

【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】 2024年4月30日

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

【代表者の役職氏名】 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：12億250万米ドル（約1,769億円）を上限とする。

クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券

841億5,000万円を上限とする。

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：14億9,140万米ドル（約2,193億円）を上限とする。

クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券

911億4,000万円を上限とする。

ハイ・イールド

クラスF - a c c 投資証券：13億8,980万米ドル（約2,044億円）を上限とする。

クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券

1,015億2,000万円を上限とする。

(注1) 上限見込額は、便宜上、各サブ・ファンドの投資証券の2023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120.25米ドル（約17,685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8,415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149.14米ドル（約21,934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9,114円、ハイ・イールドのクラスF - a c c 投資証券については138.98米ドル（約20,440円）、ハイ・イールドのクラスF - a c c 円ヘッジ投資証券については10,152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、2023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=147.07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、2024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、2024年4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、手数料等及び税金、利害関係人との取引制限ならびにその他の関係法人の概況に関する記載が更新されましたので、これらに関する記載を訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

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

2【訂正箇所および訂正事項】

(1) 半期報告書に係る訂正

半期報告書を提出したことによる原届出書の訂正内容は、以下のとおりです。

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

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

	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	2023年7月末日 に終了する 会計年度末	2024年1月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	- 423,368,854.95	- 1,451,243,355.90	255,651,585.00	367,692,857.89	89,469,511.22
(b) 経常利益金額 または 経常損失金額	- 423,368,854.95	- 1,451,243,355.90	255,651,585.00	367,692,857.89	89,469,511.22
(c) 当期純利益金額 または 当期純損失金額	- 423,368,854.95	- 1,451,243,355.90	255,651,585.00	367,692,857.89	89,469,511.22
(d) 出資総額 ⁽²⁾	5,474,543,845.01	4,272,773,950.34	5,282,694,000.34	5,203,997,715.72	3,924,592,392.65
(e) 発行済 投資口総数 (クラスF - a c c 投資証券) (クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券)	15,216,044.4050口 147,117口	14,827,856.4230口 175,872口	16,620,187.5280口 174,790口	16,093,458.5920口 139,175口	12,425,530.3910口 123,999口
(f) 純資産額	5,474,543,845.01	4,272,773,950.34	5,282,694,000.34	5,203,997,715.72	3,924,592,392.65
(g) 資産総額	5,567,728,095.87	4,293,043,311.85	5,381,893,801.19	5,284,564,141.33	3,947,711,959.69
(h) 1口当たり 純資産価格 (クラスF - a c c 投資証券) (クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券)	138.75 10,417円	117.95 8,792円	123.67 9,023円	125.37 8,906円	131.19 9,037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)	- 6.60 - 9.13	- 28.32 - 30.50	4.42 3.73	6.18 - 3.46	5.02 - 0.99
(j) 分配総額	21,530,436.66	- 21,530,436.66	19,938,288.93	19,938,288.93	23,847,642.90
(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	98.33%	99.53%	98.16%	98.48%	99.41%
(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)	- 3.83% - 4.28%	- 18.87% - 19.61%	- 10.87% - 13.38%	6.29% 1.30%	6.08% 0.16%

(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)

	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	2023年7月末日 に終了する 会計年度末	2024年1月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	- 445,326,175.61	- 1,083,623,750.29	92,486,595.60	199,825,151.37	165,260,873.94
(b) 経常利益金額 または 経常損失金額	- 445,326,175.61	- 1,083,623,750.29	92,486,595.60	199,825,151.37	165,260,873.94
(c) 当期純利益金額 または 当期純損失金額	- 445,326,175.61	- 1,083,623,750.29	92,486,595.60	199,825,151.37	165,260,873.94
(d) 出資総額 ⁽²⁾	7,937,453,531.49	5,627,315,310.44	5,784,314,883.80	5,755,799,067.32	5,329,742,876.41
(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)	21,629,552.5740口 353,863口	16,641,190.1710口 234,272口	16,218,834.9710口 230,890口	15,080,324.6480口 177,749口	13,696,484.5960口 157,496口
(f) 純資産額	7,937,453,531.49	5,627,315,310.44	5,784,314,883.80	5,755,799,067.32	5,329,742,876.41
(g) 資産総額	8,108,933,139.57	5,673,090,289.14	5,865,504,144.57	5,866,964,035.00	5,369,673,134.70
(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)	161.68 10,605円	152.95 9,972円	152.34 9,721円	152.76 9,481円	159.60 9,601円
(i) 1口当たり当期 純利益金額または 当期純損失金額 (クラスF - a c c 投資証券) (クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券)	- 5.13 - 7.85	- 17.59 - 33.14	- 0.63 0.39	- 0.20 - 9.03	6.73 - 1.26
(j) 分配総額	8,731,326.71	- 8,731,326.71	12,537,420.51	12,537,420.51	24,570,926.34
(k) 1口当たり 分配金額	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	97.89%	99.19%	98.62%	98.11%	99.26%
(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)	- 2.56% - 3.01%	- 8.42% - 9.19%	- 5.78% - 8.34%	- 0.12% - 4.92%	4.77% - 1.23%

(ハイ・イールド)

(別段の記載がない限り金額は米ドル表示)

	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	2023年7月末日 に終了する 会計年度末	2024年1月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	- 160,689,477.07	- 613,779,365.02	51,149,636.78	143,468,233.01	159,444,524.36
(b) 経常利益金額 または 経常損失金額	- 160,689,477.07	- 613,779,365.02	51,149,636.78	143,468,233.01	159,444,524.36
(c) 当期純利益金額 または 当期純損失金額	- 160,689,477.07	- 613,779,365.02	51,149,636.78	143,468,233.01	159,444,524.36
(d) 出資総額 ⁽²⁾	3,996,682,251.01	3,357,096,459.47	2,124,623,475.45	2,919,803,822.59	2,936,830,780.41
(e) 発行済 投資口総数 (クラスF - a c c 投資証券) (クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券)	12,357,772.1670口 113,331口	11,763,361.9210口 159,141口	6,793,133.9670口 154,978口	9,542,758.3510口 119,978口	9,024,113.7160口 107,783口
(f) 純資産額	3,996,682,251.01	3,357,096,459.47	2,124,623,475.45	2,919,803,822.59	2,936,830,780.41
(g) 資産総額	4,077,429,685.42	3,385,565,821.46	2,163,476,789.64	2,980,021,765.09	2,982,281,941.27
(h) 1口当たり 純資産価格 (クラスF - a c c 投資証券) (クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券)	142.12 11,125円	132.13 10,275円	136.78 10,415円	140.53 10,421円	150.16 10,797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)	- 1.35 - 6.50	- 12.67 - 22.15	1.39 3.28	4.69 - 4.16	9.69 0.52
(j) 分配総額	11,344,013.45	- 11,344,013.45	8,878,614.73	8,878,614.73	8,689,832.98
(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	98.02%	99.16%	98.20%	97.98%	98.48%
(m) 自己資本 利益率 ⁽³⁾ (クラスF - a c c 投資証券) (クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券)	1.91% 1.49%	- 8.22% - 9.01%	- 3.76% - 6.38%	6.36% 1.42%	9.78% 3.67%

(2) 外国投資法人の出資総額

2024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		
2024年2月末日現在	4,115,258,011.41	620,046	クラスF - a c c 投資証券	12,969,948.5760
			クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券	123,999

(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		
2024年2月末日現在	5,543,365,182.37	835,219	クラスF - a c c 投資証券	14,027,729.9410
			クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券	157,496

(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		
2024年2月末日現在	3,023,106,956.07	455,492	クラスF - a c c 投資証券	9,306,342.3370
			クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券	107,783

(注) 米ドルの円貨換算は、特に記載がない限り、2024年2月29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=150.67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

(2024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 マネージング・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
クリスティアン・マウラー (Christian Murer)	メンバー・オブ・ザ・ボード・オブ・ディレクターズ	UBSアセット・マネジメント・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ス・ソシエテ・コーペラティブ(PricewaterhouseCoopers, Société coopérative)である。

(5) その他

a. 定款の変更

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

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

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

b. 事業譲渡または事業譲受

投資法人、サブ・ファンドおよび投資証券クラスの解散および合併

本投資法人、サブ・ファンドおよび投資証券クラスの解散

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

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

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

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

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

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

サブ・ファンド同士またはサブ・ファンドとその他のUCIの合併

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

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

投資主総会

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

c. 出資の状況その他の重要事項

該当事項なし。

d. 訴訟事件その他の重要事項

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

[次へ](#)

2 外国投資法人の運用状況

(1) 投資状況

資産別および地域別の投資状況

(エマージング・マーケット・デッド)

(2024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	265,902,884.17	6.22
	チリ	160,665,204.76	3.76
	コロンビア	156,026,012.20	3.65
	トルコ	144,595,493.17	3.39
	ケイマン諸島	137,418,040.05	3.22
	ハンガリー	114,973,440.15	2.69
	インドネシア	114,802,345.23	2.69
	ルーマニア	113,586,765.51	2.66
	ペルー	101,240,337.77	2.37
	アラブ首長国連邦	99,868,240.11	2.34
	ドミニカ共和国	94,121,018.19	2.20
	ルクセンブルグ	92,507,291.05	2.17
	サウジアラビア	92,345,304.58	2.16
	ブラジル	88,117,783.20	2.06
	オランダ	87,093,822.92	2.04
	オマーン	85,843,269.53	2.01
	パナマ	84,607,201.49	1.98
	南アフリカ	70,792,990.30	1.66
	グアテマラ	69,299,941.33	1.62
	エジプト	68,926,585.24	1.61
	米国	62,993,080.98	1.47
	韓国	62,042,846.93	1.45
	アルゼンチン	61,556,844.45	1.44
	ナイジェリア	60,939,796.03	1.43
	インド	60,879,716.90	1.43
	英領ヴァージン諸島	59,415,592.59	1.39
	香港	53,486,902.35	1.25
	カザフスタン	52,654,537.06	1.23
	パラグアイ	51,781,932.61	1.21
	アンゴラ	49,382,911.11	1.16
	イギリス	49,360,116.81	1.16
	コートジボワール	44,300,119.02	1.04
コスタリカ	43,792,015.20	1.03	
シンガポール	39,246,078.97	0.92	
フィリピン	38,928,331.41	0.91	

アゼルバイジャン	38,827,103.94	0.91
バーレーン	37,600,699.03	0.88
エクアドル	36,277,448.15	0.85
セルビア	35,972,201.62	0.84
モロッコ	35,891,173.59	0.84
ポーランド	34,861,348.18	0.82
ヨルダン	34,644,385.95	0.81
モーリシャス	29,792,168.41	0.70
カタール	29,120,452.96	0.68
エルサルバドル	29,033,345.29	0.68
スリランカ	28,414,243.06	0.67
ブルガリア	25,987,222.18	0.61
マレーシア	25,090,283.14	0.59
ベネズエラ	24,555,369.88	0.57
モンゴル	23,722,995.70	0.56
ウクライナ	22,103,329.49	0.52
ガーナ	22,061,303.82	0.52
スペイン	21,896,345.18	0.51
タイ	21,607,227.89	0.51
マン島	21,471,216.38	0.50
カナダ	19,803,132.84	0.46
パキスタン	19,614,845.78	0.46
ガボン	18,908,384.48	0.44
バミューダ	18,726,368.53	0.44
マケドニア(旧ユーゴスラビア)	18,224,974.30	0.43
マカオ	17,600,448.20	0.41
中国	17,563,686.52	0.41
ケニヤ	15,590,990.00	0.36
ウズベキスタン	14,228,751.98	0.33
ウルグアイ	13,857,649.29	0.32
国際機関	13,779,983.12	0.32
イスラエル	12,724,279.21	0.30
チェコ共和国	12,338,941.32	0.29
セネガル	12,193,536.26	0.29
ジャージー	9,497,310.35	0.22
ザンビア	9,258,967.95	0.22
ロシア連邦	7,656,841.65	0.18
多国籍	7,654,007.32	0.18
ベニン	7,411,268.05	0.17
トリニダード・アンド・トバゴ	6,247,119.70	0.15
グルジア	4,466,918.46	0.10
オーストリア	4,230,801.70	0.10

	レバノン	4,046,505.00	0.09
	イラク	3,530,346.02	0.08
	アルメニア	3,517,288.11	0.08
	ジャマイカ	3,249,432.18	0.08
	ホンデュラス	3,122,380.44	0.07
	マーシャル諸島	2,324,287.59	0.05
	エチオピア	1,938,573.44	0.05
	クロアチア	1,849,828.29	0.04
	バハマ	1,834,384.86	0.04
	ナミビア	1,778,724.00	0.04
	ベトナム	1,692,805.00	0.04
	チュジニア	1,218,118.76	0.03
	カメルーン	1,170,480.17	0.03
	アイルランド	1,163,300.00	0.03
	パプアニューギニア	997,500.00	0.02
	クウェート	775,428.00	0.02
	セントルシア	404.00	0.00
	小計	3,928,213,650.08	91.96
短期金融商品	米国	5,743,787.20	0.13
株式	中国	257,590.59	0.01
	ポートフォリオ合計	3,934,215,027.87	92.10
	現金・その他資産(負債控除後)	337,419,839.67	7.90
	資産総額	4,271,634,867.54	100.00
	負債総額	156,376,856.13	3.66
	合計 (純資産総額)	4,115,258,011.41 (約620,046百万円)	96.34

(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)

(2024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	4,220,067,362.91	75.52
	イギリス	274,732,708.40	4.92
	カナダ	148,933,464.54	2.67
	日本	115,940,487.45	2.07
	オランダ	90,152,518.11	1.61
	アイルランド	67,783,690.81	1.21
	フランス	66,582,083.91	1.19
	オーストラリア	43,843,638.03	0.78
	ノルウェー	35,973,282.59	0.64
	スイス	35,760,542.91	0.64
	スペイン	34,893,643.30	0.62
	シンガポール	32,800,844.22	0.59
	イタリア	23,838,625.95	0.43
	多国籍	21,035,020.81	0.38
	スウェーデン	14,859,790.58	0.27
	ニュージーランド	12,931,203.83	0.23
	デンマーク	12,283,512.49	0.22
	ルクセンブルグ	11,443,035.74	0.20
	メキシコ	10,012,311.90	0.18
	チリ	8,690,384.43	0.16
	フィンランド	8,100,851.98	0.14
	韓国	7,327,062.14	0.13
	中国	5,611,044.83	0.10
	ペルー	5,391,891.14	0.10
	ブラジル	5,085,936.05	0.09
	バミューダ	4,902,545.66	0.09
	アラブ首長国連邦	3,505,527.54	0.06
	ドイツ	2,965,562.79	0.05
	ケイマン諸島	2,392,154.52	0.04
	プエルトリコ	2,266,136.99	0.04
	リベリア	1,481,947.89	0.03
	コロンビア	972,818.34	0.02
カタール	858,847.50	0.02	
小計	5,333,420,480.28	95.44	

モーゲージ 担保証券/ 資産担保証券/ その他割引債	米国	11,941,721.02	0.21
	ケイマン諸島	7,996,229.08	0.14
	アイルランド	7,047,334.63	0.13
	小計	26,985,284.73	0.48
短期金融商品	米国	21,954,810.51	0.39
株式	米国	5,945,705.20	0.11
	バミューダ	1,863,691.35	0.03
	小計	7,809,396.55	0.14
ポートフォリオ合計		5,390,169,972.07	96.46
現金・その他資産(負債控除後)		197,799,573.07	3.54
資産総額		5,587,969,545.14	100.00
負債総額		44,604,362.77	0.80
合計 (純資産総額)		5,543,365,182.37 (約835,219百万円)	99.20

(ハイ・イールド)

(2024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	1,534,056,880.74	50.20
	フランス	208,562,870.59	6.82
	オランダ	202,035,469.51	6.61
	ドイツ	160,636,391.03	5.26
	イタリア	116,265,489.53	3.80
	米国	111,122,307.68	3.64
	ルクセンブルグ	111,087,985.15	3.64
	カナダ	83,158,560.18	2.72
	スペイン	78,041,016.98	2.55
	多国籍	47,945,858.89	1.57
	スウェーデン	38,724,638.73	1.27
	アイルランド	28,705,552.62	0.94
	ケイマン諸島	22,313,606.03	0.73
	イスラエル	19,935,106.10	0.65
	オーストラリア	19,302,906.58	0.63
	バミューダ	14,885,304.03	0.49
	ポルトガル	12,593,219.80	0.41
	リベリア	10,950,766.08	0.36
	パナマ	10,228,137.58	0.33
	ジャージー	9,998,113.14	0.33
	ベルギー	9,083,245.16	0.30
	日本	9,032,476.46	0.30
	メキシコ	8,880,238.90	0.29
	フィンランド	7,785,989.93	0.25
	デンマーク	6,629,517.19	0.22
	オーストリア	5,872,983.88	0.19
	ルーマニア	4,431,459.44	0.15
	スイス	3,453,200.50	0.11
	ノルウェー	2,982,326.08	0.10
	香港	2,541,475.56	0.08
	プエルトリコ	2,179,952.82	0.07
	ジブラルタル	2,100,453.15	0.07
	マン島	2,081,794.73	0.07
	ギリシャ	1,898,755.86	0.06
ポーランド	1,707,016.14	0.06	
チェコ共和国	1,478,774.21	0.05	

	ハンガリー	1,284,833.01	0.04
	シンガポール	542,854.15	0.02
	マルタ	334,969.25	0.01
	小計	2,914,852,497.39	95.38
株式	ルクセンブルグ	1,580,130.30	0.05
	米国	406,800.00	0.01
	イギリス	385,822.68	0.01
	小計	2,372,752.98	0.08
ワラント	イギリス	19,852.14	0.00
	ルクセンブルグ	684.00	0.00
	小計	20,536.14	0.00
ポートフォリオ合計		2,917,245,786.51	95.46
現金・その他資産(負債控除後)		138,771,635.62	4.54
資産総額		3,056,017,422.13	100.00
負債総額		32,910,466.06	1.08
合計 (純資産総額)		3,023,106,956.07 (約455,492百万円)	98.92

(2) 運用実績

純資産等の推移

2024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
2023年3月末日	5,211,570	785,227	5,065,135	763,164	120.89	18,214	8,748
4月末日	5,184,367	781,129	5,132,389	773,297	121.55	18,314	8,760
5月末日	5,107,088	769,485	4,942,814	744,734	120.75	18,193	8,658
6月末日	5,144,250	775,084	5,101,805	768,689	123.22	18,566	8,796
7月末日	5,284,564	796,225	5,203,998	784,086	125.37	18,889	8,906
8月末日	3,916,609	590,115	3,874,011	583,697	123.83	18,657	8,750
9月末日	3,757,017	566,070	3,716,606	559,981	121.43	18,296	8,544
10月末日	3,697,240	557,063	3,641,044	548,596	120.25	18,118	8,415
11月末日	3,991,425	601,388	3,851,711	580,337	126.29	19,028	8,795
12月末日	4,026,463	606,667	3,994,891	601,910	131.60	19,828	9,112
2024年1月末日	3,947,712	594,802	3,924,592	591,318	131.19	19,766	9,037
2月末日	4,271,635	643,607	4,115,258	620,046	132.48	19,961	9,085

(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
2023年3月末日	6,296,965	948,764	6,205,102	934,923	152.10	22,917	9,620
4月末日	6,074,742	915,281	5,861,654	883,175	153.26	23,092	9,652
5月末日	5,685,450	856,627	5,645,762	850,647	152.09	22,915	9,528
6月末日	5,715,407	861,140	5,687,575	856,947	151.79	22,870	9,463
7月末日	5,866,964	883,975	5,755,799	867,226	152.76	23,016	9,481
8月末日	5,267,806	793,700	5,245,514	790,342	152.54	22,983	9,416
9月末日	5,120,982	771,578	5,014,258	755,498	150.40	22,661	9,242
10月末日	4,909,157	739,663	4,866,302	733,206	149.14	22,471	9,114
11月末日	5,166,327	778,410	5,115,914	770,815	154.76	23,318	9,410
12月末日	5,366,470	808,566	5,324,428	802,232	158.99	23,955	9,614
2024年1月末日	5,369,673	809,049	5,329,743	803,032	159.60	24,047	9,601
2月末日	5,587,970	841,939	5,543,365	835,219	158.13	23,825	9,468

(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
2023年3月末日	2,019,643	304,300	2,003,117	301,810	136.16	20,515	10,290
4月末日	2,974,574	448,179	2,955,922	445,369	137.28	20,684	10,331
5月末日	2,876,810	433,449	2,834,759	427,113	136.78	20,609	10,239
6月末日	2,909,432	438,364	2,881,260	434,119	138.50	20,868	10,323
7月末日	2,980,022	449,000	2,919,804	439,927	140.53	21,174	10,421
8月末日	2,899,398	436,852	2,872,554	432,808	140.96	21,238	10,398
9月末日	2,819,928	424,879	2,780,172	418,889	140.08	21,106	10,288
10月末日	2,752,878	414,776	2,708,108	408,031	138.98	20,940	10,152
11月末日	2,842,677	428,306	2,831,381	426,604	144.60	21,787	10,509

12月末日	2,987,714	450,159	2,979,532	448,926	149.49	22,524	10,804
2024年1月末日	2,982,282	449,340	2,936,831	442,492	150.16	22,625	10,797
2月末日	3,056,017	460,450	3,023,107	455,492	150.56	22,685	10,779

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

2024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)
9.90	3.66

- (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)
5.94	- 0.22

- (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)
11.20	4.91

(注) 収益率(%) = $100 \times (a - b) / b$

a = 2024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 = 2023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、2024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

2024年2月末日現在の株主資本総額は、13,738,000ユーロ(約22億円)

(注)ユーロの円貨換算は、便宜上、2024年2月29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=163.25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

2024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17億円)

(注)スイスフランの円貨換算は、便宜上、2024年2月29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=171.47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

(2024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	6,869	100

ユービーエス・スイス・エイ・ジー

(2024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

(2024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 ディレクター/ ボード・メンバー	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)	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

ユービーエス・スイス・エイ・ジー

(2024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 (2023年11月30日現在)
ロジャー・フォン・メントレン (Roger von Mentlen)	チェアマン	2023年11月1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
ガブリエラ・フーバー (Gabriela Huber)	ヴァイス・ チェアマン	2015年6月12日就任	非公開
クリストフ・ブルーナー (Christoph Brunner)	ディレクター/ ボード・メンバー	2023年11月1日就任	非公開
ピーター・ディレンディンガー (Peter Derendinger)	ディレクター/ ボード・メンバー	2023年11月1日就任	非公開
クラウディア・ディル (Claudia Dill)	ディレクター/ ボード・メンバー	2023年11月1日就任	非公開
ダミアン・フォーゲル (Damian Vogel)	ディレクター/ ボード・メンバー	2023年11月1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。

2024年2月末日現在、管理会社は以下のとおり、404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	404	430,261,393.67オーストラリア・ドル
			3,234,404,739.20カナダ・ドル
			15,495,368,126.37スイス・フラン
			2,123,070,878.14中国元
			2,840,687,384.08デンマーク・クローネ
			51,864,273,025.71ユーロ
			1,813,268,280.91英ポンド
			291,779,405.56香港ドル
			683,834,147,982.35日本円
			27,421,048.73シンガポール・ドル
			116,467,951,881.05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。

2024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	4,986,019,039
2	Global Opportunities Access - Sustainable Equities	変動資本を有する投資法人	2019年5月13日	1,227,860,234
3	UBS (Lux) Strategy Fund - Balanced Sustainable (CHF)	契約型投資信託	1994年7月1日	1,183,055,092
4	Global Opportunities Access - Sustainable Bonds	変動資本を有する投資法人	2019年5月13日	1,145,444,225
5	UBS (Lux) Strategy Fund - Yield Sustainable (CHF)	契約型投資信託	1991年9月10日	1,101,639,661
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	907,643,318
7	UBS (Lux) Strategy Fund - Yield Sustainable (USD)	契約型投資信託	1991年9月10日	640,491,831
8	Global Opportunities Access - Corporate Bonds	変動資本を有する投資法人	2015年2月18日	638,635,305
9	UBS (Lux) Strategy Fund - Balanced Sustainable (USD)	契約型投資信託	1994年7月1日	604,178,340
10	Global Opportunities Access - Global Bonds USD	変動資本を有する投資法人	2015年2月18日	562,469,620

(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、2024年2月29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 = 150.67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

	2024年1月31日現在	
	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	4,159,513,801.66	626,713,944
投資有価証券、未実現評価(損)益	(379,092,463.85)	(57,117,862)
投資有価証券合計(注1)	3,780,421,337.81	569,596,083
現金預金、要求払預金および預託金勘定	73,358,602.75	11,052,941
その他の流動資産(委託証拠金)	7,420,074.53	1,117,983
投資有価証券売却未収金(注1)	17,056,580.33	2,569,915
発行未収金	4,732,603.94	713,061
有価証券に係る未収利息	58,418,487.82	8,801,914
その他の未収金	420,000.00	63,281
金融先物に係る未実現利益(注1)	5,196,050.88	782,889
スワップに係る未実現利益(注1)	688,221.63	103,694
資産合計	3,947,711,959.69	594,801,761
負 債		
先渡為替契約に係る未実現損失(注1)	(758,165.64)	(114,233)
当座借越	(3,799,550.82)	(572,478)
投資有価証券購入未払金(注1)	(9,662,284.07)	(1,455,816)
買戻未払金	(6,616,009.54)	(996,834)
その他の未払金	(195,059.82)	(29,390)
報酬引当金(注2)	(2,040,112.99)	(307,384)
年次税引当金(注3)	(33,423.74)	(5,036)
その他の手数料および報酬に係る引当金(注2)	(14,960.42)	(2,254)
引当金合計	(2,088,497.15)	(314,674)
負債合計	(23,119,567.04)	(3,483,425)
期末現在純資産	3,924,592,392.65	591,318,336

添付の注記は当財務書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

2024年1月31日現在

	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	5,442,350,002.34	819,998,875
投資有価証券、未実現評価(損)益	(228,193,169.71)	(34,381,865)
投資有価証券合計(注1)	5,214,156,832.63	785,617,010
現金預金、要求払預金および預託金勘定	80,970,513.13	12,199,827
その他の流動資産(委託証拠金)	2,231,821.31	336,269
投資有価証券売却未収金(注1)	15,901,187.64	2,395,832
発行未収金	3,568,556.06	537,674
有価証券に係る未収利息	50,731,385.46	7,643,698
金融先物に係る未実現利益(注1)	1,022,167.00	154,010
先渡為替契約に係る未実現利益(注1)	1,090,671.47	164,331
資産合計	5,369,673,134.70	809,048,651
負 債		
当座借越	(1,882,082.10)	(283,573)
投資有価証券購入未払金(注1)	(31,491,332.94)	(4,744,799)
買戻未払金	(4,586,831.83)	(691,098)
その他の未払金	(98,556.98)	(14,850)
報酬引当金(注2)	(1,775,353.15)	(267,492)
年次税引当金(注3)	(45,390.69)	(6,839)
その他の手数料および報酬に係る引当金(注2)	(50,710.60)	(7,641)
引当金合計	(1,871,454.44)	(281,972)
負債合計	(39,930,258.29)	(6,016,292)
期末現在純資産	5,329,742,876.41	803,032,359

添付の注記は当財務書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

2024年1月31日現在

	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	2,902,958,470.42	437,388,753
投資有価証券、未実現評価(損)益	(62,355,525.21)	(9,395,107)
投資有価証券合計(注1)	2,840,602,945.21	427,993,646
現金預金、要求払預金および預託金勘定	82,505,450.32	12,431,096
その他の流動資産(委託証拠金)	3,103,481.76	467,602
投資有価証券売却未収金(注1)	8,466,948.39	1,275,715
発行未収金	2,213,543.37	333,515
有価証券に係る未収利息	44,680,537.43	6,732,017
分配に係る未収金	3,828.13	577
スワップに係る未実現利益(注1)	705,206.66	106,253
資産合計	2,982,281,941.27	449,340,420
負 債		
金融先物に係る未実現損失(注1)	(795,544.05)	(119,865)
先渡為替契約に係る未実現損失(注1)	(3,012,257.11)	(453,857)
当座借越	(771,577.77)	(116,254)
投資有価証券購入未払金(注1)	(26,613,566.84)	(4,009,866)
買戻未払金	(12,597,336.71)	(1,898,041)
その他の未払金	(83,221.10)	(12,539)
報酬引当金(注2)	(1,536,771.33)	(231,545)
年次税引当金(注3)	(25,011.48)	(3,768)
その他の手数料および報酬に係る引当金(注2)	(15,874.47)	(2,392)
引当金合計	(1,577,657.28)	(237,706)
負債合計	(45,451,160.86)	(6,848,126)
期末現在純資産	2,936,830,780.41	442,492,294

添付の注記は当財務書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2023年8月1日 至2024年1月31日

	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	3,310,392.91	498,777
有価証券に係る利息	110,689,128.09	16,677,531
スワップに係る受取利息(注1)	124,275.67	18,725
貸付有価証券に係る純収益(注10)	2,073,645.55	312,436
その他の収益	1,147,693.78	172,923
収益合計	<u>117,345,136.00</u>	<u>17,680,392</u>
費 用		
スワップに係る支払利息(注1)	(72,189.59)	(10,877)
定率報酬(注2)	(14,599,060.92)	(2,199,641)
年次税(注3)	(181,249.83)	(27,309)
当座借越に係る利息	(86,586.36)	(13,046)
その他の手数料および報酬(注2)	(101,948.58)	(15,361)
費用合計	<u>(15,041,035.28)</u>	<u>(2,266,233)</u>
投資純(損)益	<u>102,304,100.72</u>	<u>15,414,159</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	(282,781,424.29)	(42,606,677)
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	640,623.55	96,523
金融先物に係る実現(損)益	(18,317,089.57)	(2,759,836)
先渡為替契約に係る実現(損)益	(99,924,127.69)	(15,055,568)
スワップに係る実現(損)益	(316,472.13)	(47,683)
外国為替に係る実現(損)益	574,121.94	86,503
実現(損)益合計	<u>(400,124,368.19)</u>	<u>(60,286,739)</u>
当期実現純(損)益	<u>(297,820,267.47)</u>	<u>(44,872,580)</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	322,704,494.44	48,621,886
利回り評価有価証券および短期金融商品に係る 未実現評価(損)益	1,272,079.43	191,664
金融先物に係る未実現評価(損)益	10,684,314.14	1,609,806
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	52,133,769.85	7,854,995
スワップに係る未実現評価(損)益	495,120.83	74,600
未実現評価(損)益の変動合計	<u>387,289,778.69</u>	<u>58,352,951</u>
運用の結果による純資産の純増(減)	<u>89,469,511.22</u>	<u>13,480,371</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2023年8月1日 至2024年1月31日

	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	1,400,268.32	210,978
有価証券に係る利息	100,367,030.25	15,122,300
分配金	360,505.72	54,317
貸付有価証券に係る純収益 (注10)	294,859.78	44,427
その他の収益	256,467.96	38,642
収益合計	<u>102,679,132.03</u>	<u>15,470,665</u>
費 用		
定率報酬 (注2)	(12,208,680.79)	(1,839,482)
年次税 (注3)	(253,879.82)	(38,252)
当座借越に係る利息	(59,365.54)	(8,945)
その他の手数料および報酬 (注2)	(71,830.68)	(10,823)
費用合計	<u>(12,593,756.83)</u>	<u>(1,897,501)</u>
投資純 (損) 益	<u>90,085,375.20</u>	<u>13,573,163</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	(93,859,091.84)	(14,141,749)
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	414,392.62	62,437
金融先物に係る実現 (損) 益	(8,392,181.12)	(1,264,450)
先渡為替契約に係る実現 (損) 益	(97,794,042.16)	(14,734,628)
外国為替に係る実現 (損) 益	34,142.41	5,144
実現 (損) 益合計	<u>(199,596,780.09)</u>	<u>(30,073,247)</u>
当期実現純 (損) 益	<u>(109,511,404.89)</u>	<u>(16,500,083)</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	221,868,933.94	33,428,992
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	49,111.21	7,400
金融先物に係る未実現評価 (損) 益	5,997,643.64	903,665
先渡為替契約に係る未実現評価 (損) 益	46,856,590.04	7,059,882
未実現評価 (損) 益の変動合計	<u>274,772,278.83</u>	<u>41,399,939</u>
運用の結果による純資産の純増 (減)	<u>165,260,873.94</u>	<u>24,899,856</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 - ハイ・イールド

運用計算書

自2023年8月1日 至2024年1月31日

	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	1,874,808.84	282,477
有価証券に係る利息	78,781,334.54	11,869,984
スワップに係る受取利息(注1)	57,424.40	8,652
分配金	123,888.63	18,666
貸付有価証券に係る純収益(注10)	1,092,479.23	164,604
その他の収益	395,955.21	59,659
収益合計	82,325,890.85	12,404,042
費 用		
スワップに係る支払利息(注1)	(9,368.20)	(1,412)
定率報酬(注2)	(9,054,393.05)	(1,364,225)
年次税(注3)	(143,570.85)	(21,632)
当座借越に係る利息	(96,976.72)	(14,611)
その他の手数料および報酬(注2)	(56,901.89)	(8,573)
費用合計	(9,361,210.71)	(1,410,454)
投資純(損)益	72,964,680.14	10,993,588
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	(23,631,965.59)	(3,560,628)
金融先物に係る実現(損)益	1,272,542.01	191,734
先渡為替契約に係る実現(損)益	(35,821,296.34)	(5,397,195)
スワップに係る実現(損)益	150,619.05	22,694
外国為替に係る実現(損)益	8,911,373.91	1,342,677
実現(損)益合計	(49,118,726.96)	(7,400,719)
当期実現純(損)益	23,845,953.18	3,592,870
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	113,149,735.61	17,048,271
金融先物に係る未実現評価(損)益	(1,872,335.67)	(282,105)
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	23,738,802.89	3,576,725
スワップに係る未実現評価(損)益	582,368.35	87,745
未実現評価(損)益の変動合計	135,598,571.18	20,430,637
運用の結果による純資産の純増(減)	159,444,524.36	24,023,506

添付の注記は当財務書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2023年8月1日 至2024年1月31日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	5,203,997,715.72	784,086,336
発行額	189,926,456.95	28,616,219
買戻額	(1,534,953,648.34)	(231,271,466)
純発行(買戻)合計	(1,345,027,191.39)	(202,655,247)
支払分配金	(23,847,642.90)	(3,593,124)
投資純(損)益	102,304,100.72	15,414,159
実現(損)益合計	(400,124,368.19)	(60,286,739)
未実現評価(損)益の変動合計	387,289,778.69	58,352,951
運用の結果による純資産の純増(減)	89,469,511.22	13,480,371
期末現在純資産	3,924,592,392.65	591,318,336

発行済投資証券数の変動表

	自2023年8月1日 至2024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	16,093,458.5920	
期中発行投資証券数	688,663.6080	
期中買戻投資証券数	(4,356,591.8090)	
期末現在発行済投資証券数	12,425,530.3910	
クラスF - a c c円ヘッジ		
期首現在発行済投資証券数	139,175.0000	
期中発行投資証券数	668.0000	
期中買戻投資証券数	(15,844.0000)	
期末現在発行済投資証券数	123,999.0000	

最重要数値

日付	ISIN	2024年1月31日	2023年7月31日	2022年7月31日
純資産額(米ドル)		3,924,592,392.65	5,203,997,715.72	4,272,773,950.34
クラスF - a c c	LU0985399996			
発行済投資証券数(口)		12,425,530.3910	16,093,458.5920	14,827,856.4230
1口当たり純資産価格(米ドル)		131.19	125.37	117.95
1口当たり発行・買戻価格(米ドル) ¹		131.19	125.37	117.95
クラスF - a c c円ヘッジ	LU1749433899			
発行済投資証券数(口)		123,999.0000	139,175.0000	175,872.0000
1口当たり純資産価格(日本円)		9,037	8,906	8,792
1口当たり発行・買戻価格(日本円) ¹		9,037	8,906	8,792

¹ 注記1を参照

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

組入証券の構造

地域別分類	純資産割合%	地域別分類	純資産割合%
メキシコ	6.71	セネガル	0.22
コロンビア	3.86	ジャージー	0.22
チリ	3.69	ケニア	0.21
ケイマン諸島	3.48	ロシア連邦 (CIS)	0.20
トルコ	3.08	トリニダード・トバゴ共和国	0.16
ハンガリー	3.06	レバノン	0.12
インドネシア	2.91	オーストリア	0.11
ルーマニア	2.70	アルメニア	0.10
サウジアラビア	2.62	ベナン共和国	0.10
ペルー	2.58	イラク	0.09
ドミニカ共和国	2.41	ジョージア	0.09
アラブ首長国連邦	2.41	ジャマイカ	0.08
ルクセンブルグ	2.26	ホンジュラス	0.08
ブラジル	2.12	エチオピア	0.07
オランダ	2.12	マーシャル諸島	0.06
オマーン	2.11	バハマ	0.05
南アフリカ	1.86	ナミビア	0.05
パナマ	1.75	ベトナム	0.04
韓国	1.72	クロアチア	0.04
グアテマラ	1.72	カメルーン	0.03
インド	1.52	アイルランド	0.03
香港	1.51	チュニジア	0.03
英領ヴァージン諸島	1.45	パプアニューギニア	0.03
ナイジェリア	1.42	クウェート	0.02
アメリカ合衆国	1.42	合計	96.33
エジプト	1.40		
アルゼンチン	1.39		
カザフスタン	1.36		
パラグアイ	1.29		
アンゴラ	1.20		
イギリス	1.20		
コートジボワール	1.09		
コスタリカ	1.05		
フィリピン	0.99		
ポーランド	0.97		
シンガポール	0.96		
アゼルバイジャン	0.91		
ヨルダン	0.88		
モロッコ	0.88		
カタール	0.87		
バーレーン	0.86		
セルビア	0.79		
モリシャス	0.74		
エルサルバドル	0.72		
スリランカ	0.71		
エクアドル	0.69		
ベネズエラ	0.65		
マカオ	0.60		
マレーシア	0.59		
ブルガリア	0.59		
ガーナ	0.57		
タイ	0.54		
モンゴル	0.53		
スペイン	0.51		
マン島	0.50		
中国	0.50		
ウクライナ	0.50		
イスラエル	0.49		
バミューダ	0.48		
ウズベキスタン	0.47		
ガボン	0.45		
マケドニア	0.45		
ウルグアイ	0.41		
カナダ	0.37		
パキスタン	0.36		
国際機関	0.35		
チェコ共和国	0.30		
多国籍	0.23		
ザンビア	0.22		

業種別分類	純資産割合%
国債および中央政府債	44.64
金融および持株会社	12.01
銀行および金融機関	9.57
石油	9.02
エネルギー・水道	3.98
交通・運輸	2.10
通信	1.90
化学	1.35
宿泊・仕出し・レジャー	1.33
鉱業・石炭・鋼鉄	1.31
食品・清涼飲料	1.14
モーゲージおよび貸付機関	1.02
建築業・資材	0.86
インターネット、ソフトウェア・ITサービス	0.58
保険	0.56
各種サービス	0.55
貴金属および宝石	0.53
医薬品・化粧品・医療品	0.43
非分類会社	0.40
国際機関	0.36
不動産	0.35
航空宇宙産業	0.31
電気装置・部品	0.27
たばこ・アルコール	0.25
林業、紙・パルプ製品	0.23
電子工学・半導体	0.21
非鉄金属	0.18
市および地方自治体	0.12
農業・漁業	0.12
投資信託	0.11
各種貿易会社	0.10
小売り・百貨店	0.09
包装業	0.08
州、連邦州	0.06
コンピュータ・ハードウェア、ネットワーク装置	0.05
自動車	0.04
その他消費財	0.04
ヘルスケア、社会事業	0.03
機械工学・産業機器	0.03
グラフィックデザイン・出版・メディア	0.02
合計	96.33

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2023年8月1日 至2024年1月31日

	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	5,755,799,067.32	867,226,245
発行額	493,736,173.85	74,391,229
買戻額	(1,060,482,312.36)	(159,782,870)
純発行(買戻)合計	(566,746,138.51)	(85,391,641)
支払分配金	(24,570,926.34)	(3,702,101)
投資純(損)益	90,085,375.20	13,573,163
実現(損)益合計	(199,596,780.09)	(30,073,247)
未実現評価(損)益の変動合計	274,772,278.83	41,399,939
運用の結果による純資産の純増(減)	165,260,873.94	24,899,856
期末現在純資産	5,329,742,876.41	803,032,359

発行済投資証券数の変動表

自2023年8月1日 至2024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	15,080,324.6480
期中発行投資証券数	830,009.4230
期中買戻投資証券数	(2,213,849.4750)
期末現在発行済投資証券数	13,696,484.5960
クラスF - a c c円ヘッジ	
期首現在発行済投資証券数	177,749.0000
期中発行投資証券数	257.0000
期中買戻投資証券数	(20,510.0000)
期末現在発行済投資証券数	157,496.0000

最重要数値

日付	ISIN	2024年1月31日	2023年7月31日	2022年7月31日
純資産額(米ドル)		5,329,742,876.41	5,755,799,067.32	5,627,315,310.44
クラスF - a c c	LU0313364738			
発行済投資証券数(口)		13,696,484.5960	15,080,324.6480	16,641,190.1710
1口当たり純資産価格(米ドル)		159.60	152.76	152.95
1口当たり発行・買戻価格(米ドル) ¹		159.60	152.76	152.95
クラスF - a c c円ヘッジ	LU1749433972			
発行済投資証券数(口)		157,496.0000	177,749.0000	234,272.0000
1口当たり純資産価格(日本円)		9,601	9,481	9,972
1口当たり発行・買戻価格(日本円) ¹		9,601	9,481	9,972

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%
アメリカ合衆国	76.72	銀行および金融機関	28.13
イギリス	4.80	金融および持株会社	20.16
カナダ	2.69	エネルギー・水道	4.70
日本	2.23	不動産	4.42
オランダ	1.70	国債および中央政府債	3.81
アイルランド	1.52	医薬品・化粧品・医療品	3.29
フランス	1.41	インターネット、ソフトウェア・ITサービス	2.96
オーストラリア	0.83	通信	2.88
スイス	0.75	ヘルスケア、社会事業	2.88
スペイン	0.66	石油	2.43
ノルウェー	0.64	電子工学・半導体	2.04
シンガポール	0.52	食品・清涼飲料	1.87
イタリア	0.45	保険	1.76
多国籍	0.40	小売り・百貨店	1.56
ルクセンブルグ	0.38	交通・運輸	1.54
スウェーデン	0.26	電気装置・部品	1.40
ニュージーランド	0.24	グラフィックデザイン・出版・メディア	1.39
ケイマン諸島	0.20	コンピュータ・ハードウェア、ネットワーク装置	1.31
デンマーク	0.16	バイオテクノロジー	1.29
チリ	0.16	自動車	0.84
フィンランド	0.15	宿泊・仕出し・レジャー	0.70
韓国	0.14	機械工学・産業機器	0.69
メキシコ	0.13	その他消費財	0.64
バミューダ	0.12	モーゲージおよび貸付機関	0.60
中国	0.11	各種貿易会社	0.56
ベルー	0.10	公的、非営利機関	0.52
ブラジル	0.09	建築業・資材	0.49
コロンビア	0.08	環境サービスおよびリサイクル	0.34
アラブ首長国連邦	0.07	繊維・衣服・革製品	0.34
ドイツ	0.06	化学	0.33
ペルトリコ	0.04	包装業	0.32
カタール	0.02	農業・漁業	0.32
合計	97.83	各種サービス	0.31
		貴金属および宝石	0.28
		林業、紙・パルプ製品	0.22
		市および地方自治体	0.16
		鉱業・石炭・鋼鉄	0.16
		投資信託	0.08
		州、連邦州	0.07
		ゴム・タイヤ	0.03
		非分類会社	0.01
		合計	97.83

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2023年8月1日 至2024年1月31日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	2,919,803,822.59	439,926,842
発行額	181,768,742.18	27,387,096
買戻額	(315,496,475.74)	(47,535,854)
純発行(買戻)合計	(133,727,733.56)	(20,148,758)
支払分配金	(8,689,832.98)	(1,309,297)
投資純(損)益	72,964,680.14	10,993,588
実現(損)益合計	(49,118,726.96)	(7,400,719)
未実現評価(損)益の変動合計	135,598,571.18	20,430,637
運用の結果による純資産の純増(減)	159,444,524.36	24,023,506
期末現在純資産	2,936,830,780.41	442,492,294

発行済投資証券数の変動表

	自2023年8月1日 至2024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	9,542,758.3510	
期中発行投資証券数	375,447.2130	
期中買戻投資証券数	(894,091.8480)	
期末現在発行済投資証券数	9,024,113.7160	
クラスF - a c c円ヘッジ		
期首現在発行済投資証券数	119,978.0000	
期中発行投資証券数	0.0000	
期中買戻投資証券数	(12,195.0000)	
期末現在発行済投資証券数	107,783.0000	

最重要数値

日付	ISIN	2024年1月31日	2023年7月31日	2022年7月31日
純資産額(米ドル)		2,936,830,780.41	2,919,803,822.59	3,357,096,459.47
クラスF - a c c	LU1344275315			
発行済投資証券数(口)		9,024,113.7160	9,542,758.3510	11,763,361.9210
1口当たり純資産価格(米ドル)		150.16	140.53	132.13
1口当たり発行・買戻価格(米ドル) ¹		150.16	140.53	132.13
クラスF - a c c円ヘッジ	LU1749434194			
発行済投資証券数(口)		107,783.0000	119,978.0000	159,141.0000
1口当たり純資産価格(日本円)		10,797	10,421	10,275
1口当たり発行・買戻価格(日本円) ¹		10,797	10,421	10,275

¹ 注記1を参照

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

組入証券の構造

地域別分類	純資産割合%	業種別分類	純資産割合%
アメリカ合衆国	50.73	金融および持株会社	34.73
フランス	6.85	通信	7.08
オランダ	6.66	銀行および金融機関	4.69
ドイツ	5.55	石油	4.53
イタリア	4.08	宿泊・仕出し・レジャー	4.22
ルクセンブルグ	3.82	エネルギー・水道	3.87
イギリス	3.51	インターネット、ソフトウェア・ITサービス	3.25
カナダ	2.71	ヘルスケア、社会事業	2.64
スペイン	2.59	交通・運輸	2.61
多国籍	1.56	自動車	2.59
スウェーデン	1.28	不動産	2.33
アイルランド	0.94	化学	2.32
ケイマン諸島	0.73	建築業・資材	2.23
オーストラリア	0.64	医薬品・化粧品・医療品	2.16
イスラエル	0.64	包装業	1.76
パナマ	0.52	各種サービス	1.66
リベリア	0.52	航空宇宙産業	1.61
ポルトガル	0.50	その他消費財	1.35
バミューダ	0.38	コンピュータ・ハードウェア、ネットワーク装置	1.34
ベルギー	0.27	食品・清涼飲料	1.25
フィンランド	0.26	機械工学・産業機器	1.21
メキシコ	0.25	小売り・百貨店	1.04
日本	0.23	グラフィックデザイン・出版・メディア	1.00
ジャージー	0.23	電気装置・部品	0.84
オーストリア	0.21	非分類会社	0.69
デンマーク	0.19	繊維・衣服・革製品	0.59
ルーマニア	0.15	電子工学・半導体	0.43
ノルウェー	0.10	バイオテクノロジー	0.43
スイス	0.09	林業、紙・パルプ製品	0.39
プエルトリコ	0.08	鉱業・石炭・鋼鉄	0.39
ジブラルタル	0.07	環境サービスおよびリサイクル	0.29
マン島	0.07	保険	0.29
香港	0.07	各種資本財	0.26
ギリシャ	0.06	モーゲージおよび貸付機関	0.20
ポーランド	0.06	農業・漁業	0.12
チェコ共和国	0.05	貴金属および宝石	0.09
ハンガリー	0.04	非鉄金属	0.09
シンガポール	0.02	各種貿易会社	0.05
マルタ共和国	0.01	たばこ・アルコール	0.05
合計	96.72	公的、非営利機関	0.03
		ゴム・タイヤ	0.02
		合計	96.72

マルチ・マネージャー・アクセス

財務書類に対する注記

2024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、U B S 評価方針に従って決定される。
- 主に短期金融商品に投資するサブ・ファンドに関して、該当する評価日以降、第二評価日まで(同日を含む)にサブ・ファンドが稼得する受取利息は、当該サブ・ファンドの資産の評価に含まれる。したがって、特定の評価日における投資証券1口当たり純資産価格には、二評価日現在の期待利子収益が含まれる。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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2024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、2024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 = 1.086250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

2024年1月31日現在、マルチ・マネージャー・アクセス - サステナブル・インベスティング・バランスド、マルチ・マネージャー・アクセス - サステナブル・インベスティング・グロースおよびマルチ・マネージャー・アクセス - サステナブル・インベスティング・イールドは、マルチ・マネージャー・アクセス のその他のサブ・ファンドに以下の投資を行った。

マルチ・マネージャー・アクセス - サステナブル・インベスティング・バランスド	米ドルでの金額
マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット・サステナブル 米ドル F - a c c	126,790,549.20 米ドル
マルチ・マネージャー・アクセス - フューチャー・オブ・アース 米ドル F - a c c	23,402,990.21 米ドル
合計	150,193,539.41 米ドル

マルチ・マネージャー・アクセス - サステナブル・インベスティング・グロース	米ドルでの金額
マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット・サステナブル 米ドル F - a c c	15,070,868.40 米ドル
マルチ・マネージャー・アクセス - フューチャー・オブ・アース 米ドル F - a c c	10,719,873.55 米ドル
合計	25,790,741.95 米ドル

マルチ・マネージャー・アクセス - サステナブル・インベスティング・イールド	米ドルでの金額
マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット・サステナブル 米ドル F - a c c	80,642,368.80 米ドル
マルチ・マネージャー・アクセス - フューチャー・オブ・アース 米ドル F - a c c	8,265,796.61 米ドル
合計	88,908,165.41 米ドル

2024年1月31日現在、クロス・サブ・ファンド投資の総額は243,859,559.74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期末の調整後の結合純資産合計は17,744,617,092.99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	1.25%	0.72%
- 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%
- ハイ・イールド F - a c c	1.25%	0.62%
- ハイ・イールド F - a c c円ヘッジ	1.25%	0.65%
- US マルチ・クレジット・サステナブル F - a c c	0.85%	0.44%
- US マルチ・クレジット・サステナブル F - a c c円ヘッジ	0.85%	0.47%

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。）の利益に適用言語において作成し配布（印刷は含まない。）するためのコスト
- 投資主に対する通知作成コストおよび本投資法人の資産管理に関するあらゆる取引コスト（ブローカーの通常の手数料、報酬、租税等）
- ルクセンブルグ内外における本投資法人の承認および監督に関する手数料およびコスト

- 定款、英文販売目論見書ならびに年次報告書および半期報告書の印刷コストおよび費用、ならびに、定款および本投資法人に関するその他の一切の文書（本投資法人または本投資法人の投資証券募集について管轄権を有するあらゆる機関（各国の証券業協会を含む。）に対する登録届出書、目論見書および説明覚書等）を必要な言語によって作成および/または提出し、印刷するコストおよび費用
- 純資産価額の公表および投資者に対する通知の公告に関連するコストおよび費用
- 証券取引所または規制ある市場への本投資法人の投資証券の上場に関連して請求される手数料および費用
- 投資主への配当金支払における手数料およびその他のコスト
- 監査における手数料、コストおよび費用（監査人の報酬および費用を含む。）
- KID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、KID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

本投資法人はルクセンブルグの「年次税」の課税対象であり、これを四半期末ごとに支払う。この年次税は、各クラスの四半期末における総純資産に基づいて計算される。年次税は純資産総額の0.05%（年率）の割合で徴収される。クラスF投資証券等の機関投資家向けのクラスについて、かかる割合は0.01%（年率）に減じられる。ただし、0.01%の軽減税率の適用を受ける条件を充足しなくなる場合、クラスF投資証券のすべてが0.05%（年率）の手数料率により課税される可能性がある。

サブ・ファンドは、タクソノミー規則第3条が定める環境的に持続可能な経済活動に投資する部分の純資産に対して、年率0.01%から0.04%の範囲で年次税の税率の軽減措置の適用を受けることができ

る。「年次税」を既に支払っている他のルクセンブルグのUCI内に保有される投資証券に相当する資産の評価額は、いかなる「年次税」からも除外される。

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

2023年8月1日から2024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

2024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	483,209,208.11米ドル	260,624,396.01米ドル
- ハイ・イールド	102,312,706.25米ドル	151,400,110.24米ドル
- US マルチ・クレジット・サステナブル	266,206,921.89米ドル	98,030,404.78米ドル

マルチ・マネージャー・アクセス	通貨に係る金融先物 (購入)	通貨に係る金融先物 (売却)
- US マルチ・クレジット・サステナブル	- 米ドル	13,168,356.25米ドル

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

b) 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	28,061,322.96米ドル	2,715,000.00米ドル
- ハイ・イールド	- 米ドル	1,702,359.19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) 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逆及的に計算され、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	0.78%
- ハイ・イールド F - a c c	0.64%
- ハイ・イールド F - a c c 円ヘッジ	0.68%
- US マルチ・クレジット・サステナブル F - a c c	0.46%
- US マルチ・クレジット・サステナブル F - a c c 円ヘッジ	0.50%

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 - 後発事象

期末後において、財務書類の修正または開示を必要とする事象は発生していない。

注9 - 適用法、業務地および公認言語

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

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

注10 - 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

	2024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*		2024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	969,985,289.89米ドル	1,039,195,940.94米ドル	22.46	77.54	0.00
- ハイ・イールド	539,734,557.25米ドル	577,483,657.33米ドル	48.88	51.12	0.00
- U S マルチ・クレジット・サステナブル	303,240,320.09米ドル	321,505,866.69米ドル	20.48	79.52	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、2024年1月31日に証券貸付業者から直接入手されるため、2024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	マルチ・マネージャー・ アクセス - ハイ・イールド	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
貸付証券収益	3,456,075.92	1,820,798.72	491,432.97
貸付証券コスト*			
ユービーエス・スイス・ エイ・ジー	1,036,822.78米ドル	546,239.62米ドル	147,429.89米ドル
U B S ヨーロッパ S E ルクセンブルグ支店	345,607.59米ドル	182,079.87米ドル	49,143.30米ドル
純貸付証券収益	2,073,645.55米ドル	1,092,479.23米ドル	294,859.78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U B S ヨーロッパ S E 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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
株式			
中国			
HKD SUNAC CHINA HLDGS HKD0.10 'REG S'	1 113 416.00	162 370.94	0.01
HKD SUNAC SERVICES HLD HKD0.1	340 263.00	69 208.25	0.00
中国合計		231 579.19	0.01
株式合計		231 579.19	0.01

ノート、固定利付債

EUR			
EUR ARGENTINA, REPUBLIC OF 0.50000% 20-09.07.29	34 392.00	13 355.22	0.00
EUR BANQUE OUEST AFRICAINE DE DEV-REG-S 2.75000% 21-22.01.33	2 987 000.00	2 465 917.85	0.06
EUR BENIN GOVT INTERNATIONAL BD-REG-S 4.87500% 21-19.01.32	2 050 000.00	1 800 934.61	0.04
EUR BULGARIA, REPUBLIC OF-REG-S 4.12500% 22-23.09.29	5 930 000.00	6 610 550.90	0.17
EUR BULGARIA, REPUBLIC OF-REG-S 4.62500% 22-23.09.34	745 000.00	852 753.77	0.02
EUR BULGARIA, REPUBLIC OF-REG-S 4.50000% 23-27.01.33	6 819 000.00	7 712 683.23	0.20
EUR BULGARIA, REPUBLIC OF-REG-S 4.37500% 23-13.05.31	2 120 000.00	2 400 721.13	0.06
EUR BULGARIAN ENERGY HOLDING EAD-REG-S 2.45000% 21-22.07.28	3 176 000.00	3 002 517.20	0.08
EUR CENTRAL BANK OF TUNISIA-REG-S 6.37500% 19-15.07.26	1 378 000.00	1 128 252.57	0.03
EUR CHILE, REPUBLIC OF 4.12500% 23-05.07.34	1 723 568.00	1 883 927.16	0.05
EUR GOVERNMENT OF BENIN-REG-S 6.87500% 21-19.01.52	396 000.00	336 364.01	0.01
EUR GTC AURORA LUXEMBOURG SA-REG-S 2.25000% 21-23.06.26	900 000.00	843 397.10	0.02
EUR HUNGARY, REPUBLIC OF-REG-S 5.00000% 22-22.02.27	184 000.00	206 755.52	0.00
EUR HUNGARY, REPUBLIC OF-REG-S 5.37500% 23-12.09.33	3 260 000.00	3 678 926.71	0.09
EUR INDONESIA GOVERNMENT INTERNATIONAL 1.10000% 21-12.03.33	2 720 000.00	2 334 134.00	0.06
EUR INDONESIA, REPUBLIC OF 1.40000% 19-30.10.31	5 251 000.00	4 812 664.57	0.12
EUR INDONESIA, REPUBLIC OF 0.90000% 20-14.02.27	599 000.00	597 263.77	0.01
EUR IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 5.87500% 19-17.10.31	4 769 000.00	4 670 711.65	0.12
EUR IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 4.87500% 20-30.01.32	2 696 000.00	2 452 643.88	0.06
EUR MACEDONIA GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 3.67500% 20-03.06.26	6 315 000.00	6 662 453.27	0.17
EUR MACEDONIA GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 1.62500% 21-10.03.28	8 449 000.00	7 950 205.35	0.20
EUR MACEDONIA GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.96000% 23-13.03.27	2 734 000.00	3 103 448.85	0.08
EUR MAGYAR EXPORT-IMPORT BANK RT-REG-S 6.00000% 23-16.05.29	2 672 000.00	3 057 560.21	0.08
EUR MEXICO, UNITED STATES OF 1.35000% 20-18.09.27	2 980 000.00	3 006 386.97	0.08
EUR MEXICO, UNITED STATES OF 2.12500% 21-25.10.51	780 000.00	496 714.96	0.01
EUR MEXICO, UNITED STATES OF 2.25000% 21-12.08.36	2 300 000.00	1 933 117.66	0.05
EUR MEXICO, UNITED STATES OF 2.37500% 22-11.02.30	772 000.00	764 160.58	0.02
EUR MEXICO, UNITED STATES OF 4.48990% 24-25.05.32	2 740 000.00	3 017 249.46	0.08
EUR MOROCCO GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 2.00000% 20-30.09.30	2 520 000.00	2 343 855.94	0.06
EUR MOROCCO, KINGDOM OF-REG-S 1.50000% 19-27.11.31	1 210 000.00	1 051 490.00	0.03
EUR NE PROPERTY BV-REG-S 3.37500% 20-14.07.27	1 400 000.00	1 456 209.37	0.04
EUR PERU, REPUBLIC OF 1.25000% 21-11.03.33	10 000 000.00	8 499 906.25	0.22
EUR PERU, REPUBLIC OF 1.95000% 21-17.11.36	2 327 000.00	1 911 575.96	0.05
EUR PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 1.87500% 19-05.11.31	4 013 000.00	3 516 241.56	0.09
EUR PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 0.70000% 20-03.02.29	1 610 000.00	1 523 696.45	0.04
EUR PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 1.75000% 21-28.04.41	2 672 000.00	2 017 209.69	0.05
EUR POLAND, REPUBLIC OF-REG-S 3.62500% 24-11.01.34	4 190 000.00	4 578 604.80	0.12
EUR POLAND, REPUBLIC OF-REG-S 4.12500% 24-11.01.44	563 000.00	613 962.17	0.01
EUR REPUBLIC OF CAMEROON INTRNTNL BOND-REG-S 5.95000% 21-07.07.32	1 469 000.00	1 172 840.42	0.03
EUR ROMANIA-REG-S 2.62500% 20-02.12.40	1 544 000.00	1 123 703.90	0.03
EUR SENEGAL, REPUBLIC OF-REG-S 5.37500% 21-08.06.37	300 000.00	235 444.69	0.01
EUR SERBIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 1.50000% 19-26.06.29	7 415 000.00	6 755 748.57	0.17

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR SERBIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 3.12500% 20-15.05.27	3 074 000.00	3 188 871.54	0.08
EUR SERBIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 1.65000% 21-03.03.33	5 051 000.00	4 025 828.52	0.10
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 3.75000% 21-09.05.27	650 000.00	680 856.07	0.02
EUR UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 4.37500% 20-27.01.32	620 000.00	140 756.28	0.00
EUR UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 6.75000% 19-20.06.28	3 230 000.00	836 798.12	0.02
ユーロ合計		123 469 372.46	3.14
USD			
USD ABENGOA TRANSMISION SUR SA-REG-S 6.87500% 14-30.04.43	3 165 000.00	2 887 395.66	0.07
USD ABJA INVESTMENT CO PTE LTD-REG-S 5.45000% 18-24.01.28	1 450 000.00	1 444 562.50	0.04
USD ABU DHABI COMMERCIAL BANK-REG-S 3.50000% 22-31.03.27	2 950 000.00	2 807 109.36	0.07
USD ABU DHABI CRUDE OIL PIPELINE LLC-REG-S 3.65000% 17-02.11.29	2 396 000.00	2 242 506.25	0.06
USD ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO PJSC-REG-S 4.87500% 18-23.04.30	1 000 000.00	1 003 750.00	0.03
USD ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO PJSC-REG-S 2.00000% 21-29.04.28	702 000.00	626 535.00	0.02
USD ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO PJSC-REG-S 4.69600% 23-24.04.33	2 151 000.00	2 116 046.25	0.05
USD ACCESS BANK PLC-REG-S 6.12500% 21-21.09.26	4 514 000.00	4 143 005.63	0.11
USD ADANI ELECTRICITY MUMBAI LTD-REG-S 3.94900% 20-12.02.30	2 067 000.00	1 757 900.82	0.04
USD ADANI GREEN ENERGY LTD-REG-S 4.37500% 21-08.09.24	2 836 000.00	2 778 571.00	0.07
USD ADANI INTERNATIONAL CONTAINER TER-REG-S 3.00000% 20-16.02.31	2 140 000.00	1 610 981.84	0.04
USD ADANI PORTS & SPECIAL ECO ZONE-REG-S 4.20000% 20-04.08.27	3 085 000.00	2 842 827.50	0.07
USD ADANI PORTS & SPECIAL ECO ZONE-REG-S 3.10000% 21-02.02.31	1 608 000.00	1 280 530.80	0.03
USD ADANI PORTS & SPL ECO ZONE LTD-REG-S 3.82800% 21-02.02.32	200 000.00	163 500.00	0.00
USD ADANI PORTS AND SPECIAL ECO ZONE-REG-S 4.37500% 19-03.07.29	4 982 000.00	4 453 459.62	0.11
USD ADANI PORTS AND SPECIAL ECO ZONE-REG-S 3.37500% 19-24.07.24	299 000.00	293 902.05	0.01
USD ADANI TRANSMISSION LTD-REG-S 4.25000% 19-21.05.36	460 000.00	301 518.50	0.01
USD AEGEA FINANCE SARL-REG-S 6.75000% 22-20.05.29	5 853 000.00	5 667 752.55	0.14
USD AEGEA FINANCE SARL-REG-S 9.00000% 23-20.01.31	1 075 000.00	1 130 900.00	0.03
USD AEROPUERTO INTERNACIONAL DE TOCUM-REG-S 4.00000% 21-11.08.41	1 930 000.00	1 431 818.75	0.04
USD AEROPUERTO INTERNACIONAL DE TOCU-REG-S 5.12500% 21-11.08.61	12 460 000.00	9 149 004.20	0.23
USD AEROPUERTOS DOMINICANOS-REG-S 6.75000% 17-30.03.29	6 760 000.00	6 757 887.51	0.17
USD AES PANAMA GENERATION HOLDING SRL-REG-S 4.37500% 20-31.05.30	12 549 000.00	10 537 283.70	0.27
USD AFRICA FINANCE CORP-REG-S 2.87500% 21-28.04.28	524 000.00	455 880.00	0.01
USD AGILE GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 5.75000% 20-02.01.25	1 310 000.00	209 600.00	0.01
USD AI CANDELARIA SPAIN SLU-REG-S 7.50000% 18-15.12.28	4 100 000.00	3 211 255.88	0.08
USD AI CANDELARIA SPAIN SLU-REG-S 5.75000% 21-15.06.33	10 250 000.00	7 969 375.00	0.20
USD AIA GROUP LTD-REG-S 3.60000% 19-09.04.29	900 000.00	854 145.54	0.02
USD AIA GROUP LTD-REG-S 3.37500% 20-07.04.30	300 000.00	277 736.32	0.01
USD AIA GROUP LTD-REG-S-SUB 3.20000% 20-16.09.40	2 263 000.00	1 693 104.21	0.04
USD AKBANK TAS-REG-S 6.80000% 20-06.02.26	908 000.00	908 000.00	0.02
USD ALDAR INVESTMENT PROPERTIES SUKU-REG-S 4.87500% 23-24.05.33	2 921 000.00	2 836 108.44	0.07
USD ALIBABA GROUP HOLDING LTD 3.40000% 17-06.12.27	200 000.00	189 028.00	0.00
USD ALIBABA GROUP HOLDING LTD 4.00000% 17-06.12.37	300 000.00	258 810.00	0.01
USD ALIBABA GROUP HOLDING LTD 4.20000% 17-06.12.47	400 000.00	322 080.00	0.01
USD ALIBABA GROUP HOLDING LTD 2.70000% 21-09.02.41	2 320 000.00	1 579 061.60	0.04
USD ALIBABA GROUP HOLDING LTD 3.25000% 21-09.02.61	208 000.00	129 565.28	0.00
USD ALPEK SA DE CV-REG-S 4.25000% 19-18.09.29	1 464 000.00	1 336 083.00	0.03
USD ALPEK SA DE CV-REG-S 3.25000% 21-25.02.31	3 026 000.00	2 521 981.87	0.06
USD ALSEA SAB DE CV-REG-S 7.75000% 21-14.12.26	415 000.00	419 565.00	0.01
USD ALTICE FINANCING SA-REG-S 5.00000% 20-15.01.28	500 000.00	449 316.40	0.01
USD AMERICA MOVIL SAB DE CV 3.62500% 19-22.04.29	675 000.00	636 187.50	0.02
USD AMERICA MOVIL SAB DE CV 2.87500% 20-07.05.30	200 000.00	178 324.00	0.00
USD AMERICA MOVIL SAB DE CV 4.70000% 22-21.07.32	1 000 000.00	980 000.00	0.02
USD ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT S-REG-S 3.37500% 21-29.06.28	4 720 000.00	4 066 575.00	0.10
USD ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC-REG-S 4.75000% 17-10.04.27	285 000.00	281 218.05	0.01
USD ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC-REG-S 5.62500% 20-01.04.30	250 000.00	252 940.00	0.01
USD ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC-REG-S 3.87500% 22-16.03.29	1 800 000.00	1 689 426.00	0.04
USD ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC-REG-S 5.50000% 23-02.05.33	640 000.00	640 076.80	0.02
USD ANGLOGOLD ASHANTI HOLDINGS PLC 3.75000% 20-01.10.30	822 000.00	714 235.80	0.02

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)	
USD	ANGLOGOLD ASHANTI HOLDINGS PLC 3.37500% 21-01.11.28	4 605 000.00	4 144 500.00	0.11
USD	ANGOLAN GOVERNMENT INTERNATION BD-REG-S 8.75000% 22-14.04.32	7 756 000.00	6 631 380.00	0.17
USD	ANGOLAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 9.37500% 18-08.05.48	18 892 000.00	15 113 600.00	0.39
USD	ANTOFAGASTA PLC-REG-S 5.62500% 22-13.05.32	1 280 000.00	1 270 400.00	0.03
USD	ARGENTINA, REPUBLIC OF STEP-UP 20-09.07.30	28 974 551.00	11 720 205.88	0.30
USD	ARGENTINA, REPUBLIC OF STEP-UP 20-09.07.35	71 084 682.00	23 777 826.12	0.61
USD	ARGENTINA, REPUBLIC OF STEP-UP 20-09.01.38	8 399 059.00	3 225 238.66	0.08
USD	ARGENTINA, REPUBLIC OF 1.00000% 20-09.07.29	2 005 010.00	806 014.02	0.02
USD	ARMENIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 3.60000% 21-02.02.31	5 047 000.00	4 069 143.75	0.10
USD	ATP TOWER HOLDINGS LLC-REG-S 4.05000% 21-27.04.26	3 394 000.00	3 106 222.74	0.08
USD	BAHAMAS GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 6.00000% 17-21.11.28	2 079 000.00	1 850 310.00	0.05
USD	BAHRAIN GVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.75000% 17-20.09.29	4 367 000.00	4 383 376.25	0.11
USD	BANCO BRADESCO SA/CAYMAN ISLANDS-REG-S 4.37500% 22-18.03.27	500 000.00	483 575.00	0.01
USD	BANCO BTG PACTUAL SA/CAYMAN-REG-S 4.50000% 19-10.01.25	501 000.00	493 234.50	0.01
USD	BANCO CONTINENTAL SAECA-REG-S 2.75000% 20-10.12.25	3 994 000.00	3 719 412.50	0.09
USD	BANCO DE BOGOTA SA-REG-S-SUB 6.25000% 16-12.05.26	11 603 000.00	11 410 970.35	0.29
USD	BANCO DE CHILE-REG-S 2.99000% 21-09.12.31	1 250 000.00	1 070 000.00	0.03
USD	BANCO DE CREDITO DEL PERU S.A.-REG-S 5.85000% 24-11.01.29	8 424 000.00	8 518 854.24	0.22
USD	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES-REG-S 3.50000% 17-12.10.27	1 790 000.00	1 688 775.50	0.04
USD	BANCO DEL CREDITO DEL PERU-REG-S 2.70000% 19-11.01.25	260 000.00	252 281.25	0.01
USD	BANCO DO BRASIL SA/CAYMAN-REG-S 6.25000% 23-18.04.30	450 000.00	457 177.50	0.01
USD	BANCO NACIONAL DE COM EXTER SNC-REG-S 4.37500% 15-14.10.25	850 000.00	833 144.50	0.02
USD	BANCO NACIONAL DE PANAMA-REG-S 2.50000% 20-11.08.30	371 000.00	280 939.75	0.01
USD	BANCO SANTANDER CHILE-REG-S 2.70000% 20-10.01.25	350 000.00	340 016.25	0.01
USD	BANCO SANTANDER CHILE SA-REG-S 3.17700% 21-26.10.31	920 000.00	793 040.00	0.02
USD	BANCO SANTANDER SA-REG-S 5.37500% 20-17.04.25	330 000.00	327 675.15	0.01
USD	BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO-REG-S 6.25000% 23-31.10.28	4 744 000.00	4 981 200.00	0.13
USD	BANQUE OUEST AFRICAINE DE DEV-REG-S 5.00000% 17-27.07.27	3 129 000.00	2 928 562.52	0.07
USD	BANQUE OUEST AFRICAINE DE DEV-REG-S 4.70000% 19-22.10.31	4 277 000.00	3 623 388.86	0.09
USD	BBVA BANCOMER SA/TEXAS-REG-S-SUB 8.45000% 23-29.06.38	8 225 000.00	8 544 130.00	0.22
USD	BECLE SAB DE CV-REG-S 2.50000% 21-14.10.31	3 440 000.00	2 709 000.00	0.07
USD	BERMUDA GOVERNMENT OF-REG-S 5.00000% 22-15.07.32	2 033 000.00	1 972 010.00	0.05
USD	BERMUDA, GOVERNMENT OF-REG-S 3.71700% 16-25.01.27	2 255 000.00	2 165 927.50	0.06
USD	BERMUDA, GOVERNMENT OF-REG-S 4.75000% 18-15.02.29	4 562 000.00	4 464 190.72	0.11
USD	BERMUDA, GOVERNMENT OF-REG-S 3.37500% 20-20.08.50	653 000.00	440 775.00	0.01
USD	BHARTI AIRTEL LTD-REG-S 4.37500% 15-10.06.25	390 000.00	383 077.50	0.01
USD	BHARTI AIRTEL LTD-REG-S 3.25000% 21-03.06.31	560 000.00	490 560.00	0.01
USD	BIDVEST GROUP UK PLC/THE-REG-S 3.62500% 21-23.09.26	7 401 000.00	6 882 930.00	0.18
USD	BIMBO BAKERIES USA INC-REG-S 6.05000% 23-15.01.29	3 880 000.00	4 039 836.60	0.10
USD	BIMBO BAKERIES USA INC-REG-S 6.40000% 23-15.01.34	4 130 000.00	4 517 765.70	0.12
USD	BIMBO BAKERIES USA INC-REG-S 6.05000% 24-15.01.29	1 180 000.00	1 228 610.10	0.03
USD	BIMBO BAKERIES USA INC-REG-S 5.37500% 24-09.01.36	1 553 000.00	1 559 212.00	0.04
USD	BMF BOVESPA SA-REG-S 4.12500% 21-20.09.31	2 490 000.00	2 163 187.49	0.06
USD	BRASKEM IDESA SAPI-REG-S 6.99000% 21-20.02.32	5 161 000.00	3 362 714.07	0.09
USD	BRASKEM NETHERLANDS FINANCE BV-144A 4.50000% 19-31.01.30	1 240 000.00	977 244.00	0.02
USD	BRASKEM NETHERLANDS FINANCE BV-REG-S 4.50000% 17-10.01.28	2 831 000.00	2 441 029.75	0.06
USD	BRASKEM NETHERLANDS FINANCE BV-REG-S 4.50000% 19-31.01.30	4 291 000.00	3 381 737.10	0.09
USD	BRASKEM NETHERLANDS FINANCE BV-REG-S 7.25000% 23-13.02.33	1 160 000.00	1 026 600.00	0.03
USD	BRASKEM NETHERLANDS FINANCE BV-REG-S 8.50000% 23-12.01.31	1 465 000.00	1 388 058.20	0.04
USD	BRAZIL, FEDERAL REPUBLIC OF 3.87500% 20-12.06.30	420 000.00	380 310.00	0.01
USD	BRAZIL, FEDERAL REPUBLIC OF 2.87500% 20-06.06.25	450 000.00	434 475.00	0.01
USD	BRAZIL, FEDERAL REPUBLIC OF 6.00000% 23-20.10.33	5 968 000.00	5 890 416.00	0.15
USD	BRAZIL, FEDERAL REPUBLIC OF 6.12500% 24-15.03.34	260 000.00	257 452.00	0.01
USD	BRAZIL, FEDERAL REPUBLIC OF 7.12500% 24-13.05.54	5 905 000.00	5 899 095.00	0.15
USD	BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 5.62500% 09-07.01.41	3 000 000.00	2 703 000.00	0.07
USD	BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 4.25000% 13-07.01.25	6 232 000.00	6 147 992.64	0.16
USD	BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 4.62500% 17-13.01.28	376 000.00	370 924.00	0.01
USD	BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 4.75000% 19-14.01.50	10 719 000.00	7 899 903.00	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 - エマージング・マーケット・デッド

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 6.25000% 23-18.03.31	12 979 000.00	13 329 433.00	0.34
USD BRAZIL, REPUBLIC OF 3.75000% 21-12.09.31	4 100 000.00	3 597 750.00	0.09
USD BRF SA-REG-S 4.87500% 19-24.01.30	4 010 000.00	3 537 571.86	0.09
USD BRF SA-REG-S 5.75000% 20-21.09.50	690 000.00	500 112.00	0.01
USD BUFFALO ENERGY MEXICO HOLDINGS-REG-S 7.87500% 24-15.02.39	5 145 000.00	5 293 690.50	0.13
USD CABLE ONDA SA-REG-S 4.50000% 19-30.01.30	4 430 000.00	3 848 562.50	0.10
USD CANACOL ENERGY LTD-REG-S 5.75000% 21-24.11.28	600 000.00	411 366.00	0.01
USD CBQ FINANCE LTD-REG-S 2.00000% 20-15.09.25	1 693 000.00	1 595 652.50	0.04
USD CELULOSA ARAUCO Y CONSTITUCION SA-REG-S 4.25000% 19-30.04.29	800 000.00	743 499.99	0.02
USD CEMEX SAB DE CV-REG-S 5.45000% 19-19.11.29	958 000.00	945 019.10	0.02
USD CEMEX SAV DE CV-REG-S 3.87500% 21-11.07.31	1 680 000.00	1 488 480.00	0.04
USD CENCOSUD SA-REG-S 4.37500% 17-17.07.27	1 100 000.00	1 055 725.00	0.03
USD CENTRAL AMERICAN BOTTLING CORP-REG-S 5.25000% 22-27.04.29	12 723 000.00	11 832 390.00	0.30
USD CENTRAL CHINA REALREG-S *DEFAULTED* 7.25000% 20-13.08.24	525 000.00	24 937.50	0.00
USD CERRO DEL AGUILA SA-REG-S 4.12500% 17-16.08.27	5 183 000.00	4 884 977.50	0.12
USD CHAMPION PATH HOLDINGS-REG-S 4.50000% 21-27.01.26	3 080 000.00	2 910 489.72	0.07
USD CHAMPION PATH HOLDINGS-REG-S 4.85000% 21-27.01.28	2 575 000.00	2 265 721.47	0.06
USD CHILE, REPUBLIC OF 2.55000% 20-27.01.32	8 500 000.00	7 267 500.00	0.19
USD CHILE, REPUBLIC OF 2.75000% 22-31.01.27	15 500 000.00	14 647 500.00	0.37
USD CHILE, REPUBLIC OF 3.12500% 14-27.03.25	3 721 000.00	3 627 565.69	0.09
USD CHILE, REPUBLIC OF 3.24000% 18-06.02.28	353 000.00	334 291.00	0.01
USD CHILE, REPUBLIC OF 3.50000% 19-25.01.50	3 336 000.00	2 458 632.00	0.06
USD CHILE, REPUBLIC OF 3.10000% 21-22.01.61	2 570 000.00	1 640 945.00	0.04
USD CHILE, REPUBLIC OF 3.10000% 21-07.05.41	544 000.00	406 640.00	0.01
USD CHILE, REPUBLIC OF 3.25000% 21-21.09.71	1 080 000.00	691 740.00	0.02
USD CHILE, REPUBLIC OF 3.50000% 22-31.01.34	3 021 000.00	2 661 501.00	0.07
USD CHILE, REPUBLIC OF 4.00000% 22-31.01.52	1 990 000.00	1 586 030.00	0.04
USD CHILE, REPUBLIC OF 4.34000% 22-07.03.42	2 828 000.00	2 484 398.00	0.06
USD CHINA AOYUAN GRP LTD-REG-S *DEFAULTED* 5.98000% 20-18.08.25	770 000.00	15 400.00	0.00
USD CHINA HONGQIAO GROUP LTD-REG-S 6.25000% 21-08.06.24	867 000.00	858 997.59	0.02
USD CIA DE MINAS BUENAVENTURA SAA-REG-S 5.50000% 21-23.07.26	1 650 000.00	1 567 500.00	0.04
USD CIBANCO SA INST DE BANCA MUTI TRS-REG-S 4.37500% 21-22.07.31	1 750 000.00	1 321 250.00	0.03
USD CIBANCO/PLA ADMIN INDUST SDERLDE-REG-S 4.96200% 19-18.07.29	1 350 000.00	1 282 500.00	0.03
USD CIFI HOL GROUP CO LTD-REG-S *DEFAULTED* 6.45000% 19-07.11.24	240 000.00	20 625.60	0.00
USD CIFI HOL GROUP CO LTD-REG-S *DEFAULTED* 6.00000% 20-16.07.25	1 355 000.00	115 459.55	0.00
USD CIFI HOL GROUP CO LTD-REG-S *DEFAULTED* 5.95000% 20-20.10.25	1 300 000.00	111 540.00	0.00
USD CIFI HOL GROUP CO LTD REG-S*DEFAULTED* 4.37500% 21-12.04.27	861 000.00	73 649.94	0.00
USD CIKARANG LISTRINDO TBK PT-REG-S 4.95000% 16-14.09.26	1 000 000.00	963 750.00	0.02
USD CK HUTCHISON INTERNATIONAL 23 LTD-REG-S 4.75000% 23-21.04.28	338 000.00	337 182.04	0.01
USD CK HUTCHISON INTERNATIONAL 20 LTD-REG-S 2.50000% 20-08.05.30	1 600 000.00	1 401 422.90	0.04
USD CK HUTCHISON INTERNATIONAL-REG-S 2.50000% 21-15.04.31	500 000.00	425 755.00	0.01
USD CLEAN RENEWABLE POWER MAURITIUS-REG-S 4.25000% 21-25.03.27	1 020 000.00	849 150.00	0.02
USD CLIFFTON LTD-REG-S 6.25000% 21-25.10.25	1 080 000.00	1 067 850.00	0.03
USD CNAC HK FINBRIDGE CO LTD-REG-S 5.12500% 18-14.03.28	1 080 000.00	1 071 522.00	0.03
USD CNAC HK FINBRIDGE CO LTD-REG-S 3.87500% 19-19.06.29	1 030 000.00	959 342.00	0.02
USD COCA-COLA FEMSA 1.85000% 20-01.09.32	423 000.00	334 170.00	0.01
USD COCA-COLA ICECEK AS-REG-S 4.21500% 17-19.09.24	3 630 000.00	3 598 419.00	0.09
USD COCA-COLA ICECEK AS-REG-S 4.50000% 22-20.01.29	2 730 000.00	2 510 746.88	0.06
USD COLBUN SA-REG-S 3.15000% 21-19.01.32	713 000.00	605 337.00	0.02
USD COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.25000% 21-22.04.32	8 700 000.00	6 772 950.00	0.17
USD COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.12500% 21-22.02.42	3 445 000.00	2 323 652.50	0.06
USD COLOMBIA TELECOMUNICACIONES SA-REG-S 4.95000% 20-17.07.30	1 768 000.00	1 139 476.00	0.03
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 3.87500% 17-25.04.27	459 000.00	434 443.50	0.01
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 4.50000% 18-15.03.29	5 292 000.00	4 865 994.00	0.12
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 5.20000% 19-15.05.49	10 016 000.00	7 366 768.00	0.19
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 3.00000% 20-30.01.30	2 050 000.00	1 697 400.00	0.04
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 3.12500% 20-15.04.31	5 226 000.00	4 170 348.00	0.11
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 4.12500% 20-15.05.51	5 254 000.00	3 283 750.00	0.08

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 3.87500% 21-15.02.61	550 000.00	320 925.00	0.01
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 7.50000% 23-02.02.34	21 291 000.00	21 727 465.50	0.55
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 8.00000% 23-14.11.35	5 754 000.00	6 047 454.00	0.15
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 8.75000% 23-14.11.53	5 539 000.00	6 023 662.50	0.15
USD COMETA ENERGIA SA DE CV-REG-S 6.37500% 18-24.04.35	4 837 000.00	3 730 164.41	0.10
USD COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD-REG-S 3.34800% 21-09.02.31	4 625 000.00	3 821 406.25	0.10
USD COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD-REG-S 4.67700% 21-09.02.51	2 473 000.00	1 718 735.00	0.04
USD COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD-REG-S 3.87500% 21-26.07.33	248 000.00	199 627.60	0.01
USD COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD-REG-S 4.68800% 22-15.05.29	1 716 000.00	1 611 967.50	0.04
USD COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD-REG-S 6.26400% 22-15.02.52	501 000.00	433 365.00	0.01
USD CONSORCIO TRANSMANTARO-REG-S 4.70000% 19-16.04.34	2 510 000.00	2 349 360.00	0.06
USD CONSORCIO TRANSMANTARO SA-REG-S 5.20000% 22-11.04.38	5 062 000.00	4 771 441.20	0.12
USD CONTINUUM ENERGY LEVAN PTE LTD-REG-S 4.50000% 21-09.02.27	900 000.00	764 024.06	0.02
USD CORP FINANCIERA DE DESARROLLO SA-REG-S 4.75000% 15-15.07.25	1 545 000.00	1 526 676.30	0.04
USD CORP FINANCIERA DE DESARROLLO SA-REG-S 2.40000% 20-28.09.27	2 230 000.00	2 002 986.00	0.05
USD CORP INMOBILIARIA VESTA SAB DE-REG-S 3.62500% 21-13.05.31	300 000.00	252 187.50	0.01
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 3.62500% 17-01.08.27	3 000 000.00	2 832 000.00	0.07
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 4.50000% 17-01.08.47	1 284 000.00	1 007 298.00	0.03
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 4.37500% 19-05.02.49	200 000.00	154 200.00	0.00
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 3.70000% 19-30.01.50	790 000.00	540 360.00	0.01
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 3.15000% 20-14.01.30	3 658 000.00	3 224 527.00	0.08
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 3.75000% 20-15.01.31	864 000.00	769 824.00	0.02
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE-REG-S 5.12500% 23-02.02.33	7 770 000.00	7 394 670.16	0.19
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 5.95000% 23-08.01.34	1 061 000.00	1 058 559.70	0.03
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 6.30000% 23-08.09.53	1 980 000.00	1 942 360.20	0.05
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 6.44000% 24-26.01.36	2 547 000.00	2 636 145.00	0.07
USD CORP NACIONAL DEL COBRE-REG-S 6.30000% 24-08.09.53	520 000.00	508 653.60	0.01
USD COSAN LUXEMBOURG SA-REG-S 7.25000% 24-27.06.31	2 270 000.00	2 280 669.00	0.06
USD COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 5.62500% 13-30.04.43	1 115 000.00	996 252.50	0.03
USD COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 7.00000% 14-04.04.44	3 265 000.00	3 307 445.00	0.08
USD COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 7.15800% 15-12.03.45	3 950 000.00	4 058 625.00	0.10
USD COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 6.12500% 19-19.02.31	3 896 000.00	3 934 960.00	0.10
USD COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 6.55000% 23-03.04.34	13 944 000.00	14 264 712.00	0.36
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 3.30000% 21-12.01.31	1 469 000.00	110 175.00	0.00
USD CREDICORP LTD-REG-S 2.75000% 20-17.06.25	2 860 000.00	2 730 406.25	0.07
USD CSN ISLANDS XI CORP-REG-S 6.75000% 20-28.01.28	300 000.00	287 250.00	0.01
USD CSN RESOURCES SA-REG-S 4.62500% 21-10.06.31	3 710 000.00	2 991 187.50	0.08
USD CT TRUST-REG-S 5.12500% 22-03.02.32	7 912 000.00	6 883 440.00	0.18
USD DAE FUNDING LLC-REG-S 3.37500% 21-20.03.28	4 893 000.00	4 477 095.00	0.11
USD DEBT AND ASSET TRADING CORP-REG-S 1.00000% 13-10.10.25	1 900 000.00	1 664 552.00	0.04
USD DOMINICAN REPUBLIC INT BOND-REG-S 4.87500% 20-23.09.32	12 298 000.00	10 975 965.00	0.28
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 5.50000% 15-27.01.25	346 000.00	344 616.00	0.01
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 6.85000% 15-27.01.45	1 505 000.00	1 471 137.50	0.04
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 6.87500% 16-29.01.26	13 136 000.00	13 339 608.00	0.34
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 5.95000% 17-25.01.27	1 700 000.00	1 700 850.00	0.04
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 6.50000% 18-15.02.48	150 000.00	141 600.00	0.00
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 6.00000% 18-19.07.28	3 386 000.00	3 394 465.00	0.09
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 6.40000% 19-05.06.49	1 128 000.00	1 043 400.00	0.03
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 4.50000% 20-30.01.30	19 342 000.00	17 630 233.00	0.45
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 5.87500% 20-30.01.60	16 467 000.00	13 955 782.50	0.36
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 5.30000% 21-21.01.41	380 000.00	319 580.00	0.01
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 7.05000% 23-03.02.31	7 670 000.00	7 969 130.00	0.20
USD EASY TACTIC LTD (PIK) 6.50000% 22-11.07.28	658 993.00	33 806.34	0.00
USD ECOPETROL SA 4.62500% 21-02.11.31	10 474 000.00	8 580 300.80	0.22
USD ECOPETROL SA 5.87500% 14-28.05.45	5 753 000.00	4 249 741.10	0.11
USD ECOPETROL SA 5.87500% 21-02.11.51	610 000.00	434 747.00	0.01
USD ECOPETROL SA 6.87500% 20-29.04.30	2 260 000.00	2 193 104.00	0.06
USD ECOPETROL SA 7.37500% 13-18.09.43	1 790 000.00	1 632 480.00	0.04

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)	
USD	ECOPETROL SA 8.37500% 24-19.01.36	3 557 000.00	3 593 281.40	0.09
USD	ECOPETROL SA 8.62500% 23-19.01.29	6 790 000.00	7 171 937.50	0.18
USD	ECOPETROL SA 8.87500% 23-13.01.33	8 993 000.00	9 486 266.05	0.24
USD	ECUADOR GOVT INTERNATIONAL BD-REG-S STEP-UP/DOWN 20-31.07.35	44 133 887.00	17 896 291.18	0.46
USD	ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S STEP-UP 0.50000% 20-31.07.30	3 197 438.00	1 678 415.14	0.04
USD	ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S STEP-UP 20-31.07.40	16 785 117.00	6 143 352.83	0.16
USD	EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 7.90300% 18-21.02.48	12 882 000.00	7 648 687.50	0.19
USD	EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 6.58800% 18-21.02.28	713 000.00	529 402.50	0.01
USD	EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 7.62500% 20-29.05.32	8 423 000.00	5 706 582.50	0.15
USD	EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 8.87500% 20-29.05.50	7 391 000.00	4 637 852.50	0.12
USD	EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 5.25000% 20-06.10.25	1 865 000.00	1 636 537.50	0.04
USD	EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 7.62500% 11-01.02.41	4 700 000.00	3 534 400.00	0.09
USD	EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 5.87500% 12-30.01.25	294 000.00	279 006.00	0.01
USD	EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 6.37500% 14-18.01.27	3 410 000.00	3 028 080.00	0.08
USD	EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 8.62500% 17-28.02.29	6 493 000.00	5 837 207.00	0.15
USD	EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 7.12460% 19-20.01.50	8 552 000.00	6 093 300.00	0.16
USD	EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 9.50000% 20-15.07.52	8 938 000.00	7 504 344.80	0.19
USD	EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 8.25000% 02-10.04.32	470 000.00	400 205.00	0.01
USD	ELECTRICIDAD FIRME DE MEXICO-REG-S 4.90000% 21-20.11.26	2 002 000.00	1 804 302.50	0.05
USD	EMBRAER NETHERLANDS FINANCE BV-REG-S 7.00000% 23-28.07.30	2 468 000.00	2 584 613.00	0.07
USD	EMPRESA DE L FERROCARRILE DEL EST-REG-S 3.06800% 20-18.08.50	1 494 000.00	900 045.36	0.02
USD	EMPRESA DE LOS FERROCARRILES DEL-REG-S 3.83000% 21-14.09.61	410 000.00	270 887.00	0.01
USD	EMPRESA DE TRANSMISION ELECTRICA-REG-S 5.12500% 19-02.05.49	3 690 000.00	2 660 895.90	0.07
USD	EMPRESA DE TRANSPORTE DE PASA MET-REG-S 3.65000% 20-07.05.30	580 000.00	529 279.00	0.01
USD	EMPRESA DE TRANSPORTE DE PASA MET-REG-S 4.70000% 20-07.05.50	1 490 000.00	1 212 755.70	0.03
USD	EMPRESA GENERADORA DE ELECTRICID-REG-S 5.62500% 21-08.11.28	4 033 000.00	3 619 617.50	0.09
USD	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM-REG-S 4.75000% 14-01.08.26	7 101 000.00	6 947 884.69	0.18
USD	EMPRESA NACIONAL DEL PETROLEO-REG-S 3.75000% 16-05.08.26	2 957 000.00	2 802 082.77	0.07
USD	EMPRESA NACIONAL DEL PETROLEO-REG-S 4.50000% 17-14.09.47	958 000.00	707 205.18	0.02
USD	EMPRESA NACIONAL DEL PETROLEO-REG-S 5.25000% 18-06.11.29	11 544 000.00	11 142 961.44	0.28
USD	EMPRESA NACIONAL DEL PETROLEO-REG-S 3.45000% 21-16.09.31	1 436 000.00	1 205 478.92	0.03
USD	EMPRESA NACIONAL DEL PETROLEO-REG-S 6.15000% 23-10.05.33	452 000.00	450 268.84	0.01
USD	EMPRESAS PUBLICAS DE MEDELLIN ESP-REG-S 4.25000% 19-18.07.29	1 780 000.00	1 522 701.00	0.04
USD	ENDEAVOUR MINING PLC-REG-S 5.00000% 21-14.10.26	2 724 000.00	2 496 328.08	0.06
USD	ENERGEAN PLC-REG-S 6.50000% 21-30.04.27	4 130 000.00	3 702 803.13	0.09
USD	ENERGO-PRO AS-REG-S 8.50000% 22-04.02.27	3 350 000.00	3 313 359.38	0.08
USD	ENERGO-PRO AS-REG-S 11.00000% 23-02.11.28	1 075 000.00	1 122 300.00	0.03
USD	ENERGUATE TRUST-REG-S 5.87500% 17-03.05.27	3 375 000.00	3 214 687.50	0.08
USD	ENERSIS AMERICAS SA 4.00000% 16-25.10.26	2 770 000.00	2 669 726.00	0.07
USD	ENFRAGEN ENERGIA SUR SA-REG-S 5.37500% 20-30.12.30	6 959 000.00	5 410 622.50	0.14
USD	ENGIE ENERGIA CHILE SA-REG-S 3.40000% 20-28.01.30	767 000.00	659 380.31	0.02
USD	ENN CLEAN ENERGY INTERNAT INVEST-REG-S 3.37500% 21-12.05.26	5 668 000.00	5 321 458.48	0.14
USD	ENN ENERGY HOLDINGS LTD-REG-S 4.62500% 22-17.05.27	300 000.00	295 494.00	0.01
USD	ENN ENERGY HOLDINGS LTD-REG-S 2.62500% 20-17.09.30	4 485 000.00	3 843 061.95	0.10
USD	ESKOM HOLDINGS SOC LTD-REG-S 7.12500% 15-11.02.25	2 580 000.00	2 563 875.00	0.07
USD	EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 5.12500% 23-11.01.33	244 000.00	250 734.40	0.01
USD	FALABELLA SA-REG-S 3.37500% 21-15.01.32	2 756 000.00	2 039 440.00	0.05
USD	FANTASIA HOLDING GRP-REG-S *DEFAULTED* 10.87500% 20-09.01.23	870 000.00	19 575.00	0.00
USD	FANTASIA HOLDINGS GRP-REG-S *DEFAULTED* 11.87500% 20-01.06.23	3 955 000.00	88 987.50	0.00
USD	FBN VIA FINANCE CO BV-REG-S 8.62500% 20-27.10.25	820 000.00	785 918.74	0.02
USD	FEL ENERGY VI SARL-REG-S 5.75000% 20-01.12.40	11 046 000.00	8 711 878.15	0.22
USD	FENIX POWER PERU SA-REG-S 4.31700% 17-20.09.27	4 005 000.00	2 503 509.72	0.06
USD	FONDO MIVIVIENDA SA-REG-S 4.62500% 22-12.04.27	2 110 000.00	2 051 975.00	0.05
USD	FORTUNE STAR BVI LTD-REG-S 5.00000% 21-18.05.26	360 000.00	303 300.00	0.01
USD	FRANSHION BRILLIANT LTD-REG-S 4.25000% 19-23.07.29	1 200 000.00	804 000.00	0.02
USD	FREEPORT INDONESIA-REG-S 6.20000% 22-14.04.52	1 685 000.00	1 624 104.10	0.04
USD	FS LUXEMBOURG SARL-REG-S 10.00000% 20-15.12.25	900 000.00	937 575.00	0.02
USD	FS LUXEMBOURG SARL-REG-S 8.87500% 24-12.02.31	3 433 000.00	3 396 953.50	0.09
USD	FUTURE RETAIL LTD-REG-S *DEFAULTED* 5.60000% 20-22.01.25	350 000.00	875.00	0.00

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD GABON, REPUBLIC OF-REG-S 6.62500% 20-06.02.31	11 144 000.00	9 082 360.00	0.23
USD GABON, REPUBLIC OF-REG-S 7.00000% 21-24.11.31	2 770 000.00	2 257 550.00	0.06
USD GACI FIRST INVESTMENT CO-REG-S 5.25000% 22-13.10.32	2 173 000.00	2 186 581.25	0.06
USD GACI FIRST INVESTMENT CO-REG-S 5.00000% 22-13.10.27	2 390 000.00	2 384 025.00	0.06
USD GACI FIRST INVESTMENT CO-REG-S 4.75000% 23-14.02.30	1 032 000.00	1 012 650.00	0.03
USD GACI FIRST INVESTMENT CO-REG-S 5.12500% 23-14.02.53	1 298 000.00	1 103 624.50	0.03
USD GALAXY PIPELINE ASSETS BIDCO LTD-REG-S 1.75000% 20-30.09.27	2 910 000.00	1 761 065.62	0.04
USD GALAXY PIPELINE ASSETS BIDCO LTD-REG-S 2.16000% 21-31.03.34	5 625 000.00	4 094 234.43	0.10
USD GALAXY PIPELINE ASSETS BIDCO LTD-REG-S 2.94000% 21-30.09.40	4 604 000.00	3 439 552.64	0.09
USD GCC SAB DE CV-REG-S 3.61400% 22-20.04.32	6 565 000.00	5 608 873.40	0.14
USD GENM CAPITAL LABUAN LTD-REG-S 3.88200% 21-19.04.31	3 395 000.00	2 898 990.50	0.07
USD GEOPARK LTD-REG-S 5.50000% 20-17.01.27	3 230 000.00	2 864 606.25	0.07
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 7.62500% 18-16.05.29	6 500 000.00	2 876 250.00	0.07
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 8.62700% 18-16.06.49	1 595 000.00	689 837.50	0.02
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 6.37500% 20-11.02.27	3 211 000.00	1 440 936.25	0.04
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 8.62500% 21-07.04.34	11 479 000.00	5 093 806.25	0.13
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 8.87500% 21-07.05.42	1 703 000.00	747 191.25	0.02
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 7.75000% 21-07.04.29	3 890 000.00	1 731 050.00	0.04
USD GMR HYDERABAD INTNATL AIRPORT LTD-REG-S 4.25000% 17-27.10.27	630 000.00	581 647.50	0.01
USD GNL QUINTERO SA-REG-S 4.63400% 14-31.07.29	5 343 000.00	3 696 714.84	0.09
USD GOLD FIELDS OROGEN HOLDINGS BVI-REG-S 5.12500% 19-15.05.24	250 000.00	248 377.50	0.01
USD GOLD FIELDS OROGEN HOLDINGS-REG-S 6.12500% 19-15.05.29	3 474 000.00	3 523 938.75	0.09
USD GRUMA SA DE CV-REG-S 4.87500% 14-01.12.24	5 127 000.00	5 063 425.20	0.13
USD GRUPO AVAL LTD-REG-S 4.37500% 20-04.02.30	2 600 000.00	2 144 740.00	0.05
USD GRUPO BIMBO SA DE CV-REG-S 3.87500% 14-27.06.24	300 000.00	297 435.00	0.01
USD GRUPO BIMBO SA DE CV-REG-S 4.00000% 19-06.09.49	490 000.00	380 975.00	0.01
USD GRUPO BIMBO SAB DE CV-REG-S 4.70000% 17-10.11.47	200 000.00	174 000.00	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	5 959 000.00	4 649 297.58	0.12
USD GUATEMALA GOVERNMENT BOND-REG-S 4.65000% 21-07.10.41	1 234 000.00	989 051.00	0.03
USD GUATEMALA, REPUBLIC OF-144A 7.05000% 23-04.10.32	1 400 000.00	1 471 400.00	0.04
USD GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 4.50000% 16-03.05.26	5 490 000.00	5 332 162.50	0.14
USD GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 4.37500% 17-05.06.27	4 315 000.00	4 129 455.00	0.11
USD GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 4.90000% 19-01.06.30	8 660 000.00	8 257 310.00	0.21
USD GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 6.12500% 19-01.06.50	6 665 000.00	6 060 651.13	0.15
USD GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 5.37500% 20-24.04.32	6 159 000.00	5 906 481.00	0.15
USD GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 3.70000% 21-07.10.33	2 236 000.00	1 839 110.00	0.05
USD GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 5.25000% 22-10.08.29	2 140 000.00	2 072 590.00	0.05
USD GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 6.60000% 23-13.06.36	15 015 000.00	15 217 702.50	0.39
USD GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 7.05000% 23-04.10.32	3 059 000.00	3 215 009.00	0.08
USD HANA BANK-REG-S 3.25000% 22-30.03.27	6 346 000.00	6 047 103.40	0.15
USD HEALTH AND HAPPINESS H&H INTL HLD-REG-S 5.62500% 19-24.10.24	200 000.00	196 878.00	0.00
USD HEALTH&HAPPINESS H&H INT HOLDING-REG-S 13.50000% 23-26.06.26	410 000.00	414 100.00	0.01
USD HIKMA FINANCE USA LLC-REG-S 3.25000% 20-09.07.25	385 000.00	367 193.75	0.01
USD HKT CAPITAL NO 6 LTD-REG-S 3.00000% 22-18.01.32	300 000.00	257 503.82	0.01
USD HONDURAS, REPUBLIC OF-REG-S 6.25000% 17-19.01.27	824 000.00	781 976.00	0.02
USD HONDURAS, REPUBLIC OF-REG-S 5.62500% 20-24.06.30	2 667 000.00	2 325 290.60	0.06
USD HTA GROUP LTD/MAURITIUS-REG-S 7.00000% 20-18.12.25	270 000.00	266 034.38	0.01
USD HUNGARY, REPUBLIC OF 7.62500% 11-29.03.41	2 070 000.00	2 381 017.50	0.06
USD HUNGARY, REPUBLIC OF 5.37500% 14-25.03.24	122 000.00	121 749.90	0.00
USD HUNGARY, REPUBLIC OF-REG-S 5.25000% 22-16.06.29	7 080 000.00	7 009 200.00	0.18
USD HUNGARY, REPUBLIC OF-REG-S 5.50000% 22-16.06.34	20 765 000.00	20 557 350.00	0.52
USD HUNGARY, REPUBLIC OF-REG-S 2.12500% 21-22.09.31	15 970 000.00	12 696 150.00	0.32
USD HUNGARY, REPUBLIC OF-REG-S 3.12500% 21-21.09.51	8 427 000.00	5 372 212.50	0.14
USD HUNGARY, REPUBLIC OF-REG-S 6.12500% 23-22.05.28	14 255 000.00	14 661 267.50	0.37
USD HUNGARY, REPUBLIC OF-REG-S 6.25000% 22-22.09.32	9 120 000.00	9 516 720.00	0.24
USD HUNGARY, REPUBLIC OF-REG-S 6.75000% 22-25.09.52	1 065 000.00	1 140 881.25	0.03
USD HUNGARY, REPUBLIC OF-REG-S 5.50000% 24-26.03.36	8 040 000.00	7 888 245.00	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 - エマージング・マーケット・デッド

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD HUNT OIL CO OF PERU LLC SUCUAL DL-REG-S 8.55000% 23-18.09.33	6 330 000.00	6 731 322.00	0.17
USD HUNT OIL CO OF PERU LLC DEL PERU-REG-S 8.55000% 23-18.09.33	400 000.00	401 036.00	0.01
USD HYUNDAI ASSAN OTOMOTIV SANAYI VE-REG-S 1.62500% 21-12.07.26	610 000.00	551 116.70	0.01
USD HYUNDAI CAPITAL AMERICA-REG-S 2.75000% 16-27.09.26	454 000.00	427 388.06	0.01
USD HYUNDAI CAPITAL AMERICA-REG-S 3.50000% 19-02.11.26	3 554 000.00	3 401 776.16	0.09
USD HYUNDAI CAPITAL AMERICA-REG-S 1.65000% 21-17.09.26	1 210 000.00	1 109 564.91	0.03
USD HYUNDAI CAPITAL AMERICA-REG-S 5.68000% 23-26.06.28	372 000.00	382 008.27	0.01
USD HYUNDAI CAPITAL AMERICA-REG-S 5.40000% 24-08.01.31	639 000.00	651 277.89	0.02
USD HYUNDAI CAPITAL SERVICES INC-REG-S 5.12500% 24-05.02.29	829 000.00	828 645.11	0.02
USD ICL GROUP LTD-144A-REG-S 6.37500% 18-31.05.38	420 000.00	393 519.00	0.01
USD IHS NETHERLANDS HOLDCO BV-REG-S 8.00000% 19-18.09.27	2 014 000.00	1 843 439.37	0.05
USD INDIA GREEN POWER HOLDINGS-REG-S 4.00000% 21-22.02.27	3 619 000.00	3 346 670.25	0.09
USD INDIKA ENERGY CAPITAL IV PTE LTD-REG-S 8.25000% 20-22.10.25	990 000.00	988 762.50	0.03
USD INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT-REG-S 4.74500% 21-09.06.51	280 000.00	220 530.80	0.01
USD INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT-REG-S 3.39800% 21-09.06.31	2 364 000.00	2 036 255.04	0.05
USD INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT-REG-S 3.54100% 21-27.04.32	2 170 000.00	1 863 726.20	0.05
USD INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM PT-REG-S 6.53000% 18-15.11.28	420 000.00	437 850.00	0.01
USD INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM PT-REG-S 4.75000% 20-15.05.25	223 000.00	219 400.78	0.01
USD INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM PT-REG-S 5.45000% 20-15.05.30	733 000.00	728 499.38	0.02
USD INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM PT-REG-S 5.80000% 20-15.05.50	1 480 000.00	1 387 662.80	0.04
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 4.75000% 18-11.02.29	2 800 000.00	2 793 000.00	0.07
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 3.35000% 21-12.03.71	390 000.00	259 880.40	0.01
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 3.20000% 21-23.09.61	690 000.00	458 063.40	0.01
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 4.55000% 23-11.01.28	490 000.00	485 766.40	0.01
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 4.85000% 23-11.01.33	5 065 000.00	5 065 557.15	0.13
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 5.65000% 23-11.01.53	720 000.00	750 679.20	0.02
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 7.75000% 08-17.01.38	759 000.00	947 884.74	0.02
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.25000% 12-17.01.42	1 020 000.00	1 016 287.20	0.03
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.25000% 16-08.01.47	232 000.00	230 285.52	0.01
USD INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV-REG-S 4.75000% 20-06.08.50	200 000.00	156 500.00	0.00
USD INKIA ENERGY LTD-REG-S 5.87500% 17-09.11.27	550 000.00	528 000.00	0.01
USD INRETAIL SHOPPING MALLS-REG-S 5.75000% 18-03.04.28	370 000.00	356 125.00	0.01
USD INSTITUTO COSTARRICENSE DE ELEC-REG-S 6.37500% 13-15.05.43	540 000.00	464 400.00	0.01
USD INSTITUTO COSTARRICENSE DE ELECT-REG-S 6.75000% 21-07.10.31	1 270 000.00	1 256 109.37	0.03
USD INTERCORP PERU LTD-REG-S 3.87500% 19-15.08.29	330 000.00	284 625.00	0.01
USD INTERNATIONAL AIRPORT FINANCE SA-REG-S 12.00000% 19-15.03.33	3 474 000.00	3 389 120.57	0.09
USD INVERSIONES CMPC SA-REG-S 3.00000% 21-06.04.31	800 000.00	672 800.00	0.02
USD INVERSIONES CMPC SA-REG-S 6.12500% 23-23.06.33	4 845 000.00	4 867 916.85	0.12
USD INVESTMENT ENERGY RESOURCES LTD-REG-S 6.25000% 21-26.04.29	1 289 000.00	1 220 012.72	0.03
USD IPOTEKA-BANK ATIB-REG-S 5.50000% 20-19.11.25	2 760 000.00	2 615 100.00	0.07
USD ISRAEL ELECTRIC CORP LTD-144A-REG-S 5.00000% 14-12.11.24	1 059 000.00	1 045 762.50	0.03
USD ISTANBUL MUNICIPALITY OF-REG-S 10.50000% 23-06.12.28	1 721 000.00	1 815 655.00	0.05
USD IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S STEP-UP 10-31.12.32	3 007 000.00	1 553 013.00	0.04
USD IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 7.62500% 24-30.01.33	1 154 000.00	1 143 614.00	0.03
USD IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 8.25000% 24-30.01.37	7 649 000.00	7 656 649.00	0.20
USD JAMAICA, GOVERNMENT OF 7.87500% 15-28.07.45	2 806 000.00	3 261 975.00	0.08
USD JD.COM INC 4.12500% 20-14.01.50	550 000.00	423 263.50	0.01
USD JORDAN GOVERNMENT INTERNATIONAL B-REG-S 7.75000% 22-15.01.28	7 955 000.00	7 955 000.00	0.20
USD JORDAN, KINGDOM OF-REG-S 6.12500% 15-29.01.26	335 000.00	325 368.75	0.01
USD JORDAN, KINGDOM OF-REG-S 5.75000% 16-31.01.27	6 005 000.00	5 734 775.00	0.15
USD JORDAN, KINGDOM OF-REG-S 5.85000% 20-07.07.30	5 493 000.00	4 913 488.50	0.13
USD JORDAN, KINGDOM OF-REG-S 4.95000% 20-07.07.25	7 008 000.00	6 736 440.00	0.17
USD JORDAN, KINGDOM OF-REG-S 7.50000% 23-13.01.29	7 825 000.00	7 658 718.75	0.20
USD JSW HYDRO ENERGY LTD-REG-S 4.12500% 21-18.05.31	500 000.00	351 684.37	0.01
USD JSW STEEL LTD-REG-S 3.95000% 21-05.04.27	1 797 000.00	1 668 963.75	0.04
USD JSW STEEL LTD-REG-S 5.05000% 21-05.04.32	800 000.00	706 000.00	0.02
USD KAISA GROUP HOLDINGS-REG-S *DEFAULTED* 11.50000% 19-30.01.23	1 345 000.00	43 712.50	0.00
USD KAISA GROUP HOLDINGS-REG-S *DEFAULTED* 11.25000% 20-16.04.25	400 000.00	13 000.00	0.00

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD KALLPA GENERACION SA-REG-S 4.87500% 16-24.05.26	1 135 000.00	1 106 625.00	0.03
USD KAZMUNAYGAS NATIONAL CO-REG-S 4.75000% 17-19.04.27	3 520 000.00	3 424 960.00	0.09
USD KAZMUNAYGAS NATIONAL CO-REG-S 5.75000% 17-19.04.47	9 512 000.00	8 251 660.00	0.21
USD KAZMUNAYGAS NATIONAL CO-REG-S 6.37500% 18-24.10.48	4 066 000.00	3 740 720.00	0.10
USD KAZMUNAYGAS NATIONAL CO-REG-S 5.37500% 18-24.04.30	21 874 000.00	21 370 898.00	0.54
USD KAZMUNAYGAS NATIONAL CO JSC-REG-S 3.50000% 20-14.04.33	5 653 000.00	4 621 327.50	0.12
USD KB KOOKMIN CRD CO LTD-REG-S 4.00000% 22-09.06.25	1 773 000.00	1 738 125.09	0.04
USD KENYA, REPUBLIC OF-REG-S 8.25000% 18-28.02.48	3 485 000.00	2 774 931.25	0.07
USD KENYA, REPUBLIC OF-REG-S 8.00000% 19-22.05.32	1 760 000.00	1 540 000.00	0.04
USD KENYA, REPUBLIC OF-REG-S 6.30000% 21-23.01.34	5 133 000.00	3 984 491.25	0.10
USD KLABIN AUSTRIA GMBH-REG-S 7.00000% 19-03.04.49	900 000.00	901 620.00	0.02
USD KOC HOLDING AS-REG-S 6.50000% 19-11.03.25	250 000.00	249 375.00	0.01
USD KOREA EXPRESSWAY CORP-REG-S 3.62500% 22-18.05.25	1 139 000.00	1 117 108.42	0.03
USD KOREA GAS CORP-REG-S 4.87500% 23-05.07.28	350 000.00	350 906.50	0.01
USD KOSMOS ENERGY LTD-144A 7.12500% 19-04.04.26	910 000.00	874 737.50	0.02
USD KOSMOS ENERGY LTD-REG-S 7.12500% 19-04.04.26	4 290 000.00	4 123 762.50	0.11
USD KOSMOS ENERGY LTD-REG-S 7.50000% 21-01.03.28	1 180 000.00	1 091 500.00	0.03
USD KOSMOS ENERGY LTD-REG-S 7.75000% 21-01.05.27	2 678 000.00	2 534 057.50	0.06
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.65000% 15-26.02.30	7 830 000.00	446 310.00	0.01
USD LENOVO GROUP LTD-REG-S 3.42100% 20-02.11.30	1 900 000.00	1 674 071.00	0.04
USD LENOVO GROUP LTD-REG-S 5.83100% 22-27.01.28	300 000.00	304 944.00	0.01
USD LG CHEM LTD-REG-S 2.37500% 21-07.07.31	475 000.00	389 732.75	0.01
USD LG ENERGY SOLUTION LTD-REG-S 5.75000% 23-25.09.28	441 000.00	449 802.36	0.01
USD LIQUID TELECOMMUNICATIONS FIN-REG-S 5.50000% 21-04.09.26	300 000.00	187 312.50	0.00
USD LLPL CAPITAL PTE LTD-REG-S 6.87500% 19-04.02.39	7 430 000.00	5 724 105.43	0.15
USD MAGYAR EXPORT-IMPORT BANK ZRT-REG-S 6.12500% 23-04.12.27	4 895 000.00	4 950 068.75	0.13
USD MALDIVES SUKUK ISSUANCE LTD-REG-S 9.87500% 21-08.04.2026	400 000.00	327 625.00	0.01
USD MC BRAZIL DOWNSTREAM TRADING SARL-REG-S 7.25000% 21-30.06.31	1 400 000.00	1 024 510.75	0.03
USD MDGH GMTN RSC LTD-REG-S 5.50000% 22-28.04.33	417 000.00	431 073.75	0.01
USD MDGH GMTN RSC LTD-REG-S 5.87500% 23-01.05.34	441 000.00	470 216.25	0.01
USD MEDCO BELL PTE LTD-REG-S 6.37500% 20-30.01.27	2 389 000.00	2 300 941.46	0.06
USD MEDCO OAK TREE PTE LTD-REG-S 7.37500% 19-14.05.26	2 367 000.00	2 355 165.00	0.06
USD MEGA ADVANCE INVESTMENTS LTD-REG-S 6.37500% 11-12.05.41	200 000.00	212 100.00	0.01
USD MEITUAN DIANPING-REG-S 2.12500% 20-28.10.25	2 570 000.00	2 420 862.90	0.06
USD MEITUAN DIANPING-REG-S 3.05000% 20-28.10.30	1 030 000.00	872 420.30	0.02
USD MELCO RESORTS FINANCE LTD-REG-S 5.62500% 19-17.07.27	2 500 000.00	2 356 667.04	0.06
USD MELCO RESORTS FINANCE LTD-REG-S 5.37500% 19-04.12.29	700 000.00	623 408.33	0.02
USD MELCO RESORTS FINANCE LTD-REG-S 5.75000% 20-21.07.28	3 655 000.00	3 412 072.09	0.09
USD MERSIN ULUSLARARASI LIMAN ISLT AS-REG-S 8.25000% 23-15.11.28	9 334 000.00	9 616 936.87	0.25
USD MEXICAN, UNITED STATES OF 4.60000% 15-23.01.46	200 000.00	162 300.00	0.00
USD MEXICHEM SAB DE CV-REG-S 5.87500% 14-17.09.44	3 360 000.00	2 956 800.00	0.08
USD MEXICHEM SAB DE CV-REG-S 4.00000% 17-04.10.27	260 000.00	245 050.00	0.01
USD MEXICHEM SAB DE CV-REG-S 5.50000% 17-15.01.48	850 000.00	709 750.00	0.02
USD MEXICO CITY AIRPORT TRUST-REG-S 4.25000% 16-31.10.26	3 770 000.00	3 617 164.20	0.09
USD MEXICO GEN DE ENERGIA S DE RL-REG-S 5.50000% 12-06.12.32	3 400 000.00	2 077 209.53	0.05
USD MEXICO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.65900% 20-24.05.31	4 259 000.00	3 577 559.99	0.09
USD MEXICO, UNITED STATES OF 6.05000% 08-11.01.40	154 000.00	153 461.00	0.00
USD MEXICO, UNITED STATES OF 5.75000% 10-12.10.110	6 346 000.00	5 590 191.40	0.14
USD MEXICO, UNITED STATES OF 4.35000% 16-15.01.47	1 470 000.00	1 156 155.00	0.03
USD MEXICO, UNITED STATES OF 4.60000% 17-10.02.48	210 000.00	168 735.00	0.00
USD MEXICO, UNITED STATES OF 3.77100% 20-24.05.61	1 807 000.00	1 181 778.00	0.03
USD MEXICO, UNITED STATES OF 4.40000% 22-12.02.52	4 324 000.00	3 327 318.00	0.08
USD MEXICO, UNITED STATES OF 4.87500% 22-19.05.33	4 588 000.00	4 383 834.00	0.11
USD MEXICO, UNITED STATES OF 5.40000% 23-09.02.28	3 640 000.00	3 707 340.00	0.09
USD MEXICO, UNITED STATES OF 6.35000% 23-09.02.35	12 132 000.00	12 618 493.20	0.32
USD MEXICO, UNITED STATES OF 6.33800% 23-04.05.53	6 412 000.00	6 373 528.00	0.16
USD MEXICO, UNITED STATES OF 6.00000% 24-07.05.36	2 003 000.00	2 029 039.00	0.05
USD MEXICO, UNITED STATES OF 6.40000% 24-07.05.54	6 860 000.00	6 877 836.00	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 - エマージング・マーケット・デッド

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD MFB MAGYAR FEJLESZTESI BANK-REG-S 6.50000% 23-29.06.28	8 845 000.00	9 055 068.75	0.23
USD MGM CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 5.87500% 19-15.05.26	200 000.00	195 689.38	0.00
USD MGM CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 5.25000% 20-18.06.25	300 000.00	293 321.48	0.01
USD MGM CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 4.75000% 21-01.02.27	2 120 000.00	1 989 746.45	0.05
USD MHP LUX SA-REG-S 6.95000% 18-03.04.26	4 126 000.00	3 342 060.00	0.09
USD MHP SA-REG-S 7.75000% 17-10.05.24	2 400 000.00	2 292 000.00	0.06
USD MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-REG-S 5.12500% 17-15.01.28	923 000.00	771 512.62	0.02
USD MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-REG-S 6.25000% 19-25.03.29	2 093 000.00	1 795 401.56	0.05
USD MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-REG-S 4.50000% 20-27.04.31	3 675 000.00	3 064 031.25	0.08
USD MINERVA LUXEMBOURG SA-REG-S 4.37500% 21-18.03.31	2 988 000.00	2 446 425.00	0.06
USD MINERVA LUXEMBOURG SA-REG-S 8.87500% 23-13.09.33	5 106 000.00	5 345 982.00	0.14
USD MINSUR SA-REG-S 4.50000% 21-28.10.31	1 750 000.00	1 515 390.63	0.04
USD MODERNLAND OVERSEAS PTE LTD-REG-S (PIK) 6.95000% 21-30.04.27	50 610.00	14 929.95	0.00
USD MONG DUONG FINANCE HOLDINGS BV-REG-S 5.12500% 19-07.05.29	2 820 000.00	2 428 550.97	0.06
USD MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 8.65000% 23-19.01.28	11 492 000.00	12 024 769.12	0.31
USD MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 7.87500% 23-05.06.29	1 612 000.00	1 654 492.32	0.04
USD MONGOLIAN MINING CORP/ENERGY RES-REG-S 12.50000% 23-13.09.26	724 000.00	759 635.28	0.02
USD MOROCCO GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 4.00000% 20-15.12.50	630 000.00	429 313.50	0.01
USD MOROCCO, KINGDOM OF-REG-S 2.37500% 20-15.12.27	2 199 000.00	1 968 105.00	0.05
USD MOROCCO, KINGDOM OF-REG-S 3.00000% 20-15.12.32	5 966 000.00	4 805 613.00	0.12
USD MOROCCO, KINGDOM OF-REG-S 5.95000% 23-08.03.28	4 482 000.00	4 571 640.00	0.12
USD MOROCCO, KINGDOM OF-REG-S 6.50000% 23-08.09.33	2 592 000.00	2 679 480.00	0.07
USD MTN MAURITIUS INVESTMENTS LTD-REG-S 6.50000% 16-13.10.26	9 035 000.00	9 114 056.25	0.23
USD NAMIBIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.25000% 15-29.10.25	1 800 000.00	1 772 437.50	0.05
USD NATIONAL BANK OF UZBEKISTAN-REG-S 4.85000% 20-21.10.25	1 620 000.00	1 526 850.00	0.04
USD NATIONAL CENTRAL COOLING CO-REG-S 2.50000% 20-21.10.27	7 090 000.00	6 378 784.38	0.16
USD NBM US HOLDINGS INC-REG-S 7.00000% 19-14.05.26	200 000.00	200 062.50	0.01
USD NEMAK SAB DE CV-REG-S 3.62500% 21-28.06.31	900 000.00	722 250.00	0.02
USD NEXA RESOURCES SA-REG-S 6.50000% 20-18.01.28	2 145 000.00	2 148 861.00	0.05
USD NG PET R&P LATIN AMERICA SA-REG-S 3.50000% 21-02.08.28	6 290 000.00	5 383 846.88	0.14
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 7.87500% 17-16.02.32	1 399 000.00	1 213 632.50	0.03
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 7.14300% 18-23.02.30	3 858 000.00	3 366 105.00	0.09
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 7.69600% 18-23.02.38	2 057 000.00	1 621 327.40	0.04
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 7.62500% 18-21.11.25	1 500 000.00	1 473 750.00	0.04
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 8.74700% 18-21.01.31	660 000.00	611 325.00	0.02
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 9.24800% 18-21.01.49	4 449 000.00	3 917 344.50	0.10
USD NOGAHOLDING SUKUK LTD-REG-S 6.62500% 23-25.05.33	940 000.00	972 312.50	0.02
USD NPC UKRENERGO-REG-S 6.87500% 21-09.11.28	3 196 000.00	890 086.00	0.02
USD OCP SA-REG-S 3.75000% 21-23.06.31	3 840 000.00	3 234 624.00	0.08
USD OCP SA-REG-S 5.12500% 21-23.06.51	10 881 000.00	7 817 998.49	0.20
USD OCP SA-REG-S 6.87500% 14-25.04.44	3 267 000.00	2 993 388.75	0.08
USD OIL AND GAS HOLDING CO BSCC/THE-REG-S 8.37500% 18-07.11.28	5 334 000.00	5 790 723.74	0.15
USD OLEODUCTO CENTRAL SA-REG-S 4.00000% 20-14.07.27	1 884 000.00	1 738 578.75	0.04
USD OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 7.00000% 21-25.01.51	6 890 000.00	7 096 011.00	0.18
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 4.75000% 16-15.06.26	3 930 000.00	3 871 050.00	0.10
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 5.37500% 17-08.03.27	15 087 000.00	15 105 858.75	0.38
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.50000% 17-08.03.47	4 315 000.00	4 249 735.63	0.11
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 5.62500% 18-17.01.28	4 650 000.00	4 704 056.25	0.12
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.75000% 18-17.01.48	21 934 000.00	22 098 505.00	0.56
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.25000% 21-25.01.31	9 003 000.00	9 309 552.15	0.24
USD ORAZUL ENERGY PERU SA-REG-S 5.62500% 17-28.04.27	2 262 000.00	2 133 348.75	0.05
USD ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV-REG-S 1.87500% 21-11.05.26	320 000.00	293 412.80	0.01
USD ORYX FUNDING LTD-REG-S 5.80000% 21-03.02.31	3 065 000.00	3 037 598.90	0.08
USD OTEL SUKUK LTD-REG-S 5.37500% 24-24.01.31	750 000.00	741 375.00	0.02
USD PAKISTAN WATER & POWER DEVEL AUTH-REG-S 7.50000% 21-04.06.31	1 340 000.00	751 565.80	0.02
USD PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 7.87500% 06-31.03.36	450 000.00	294 799.50	0.01
USD PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 8.25000% 14-15.04.24	1 262 000.00	1 232 166.32	0.03
USD PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 8.25000% 15-30.09.25	1 367 000.00	1 182 605.37	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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 6.87500% 17-05.12.27	2 143 000.00	1 537 838.23	0.04
USD PAMPA ENERGIA SA-REG-S 9.12500% 19-15.04.29	1 090 000.00	1 063 567.50	0.03
USD PANAMA, REPUBLIC OF 3.16000% 19-23.01.30	1 070 000.00	893 985.00	0.02
USD PANAMA, REPUBLIC OF 3.87000% 19-23.07.60	12 504 000.00	6 989 736.00	0.18
USD PANAMA, REPUBLIC OF 4.50000% 20-01.04.56	2 907 000.00	1 847 398.50	0.05
USD PANAMA, REPUBLIC OF 3.29800% 22-19.01.33	840 000.00	644 700.00	0.02
USD PANAMA, REPUBLIC OF 4.50000% 22-19.01.63	1 380 000.00	854 910.00	0.02
USD PANAMA, REPUBLIC OF 6.40000% 22-14.02.35	9 527 000.00	8 964 907.00	0.23
USD PANAMA, REPUBLIC OF 6.85300% 23-28.03.54	5 790 000.00	5 153 100.00	0.13
USD PANAMA, REPUBLIC OF 6.87500% 23-31.01.36	1 514 000.00	1 457 376.40	0.04
USD PAPUA NEW GUINEA GOVT INTL BOND-REG-S 8.37500% 18-04.10.28	1 064 000.00	991 967.20	0.03
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 6.10000% 14-11.08.44	2 494 000.00	2 374 288.00	0.06
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 5.60000% 18-13.03.48	3 730 000.00	3 321 565.00	0.08
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 5.40000% 19-30.03.50	8 449 000.00	7 274 589.00	0.19
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 4.95000% 20-28.04.31	8 970 000.00	8 629 140.00	0.22
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 2.73900% 21-29.01.33	11 069 000.00	8 921 614.00	0.23
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 3.84900% 22-28.06.33	1 370 000.00	1 187 790.00	0.03
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 5.85000% 23-21.08.33	745 000.00	742 765.00	0.02
USD PERIAMA HOLDINGS LLC/DE-REG-S 5.95000% 20-19.04.26	1 300 000.00	1 281 670.00	0.03
USD PERTAMINA GEOTHERMAL ENERGY PT-REG-S 5.15000% 23-27.04.28	560 000.00	558 600.00	0.01
USD PERTAMINA PERSERO PT-144A 2.30000% 21-09.02.31	1 730 000.00	1 440 415.30	0.04
USD PERTAMINA PT-REG-S 5.62500% 13-20.05.43	2 615 000.00	2 533 568.90	0.06
USD PERTAMINA PT-REG-S 6.50000% 11-27.05.41	1 391 000.00	1 485 045.51	0.04
USD PERTAMINA PT-REG-S 6.00000% 12-03.05.42	2 272 000.00	2 294 969.92	0.06
USD PERU LNG SRL-REG-S 5.37500% 18-22.03.30	2 360 000.00	1 930 480.00	0.05
USD PERU, REPUBLIC OF 3.23000% 20-28.07.21	11 278 000.00	6 625 825.00	0.17
USD PERU, REPUBLIC OF 3.30000% 21-11.03.41	303 000.00	228 916.50	0.01
USD PERU, REPUBLIC OF 3.00000% 21-15.01.34	7 494 000.00	6 241 752.60	0.16
USD PERU, REPUBLIC OF 3.60000% 21-15.01.72	360 000.00	242 640.00	0.01
USD PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 4.32500% 15-28.05.25	200 000.00	198 588.00	0.01
USD PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 4.55000% 16-29.03.26	5 140 000.00	5 107 926.40	0.13
USD PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 4.40000% 18-01.03.28	5 290 000.00	5 217 262.50	0.13
USD PERUSAHAAN SBSN INDONESIA III-REG-S 4.70000% 22-06.06.32	1 775 000.00	1 748 570.25	0.04
USD PERUVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.78000% 20-01.12.60	462 000.00	273 042.00	0.01
USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 6.87500% 09-20.01.40	300 000.00	301 410.00	0.01
USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 6.85000% 15-05.06.115	1 119 000.00	1 032 613.20	0.03
USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 5.50000% 21-10.06.51	1 342 000.00	1 103 795.00	0.03
USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 6.50000% 23-03.07.33	420 000.00	415 800.00	0.01
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 12.75000% 11-17.02.22	560 000.00	69 160.00	0.00
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 8.50000% 16-27.10.20	23 675 000.00	9 854 718.75	0.25
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 5.37500% 07-12.04.27	23 369 600.00	2 360 329.60	0.06
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 5.50000% 07-12.04.37	370 000.00	40 145.00	0.00
USD PETROLEOS DEL PERU SA-REG-S 4.75000% 17-19.06.32	2 598 000.00	1 877 522.64	0.05
USD PETROLEOS DEL PERU SA-REG-S 5.62500% 17-19.06.47	7 266 000.00	4 639 268.34	0.12
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.70000% 22-16.02.32	3 050 000.00	2 474 922.50	0.06
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.50000% 18-13.03.27	7 574 000.00	7 089 264.00	0.18
USD PETROLEOS MEXICANOS 5.35000% 18-12.02.28	4 180 000.00	3 651 940.60	0.09
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.35000% 18-12.02.48	6 434 000.00	3 982 646.00	0.10
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.49000% 20-23.01.27	107 000.00	100 628.15	0.00
USD PETROLEOS MEXICANOS 7.69000% 20-23.01.50	19 611 000.00	13 659 061.50	0.35
USD PETROLEOS MEXICANOS 5.95000% 20-28.01.31	10 499 000.00	8 210 218.00	0.21
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.95000% 20-28.01.60	4 762 000.00	3 040 537.00	0.08
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.87500% 22-16.10.25	7 805 000.00	7 706 891.15	0.20
USD PETRORIO LUXEMBOURG SARL-REG-S 6.12500% 21-09.06.26	1 000 000.00	976 250.00	0.02
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 9.50000% 05-02.02.30	460 000.00	570 400.00	0.01
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 2.95000% 20-05.05.45	284 000.00	200 606.24	0.01

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 3.20000% 21-06.07.46	250 000.00	180 652.50	0.00
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 3.55600% 22-29.09.32	1 700 000.00	1 540 812.00	0.04
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 5.60900% 22-13.04.33	3 950 000.00	4 133 122.00	0.11
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 5.95000% 22-13.10.47	7 170 000.00	7 699 576.20	0.20
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 5.00000% 23-17.07.33	217 000.00	219 465.12	0.01
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 5.50000% 23-17.01.48	1 226 000.00	1 249 122.36	0.03
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 4.62500% 23-17.07.28	7 500 000.00	7 471 875.00	0.19
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 4.20000% 22-29.03.47	289 000.00	244 598.04	0.01
USD PLDT INC-REG-S 3.45000% 20-23.06.50	200 000.00	143 330.00	0.00
USD POSCO-REG-S 5.62500% 23-17.01.26	840 000.00	844 611.60	0.02
USD POSCO-REG-S 5.75000% 23-17.01.28	560 000.00	569 704.80	0.01
USD POSCO-REG-S 5.87500% 23-17.01.33	210 000.00	216 669.60	0.01
USD PROMIGAS SA ESP/GASES DEL PACIFIC-REG-S 3.75000% 19-16.10.29	1 830 000.00	1 586 381.25	0.04
USD PROSUS NV-144A 3.68000% 20-21.01.30	200 000.00	172 536.00	0.00
USD PROSUS NV-REG S 3.83200% 20-08.02.51	1 000 000.00	611 320.00	0.02
USD PROSUS NV-REG-S 3.25700% 22-19.01.27	200 000.00	183 850.00	0.00
USD PROSUS NV-REG-S 3.68000% 20-21.01.30	11 660 000.00	10 058 848.80	0.26
USD PROSUS NV-REG-S 4.02700% 20-03.08.50	440 000.00	279 400.00	0.01
USD PROSUS NV-REG-S 4.19300% 22-19.01.32	2 060 000.00	1 763 257.00	0.04
USD PROSUS NV-REG-S 4.98700% 22-19.01.52	2 058 000.00	1 504 994.82	0.04
USD PRUMO PARTICIPACOES E INVESTIMENT-REG-S 7.50000% 19-31.12.31	5 380 000.00	4 128 455.45	0.11
USD PUMA INTL FINANCING-REG-S 5.00000% 18-24.01.26	500 000.00	474 765.00	0.01
USD QATAR PETROLEUM-REG-S 1.37500% 21-12.09.26	7 190 000.00	6 569 862.50	0.17
USD QATAR PETROLEUM-REG-S 3.30000% 21-12.07.51	6 807 000.00	4 750 435.13	0.12
USD QATAR PETROLEUM-REG-S 3.12500% 21-12.07.41	4 025 000.00	2 990 071.87	0.08
USD QATAR, STATE OF-REG-S 5.10300% 18-23.04.48	1 392 000.00	1 342 062.00	0.03
USD QATAR, STATE OF-REG-S 4.81700% 19-14.03.49	9 969 000.00	9 283 631.25	0.24
USD QATAR, STATE OF-REG-S 4.40000% 20-16.04.50	7 912 000.00	6 909 549.60	0.18
USD QTEL INTERNATIONAL FINANCE LTD-REG-S 5.00000% 10-19.10.25	300 000.00	298 125.00	0.01
USD REC LTD-REG-S 3.50000% 19-12.12.24	1 200 000.00	1 176 840.00	0.03
USD REDE D'OR FINANCE SARL-REG-S 4.50000% 20-22.01.30	4 223 000.00	3 733 132.00	0.10
USD REDSUN PROPERTIES GRP-REG-S *DEFAULTED* 9.70000% 20-16.04.23	480 000.00	2 400.00	0.00
USD RELIANCE INDUSTRIES LTD-REG-S 2.87500% 22-12.01.32	5 843 000.00	4 960 297.99	0.13
USD RELIANCE INDUSTRIES LTD-REG-S 3.75000% 22-12.01.62	250 000.00	174 187.50	0.00
USD RELIANCE INDUSTRIES LTD-REG-S 3.62500% 22-12.01.52	1 394 000.00	997 462.76	0.03
USD RENEW WIND ENER AP2 / RENEW POWER-REG-S 4.50000% 21-14.07.28	6 080 000.00	5 483 248.00	0.14
USD REPUBLIC OF AZERBAIJAN-REG-S 4.75000% 14-18.03.24	771 000.00	767 145.00	0.02
USD REPUBLIC OF UZBEKISTAN BOND-REG-S 3.90000% 21-19.10.31	200 000.00	162 000.00	0.00
USD ROMANIA-REG-S 3.00000% 20-14.02.31	6 162 000.00	5 222 295.00	0.13
USD ROMANIA-REG-S 3.00000% 22-27.02.27	4 454 000.00	4 154 468.50	0.11
USD ROMANIA-REG-S 3.62500% 22-27.03.32	634 000.00	546 825.00	0.01
USD ROMANIA-REG-S 4.00000% 20-14.02.51	8 646 000.00	6 214 312.50	0.16
USD ROMANIA-REG-S 5.87500% 24-30.01.29	3 138 000.00	3 166 555.80	0.08
USD ROMANIA-REG-S 6.37500% 24-30.01.34	4 056 000.00	4 137 525.60	0.11
USD ROMANIA-REG-S 6.62500% 23-17.02.28	6 660 000.00	6 901 425.00	0.18
USD ROMANIA-REG-S 7.12500% 23-17.01.33	1 596 000.00	1 719 849.60	0.04
USD ROMANIA-REG-S 7.62500% 23-17.01.53	5 066 000.00	5 648 590.00	0.14
USD ROMANIAN GOVT INT BND-REG-S 5.25000% 22-25.11.27	1 010 000.00	998 021.40	0.03
USD RUMO LUXEMBOURG SARL-REG-S 5.25000% 20-10.01.28	1 775 000.00	1 695 679.69	0.04
USD RUMO LUXEMBOURG SARL-REG-S 4.20000% 21-18.01.32	400 000.00	334 600.00	0.01
USD RUSSIA, FEDERATION OF-REG-S 5.62500% 12-04.04.42	9 200 000.00	6 052 128.00	0.15
USD SA GLOBAL SUKUK LTD-REG-S 2.69400% 21-17.06.31	495 000.00	426 937.50	0.01
USD SAGICOR FINANCIAL CO LTD-REG-S 5.30000% 21-13.05.28	2 457 000.00	2 334 150.00	0.06
USD SANDS CHINA LTD STEP-UP 19-08.08.28	15 886 000.00	15 606 194.58	0.40
USD SANDS CHINA LTD STEP-UP 21-08.01.26	930 000.00	895 723.45	0.02
USD SANDS CHINA LTD STEP-UP 21-18.06.30	500 000.00	456 273.81	0.01
USD SANDS CHINA LTD STEP-UP 22-08.03.27	3 050 000.00	2 759 911.45	0.07
USD SASOL FINANCING USA LLC 5.87500% 18-27.03.24	8 682 000.00	8 647 532.46	0.22
USD SASOL FINANCING USA LLC 6.50000% 18-27.09.28	1 400 000.00	1 321 530.00	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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD SASOL FINANCING USA LLC 4.37500% 21-18.09.26	281 000.00	261 769.06	0.01
USD SASOL FINANCING USA LLC-REG-S 8.75000% 23-03.05.29	1 271 000.00	1 292 050.94	0.03
USD SAUDI ARABIAN OIL CO-REG-S 1.62500% 20-24.11.25	12 320 000.00	11 550 000.00	0.29
USD SAUDI ARABIAN OIL CO-REG-S 2.25000% 20-24.11.30	7 557 000.00	6 338 433.75	0.16
USD SAUDI ARABIAN OIL CO-REG-S 3.25000% 20-24.11.50	380 000.00	252 700.00	0.01
USD SAUDI ARABIAN OIL CO-REG-S 3.50000% 20-24.11.70	3 823 000.00	2 427 605.00	0.06
USD SAUDI ELECTRIC SUKUK PROGRAM CO-REG-S 5.68400% 23-11.04.53	1 359 000.00	1 318 230.00	0.03
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 5.50000% 22-25.10.32	2 460 000.00	2 555 632.50	0.07
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 4.75000% 24-16.01.30	7 800 000.00	7 758 465.00	0.20
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 5.00000% 24-16.01.34	4 338 000.00	4 316 310.00	0.11
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 5.75000% 24-16.01.54	7 660 000.00	7 500 863.50	0.19
USD SENEGAL, REPUBLIC OF-REG-S 6.75000% 18-13.03.48	1 171 000.00	872 395.00	0.02
USD SERBIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 2.12500% 20-01.12.30	2 210 000.00	1 762 475.00	0.04
USD SERBIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.25000% 23-26.05.28	1 695 000.00	1 731 230.62	0.04
USD SERBIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.50000% 23-26.09.33	7 897 000.00	8 066 588.08	0.21
USD SF HOLDING INVESTMENT-REG-S 2.37500% 21-17.11.26	830 000.00	770 289.80	0.02
USD SF HOLDING INVESTMENT-REG-S 3.12500% 21-17.11.31	1 750 000.00	1 519 455.00	0.04
USD SHAMARAN PETROLEUM-144A-REG-S 12.00000% 21-30.07.25	1 396 749.00	1 257 074.10	0.03
USD SHELF DRILLING HOLDINGS LTD-REG-S 9.62500% 23-15.04.29	530 000.00	512 298.00	0.01
USD SHIMAO PRPTY HLDG LTD-REG-S *DEFAULTED* 4.60000% 20-13.07.30	290 000.00	13 464.70	0.00
USD SHIMAO PRPTY HLDG LTD-REG-S *DEFAULTED* 3.45000% 21-11.01.31	1 660 000.00	77 073.80	0.00
USD SHIMAO PRPTY HLDG LTD-REG-S *DEFAULTED* 5.20000% 21-16.01.27	210 000.00	9 712.50	0.00
USD SHIMAO PRPTY HLDG LTD-REG-S *DEFAULTED* 5.60000% 19-15.07.26	360 000.00	16 650.00	0.00
USD SHINHAN CARD CO LTD-REG-S 1.37500% 20-19.10.25	650 000.00	608 458.50	0.02
USD SHINHAN CARD CO LTD-REG-S 2.50000% 22-27.01.27	1 680 000.00	1 552 101.60	0.04
USD SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD-REG-S 5.00000% 23-24.07.28	1 100 000.00	1 098 746.00	0.03
USD SIGMA ALIMENTOS-REG-S 4.12500% 16-02.05.26	1 886 000.00	1 823 526.25	0.05
USD SILKNET JSC-REG-S 8.37500% 22-31.01.27	2 160 000.00	2 157 300.00	0.05
USD SINOPEC GROUP OVERSEAS DEV12 LTD-REG-S 4.87500% 12-17.05.42	204 000.00	197 803.50	0.01
USD SINOPEC GRP OVERSEAS DEV LTD-REG-S 2.15000% 20-13.05.25	540 000.00	520 827.30	0.01
USD SINOPEC GRP OVERSEAS DEV LTD-REG-S 2.70000% 20-13.05.30	2 673 000.00	2 419 252.11	0.06
USD SITIOS LATINOAMERICA SAB DE CV-REG-S 5.37500% 22-04.04.32	4 700 000.00	4 350 743.00	0.11
USD SK BATTERY AMERICA INC-REG-S 2.12500% 21-26.01.26	467 000.00	432 904.33	0.01
USD SK HYNIX INC-REG-S 2.37500% 21-19.01.31	2 880 000.00	2 366 207.99	0.06
USD SK HYNIX INC-REG-S 5.50000% 24-16.01.29	200 000.00	201 212.00	0.01
USD SK HYNIX INC-REG-S 6.25000% 23-17.01.26	200 000.00	202 172.00	0.01
USD SK HYNIX INC-REG-S 6.37500% 23-17.01.28	3 019 000.00	3 123 819.68	0.08
USD SK HYNIX INC-REG-S 6.50000% 23-17.01.33	2 020 000.00	2 134 655.20	0.05
USD SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHIL-REG-S 4.37500% 14-28.01.25	940 000.00	923 550.00	0.02
USD SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA-REG-S 6.50000% 23-07.11.33	200 000.00	206 000.00	0.01
USD SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.37500% 14-24.07.44	2 140 000.00	1 592 962.50	0.04
USD SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.65000% 17-27.09.47	3 217 000.00	2 398 836.47	0.06
USD SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 4.85000% 19-30.09.29	3 780 000.00	3 435 831.00	0.09
USD SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.75000% 19-30.09.49	12 923 000.00	9 576 589.15	0.24
USD SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.87500% 22-20.04.32	3 888 000.00	3 566 851.20	0.09
USD SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 7.30000% 22-20.04.52	13 286 000.00	11 731 538.00	0.30
USD SOUTHERN COPPER CORP 3.87500% 15-23.04.25	150 000.00	146 622.00	0.00
USD SOUTHERN COPPER CORP 5.87500% 15-23.04.45	110 000.00	109 862.50	0.00
USD SRI LANKA, DEMO REP OF-REG-S *DEFAULT* 5.87500% 12-25.07.22	585 000.00	305 270.55	0.01
USD SRI LANKA, DEMO REP OF-REG-S *DEFAULT* 6.12500% 15-03.06.25	460 000.00	243 110.00	0.01
USD SRI LANKA, DEMO REP OF-REG-S *DEFAULT* 6.82500% 16-18.07.26	10 883 000.00	5 673 960.88	0.14
USD SRI LANKA, DEMO REP OF-REG-S *DEFAULT* 6.20000% 17-11.05.27	6 520 000.00	3 309 617.20	0.08
USD SRI LANKA, DEMO REP OF-REG-S *DEFAULT* 5.75000% 18-18.04.23	1 260 000.00	658 488.60	0.02
USD SRI LANKA, DEMO REP OF-REG-S *DEFAULT* 6.75000% 18-18.04.28	17 476 000.00	8 960 819.00	0.23
USD SRI LANKA, DEMO REP OF-REG-S *DEFAULT* 6.85000% 19-14.03.24	2 854 000.00	1 463 702.44	0.04
USD SRI LANKA, DEMO REP OF-REG-S *DEFAULT* 7.85000% 19-14.03.29	11 430 000.00	5 747 689.80	0.15
USD SRI LANKA, DEMO REP OF-REG-S *DEFAULT* 6.35000% 19-28.06.24	2 140 000.00	1 096 750.00	0.03

USD	SRI LANKA, DEMO REP OF-REG-S * DEFAULT *	7.55000%	19-28.03.30	302 000.00	151 788.22	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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD SRI REJEKI ISMAN TBK PT-REG-S *DEFAULTED* 7.25000% 19-16.01.25	200 000.00	6 000.00	0.00
USD STANDARD CHARTERED PLC-REG-S 6.29600% 23-06.07.34	4 652 000.00	4 871 698.98	0.12
USD STAR ENERGY GEOTHERMAL WAYANG-REG-S 6.75000% 18-24.04.33	4 160 000.00	3 371 241.54	0.09
USD STATE AGENCY OF ROADS OF UKRAINE-REG-S 6.25000% 21-24.06.30	639 000.00	158 472.00	0.00
USD STILLWATER MINING CO-REG-S 4.00000% 21-16.11.26	2 570 000.00	2 269 631.25	0.06
USD STILLWATER MINING CO-REG-S 4.50000% 21-16.11.29	4 730 000.00	3 710 093.75	0.09
USD STUDIO CITY CO LTD-REG-S 7.00000% 22-15.02.27	2 250 000.00	2 224 440.00	0.06
USD STUDIO CITY FINANCE LTD-REG-S 6.00000% 20-15.07.25	2 112 000.00	2 073 186.83	0.05
USD STUDIO CITY FINANCE LTD-REG-S 6.50000% 20-15.01.28	5 996 000.00	5 582 865.58	0.14
USD STUDIO CITY FINANCE LTD-REG-S 5.00000% 21-15.01.29	5 135 000.00	4 389 033.89	0.11
USD SUCI SECOND INVESTMENT CO-REG-S 6.00000% 23-25.10.28	276 000.00	286 350.00	0.01
USD SUNAC CHINA HOLDINGS-REG-S *DEFAULTED* 8.35000% 18-19.04.23	200 000.00	27 000.00	0.00
USD SUNAC CHINA HOLDINGS-REG-S *DEFAULTED* 6.50000% 20-09.07.23	1 270 000.00	191 554.10	0.00
USD SUNAC CHINA HOLDINGS-REG-S *DEFAULTED* 7.00000% 20-09.07.25	610 000.00	88 053.50	0.00
USD SUNAC CHINA HOLDINGS-REG-S *DEFAULTED* 6.65000% 20-03.08.24	200 000.00	30 068.00	0.00
USD SUZANO AUSTRIA GMBH 6.00000% 19-15.01.29	523 000.00	525 986.33	0.01
USD SUZANO AUSTRIA GMBH 3.75000% 20-15.01.31	1 530 000.00	1 328 709.37	0.03
USD SUZANO AUSTRIA GMBH 3.12500% 19-15.01.32	2 698 000.00	2 205 615.00	0.06
USD SUZANO AUSTRIA GMBH-REG-S 7.00000% 17-16.03.47	1 075 000.00	1 119 612.50	0.03
USD TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS-REG-S 8.50000% 23-07.12.28	1 162 000.00	1 184 876.87	0.03
USD TC ZIRAAT BANKASI AS-REG-S 8.00000% 24-16.01.29	786 000.00	789 517.35	0.02
USD TELECOM ARGENTINA SA-REG-S 8.00000% 19-18.07.26	644 000.00	607 936.00	0.02
USD TELEFONICA CELULAR DEL PARAGUAY-REG-S 5.87500% 19-15.04.27	5 975 000.00	5 764 007.81	0.15
USD TERMOCANDELARIA POWER LTD-REG-S 7.87500% 19-30.01.29	6 782 000.00	5 150 929.00	0.13
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 3.15000% 16-01.10.26	6 731 000.00	6 259 830.00	0.16
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 4.10000% 16-01.10.46	4 844 000.00	3 215 205.00	0.08
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 6.75000% 18-01.03.28	1 450 000.00	1 480 812.50	0.04
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 6.00000% 18-15.04.24	649 000.00	646 624.66	0.02
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 4.75000% 21-09.05.27	700 000.00	672 021.00	0.02
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NETHERLANDS 8.12500% 23-15.09.31	700 000.00	766 500.00	0.02
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NETHERLANDS 7.87500% 23-15.09.29	2 670 000.00	2 870 250.00	0.07
USD TML HOLDINGS PTE LTD-REG-S 5.50000% 20-03.06.24	230 000.00	228 631.50	0.01
USD TOWER BERSAMA INFRA TBK PT-REG-S 2.75000% 21-20.01.26	400 000.00	376 000.00	0.01
USD TRANSNET SOC LTD-REG-S 8.25000% 23-06.02.28	6 240 000.00	6 271 824.00	0.16
USD TRANSPORTADORA DE GAS DEL PERU SA-REG-S 4.25000% 13-30.04.28	370 000.00	359 362.50	0.01
USD TRINIDAD & TOBAGO, REPUBLIC OF-REG-S 4.50000% 20-26.06.30	1 730 000.00	1 643 500.00	0.04
USD TRINIDAD & TOBAGO, REPUBLIC OF-REG-S 5.95000% 23-14.01.31	2 670 000.00	2 706 045.00	0.07
USD TRINIDAD GENERATION UNLTD-REG-S 5.25000% 16-04.11.27	2 000 000.00	1 958 540.00	0.05
USD TRUST F/1401-REG-S 4.86900% 19-15.01.30	245 000.00	222 950.00	0.01
USD TRUST F/1401-REG-S 5.25000% 15-30.01.26	890 000.00	870 535.70	0.02
USD TRUST F/1401-REG-S 6.39000% 19-15.01.50	3 250 000.00	2 686 515.00	0.07
USD TRUST F/1401-REG-S 6.95000% 14-30.01.44	500 000.00	438 440.00	0.01
USD TSMC ARIZONA CORP 2.50000% 21-25.10.31	802 000.00	679 695.00	0.02
USD TSMC ARIZONA CORP 3.12500% 21-25.10.41	200 000.00	157 938.00	0.00
USD TSMC ARIZONA CORP 4.25000% 22-22.04.32	1 500 000.00	1 449 120.00	0.04
USD TSMC GLOBAL LTD-REG-S 1.25000% 21-23.04.26	524 000.00	484 605.68	0.01
USD TSMC GLOBAL LTD-REG-S 2.25000% 21-23.04.31	220 000.00	184 969.40	0.00
USD TULLOW OIL PLC-REG-S 10.25000% 21-15.05.26	563 000.00	514 617.19	0.01
USD TUPRAS TURKIYE PETROL-REG-S 4.50000% 17-18.10.24	2 324 000.00	2 290 302.00	0.06
USD TUPY OVERSEAS SA-REG-S 4.50000% 21-16.02.31	520 000.00	438 100.00	0.01
USD TURK SISE VE CAM FABRIKA-REG-S 6.95000% 19-14.03.26	900 000.00	897 750.00	0.02
USD TURK TELEKOMUNIKASYON AS-REG-S 4.87500% 14-19.06.24	400 000.00	395 428.00	0.01
USD TURK TELEKOMUNIKASYON AS-REG-S 6.87500% 19-28.02.25	526 000.00	521 726.25	0.01
USD TURKCELL ILETISIM HIZMETLERI AS-REG-S 5.75000% 15-15.10.25	730 000.00	717 681.25	0.02
USD TURKCELL ILETISIM HIZMETLERI AS-REG-S 5.80000% 18-11.04.28	900 000.00	854 156.25	0.02
USD TURKEY, REPUBLIC OF 6.00000% 11-14.01.41	240 000.00	190 620.00	0.00
USD TURKEY, REPUBLIC OF 4.87500% 13-16.04.43	8 285 000.00	5 592 375.00	0.14
USD TURKEY, REPUBLIC OF 5.75000% 17-11.05.47	3 880 000.00	2 834 146.00	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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD TURKEY, REPUBLIC OF 7.62500% 19-26.04.29	2 140 000.00	2 149 095.00	0.05
USD TURKEY, REPUBLIC OF 5.25000% 20-13.03.30	5 270 000.00	4 661 315.00	0.12
USD TURKEY, REPUBLIC OF 5.95000% 20-15.01.31	5 510 000.00	5 003 080.00	0.13
USD TURKEY, REPUBLIC OF 6.50000% 21-20.09.33	1 790 000.00	1 632 480.00	0.04
USD TURKEY, REPUBLIC OF 9.87500% 22-15.01.28	8 743 000.00	9 503 641.00	0.24
USD TURKEY, REPUBLIC OF 9.37500% 23-14.03.29	4 016 000.00	4 317 200.00	0.11
USD TURKEY, REPUBLIC OF 9.12500% 23-13.07.30	6 473 000.00	6 893 745.00	0.18
USD TURKEY, REPUBLIC OF-REG-S 8.50910% 23-14.01.29	5 959 000.00	6 175 013.75	0.16
USD TURKEY, REPUBLIC OF 9.37500% 23-19.01.33	4 398 000.00	4 771 830.00	0.12
USD TURKIYE IHRACAT KREDI BANKASI AS-REG-S 9.37500% 23-31.01.26	2 503 000.00	2 606 874.50	0.07
USD TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO-REG-S 5.50000% 21-01.10.26	1 000 000.00	962 500.00	0.02
USD TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO-REG-S 9.00000% 23-12.10.28	1 016 000.00	1 060 622.72	0.03
USD UKRAINE RAILWAYS VIA RL CPTL MKTS-REG-S 8.25000% 19-09.07.24	400 000.00	230 000.00	0.01
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S STEP-UP/DOWN 15-01.09.25	4 600 000.00	1 258 100.00	0.03
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S STEP UP/DOWN 15-01.09.26	1 170 000.00	303 907.50	0.01
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S STEP UP/DOWN 15-01.09.27	5 056 000.00	1 274 112.00	0.03
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.75000% 15-01.09.28	600 000.00	150 000.00	0.00
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.75000% 15-01.09.29	6 851 000.00	1 724 396.70	0.04
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S STEP UP/DOWN 17-25.09.34	8 584 000.00	1 939 984.00	0.05
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S STEP UP/DOWN 18-01.02.26	4 006 000.00	1 155 731.00	0.03
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 9.75000% 18-01.11.30	8 054 000.00	2 126 256.00	0.05
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 6.87600% 21-21.05.31	4 856 000.00	1 056 180.00	0.03
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.25300% 20-15.03.35	7 801 000.00	1 764 976.25	0.04
USD URUGUAY, REPUBLIC OF 4.12500% 12-20.11.45	284 910.00	250 720.80	0.01
USD URUGUAY, REPUBLIC OF 5.75000% 22-28.10.34	3 415 840.00	3 660 072.57	0.09
USD UZBEK INDUSTRIAL AND CONS ATB-REG-S 5.75000% 19-02.12.24	1 400 000.00	1 368 500.00	0.03
USD UZBEKNEFTEGAZ JSC-REG-S 4.75000% 21-16.11.28	5 328 000.00	4 456 872.00	0.11
USD VALE OVERSEAS LTD 3.75000% 20-08.07.30	666 000.00	601 897.50	0.02
USD VALE OVERSEAS LTD 6.87500% 06-21.11.36	1 710 000.00	1 842 525.00	0.05
USD VALE OVERSEAS LTD 6.12500% 23-12.06.33	2 465 000.00	2 513 683.75	0.06
USD VENEZUELA, REP. OF REG-S *DEFAULTED* 8.25000% 09-13.10.24	16 066 700.00	2 249 338.00	0.06
USD VENEZUELA, REP. OF-REG-S *DEFAULTED* 7.75000% 09-13.10.19	4 264 700.00	511 764.00	0.01
USD VEON HOLDINGS BV-REG-S 4.00000% 19-09.04.25	2 505 000.00	2 285 812.50	0.06
USD VIVO ENERGY INVEST BV-REG-S 5.12500% 20-24.09.27	1 430 000.00	1 347 775.00	0.03
USD VM HOLDING SA-REG-S 5.37500% 17-04.05.27	1 475 000.00	1 431 487.50	0.04
USD VTR COMUNICACION SPA-REG-S 5.12500% 20-15.01.28	535 000.00	310 300.00	0.01
USD VTR FINANCE NV-REG-S 6.37500% 20-15.07.28	1 860 000.00	712 612.50	0.02
USD WEIBO CORP 3.37500% 20-08.07.30	1 160 000.00	1 003 539.20	0.03
USD WOORI BANK-REG-S 2.00000% 22-20.01.27	5 895 000.00	5 444 032.50	0.14
USD WYNN MACAU LTD-REG-S 4.87500% 17-01.10.24	1 786 000.00	1 767 093.52	0.04
USD WYNN MACAU LTD-REG-S 5.50000% 17-01.10.27	890 000.00	837 896.37	0.02
USD WYNN MACAU LTD-REG-S 5.12500% 19-15.12.29	516 000.00	460 426.80	0.01
USD WYNN MACAU LTD-REG-S 5.50000% 20-15.01.26	2 410 000.00	2 341 193.08	0.06
USD WYNN MACAU LTD-REG-S 5.62500% 20-26.08.28	8 730 000.00	8 124 472.65	0.21
USD XP INC-REG-S 3.25000% 21-01.07.26	600 000.00	557 062.50	0.01
USD YPF SA-REG-S 6.95000% 17-21.07.27	1 827 000.00	1 612 875.60	0.04
USD YPF SA-REG-S 7.00000% 17-15.12.47	1 300 000.00	952 159.00	0.02
USD YPF SA-REG-S 8.50000% 15-28.07.25	400 000.00	386 000.00	0.01
USD YPF SA-REG-S 8.50000% 19-27.06.29	570 000.00	511 753.13	0.01
USD YPF SA-REG-S 9.50000% 24-17.01.31	3 400 000.00	3 397 620.00	0.09
USD YPF SA-REG-S STEP-UP 21-30.09.33	1 127 142.00	943 981.43	0.02
USD YUZHOU PROPERTIES-REG-S *DEFAULTED* 6.00000% 16-25.10.23	1 285 000.00	89 950.00	0.00
USD YUZHOU PROPERTIES-REG-S *DEFAULTED* 8.37500% 19-30.10.24	3 544 000.00	248 080.00	0.01
USD YUZHOU PROPERTIES-REG-S *DEFAULTED* 7.37500% 20-13.01.26	5 450 000.00	381 500.00	0.01
USD YUZHOU PROPERTIES-REG-S *DEFAULTED* 7.70000% 20-20.02.25	1 050 000.00	76 093.50	0.00
USD ZAMBIA, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 8.50000% 14-14.04.24	2 015 000.00	1 269 450.00	0.03
USD ZAMBIA, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 8.97000% 15-30.07.27	10 565 000.00	6 589 918.75	0.17
USD ZHENRO PROP GROUP *DEFAULTED* 8.00000% 22-06.03.23	961 000.00	7 207.50	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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD ZHENRO PROP GROUP -REG-S *DEFAULTED* 7.10000% 21-10.09.24	1 797 000.00	13 477.50	0.00
USD ZHENRO PROP GROUP-REG-S *DEFAULTED* 7.87500% 20-14.04.24	4 558 000.00	34 185.00	0.00
USD ZHENRO PROP GROUP-REG-S *DEFAULTED* 8.35000% 20-10.03.24	1 007 000.00	7 552.50	0.00
USD ZHENRO PROP GROUP-REG-S *DEFAULTED* 8.30000% 20-15.09.23	2 424 000.00	18 180.00	0.00
USD ZHENRO PROP GROUP-REG-S *DEFAULTED* 7.35000% 20-05.02.25	8 015 000.00	60 112.50	0.00
USD ZHENRO PROP GRP LTD-REG-S *DEFAULTED* 8.70000% 19-03.08.22	226 000.00	1 695.00	0.00
USD ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE-REG-S 3.50000% 20-08.03.26	1 470 000.00	1 351 503.30	0.03
USD ZORLU YENILENEBILIR ENERJI AS-REG-S 9.00000% 21-01.06.26	3 135 000.00	3 054 665.63	0.08
米ドル合計		2 279 747 036.77	58.09
ノート、固定利付債合計		2 403 216 409.23	61.23
ノート、ゼロ・クーポン			
USD			
USD BIOCEANICO SOVEREIGN CERTIFICATE-REG-S 0.00000% 19-05.06.34	9 700 000.00	6 042 536.20	0.15
USD CHILE ELECTRICITY PEC SPA-REG-S 0.00000% 21-25.01.28	2 850 000.00	2 285 700.00	0.06
USD ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 20-31.07.30	4 338 654.00	1 433 925.15	0.04
USD RUTAS 2 AND 7 FINANCE LTD-REG-S 0.00000% 19-30.09.36	4 720 000.00	2 752 363.92	0.07
米ドル合計		12 514 525.27	0.32
ノート、ゼロ・クーポン合計		12 514 525.27	0.32
ノート、変動利付債			
USD			
USD ABSA GROUP LTD-REG-S-SUB 6.375%/VAR 21-PRP	3 302 000.00	3 136 900.00	0.08
USD ABU DHABI COMM BK-REG-S-SUB 8.000%/VAR 23-PRP	462 000.00	490 441.88	0.01
USD AES GENER SA-REG-S-SUB 7.125%/VAR 19-26.03.79	2 433 000.00	2 335 680.00	0.06
USD ALFA BD ISS OJSC ALFA BK-REG-S-SUB VAR 19-15.04.30	4 650 000.00	232 500.00	0.01
USD BANCO DE CREDITO DEL PERU-REG-S-SUB 3.125%/VAR 20-01.07.30	3 059 000.00	2 901 767.40	0.07
USD BANCO DE CREDITO DEL PERU-REG-S-SUB 3.250%/VAR 21-30.09.31	115 000.00	104 420.00	0.00
USD BANCO DO BRASIL CAYMAN-REG-S-SUB 6.250%/VAR 13-PRP	6 887 000.00	6 818 130.00	0.17
USD BANCO INTL PERU-REG-S-SUB 7.625%/VAR 24-16.01.34	200 000.00	207 750.00	0.01
USD BANCO MER DEL NORTE SA/GRAND CY-REG-S-SUB 7.625%/VAR 17-PRP	3 370 000.00	3 226 775.00	0.08
USD BANCO MER DEL NORTE SA/GRAN-REG-S-SUB COCO 7.500%/VAR 19-PRP	3 426 000.00	3 231 142.45	0.08
USD BANCO MERCANTIL DEL NOR-REG-S-SUB COCO 6.750%/VAR 19-PRP	4 540 000.00	4 502 579.95	0.11
USD BANCO MERCANTL DEL NORTE SA-REG-S-SUB COCO 8.375%/VAR 20-PRP	1 523 000.00	1 496 347.50	0.04
USD BANCO NACIONAL DE COM-REG-S-SUB 2.720%/VAR 21-11.08.31	1 980 000.00	1 677 951.00	0.04
USD BANCO SANTANDER SA-REG-S-SUB 5.950%/VAR 18-01.10.28	1 860 000.00	1 927 425.00	0.05
USD BANCOLOMBIA SA-SUB 4.875%/VAR 17-18.10.27	200 000.00	195 951.00	0.01
USD BANGKOK BANK -REG-S-SUB 3.466%/VAR 21-23.09.36	2 330 000.00	1 938 932.80	0.05
USD BANK HAPOLIM BM-144A-REG-S-SUB COCO 3.255%/VAR 21-21.01.32	1 200 000.00	1 052 250.00	0.03
USD BANK LEUMI ISR BM-144A-REG-S-SUB COCO 3.275%/VAR 20-29.01.31	11 415 000.00	10 319 873.43	0.26
USD BBVA BANCOMER SA/TEXAS-REG-S-SUB 5.125%/VAR 18-18.01.33	8 759 000.00	7 984 266.45	0.20
USD BBVA BANCOMER SA/TEXAS-REG-S-SUB 8.125%/VAR 24-08.01.39	4 559 000.00	4 618 267.00	0.12
USD BLOSSOM JOY LTD-REG-S-SUB 3.100%/VAR 20-PRP	368 000.00	354 332.48	0.01
USD BRASKEM NETHERLANDS FINANCE-REG-S-SUB 8.500%/VAR 20-23.01.81	200 000.00	193 000.00	0.01
USD BURGAN BANK SAK-REG-S-SUB 2.750%/VAR 20-15.12.31	912 000.00	762 090.00	0.02
USD CEMEX SAB DE CV-REG-S-SUB 5.125%/VAR 21-PRP	5 160 000.00	4 896 840.00	0.13
USD CHINA DEV BANK FIN LEASING-REG-S-SUB 2.875%/VAR 20-28.09.30	700 000.00	664 139.00	0.02
USD CHINA HUADIAN OVERSEAS DEVP MANG-REG-S 4.000%/VAR 19-PRP	222 000.00	220 674.66	0.01
USD CLI OVERSEAS CO LTD/HK-REG-S-SUB 5.350%/VAR 23-15.08.33	331 000.00	334 862.77	0.01
USD COMMERCIAL BK PS-REG-S-SUB 4.500%/VAR 21-PRP	1 644 000.00	1 505 801.25	0.04
USD CORP FINANCIERA DE DESARROL-REG-S-SUB 5.250%/VAR 14-15.07.29	480 000.00	473 606.40	0.01
USD CREDIT BK MOSCOW/CBOM FIN-REG-S-SUB 7.500%/VAR 17-05.10.27	7 380 000.00	1 645 297.20	0.04
USD DP WORLD SALAAM-REG-S-SUB 6.000%/VAR 20-PRP	3 511 000.00	3 481 156.50	0.09
USD EMIRATES NBD BANK PJSC-REG-S-SUB 4.250%/VAR 21-PRP	1 200 000.00	1 089 375.00	0.03
USD FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S-SUB 6.320%/VAR 23-04.04.34	4 020 000.00	4 124 268.75	0.11
USD HANWHA LIFE INSURANCE CO LT-REG-S-SUB 3.379%/VAR 22-04.02.32	6 594 000.00	6 064 765.56	0.15

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD KRUNG THAI/CAYMAN ISLANDS-REG-S-SUB COCO 4.400%/VAR 21-PRP	2 356 000.00	2 236 786.40	0.06
USD KYOBO LF INSURANCE CO LTD REG-S-SUB 5.900%/VAR 22-15.06.52	3 883 000.00	3 815 047.50	0.10
USD MAF GLOBAL SECURITIES LTD-REG-S-SUB 7.875%/VAR 22-PRP	500 000.00	514 531.25	0.01
USD MASHREQBANK PSC-REG-S-SUB 7.875%/VAR 22-24.02.33	300 000.00	312 656.25	0.01
USD MINMETALS BOUNTEOUS FIN BVI LTD-REG-S 3.375%/VAR 20-PRP	1 769 000.00	1 740 819.83	0.04
USD MODERN LAND CHINA CO LTD-REG-S (PIK) 8.000%/VAR 22-30.12.24	201 279.00	281.79	0.00
USD MODERN LAND CHINA CO LTD-REG-S (PIK) 9.000%/VAR 22-30.12.25	234 462.00	328.25	0.00
USD MODERN LAND CHINA CO LTD (PIK) 9.000%/VAR 22-30.12.26	312 618.00	437.66	0.00
USD MUANG THAI LIFE ASSURANCE-REG-S-SUB 3.552%/VAR 21-27.01.37	1 020 000.00	945 193.20	0.02
USD NANYANG COMMERCIAL BANK LTD-REG-S-SUB 3.800%/VAR 19-20.11.29	300 000.00	294 002.98	0.01
USD NBK SPC LTD-REG-S 1.625%/VAR 21-15.09.27	600 000.00	544 312.50	0.01
USD NBK TIER 2 LTD-REG-S-SUB 2.500%/VAR 20-24.11.30	500 000.00	467 343.75	0.01
USD OVERSEA-CHINESE BKNG-REG-S-SUB 1.832%/VAR 20-10.09.30	511 000.00	482 923.35	0.01
USD PRUDENTIAL FUNDING PLC-REG-S-SUB 2.950%/VAR 21-03.11.33	3 229 000.00	2 850 625.78	0.07
USD STANDARD CHARTERED PLC-REG-S 7.776%/VAR 22-16.11.25	415 000.00	422 160.37	0.01
USD STANDARD CHARTERED PLC-REG-S 6.170%/VAR 23-09.01.27	1 700 000.00	1 727 772.12	0.04
USD STANDARD CHARTERED PLC-REG-S 6.187%/VAR 23-06.07.27	360 000.00	366 192.37	0.01
USD STANDARD CHARTERED PLC-REG-S 6.750%/VAR 23-08.02.28	500 000.00	516 467.30	0.01
USD STANDARD CHARTERED PLC-REG-S 7.018%/VAR 23-08.02.30	3 844 000.00	4 065 446.69	0.10
USD TURK EKONOMI BANKASI AS-REG-S-SUB 9.375%/VAR 24-17.01.34	694 000.00	709 510.90	0.02
USD YAPI VE KREDI BANKASI AS-REG-S-SUB 9.250%/VAR 24-17.01.34	2 494 000.00	2 544 129.40	0.07
米ドル合計		108 766 530.07	2.77
ノート、変動利付債合計		108 766 530.07	2.77

中期債券、固定利付債

EUR BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO-REG-S 5.12500% 23-22.02.33	2 405 000.00	2 821 425.75	0.07
EUR BULGARIA, REPUBLIC OF-REG-S 3.12500% 15-26.03.35	2 440 000.00	2 428 474.82	0.06
EUR CETIN GROUP BV-REG-S 3.12500% 22-14.04.27	230 000.00	242 853.55	0.01
EUR EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 6.37500% 19-11.04.31	6 047 000.00	4 187 453.01	0.11
EUR INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 3.75000% 16-14.06.28	695 000.00	757 487.92	0.02
EUR KAZAKHSTAN, REPUBLIC OF-REG-S 1.50000% 19-30.09.34	1 372 000.00	1 183 419.13	0.03
EUR NE PROPERTY BV-REG-S 1.87500% 19-09.10.26	3 600 000.00	3 619 910.75	0.09
EUR NE PROPERTY BV-REG-S 2.00000% 22-20.01.30	190 000.00	172 333.56	0.00
EUR ORLEN SA-REG-S 4.75000% 23-13.07.30	350 000.00	392 866.75	0.01
EUR PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 0.87500% 19-17.05.27	5 080 000.00	5 043 147.64	0.13
EUR ROMANIA-REG-S 1.75000% 21-13.07.30	2 700 000.00	2 396 892.10	0.06
EUR ROMANIA-REG-S 2.00000% 20-28.01.32	7 798 000.00	6 680 744.47	0.17
EUR ROMANIA-REG-S 2.12400% 19-16.07.31	220 000.00	192 458.52	0.00
EUR ROMANIA-REG-S 2.50000% 18-08.02.30	620 000.00	590 132.47	0.02
EUR ROMANIA-REG-S 2.75000% 21-14.04.41	40 000.00	29 111.50	0.00
EUR ROMANIA-REG-S 2.87500% 18-11.03.29	510 000.00	504 821.11	0.01
EUR ROMANIA-REG-S 2.87500% 21-13.04.42	861 000.00	628 963.20	0.02
EUR ROMANIA-REG-S 3.37500% 20-28.01.50	5 060 000.00	3 751 310.06	0.10
EUR ROMANIA-REG-S 3.50000% 19-03.04.34	500 000.00	461 656.25	0.01
EUR ROMANIA-REG-S 3.87500% 15-29.10.35	800 000.00	737 867.90	0.02
EUR ROMANIA-REG-S 6.37500% 23-18.09.33	1 261 000.00	1 450 714.14	0.04
EUR ROMANIA-REG-S 6.62500% 22-27.09.29	1 630 000.00	1 894 528.62	0.05
EUR ROMANIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 2.00000% 21-14.04.33	6 398 000.00	5 263 451.86	0.13
EUR ROMANIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 3.75000% 22-07.02.34	12 270 000.00	11 545 629.05	0.29
EUR SERBIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 1.00000% 21-23.09.28	2 890 000.00	2 640 904.58	0.07
EUR SERBIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 2.05000% 21-23.09.36	3 813 000.00	2 863 068.50	0.07
ユーロ合計		62 481 627.21	1.59

USD			
USD ABQ FINANCE LTD-REG-S 3.12500% 19-24.09.24	380 000.00	373 112.50	0.01
USD ABQ FINANCE LTD-REG-S 1.87500% 20-08.09.25	270 000.00	253 378.12	0.01

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / 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 5.37500% 23-18.07.28	750 000.00	757 734.38	0.02
USD ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC-REG-S 5.50000% 23-12.01.29	2 240 000.00	2 277 100.00	0.06
USD ABU DHABI GOVERNMENT INTERNAT-REG-S 3.00000% 21-15.09.51	2 106 000.00	1 432 080.00	0.04
USD ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO PJSC-REG-S 3.40000% 21-29.04.51	1 040 000.00	737 100.00	0.02
USD ABU DHABI PORTS CO PJSC-REG-S 2.50000% 21-06.05.31	901 000.00	761 063.44	0.02
USD ADIB SUKUK CO II LTD-REG-S 5.69500% 23-15.11.28	300 000.00	307 632.00	0.01
USD AFRICA FINANCE CORP-REG-S 4.37500% 19-17.04.26	1 665 000.00	1 601 796.60	0.04
USD ALDAR SUKUK NO 2 LTD-REG-S 3.87500% 19-22.10.29	1 420 000.00	1 323 262.50	0.03
USD ANGOLAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 8.00000% 19-26.11.29	7 328 000.00	6 357 040.00	0.16
USD ANGOLAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 9.12500% 19-26.11.49	6 371 000.00	5 025 126.25	0.13
USD ARAB REPUBLIC OF EGYPT-REG-S 5.87500% 21-16.02.31	8 849 000.00	5 762 911.25	0.15
USD AXIATA SPV5 LABUAN LTD-REG-S 3.06400% 20-19.08.50	1 630 000.00	1 097 201.90	0.03
USD BAHRAIN GVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 5.25000% 21-25.01.33	1 780 000.00	1 564 175.00	0.04
USD BAHRAIN GVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 5.62500% 21-18.05.34	770 000.00	682 412.50	0.02
USD BAHRAIN, KINGDOM OF-REG-S 6.25000% 21-25.01.51	1 010 000.00	811 787.50	0.02
USD BANCO DE CREDITO E INVERSIONES SA-REG-S 2.87500% 21-14.10.31	2 000 000.00	1 684 000.00	0.04
USD BANGKOK BANK PCL/HONG KONG-144A 5.50000% 23-21.09.33	1 840 000.00	1 862 521.60	0.05
USD BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO-REG-S 5.37500% 23-22.05.33	5 008 000.00	5 020 019.20	0.13
USD BANK MANDIRI PERSERO TBK PT-REG-S 4.75000% 20-13.05.25	1 460 000.00	1 447 385.60	0.04
USD BANK MUSCAT SAOG-REG-S 4.75000% 21-17.03.26	950 000.00	929 812.50	0.02
USD BANK NEGARA INDONESIA PERSERO-REG-S-SUB 3.75000% 21-30.03.26	2 140 000.00	2 038 585.40	0.05
USD BANK OF CHINA LTD-REG-S-SUB 5.00000% 14-13.11.24	200 000.00	199 078.00	0.00
USD BANK OF EAST ASIA LTD-REG-S-SUB 4.00000% 20-29.05.30	280 000.00	265 935.60	0.01
USD BDO UNIBANK INC-REG-S 2.12500% 20-13.01.26	200 000.00	188 308.00	0.00
USD BOC AVIATION LTD-REG-S 3.00000% 19-11.09.29	2 000 000.00	1 795 512.22	0.05
USD BOC AVIATION LTD-REG-S 4.50000% 23-23.05.28	720 000.00	704 016.00	0.02
USD BOC AVIATION USA CORP-REG-S 4.87500% 23-03.05.33	381 000.00	374 370.60	0.01
USD BSF FINANCE-REG-S 5.50000% 22-23.11.27	1 162 000.00	1 175 798.75	0.03
USD BUENOS AIRES, PROVINCE OF-REG-S STEP-UP 21-01.09.37	2 259 000.00	883 269.00	0.02
USD CBQ FINANCE LTD-REG-S 2.00000% 21-12.05.26	1 523 000.00	1 405 919.38	0.04
USD CDBL FUNDING 2-REG-S 2.00000% 21-04.03.26	1 250 000.00	1 176 362.50	0.03
USD CHINA CINDA FINANCE 2017 I LTD-REG-S 4.75000% 18-08.02.28	600 000.00	583 584.00	0.01
USD CMB INTERNATIONAL LEASING MGT LTD-REG-S 1.87500% 20-12.08.25	960 000.00	910 272.00	0.02
USD COMMERCIAL BANK OF DUBAI PSC-REG-S 5.31900% 23-14.06.28	673 000.00	672 369.07	0.02
USD DBS GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 5.47900% 23-12.09.25	200 000.00	201 862.40	0.00
USD DIB SUKUK LTD-REG-S 1.95900% 21-22.06.26	700 000.00	649 468.75	0.02
USD DIB SUKUK LTD-REG-S 4.80000% 23-16.08.28	614 000.00	609 011.25	0.02
USD DOHA FINANCE LTD-REG-S 2.37500% 21-31.03.26	700 000.00	648 593.75	0.02
USD DP WORLD CRESCENT LTD-REG-S 4.84800% 18-26.09.28	1 060 000.00	1 042 987.00	0.03
USD DP WORLD CRESCENT LTD-REG-S 3.87500% 19-18.07.29	236 000.00	221 238.20	0.01
USD DP WORLD CRESCENT LTD-REG-S 3.75000% 19-30.01.30	391 000.00	362 163.75	0.01
USD DP WORLD PLC-144A 6.85000% 07-02.07.37	330 000.00	354 750.00	0.01
USD DP WORLD PLC-REG-S 4.70000% 19-30.09.49	3 070 000.00	2 492 456.25	0.06
USD DP WORLD PLC-REG-S 5.62500% 18-25.09.48	2 812 000.00	2 608 973.60	0.07
USD DP WORLD PLC-REG-S 6.85000% 07-02.07.37	4 900 000.00	5 267 500.00	0.13
USD DUBAI, GOVERNMENT OF-REG-S 3.90000% 20-09.09.50	3 356 000.00	2 445 685.00	0.06
USD EASTERN AND SOUTHERN AFRICAN TRAD-REG-S 4.87500% 19-23.05.24	1 423 000.00	1 407 033.94	0.04
USD EASTERN AND SOUTHERN AFRICAN TRAD-REG-S 4.12500% 21-30.06.28	1 674 000.00	1 451 358.00	0.04
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 8.50000% 17-31.01.47	6 621 000.00	4 038 810.00	0.10
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 7.50000% 17-31.01.27	625 000.00	511 250.00	0.01
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 7.60030% 19-01.03.29	2 670 000.00	1 962 450.00	0.05
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 8.70020% 19-01.03.49	4 051 000.00	2 511 620.00	0.06
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 7.05290% 19-15.01.32	5 890 000.00	3 938 937.50	0.10
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 8.15000% 19-20.11.59	6 235 000.00	3 772 175.00	0.10
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 3.87500% 21-16.02.26	700 000.00	566 125.00	0.01
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 7.50000% 21-16.02.61	2 200 000.00	1 265 000.00	0.03
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 5.80000% 21-30.09.27	4 545 000.00	3 391 706.25	0.09
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 7.30000% 21-30.09.33	3 557 000.00	2 347 620.00	0.06

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 8.75000% 21-30.09.51	1 100 000.00	687 500.00	0.02
USD EMAAR SUKUK LTD-REG-S 3.87500% 19-17.09.29	700 000.00	649 250.00	0.02
USD EMIRATES DEVELOPMENT BANK PJSC-REG-S 3.51600% 19-06.03.24	400 000.00	398 192.00	0.01
USD EMIRATES NBD BANK PJSC-REG-S 2.62500% 20-18.02.25	765 000.00	740 653.88	0.02
USD EMIRATES NBD BANK PJSC-REG-S 5.87500% 23-11.10.28	4 321 000.00	4 466 833.75	0.11
USD ESKOM HOLDINGS SOC LTD-REG-S 6.35000% 18-10.08.28	9 115 000.00	8 852 943.75	0.23
USD EXPORT-IMPORT BANK OF INDIA-REG-S 2.25000% 21-13.01.31	438 000.00	361 818.66	0.01
USD FAR EAST HORIZON LTD-REG-S 4.25000% 21-26.10.26	5 265 000.00	4 802 943.59	0.12
USD FINANCE DEPARTMENT GOVT OF SHARJAH-REG-S 4.00000% 20-28.07.50	1 700 000.00	1 092 250.00	0.03
USD FINANCE DEPARTMENT GOVT OF SHARJAH-REG-S 3.62500% 21-10.03.33	2 010 000.00	1 673 325.00	0.04
USD FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 5.12500% 22-13.10.27	2 240 000.00	2 253 300.00	0.06
USD FREEPORT INDONESIA-REG-S PT 4.76300% 22-14.04.27	450 000.00	440 487.00	0.01
USD FREEPORT INDONESIA-REG-S 5.31500% 22-14.04.32	6 731 000.00	6 521 396.66	0.17
USD GC TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 2.98000% 21-18.03.31	1 331 000.00	1 113 487.98	0.03
USD GC TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 4.40000% 22-30.03.32	1 600 000.00	1 454 688.00	0.04
USD GLP CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 2.95000% 21-29.03.26	881 000.00	609 925.11	0.02
USD GREENKO POWER II LTD-REG-S 4.30000% 21-13.12.28	8 627 000.00	7 051 149.05	0.18
USD GULF INTERNATIONAL BANK BSC-REG-S 2.37500% 20-23.09.25	400 000.00	375 816.00	0.01
USD HUARONG FINANCE 2017 CO-REG-S 4.25000% 17-07.11.27	565 000.00	516 975.00	0.01
USD HUARONG FINANCE II CO LTD-REG-S 5.50000% 15-16.01.25	1 420 000.00	1 398 700.00	0.04
USD HUARONG FINANCE-REG-S 3.75000% 19-29.05.24	1 171 000.00	1 157 100.23	0.03
USD HUARONG FINANCE-REG-S 4.50000% 19-29.05.29	500 000.00	447 500.00	0.01
USD HUARONG FINANCE-REG-S 3.87500% 19-13.11.29	420 000.00	361 078.20	0.01
USD HUTAMA KARYA PERSERO PT-REG-S 3.75000% 20-11.05.30	2 064 000.00	1 906 620.00	0.05
USD HYUNDAI CAPITAL SERVICES INC-REG-S 1.25000% 21-08.02.26	1 529 000.00	1 407 230.44	0.04
USD INDIAN RAILWAY FINANCE CORP LTD-REG-S 3.57000% 22-21.01.32	1 553 000.00	1 374 373.94	0.03
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.95000% 15-08.01.46	325 000.00	349 817.00	0.01
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 4.75000% 17-18.07.47	333 000.00	310 142.88	0.01
USD IOI INVESTMENT L BHD-REG-S 3.37500% 21-02.11.31	2 460 000.00	2 047 704.00	0.05
USD ISRAEL ELECTRIC CORP LTD-144A-REG-S 4.25000% 18-14.08.28	4 414 000.00	4 077 432.50	0.10
USD KAZAKHSTAN, REPUBLIC OF-144A 6.50000% 15-21.07.45	3 440 000.00	3 792 600.00	0.10
USD KAZAKHSTAN, REPUBLIC OF-REG-S 6.50000% 15-21.07.45	360 000.00	396 900.00	0.01
USD KEB HANA BANK-REG-S-SUB 4.37500% 14-30.09.24	230 000.00	227 596.50	0.01
USD KHAZANAH CAPITAL LTD-REG-S 4.87600% 23-01.06.33	1 307 000.00	1 295 681.38	0.03
USD KHAZANAH GLOBAL SUKUK BHD-REG-S 4.68700% 23-01.06.28	500 000.00	498 585.00	0.01
USD KINGDOM OF SAUDI ARABIA-REG-S 2.25000% 21-02.02.33	2 594 000.00	2 094 655.00	0.05
USD KOOKMIN BANK-REG-S-SUB 4.50000% 19-01.02.29	2 000 000.00	1 921 360.00	0.05
USD KSA SUKUK LTD-REG-S 4.30300% 18-19.01.29	6 090 000.00	5 991 037.50	0.15
USD KSA SUKUK LTD-REG-S 2.96900% 19-29.10.29	6 130 000.00	5 570 637.50	0.14
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 8.25000% 06-12.04.21	2 491 000.00	141 987.00	0.00
USD LEBANON, REPUBLIC OF *DEFAULT* 6.37500% 10-09.03.20	22 074 000.00	1 258 218.00	0.03
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.10000% 10-04.10.22	1 166 000.00	66 462.00	0.00
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.60000% 11-27.11.26	6 260 000.00	356 820.00	0.01
USD LEBANON, REPUBLIC OF *DEFAULTED* 6.15000% 13-19.06.20	7 107 000.00	405 099.00	0.01
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 5.80000% 14-14.04.20	2 179 000.00	124 203.00	0.00
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 7.00000% 17-20.03.28	270 000.00	15 390.00	0.00
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 7.15000% 17-20.11.31	180 000.00	10 260.00	0.00
USD MASDAR ABU DHABI FUTURE ENERGY CO-REG-S 4.87500% 23-25.07.33	300 000.00	294 000.00	0.01
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 2.87500% 19-07.11.29	1 610 000.00	1 451 616.25	0.04
USD MDGH GMTN RSC LTD-REG-S 4.37500% 23-22.11.33	308 000.00	293 370.00	0.01
USD MEGLOBAL BV-REG-S 2.62500% 21-28.04.28	389 000.00	347 425.63	0.01
USD MEGLOBAL CANADA INC-REG-S 5.87500% 20-18.05.30	600 000.00	608 062.50	0.02
USD MEGLOBAL CANADA INC-REG-S 5.00000% 20-18.05.25	3 027 000.00	2 984 432.81	0.08
USD METROPOLITAN BANK & TRUST CO-REG-S 2.12500% 20-15.01.26	200 000.00	187 500.00	0.00
USD MEXICO, UNITED STATES OF 4.75000% 12-08.03.44	372 000.00	311 178.00	0.01
USD MEXICO, UNITED STATES OF 5.55000% 14-21.01.45	303 000.00	282 699.00	0.01
USD MEXICO, UNITED STATES OF 3.75000% 21-19.04.71	6 702 000.00	4 316 088.00	0.11
USD MISC CAPITAL TWO LABUAN LTD-REG-S 3.75000% 22-06.04.27	500 000.00	478 500.00	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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD MTR CORP LTD-REG-S 1.62500% 20-19.08.30	750 000.00	627 380.29	0.02
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 6.50000% 17-28.11.27	8 502 000.00	7 698 561.00	0.20
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 7.62500% 17-28.11.47	4 861 000.00	3 688 283.75	0.09
USD NIGERIA, FEDERAL REP OF-REG-S 6.12500% 21-28.09.28	10 233 000.00	8 889 918.75	0.23
USD NIGERIA, FEDERAL REP OF-REG-S 7.37500% 21-28.09.33	6 376 000.00	5 244 260.00	0.13
USD NIGERIA, FEDERAL REP OF-REG-S 8.25000% 21-28.09.51	3 572 000.00	2 839 740.00	0.07
USD NIGERIA, FEDERAL REP OF-REG-S 8.37500% 22-24.03.29	2 896 000.00	2 711 380.00	0.07
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.00000% 19-01.08.29	3 650 000.00	3 727 562.50	0.09
USD OVERSEA-CHINESE BANKING CORP-REG-S-SUB 4.25000% 14-19.06.24	1 052 000.00	1 046 142.49	0.03
USD PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 6.00000% 21-08.04.26	1 454 000.00	1 122 887.85	0.03
USD PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 7.37500% 21-08.04.31	4 399 000.00	2 837 838.89	0.07
USD PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 8.87500% 21-08.04.51	8 150 000.00	5 033 521.50	0.13
USD PANAMA, REPUBLIC OF 9.37500% 99-01.04.29	3 424 000.00	3 826 320.00	0.10
USD PERTAMINA PERSERO PT-REG-S 3.65000% 19-30.07.29	1 346 000.00	1 253 462.50	0.03
USD PERTAMINA PERSERO PT-REG-S 4.70000% 19-30.07.49	1 780 000.00	1 517 645.80	0.04
USD PERTAMINA PERSERO PT-REG-S 4.17500% 20-21.01.50	2 820 000.00	2 214 010.20	0.06
USD PERTAMINA PT-REG-S 6.45000% 14-30.05.44	328 000.00	346 076.08	0.01
USD PERTAMINA PT-REG-S 6.50000% 18-07.11.48	306 000.00	327 071.16	0.01
USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 5.25000% 17-15.05.47	7 563 000.00	6 826 439.43	0.17
USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 6.15000% 18-21.05.48	5 834 000.00	5 820 056.74	0.15
USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 3.37500% 19-05.02.30	3 991 000.00	3 586 911.25	0.09
USD PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 4.45000% 19-20.02.29	3 380 000.00	3 329 671.80	0.08
USD PETROLEOS MEXICANOS 4.50000% 16-23.01.26	4 446 000.00	4 173 015.60	0.11
USD PETROLEOS MEXICANOS 5.62500% 16-23.01.46	100 000.00	58 750.00	0.00
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.87500% 17-04.08.26	3 650 000.00	3 545 610.00	0.09
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.75000% 17-21.09.47	6 222 000.00	3 980 213.40	0.10
USD PETRONAS CAPITAL LTD-REG-S 4.50000% 15-18.03.45	1 030 000.00	914 640.00	0.02
USD PETRONAS CAPITAL LTD-REG-S 4.55000% 20-21.04.50	5 115 000.00	4 551 736.20	0.12
USD PETRONAS CAPITAL LTD-REG-S 4.80000% 20-21.04.60	1 969 000.00	1 786 355.56	0.05
USD PETRONAS CAPITAL LTD-REG-S 3.40400% 21-28.04.61	486 000.00	333 109.26	0.01
USD PETRONAS CAPITAL LTD-REG-S 2.48000% 21-28.01.32	813 000.00	683 139.51	0.02
USD PHILIPPINE NATIONAL BANK-REG-S 3.28000% 19-27.09.24	1 680 000.00	1 650 600.00	0.04
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 10.62500% 00-16.03.25	188 000.00	199 770.68	0.00
USD POLAND, REPUBLIC OF 5.50000% 22-16.11.27	200 000.00	206 396.00	0.01
USD POLAND, REPUBLIC OF 5.75000% 22-16.11.32	3 297 000.00	3 496 204.74	0.09
USD POWER FINANCE CORP LTD-REG-S 6.15000% 18-06.12.28	300 000.00	310 248.00	0.01
USD POWER FINANCE CORP LTD-REG-S 3.95000% 20-23.04.30	400 000.00	368 132.00	0.01
USD PROSUS NV-REG-S 3.06100% 21-13.07.31	485 000.00	388 945.75	0.01
USD PTT TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 3.70000% 20-16.07.70	2 470 000.00	1 728 407.20	0.04
USD PTTEP TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 2.99300% 20-15.01.30	1 900 000.00	1 704 205.00	0.04
USD PTTEP TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 2.58700% 20-10.06.27	584 000.00	539 843.76	0.01
USD QNB FINANCE LTD-REG-S 3.50000% 19-28.03.24	700 000.00	697 340.00	0.02
USD QNB FINANCE LTD-REG-S 2.75000% 20-12.02.27	1 200 000.00	1 120 125.00	0.03
USD QNB FINANCE LTD-REG-S 2.62500% 20-12.05.25	9 315 000.00	8 948 221.87	0.23
USD QNB FINANCE LTD-REG-S 1.62500% 20-22.09.25	760 000.00	712 262.50	0.02
USD QNB FINANCE LTD-REG-S 1.37500% 21-26.01.26	2 815 000.00	2 598 596.87	0.07
USD QTEL INTERNATIONAL FINANCE LTD-REG-S 2.62500% 21-08.04.31	945 000.00	815 700.38	0.02
USD REC LTD-REG-S 2.25000% 21-01.09.26	1 000 000.00	924 490.00	0.02
USD REC LTD-REG-S 5.62500% 23-11.04.28	200 000.00	201 588.00	0.00
USD REPUBLIC OF UZBEKISTAN BOND-REG-S 5.37500% 19-20.02.29	420 000.00	391 440.00	0.01
USD REPUBLIC OF UZBEKISTAN BOND-REG-S 4.75000% 19-20.02.24	1 500 000.00	1 496 250.00	0.04
USD REPUBLIC OF UZBEKISTAN BOND-REG-S 3.70000% 20-25.11.30	760 000.00	620 160.00	0.02
USD REPUBLIC OF UZBEKISTAN BOND-REG-S 7.85000% 23-12.10.28	5 605 000.00	5 809 582.50	0.15
USD RIZAL COMMERCIAL BANKING CORP-REG-S 5.50000% 24-18.01.29	564 000.00	564 705.00	0.01
USD ROMANIA -REG-S 6.00000% 22-25.05.34	9 634 000.00	9 605 098.00	0.24
USD ROMANIA-REG-S 6.12500% 14-22.01.44	210 000.00	205 863.00	0.00
USD SATS TREASURY PTE LTD-REG-S 4.82800% 24-23.01.29	1 681 000.00	1 684 656.01	0.04
USD SAUDI ARABIAN OIL CO-REG-S 2.87500% 19-16.04.24	3 320 000.00	3 291 282.00	0.08

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD SAUDI ARABIAN OIL CO-REG-S 3.50000% 19-16.04.29	2 690 000.00	2 498 337.50	0.06
USD SAUDI ARABIAN OIL CO-REG-S 4.25000% 19-16.04.39	6 276 000.00	5 420 110.50	0.14
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-144A 3.25000% 21-17.11.51	4 760 000.00	3 153 500.00	0.08
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 4.62500% 17-04.10.47	5 339 000.00	4 591 540.00	0.12
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 4.50000% 18-17.04.30	3 600 000.00	3 523 500.00	0.09
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 5.00000% 18-17.04.49	591 000.00	534 928.87	0.01
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 2.75000% 20-03.02.32	4 480 000.00	3 836 000.00	0.10
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 3.75000% 20-21.01.55	2 994 000.00	2 114 512.50	0.05
USD SAUDI GOVERNMENT INTER-REG-S 4.50000% 20-22.04.60	1 416 000.00	1 154 040.00	0.03
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 3.45000% 21-02.02.61	3 067 000.00	2 008 885.00	0.05
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 3.25000% 21-17.11.51	7 600 000.00	5 035 000.00	0.13
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 4.75000% 23-18.01.28	4 800 000.00	4 806 000.00	0.12
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 5.00000% 23-18.01.53	6 344 000.00	5 638 230.00	0.14
USD SHARJAH SUKUK PROGRAM LTD-REG-S 3.85400% 19-03.04.26	1 330 000.00	1 283 450.00	0.03
USD SHINHAN BANK CO LTD-REG-S-SUB 4.37500% 22-13.04.32	4 060 000.00	3 720 705.80	0.09
USD SHINHAN BANK-REG-S 4.50000% 23-12.04.28	1 200 000.00	1 185 120.00	0.03
USD SHINHAN BANK-REG-S-SUB 3.87500% 16-24.03.26	1 210 000.00	1 169 852.20	0.03
USD SHRIRAM FINANCE LTD-REG-S 6.62500% 24-22.04.27	1 400 000.00	1 408 750.00	0.04
USD SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD-REG-S 4.40000% 21-13.03.24	1 365 000.00	1 358 898.45	0.03
USD ST ENGINEERING URBAN SOLUTIONS US-REG-S 3.37500% 22-05.05.27	1 770 000.00	1 699 996.50	0.04
USD STATE BANK OF INDIA/LONDON-REG-S 4.87500% 23-05.05.28	350 000.00	347 938.50	0.01
USD STATE BANK OF INDIA/LONDON-REG-S 5.00000% 24-17.01.29	2 255 000.00	2 252 158.70	0.06
USD SUN HUNG KAI PROP CAP MRKT LTD-REG-S 2.87500% 20-21.01.30	200 000.00	176 409.96	0.00
USD SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD-REG-S 3.75000% 19-25.02.29	1 296 000.00	1 218 193.41	0.03
USD TBC BANK JSC-REG-S 5.75000% 19-19.06.24	1 307 000.00	1 296 988.38	0.03
USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.97500% 19-11.04.29	280 000.00	266 162.40	0.01
USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.24000% 20-03.06.50	536 000.00	357 608.48	0.01
USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.29000% 20-03.06.60	238 000.00	150 049.48	0.00
USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.68000% 21-22.04.41	550 000.00	429 385.00	0.01
USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.84000% 21-22.04.51	1 300 000.00	965 497.00	0.02
USD THAIOIL TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 3.75000% 20-18.06.50	5 520 000.00	3 793 620.00	0.10
USD TURKIYE IHRACAT KREDI BANKASI AS-REG-S 9.00000% 23-28.01.27	3 112 000.00	3 228 700.00	0.08
USD UAE INTERNATIONAL GOVNT BOND-REG-S 4.05000% 22-07.07.32	984 000.00	953 250.00	0.02
USD UAE INTERNATIONAL GOVNT BOND-REG-S 4.95100% 22-07.07.52	2 305 000.00	2 189 750.00	0.06
USD UNITED BANK FOR AFRICA PLC-REG-S 6.75000% 21-19.11.26	1 580 000.00	1 474 337.50	0.04
USD VANKE REAL ESTAT HONG KONG CO LTD-REG-S 3.97500% 17-09.11.27	558 000.00	353 744.10	0.01
USD VANKE REAL ESTAT HONG KONG CO LTD-REG-S 3.50000% 19-12.11.29	600 000.00	329 016.00	0.01
USD VENA ENERGY CAPITAL PTE LTD-REG-S 3.13300% 20-26.02.25	6 388 000.00	6 200 331.99	0.16
USD WHARF REIC FIN BVI-REG-S 3.50000% 18-17.01.28	400 000.00	376 896.00	0.01
USD WOORI BANK-REG-S 4.87500% 23-26.01.28	200 000.00	201 196.00	0.00
USD YAPI VE KREDI BANKASI AS-REG-S 9.25000% 23-16.10.28	5 075 000.00	5 344 609.38	0.14
米ドル合計		426 002 833.06	10.86
中期債券、固定利付債合計		488 484 460.27	12.45
中期債券、変動利付債			
EUR BANCA COMERCIALA ROMANA SA-REG-S 7.625%/VAR 23-19.05.27	2 100 000.00	2 397 006.15	0.06
EUR BANCA TRANSILVANIA SA-REG-S 8.875%/VAR 23-27.04.27	6 385 000.00	7 317 170.10	0.19
EUR BANCA TRANSILVANIA SA-REG-S 7.250%/VAR 23-07.12.28	3 770 000.00	4 228 255.28	0.11
EUR BANK POLSKA KASA OPIEKI SA-REG-S 5.500%/VAR 23-23.11.27	4 489 000.00	4 974 772.54	0.13
EUR CESKA SPORITELNA AS-REG-S 5.737%/VAR 23-08.03.28	3 000 000.00	3 380 953.12	0.08
EUR CESKA SPORITELNA AS-REG-S 4.824%/VAR 24-15.01.30	3 500 000.00	3 830 389.07	0.10
EUR ERSTE&STEIERMAERKISCHE BANKA DD-REG-S 4.875%/VAR 24-31.01.29	1 300 000.00	1 428 604.50	0.04
EUR MBANK SA-REG-S 8.375%/VAR 23-11.09.27	4 200 000.00	4 811 576.96	0.12
EUR OTP BANK NYRT-REG-S 5.000%/VAR 24-31.01.29	3 015 000.00	3 288 307.68	0.08
EUR OTP BANK NYRT-REG-S-SUB 2.875%/VAR 19-15.07.29	3 590 000.00	3 794 308.29	0.10
EUR RAIFFEISEN BANK SA-REG-S 7.000%/VAR 23-12.10.27	1 500 000.00	1 690 476.56	0.04
ユーロ合計		41 141 820.25	1.05

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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD			
USD AIA GROUP LTD-REG-S-SUB 2.700%/VAR 21-PRP	2 953 000.00	2 732 802.76	0.07
USD AXIS BANK LTD/GIFT CITY-REG-S-SUB 4.100%/VAR 21-PRP	1 400 000.00	1 286 250.00	0.03
USD BANGKOK BANK PCL/HONG KONG-REG-S-SUB 3.733%/VAR 19-25.09.34	2 270 000.00	2 006 430.30	0.05
USD BANGKOK BANK PCL/HONG KONG-REG-S-SUB 5.000%/VAR 20-PRP	900 000.00	876 600.00	0.02
USD DAH SING BANK LTD-REG-S-SUB 3.000%/VAR 21-02.11.31	4 939 000.00	4 490 637.58	0.11
USD DAH SING BANK LTD-REG-S-SUB 7.375%/VAR 23-15.11.33	310 000.00	322 241.90	0.01
USD DBS GROUP HOLDINGS LTD-REG-S-SUB 3.300%/VAR 20-PRP	1 680 000.00	1 631 687.62	0.04
USD KASIKORNBANK PCL/HONG KONG-REG-S-SUB 3.343%/VAR 19-02.10.31	1 426 000.00	1 320 675.64	0.03
USD KASIKORNBANK PCL/HONG KONG-REG-S-SUB 4.000%/VAR 21-PRP	714 000.00	647 062.50	0.02
USD KOREA EXPRESSWAY CORP-REG-S O/N SOFR+103BP 23-10.07.28	609 000.00	611 904.93	0.02
USD OTP BANK NYRT-REG-S 7.500%/VAR 23-25.05.27	4 790 000.00	4 921 725.00	0.13
USD OTP BANK NYRT-REG-S-SUB 8.750%/VAR 23-15.05.33	5 724 000.00	5 896 864.80	0.15
USD QIB SUKUK LTD-REG-S 3M LIBOR+135BP 20-07.02.25	440 000.00	442 887.50	0.01
USD SHINHAN FIN GROUP CO LTD-REG-S-SUB 3.340%/VAR 19-05.02.30	400 000.00	389 328.00	0.01
USD SHINHAN FINANCIAL GR-144A-SUB 3.340%/VAR 19-05.02.30	1 170 000.00	1 138 784.40	0.03
USD UNITED OVERSEAS BANK LTD-REG-S-SUB 3.750%/VAR 19-15.04.29	900 000.00	896 636.89	0.02
USD UNITED OVERSEAS BANK LTD-REG-S-SUB 2.000%/VAR 21-14.10.31	1 509 000.00	1 379 734.54	0.03
USD UNITED OVERSEAS BANK LTD-REG-S-SUB 3.863%/VAR 22-07.10.32	255 000.00	242 483.70	0.01
USD UNITED OVERSEAS BANK LTD-REG-S-SUB 1.750%/VAR 20-16.03.31	226 000.00	209 128.13	0.01
米ドル合計		31 443 866.19	0.80
中期債券、変動利付債合計		72 585 686.44	1.85
債券、固定利付債			
EUR			
EUR ALTICE FINANCING SA-REG-S 4.25000% 21-15.08.29	3 310 000.00	3 149 611.10	0.08
EUR BENIN GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 4.95000% 21-22.01.35	2 063 000.00	1 759 133.00	0.05
EUR IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 5.25000% 18-22.03.30	7 226 000.00	7 116 319.48	0.18
EUR IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 6.62500% 18-22.03.48	5 145 000.00	4 380 187.71	0.11
EUR IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 6.87500% 19-17.10.40	7 037 000.00	6 373 136.02	0.16
EUR METINVEST BV-REG-S 5.62500% 19-17.06.25	1 460 000.00	1 395 614.00	0.04
EUR NAK NAFTOGAZ UKRAINE VIA KONDOR-REG-S 7.12500% 19-19.07.26	1 343 000.00	780 476.06	0.02
EUR ROMANIAN GOVERNMENT INTERN BDS-REG-S 3.62400% 20-26.05.30	4 689 000.00	4 710 145.93	0.12
EUR RUSSIA, FEDERATION OF-REG-S 2.87500% 18-04.12.25	4 700 000.00	0.51	0.00
EUR SENEGAL, REPUBLIC OF-REG-S 4.75000% 18-13.03.28	6 731 000.00	6 680 927.67	0.17
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV-REG-S 1.12500% 16-15.10.24	510 000.00	538 775.01	0.01
ユーロ合計		36 884 326.49	0.94
USD			
USD ABJA INVESTMENT CO PTE LTD-REG-S 5.95000% 14-31.07.24	1 742 000.00	1 737 122.40	0.04
USD ABU DHABI CRUDE OIL PIPELINE LLC-REG-S 4.60000% 17-02.11.47	4 342 000.00	3 856 238.75	0.10
USD ABU DHABI, GOVERNMENT OF-REG-S 3.12500% 19-30.09.49	1 920 000.00	1 336 800.00	0.03
USD ACWA POWER MGMT & INVEST ONE LTD-REG-S 5.95000% 17-15.12.39	850 000.00	810 680.06	0.02
USD ADANI GREEN ENERGY UP LTD-REG-S 6.25000% 19-10.12.24	1 800 000.00	1 778 634.00	0.05
USD ALDAR SUKUK LTD-REG-S 4.75000% 18-29.09.25	550 000.00	543 125.00	0.01
USD ALFA DESARROLLO SPA-REG-S 4.55000% 21-27.09.51	9 581 000.00	6 952 493.07	0.18
USD ALTICE FINANCING SA-REG-S 5.75000% 21-15.08.29	1 000 000.00	871 476.40	0.02
USD ANGOLAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 9.50000% 15-12.11.25	4 393 000.00	4 310 411.60	0.11
USD ANGOLAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 8.25000% 18-09.05.28	10 893 000.00	9 803 700.00	0.25
USD ARABIAN CENTRES SUKUK II LTD-REG-S 5.62500% 21-07.10.26	290 000.00	264 987.50	0.01
USD ARGENTINA, REPUBLIC OF STEP-UP 20-09.07.41	14 034 239.00	4 659 367.35	0.12
USD AXIAN TELECOM-REG-S 7.37500% 22-16.02.27	2 180 000.00	2 052 606.24	0.05
USD BAHRAIN GVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.00000% 14-19.09.44	260 000.00	207 350.00	0.01
USD BAHRAIN GVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 7.00000% 16-12.10.28	9 880 000.00	10 114 650.00	0.26
USD BAHRAIN GVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 7.50000% 17-20.09.47	462 000.00	424 416.30	0.01
USD BAHRAIN, KINGDOM OF-REG-S 5.62500% 19-30.09.31	1 950 000.00	1 813 500.00	0.05
USD BAHRAIN, KINGDOM OF-REG-S 7.37500% 20-14.05.30	4 020 000.00	4 145 625.00	0.11

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD BAHRAIN, KINGDOM OF-REG-S 5.45000% 20-16.09.32	1 080 000.00	973 350.00	0.02
USD BANK OF BAHRAIN & KUWAIT-REG-S 5.50000% 19-09.07.24	550 000.00	544 417.50	0.01
USD BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO-REG-S-SUB 4.20000% 20-23.01.25	892 000.00	869 798.12	0.02
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 8.25000% 04-20.01.34	247 000.00	282 321.00	0.01
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 5.00000% 14-27.01.45	538 000.00	425 558.00	0.01
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 6.00000% 16-07.04.26	345 000.00	353 280.00	0.01
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 5.62500% 16-21.02.47	2 760 000.00	2 347 380.00	0.06
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 4.50000% 19-30.05.29	6 994 000.00	6 689 761.00	0.17
USD CBB INTERNATIONAL SUKUK PROGRAMME-REG-S 3.95000% 20-16.09.27	2 170 000.00	2 047 937.50	0.05
USD CFLD CAYMAN INVESTMENT LTD-REG-S 2.50000% 23-31.01.31	73 260.00	1 831.50	0.00
USD CHILE, REPUBLIC OF 3.12500% 16-21.01.26	5 290 000.00	5 131 300.00	0.13
USD CHINA OVERSEAS FINANCE CAYMAN-REG-S 6.45000% 14-11.06.34	550 000.00	555 225.00	0.01
USD CHINA SCE GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 7.00000% 20-02.05.25	400 000.00	24 000.00	0.00
USD CHINA SCE GROUP HOLDINGS LTD-REG-S- 6.00000% 21-04.02.26	695 000.00	41 700.00	0.00
USD CHINA SCE PROPERTY HOLDINGS LTD-REG-S 7.37500% 19-09.04.24	525 000.00	31 500.00	0.00
USD CHINA SCE PROPERTY HOLDINGS LTD-REG-S 5.95000% 21-29.09.24	2 025 000.00	121 500.00	0.00
USD CHINALCO CAPITAL HOLDINGS LTD-REG-S 2.12500% 21-03.06.26	132 000.00	123 107.16	0.00
USD CIA CERVECERIAS UNIDAS SA-REG-S 3.35000% 22-19.01.32	1 400 000.00	1 186 850.00	0.03
USD CIFI HOLD GROUP CO LTD-REG-S *DEFAULTED* 5.25000% 20-13.05.26	1 244 000.00	105 391.68	0.00
USD CK HUTCHISON INTERNATIONAL 23 LTD-REG-S 4.87500% 23-21.04.33	1 040 000.00	1 032 668.00	0.03
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 7.37500% 06-18.09.37	1 692 000.00	1 681 848.00	0.04
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 6.12500% 09-18.01.41	1 170 000.00	1 014 975.00	0.03
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 5.62500% 14-26.02.44	2 690 000.00	2 134 515.00	0.05
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 5.00000% 15-15.06.45	5 837 000.00	4 249 336.00	0.11
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 8.00000% 22-20.04.33	8 713 000.00	9 238 502.82	0.24
USD CONTINUUM ENERGY AURA PTE LTD-REG-S 9.50000% 23-24.02.27	430 000.00	443 437.50	0.01
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 5.62500% 05-21.09.35	2 920 000.00	2 829 480.00	0.07
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 6.15000% 06-24.10.36	1 750 000.00	1 751 750.00	0.04
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 5.62500% 13-18.10.43	350 000.00	325 500.00	0.01
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 4.87500% 14-04.11.44	384 000.00	321 024.00	0.01
USD COSTA RICA, REPUBLIC OF-144A 7.30000% 23-13.11.54	2 420 000.00	2 527 690.00	0.06
USD COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 7.30000% 23-13.11.54	10 028 000.00	10 474 246.00	0.27
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 5.62500% 20-14.01.30	535 000.00	40 125.00	0.00
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 3.12500% 20-22.10.25	1 206 000.00	95 394.59	0.00
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 3.87500% 20-22.10.30	1 010 000.00	75 750.00	0.00
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 2.70000% 21-12.07.26	3 372 000.00	252 900.00	0.01
USD DAR AL-ARKAN SUKUK CO LTD-REG-S 6.75000% 19-15.02.25	325 000.00	323 781.25	0.01
USD DIB SUKUK LTD-REG-S 2.95000% 20-16.01.26	1 270 000.00	1 214 437.50	0.03
USD DIB SUKUK LTD-REG-S 5.49300% 22-30.11.27	969 000.00	986 563.12	0.03
USD DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL-REG-S 6.00000% 22-22.02.33	1 754 000.00	1 692 434.60	0.04
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 5.50000% 22-22.02.29	10 674 000.00	10 323 892.80	0.26
USD DP WORLD CRESCENT LTD-REG-S 5.50000% 23-13.09.33	606 000.00	609 030.00	0.02
USD EDO SUKUK LTD-REG-S 5.87500% 23-21.09.33	2 905 000.00	2 951 480.00	0.08
USD EIG PEARL HOLDINGS SARL-REG-S 3.54500% 22-31.08.36	6 205 000.00	5 196 687.49	0.13
USD EIG PEARL HOLDINGS SARL-REG-S 4.38700% 22-30.11.46	5 442 000.00	4 167 592.44	0.11
USD EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 7.65000% 05-15.06.35	1 875 000.00	1 460 625.00	0.04
USD EL SUKUK CO LTD-REG-S 1.82700% 20-23.09.25	350 000.00	329 109.37	0.01
USD ENERGEAN ISRAEL FINANCE LTD-144A-REG-S 5.87500% 21-30.03.31	1 000 000.00	832 500.00	0.02
USD ESKOM HOLDINGS SOC LTD-REG-S 4.31400% 21-23.07.27	3 800 000.00	3 526 875.00	0.09
USD ETHIOPIA INTERNATI BD-REG-S *DEFAULTED* 6.62500% 14-11.12.24	3 948 000.00	2 684 640.00	0.07
USD EXPORT-IMPORT BANK OF INDIA-REG-S 3.37500% 16-05.08.26	380 000.00	364 104.60	0.01
USD FANTASIA HOLDING GRP REG-S *DEFAULTED* 10.87500% 21-02.03.24	330 000.00	7 425.00	0.00
USD FORMOSA GROUP CAYMAN LTD-REG-S 3.37500% 15-22.04.25	800 000.00	781 272.00	0.02
USD FOXCONN FAR EAST LTD-REG-S 2.50000% 20-28.10.30	470 000.00	398 212.20	0.01
USD GABON, REPUBLIC OF-REG-S 6.95000% 15-16.06.25	6 788 000.00	6 503 752.50	0.17
USD GALAXY PIPELINE ASSETS BIDCO LTD-REG-S 2.62500% 20-31.03.36	5 647 000.00	4 579 434.65	0.12
USD GALAXY PIPELINE ASSETS BIDCO LTD-REG-S 3.25000% 20-30.09.40	940 000.00	711 392.00	0.02
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 10.75000% 15-14.10.30	5 456 000.00	3 519 120.00	0.09

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 7.87500% 19-26.03.27	202 000.00	90 900.00	0.00
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 8.12500% 19-26.03.32	3 535 000.00	1 546 562.50	0.04
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 8.95000% 19-26.03.51	1 521 000.00	671 141.25	0.02
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 7.87500% 20-11.02.35	5 906 000.00	2 613 405.00	0.07
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 8.75000% 20-11.03.61	3 100 000.00	1 367 875.00	0.03
USD GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD-REG-S 3.87500% 15-04.06.25	707 000.00	536 436.25	0.01
USD GOHL CAPITAL LTD-REG-S 4.25000% 17-24.01.27	15 642 000.00	14 938 109.99	0.38
USD GREENKO DUTCH BV-REG-S 3.85000% 21-29.03.26	12 017 000.00	10 434 886.83	0.27
USD GREENKO SOLAR MAURITIUS LTD-REG-S 5.55000% 19-29.01.25	200 000.00	197 344.00	0.01
USD GREENKO SOLAR MAURITIUS LTD-REG-S 5.95000% 19-29.07.26	1 355 000.00	1 326 578.87	0.03
USD GREENKO WIND PROJECTS MAURITIUS-REG-S 5.50000% 22-06.04.25	380 000.00	373 160.00	0.01
USD GREENSAIF PIPELINES BIDCO SARL-REG-S 6.12900% 23-23.02.38	4 430 000.00	4 514 170.00	0.12
USD GREENSAIF PIPELINES BIDCO SARL-REG-S 6.51000% 23-23.02.42	5 081 000.00	5 182 620.00	0.13
USD GRUPO TELEVISA SAB 6.62500% 09-15.01.40	700 000.00	728 000.00	0.02
USD GRUPOSURA FINANCE-REG-S 5.50000% 16-29.04.26	700 000.00	680 487.50	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 HANWHA TOTALENE PETROCHE CO LTD-REG-S 5.50000% 24-18.07.29	4 575 000.00	4 571 726.13	0.12
USD HAZINE MUSTESARLIGI VARLIK KIRAL-REG-S 5.12500% 21-22.06.26	2 160 000.00	2 072 250.00	0.05
USD HKT CAPITAL NO 5 LTD-REG-S 3.25000% 19-30.09.29	1 620 000.00	1 456 850.59	0.04
USD HPCL MITTAL ENERGY LTD-REG-S 5.25000% 17-28.04.27	1 262 000.00	1 213 097.50	0.03
USD HUARONG FINANCE II CO LTD-REG-S 4.62500% 16-03.06.26	4 439 000.00	4 239 245.00	0.11
USD ICD FUNDING LTD-REG-S 3.22300% 20-28.04.26	1 290 000.00	1 219 050.00	0.03
USD IHS HOLDING LTD-REG-S 5.62500% 21-29.11.26	3 242 000.00	2 911 721.25	0.07
USD IHS HOLDING LTD-REG-S 6.25000% 21-29.11.28	4 139 000.00	3 476 760.00	0.09
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 8.50000% 05-12.10.35	7 853 000.00	10 131 233.83	0.26
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 6.62500% 07-17.02.37	493 000.00	559 547.60	0.01
USD IRAQ INTERNATIONAL BOND-REG-S 5.80000% 06-15.01.28	7 567 000.00	3 523 384.37	0.09
USD IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 6.37500% 15-03.03.28	1 375 000.00	1 338 906.25	0.03
USD IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 6.12500% 17-15.06.33	6 713 000.00	6 024 917.50	0.15
USD JORDAN, KINGDOM OF-REG-S 7.37500% 17-10.10.47	1 457 000.00	1 238 450.00	0.03
USD KASIKORNBANK PCL/HONG KONG-REG-S 5.45800% 23-07.03.28	3 712 000.00	3 766 752.00	0.10
USD KOOKMIN BANK-REG-S-SUB 2.50000% 20-04.11.30	9 099 000.00	7 572 551.76	0.19
USD LAMAR FUNDING LTD-REG-S 3.95800% 15-07.05.25	9 997 000.00	9 659 601.25	0.25
USD LATAM AIRLINES GROUP SA-REG-S 13.37500% 22-15.10.29	306 000.00	350 370.00	0.01
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.75000% 12-29.11.27	65 000.00	3 705.00	0.00
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.00000% 12-27.01.23	300 000.00	17 100.00	0.00
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.20000% 15-26.02.25	4 600 000.00	262 200.00	0.01
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 7.05000% 15-02.11.35	523 000.00	29 811.00	0.00
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.65000% 15-03.11.28	5 549 000.00	316 293.00	0.01
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.65000% 16-22.04.24	390 000.00	22 230.00	0.00
USD LEBANON, REPUBLIC OF *DEFAULTED* 6.85000% 16-25.05.29	3 069 000.00	174 933.00	0.00
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 6.85000% 17-23.03.27	4 624 000.00	263 568.00	0.01
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 7.25000% 17-23.03.37	493 000.00	28 101.00	0.00
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 7.00000% 17-23.03.32	371 000.00	21 147.00	0.00
USD LEBANON, REPUBLIC OF *DEFAULTED* 8.25000% 18-17.05.34	12 420 000.00	707 940.00	0.02
USD LEBANON, REPUBLIC OF *DEFAULTED* 8.20000% 18-17.05.33	180 000.00	10 260.00	0.00
USD LIMAK ISKENDERUN ULUSLARARASI-REG-S 9.50000% 21-10.07.36	1 790 000.00	1 621 885.64	0.04
USD LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 3.95000% 19-16.09.29	3 454 000.00	1 529 707.52	0.04
USD MAF SUKUK LTD-REG-S 4.50000% 15-03.11.25	230 000.00	225 471.88	0.01
USD MARB BONDCO PLC-REG S-3.95000% 21-29.01.31	1 950 000.00	1 548 300.00	0.04
USD MASHREQBANK PSC-REG-S 4.25000% 19-26.02.24	201 000.00	200 226.15	0.01
USD MDGH GMTN RSC LTD-REG-S 5.08400% 23-22.05.53	246 000.00	232 777.50	0.01
USD MELCO RESORTS FINANCE LTD-REG-S 5.25000% 19-26.04.26	4 520 000.00	4 334 777.44	0.11
USD MEXICO CITY AIRPORT TRUST-144A 5.50000% 16-31.10.46	1 300 000.00	1 069 289.00	0.03
USD MEXICO CITY AIRPORT TRUST-144A 3.87500% 17-30.04.28	1 800 000.00	1 669 104.00	0.04
USD MEXICO CITY AIRPORT TRUST-REG-S 5.50000% 16-31.10.46	3 331 000.00	2 739 847.43	0.07
USD MEXICO CITY AIRPORT TRUST-REG-S 3.87500% 17-30.04.28	2 140 000.00	1 984 379.20	0.05

USD MEXICO CITY AIRPORT TRUST-REG-S 5.50000% 17-31.07.47

4 586 000.00

3 761 895.80 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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD MINEJESA CAPITAL BV-REG-S 4.62500% 17-10.08.30	1 490 000.00	1 410 076.40	0.04
USD MINEJESA CAPITAL BV-REG-S 5.62500% 17-10.08.37	1 904 000.00	1 642 200.00	0.04
USD MINERA Y METALURGICA DEL BOLEO-REG-S 3.25000% 19-17.04.24	357 000.00	354 829.44	0.01
USD MODERNA OVE PTE LTD-REG-S STEP-UP 17-30.04.27	883 749.00	273 962.19	0.01
USD MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 5.12500% 20-07.04.26	4 714 000.00	4 525 958.54	0.12
USD MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 4.45000% 21-07.07.31	530 000.00	445 258.30	0.01
USD MOROCCO, KINGDOM OF THE-REG-S 5.50000% 12-11.12.42	1 153 000.00	1 008 875.00	0.03
USD MOROCCO, KINGDOM OF-144A 5.95000% 23-08.03.28	1 558 000.00	1 589 160.00	0.04
USD NAKILAT INC-REG-S 6.06700% 06-31.12.33	2 710 000.00	2 313 004.64	0.06
USD NWD MTN LTD-REG-S 4.12500% 19-18.07.29	579 000.00	434 790.24	0.01
USD OI SA (PIK) *DEFAULTED* 10.00000% 18-27.07.25	1 100 000.00	33 000.00	0.00
USD OIL INDIA INTERNATIONAL PTE LTD-REG-S 4.00000% 17-21.04.27	800 000.00	770 192.00	0.02
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.75000% 20-28.10.27	4 850 000.00	5 080 375.00	0.13
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 7.37500% 20-28.10.32	3 168 000.00	3 524 400.00	0.09
USD OMGRID FUNDING LTD-REG-S 5.19600% 17-16.05.27	480 000.00	470 860.80	0.01
USD OZTEL HOLDINGS SPC-REG-S 6.62500% 18-24.04.28	1 200 000.00	1 239 000.00	0.03
USD PANAMA, REPUBLIC OF 8.87500% 97-30.09.27	226 000.00	245 888.00	0.01
USD PANAMA, REPUBLIC OF 7.12500% 05-29.01.26	171 000.00	175 018.50	0.00
USD PANAMA, REPUBLIC OF 6.70000% 06-26.01.36	2 022 000.00	1 938 188.10	0.05
USD PANAMA, REPUBLIC OF 4.30000% 13-29.04.53	1 401 000.00	884 731.50	0.02
USD PANAMA, REPUBLIC OF 3.75000% 15-16.03.25	3 900 000.00	3 801 720.00	0.10
USD PANAMA, REPUBLIC OF 3.87500% 16-17.03.28	2 767 000.00	2 526 271.00	0.06
USD PANAMA, REPUBLIC OF 4.50000% 18-16.04.50	1 062 000.00	701 185.50	0.02
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 5.00000% 16-15.04.26	8 897 000.00	8 855 273.07	0.23
USD PELABUHAN INDONESIA II PT-REG-S 4.25000% 15-05.05.25	1 800 000.00	1 769 625.00	0.05
USD PERU, REPUBLIC OF 2.39200% 20-23.01.26	910 000.00	865 410.00	0.02
USD PERU, REPUBLIC OF 4.12500% 15-25.08.27	650 000.00	634 725.00	0.02
USD PERU, REPUBLIC OF 7.35000% 05-21.07.25	224 000.00	230 790.00	0.01
USD PERU, REPUBLIC OF 8.75000% 03-21.11.33	735 000.00	915 075.00	0.02
USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 5.37500% 18-25.01.29	490 000.00	490 612.50	0.01
USD PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 2.55000% 21-09.06.31	2 040 000.00	1 746 974.40	0.04
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 9.75000% 12-17.05.35	1 493 000.00	182 892.50	0.00
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 6.00000% 14-16.05.24	33 023 021.00	3 549 974.76	0.09
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 7.75000% 06-14.01.31	300 000.00	349 875.00	0.01
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 6.37500% 09-23.10.34	300 000.00	332 658.00	0.01
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 3.95000% 15-20.01.40	656 000.00	569 152.16	0.01
USD PHOENIX LEAD LTD-REG-S-SUB 4.85000% 17-PRP	500 000.00	400 500.00	0.01
USD POLAND, REPUBLIC OF 4.87500% 23-04.10.33	1 009 000.00	1 003 702.75	0.03
USD POLAND, REPUBLIC OF 5.50000% 23-04.04.53	5 037 000.00	5 091 651.45	0.13
USD POWER FINANCE CORP LTD-REG-S 4.50000% 19-18.06.29	760 000.00	729 828.00	0.02
USD QATAR, STATE OF-REG-S 3.25000% 16-02.06.26	200 000.00	194 000.00	0.00
USD QIB SUKUK LTD-REG-S 1.950000% 20-27.10.25	1 780 000.00	1 674 312.50	0.04
USD REDSUN PROPERTIES GRP-REG-S *DEFAULTED* 7.30000% 21-13.01.25	250 000.00	1 250.00	0.00
USD REPUBLIC OF AZERBAIJAN-REG-S 3.50000% 17-01.09.32	10 650 000.00	9 100 425.00	0.23
USD RUSSIA, FEDERATION OF-REG-S 4.75000% 16-27.05.26	17 400 000.00	1.74	0.00
USD RUSSIA, FEDERATION OF-REG-S 4.25000% 17-23.06.27	8 000 000.00	0.80	0.00
USD RZD CAP /RUS RAIL LPN-REG-S *DEFAULTED* 5.70000% 12-05.04.22	2 850 000.00	142 500.00	0.00
USD SABIC CAPTIAL BV-REG-S 2.15000% 20-14.09.30	1 265 000.00	1 067 343.75	0.03
USD SAMBA FUNDING LTD-REG-S 2.90000% 20-29.01.27	1 000 000.00	936 250.00	0.02
USD SANDS CHINA LTD STEP-UP 19-08.08.25	1 630 000.00	1 612 926.08	0.04
USD SAUDI ELECTRICITY GLOBAL SUKIK CO REG-S 5.50000% 14-08.04.44	2 056 000.00	2 002 030.00	0.05
USD SAUDI ELECTRICITY GLOBAL SUKUK CO-REG-S 4.72300% 18-27.09.28	1 643 000.00	1 632 731.25	0.04
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 5.25000% 19-16.01.50	2 593 000.00	2 419 074.52	0.06
USD SENEGAL, REPUBLIC OF-REG-S 6.25000% 17-23.05.33	898 000.00	774 525.00	0.02
USD SEPLAT PETROLEUM DEVELOPMENT CO-REG-S 7.75000% 21-01.04.26	7 550 000.00	6 964 875.00	0.18
USD SHARJAH SUKUK PROGRAM LTD-REG-S 3.23400% 19-23.10.29	1 390 000.00	1 240 575.00	0.03
USD SHINHAN CARD CO LTD-REG-S 1.37500% 21-23.06.26	1 480 000.00	1 352 498.00	0.03
USD SNB SUKUK LTD-REG-S 2.34200% 22-19.01.27	1 094 000.00	1 008 873.13	0.03

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)	
USD	SOCOMBANK CAP DAC-REG-S-SUB *DEFAULTED* 8.00000% 19-07.04.30	3 730 000.00	186 500.00	0.00
USD	SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 4.30000% 16-12.10.28	6 962 000.00	6 374 929.35	0.16
USD	SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.00000% 16-12.10.46	9 106 000.00	6 305 905.00	0.16
USD	SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.87500% 18-22.06.30	360 000.00	338 238.00	0.01
USD	SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 6.30000% 18-22.06.48	4 150 000.00	3 326 484.38	0.08
USD	SOUTHERN GAS CORRIDOR CJSC-REG-S 6.87500% 16-24.03.26	18 707 000.00	18 894 070.00	0.48
USD	SRI LANKA, DEMO REP OF-REG-S *DEFAULT* 6.85000% 15-03.11.25	200 000.00	104 272.00	0.00
USD	STAR ENERGY GEOTHERMAL DARAJAT II-REG-S 4.85000% 20-14.10.38	750 000.00	686 655.00	0.02
USD	STATE OIL OF THE AZERBAIJAN REP-REG-S 6.95000% 15-18.03.30	5 557 000.00	5 723 710.00	0.15
USD	SUNAC CHINA HOLDINGS-REG-S *DEFAULTED* 7.95000% 19-11.10.23	200 000.00	28 000.00	0.00
USD	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S (PIK) 6.00000% 23-30.09.25	412 146.00	51 518.26	0.00
USD	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S (PIK) 6.25000% 23-30.09.26	412 146.00	47 396.79	0.00
USD	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S (PIK) 6.50000% 23-30.09.27	824 311.00	86 552.66	0.00
USD	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S (PIK) 6.75000% 23-30.09.28	1 236 476.00	114 374.04	0.00
USD	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S (PIK) 7.00000% 23-30.09.29	1 236 476.00	98 918.08	0.00
USD	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S (PIK) 7.25000% 23-30.09.30	584 150.00	40 890.50	0.00
USD	TML HOLDINGS PTE LTD-REG-S 4.35000% 21-09.06.26	300 000.00	284 991.00	0.01
USD	TNB GLOBAL VENTURES CAPITAL-REG-S 4.85100% 18-01.11.28	500 000.00	497 510.00	0.01
USD	TULLOW OIL PLC-REG-S 7.00000% 18-01.03.25	120 000.00	113 475.00	0.00
USD	TURKEY, REPUBLIC OF 4.25000% 15-14.04.26	4 005 000.00	3 814 762.50	0.10
USD	TURKEY, REPUBLIC OF 6.12500% 18-24.10.28	3 049 000.00	2 925 058.15	0.07
USD	TURKEY, REPUBLIC OF 5.87500% 21-26.06.31	4 787 000.00	4 299 922.75	0.11
USD	URUGUAY, REPUBLIC OF 7.62500% 06-21.03.36	4 340 419.00	5 289 885.66	0.13
USD	URUGUAY, REPUBLIC OF 5.10000% 14-18.06.50	880 645.00	856 779.52	0.02
USD	URUGUAY, REPUBLIC OF 4.97500% 18-20.04.55	3 692 196.00	3 468 818.14	0.09
USD	VALE OVERSEAS LTD 6.87500% 09-10.11.39	250 000.00	270 000.00	0.01
USD	VALE OVERSEAS LTD 8.25000% 04-17.01.34	190 000.00	223 953.00	0.01
USD	VEDANTA RESOURCES FINANCE II PLC-REG-S STEP-UP 21-09.12.28	2 660 000.00	2 314 200.00	0.06
USD	VEDANTA RESOURCES FINANCE II PLC-REG-S 13.87500% 20-21.01.27	600 000.00	564 450.00	0.01
USD	VENEZUELA, REP. OF REG-S *DEFAULTED* 11.75000% 11-21.10.26	4 098 600.00	731 600.10	0.02
USD	VENEZUELA, REP. OF-REG-S *DEFAULTED* 9.00000% 08-07.05.23	378 000.00	52 920.00	0.00
USD	VENEZUELA, REP. OF-REG-S *DEFAULTED* 9.25000% 08-07.05.28	3 897 000.00	629 365.50	0.02
USD	VENEZUELA, REP. OF-REG-S *DEFAULTED* 12.75000% 10-23.08.22	2 305 600.00	328 548.00	0.01
USD	VENEZUELA, REP. OF-REG-S *DEFAULTED* 11.95000% 11-05.08.31	6 785 300.00	1 211 176.05	0.03
USD	VENEZUELA, REPUBLIC OF *DEFAULTED* 9.25000% 97-15.09.27	1 002 000.00	178 857.00	0.00
USD	WE SODA INVESTMENTS HOLDING PLC-REG-S 9.50000% 23-06.10.28	6 765 000.00	6 900 300.00	0.18
USD	WEST CHINA CEMENT LTD-REG-S 4.95000% 21-08.07.26	310 000.00	228 625.00	0.01
USD	WOORI BANK-REG-S-SUB 4.75000% 14-30.04.24	1 000 000.00	997 400.00	0.03
USD	XIAOMI BEST TIME INTER LTD-REG-S 4.10000% 21-14.07.51	2 254 000.00	1 618 417.08	0.04
USD	YUNDA HOLDING INVESTMENT LTD-REG-S 2.25000% 20-19.08.25	6 136 000.00	5 688 133.36	0.14
USD	YUZHOU GROUP HOLDINGS-REG-S *DEFAULTED* 6.35000% 21-13.01.27	650 000.00	45 500.00	0.00
USD	YUZHOU PROPERTIES-REG-S *DEFAULTED* 8.50000% 19-04.02.23	200 000.00	14 000.00	0.00
USD	YUZHOU PROPERTIES-REG-S *DEFAULTED* 8.50000% 19-26.02.24	430 000.00	30 100.00	0.00
USD	ZAMBIA, REPUBLIC OF-REG-S *DEFAULTED* 5.37500% 12-20.09.22	1 722 000.00	972 465.06	0.02
USD	ZHENRO PROP GROUP-REG-S *DEFAULTED* 6.63000% 21-07.01.26	1 765 000.00	13 237.50	0.00
USD	ZHENRO PROP GROUP-REG-S *DEFAULTED* 6.70000% 21-04.08.26	5 382 000.00	40 365.00	0.00
USD	ZHENRO PROPER GRP LTD-REG-S *DEFAULTED* 9.15000% 19-06.05.23	200 000.00	1 500.00	0.00
USD	ZIRAAT KATILIM VARLIK KIRALAMA AS-REG-S 9.37500% 23-12.11.26	1 852 000.00	1 948 072.50	0.05
米ドル合計			486 799 345.78	12.40
債券、固定利付債合計			523 683 672.27	13.34

債券、ゼロ・クーポン

USD	CFLD CAYMAN INVESTMENT LTD-REG-S 0.00000% 23-31.01.31	11 260.00	112.60	0.00
-----	---	-----------	--------	------

USD	ECUADOR SOCIAL BOND SARL-REG-S 0.00000% 20-30.01.35	6 810 000.00	1 801 487.34	0.05
米ドル合計			1 801 599.94	0.05
債券、ゼロ・クーポン合計			1 801 599.94	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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / 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	1 776 000.00	1 653 294.65	0.04
USD BANCO DAVIVIENDA SA-REG-S-SUB 6.650%/VAR 21-PRP	3 564 000.00	2 506 561.20	0.06
USD BANCOLOMBIA SA-SUB COCO 4.625%/VAR 19-18.12.29	7 494 000.00	6 991 902.00	0.18
USD BANK NEGARA INDONESIA PERSERO-REG-S-SUB 4.300%/VAR 21-PRP	5 761 000.00	5 170 497.50	0.13
USD CASHLD FLR REG-S-SUB 4.000%/VAR 21-PRP	6 404 000.00	5 537 980.68	0.14
USD CEMEX SAB DE CV-REG-S-SUB 9.125%/VAR 23-PRP	5 274 000.00	5 579 628.30	0.14
USD CHINA CONSTRUCTION BK CORP-REG-S-SUB 2.450%/VAR 20-24.06.30	900 000.00	862 740.00	0.02
USD CLP POWER HK FINANCE LTD-REG-S-SUB 3.550%/VAR 19-PRP	400 000.00	390 499.75	0.01
USD DIB TIER 1 SUKUK 3 LTD-REG-S-SUB 6.250%/VAR 19-PRP	1 330 000.00	1 322 086.50	0.03
USD ELECT GLOBAL INVESTMENTS LTD-REG-S-SUB 4.100%/VAR 20-PRP	1 700 000.00	1 446 700.00	0.04
USD EMIRATES NBD PJSC-REG-S-SUB 6.125%/VAR 19-PRP	1 300 000.00	1 291 875.00	0.03
USD FIRST ABU DHABI BANK-REG-S-SUB 4.500%/VAR 20-PRP	750 000.00	717 890.63	0.02
USD GLOBE TELECOM INC-REG-S 4.200%/VAR 21-PRP	2 430 000.00	2 317 418.10	0.06
USD HDFC BANK LTD-REG-S-SUB COCO 3.700%/VAR 21-PRP	4 667 000.00	4 276 138.75	0.11
USD HONG KONG AIRPORT AUTHORITY 2.400%/VAR 20-PRP	1 580 000.00	1 410 328.35	0.04
USD KAISA GROUP HOLDINGS-REG-S* DEFAULTED* 10.875%/VAR 20-PRP	920 000.00	26 762.80	0.00
USD MAF GLOBAL SECURITIES LTD-REG-S-SUB 6.375%/VAR 18-PRP	2 410 000.00	2 372 343.75	0.06
USD MODERN LAND CHINA CO LTD-REG-S (PIK) 9.000%/VAR 22-30.12.27	456 248.00	638.75	0.00
USD NBK TIER 1 FINANCING 2 LTD-REG-S-SUB 4.500%/VAR 19-PRP	10 455 000.00	9 997 593.75	0.25
USD NBK TIER 1 FINANCING LTD-REG-S-SUB 3.625%/VAR 21-PRP	1 270 000.00	1 147 365.63	0.03
USD NETWORK I2I LTD-REG-S-SUB 5.650%/VAR 19-PRP	8 041 000.00	7 940 487.50	0.20
USD NETWORK I2I LTD-REG-S-SUB 3.975%/VAR 21-PRP	430 000.00	403 125.00	0.01
USD NWD FINANCE BVI LTD-REG-S 5.250%/VAR 20-PRP	600 000.00	393 600.00	0.01
USD OVERSEA-CHINESE BNKNG CORP-REG-S-SUB 4.602%/VAR 22-15.06.32	3 110 000.00	3 056 134.80	0.08
USD POWERCHINA ROADBRIDGE GRP BRITISH-REG-S 3.080%/VAR 21-PRP	394 000.00	374 457.60	0.01
USD RIYAD BANK 3.174%/VAR 20-25.02.30	230 000.00	221 518.75	0.00
USD SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD-REG-S-SUB 2.875%/VAR 21-PRP	1 960 000.00	1 819 134.80	0.05
USD SMC GLOBAL POWER HOLDINGS CORP-REG-S 6.500%/VAR 19-PRP	270 000.00	258 606.00	0.01
USD TRAFIGURA GROUP PTE LTD-REG-S-SUB 5.875%/VAR 21-PRP	300 000.00	273 000.00	0.01
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S VAR 15-01.08.41	5 821 000.00	2 654 084.95	0.07
USD URUGUAY, REPUBLIC OF (PIK) 7.87500% 03-15.01.33	2 230 373.00	2 690 945.03	0.07
USD YUZHOU PROPERTIES-REG-S* DEFAULTED* 5.375%/VAR 17-PRP	2 670 000.00	26 700.00	0.00
USD ZHENRO PROPERT GRP LTD-REG-S* DEFAULTED* 10.250%/VAR 19-PRP	200 000.00	2 282.00	0.00
米ドル合計		75 134 322.52	1.91
債券、変動利付債合計		75 134 322.52	1.91
財務省証券(T-note)、固定利付債			
USD			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.50000% 23-15.02.33	1 882 400.00	1 818 354.28	0.05
USD AMERICA, UNITED STATES OF 4.12500% 22-15.11.32	2 085 000.00	2 112 365.62	0.05
米ドル合計		3 930 719.90	0.10
財務省証券(T-note)、固定利付債合計		3 930 719.90	0.10
転換社債型新株予約権付社債、固定利付債			
USD			
USD CFLD CAYMAN INVESTMENT LTD-REG-S 2.50000% 23-31.01.31	102 740.00	3 766.45	0.00
USD CFLD CAYMAN INVESTMENT LTD-REG-S 2.50000% 23-31.01.31	44 000.00	1 349.04	0.00
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S (PIK) 1.00000% 23-30.09.32	806 081.00	45 970.80	0.00
米ドル合計		51 086.29	0.00
転換社債型新株予約権付社債、固定利付債合計		51 086.29	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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / 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、ゼロ・クーポン			
USD			
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 0.00000% 23-30.09.28	1 294 326.00	275 976.19	0.01
米ドル合計		275 976.19	0.01
転換社債型新株予約権付社債、ゼロ・クーポン合計			
		275 976.19	0.01
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		3 690 676 567.58	94.04

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

ノート、固定利付債

USD			
USD 3R LUX SARL-REG-S 9.75000% 24-05.02.31	356 000.00	354 871.48	0.01
USD ACU PETROLEO LUXEMBOURG-REG-S 7.50000% 22-13.01.32	3 755 000.00	3 471 906.61	0.09
USD AGROSUPER SA-REG-S 4.60000% 22-20.01.32	650 000.00	552 500.00	0.01
USD ALFA SAB DE CV-REG-S 6.87500% 14-25.03.44	2 926 000.00	2 887 596.25	0.07
USD ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC-144A 5.50000% 23-02.05.33	1 430 000.00	1 430 171.60	0.04
USD ATP TOWER HOLDINGS LLC-144A 4.05000% 21-27.04.26	2 280 000.00	2 086 792.80	0.05
USD BANGKOK BANK PUBLIC CO LTD HK-REG-S-SUB 9.02500% 97-15.03.29	600 000.00	692 952.00	0.02
USD BRAZIL MINAS SPE-REG-S 5.33300% 13-15.02.28	11 266 000.00	5 553 349.38	0.14
USD C&W SENIOR FIN DESIGNATD ACT V CO-REG-S 6.87500% 17-15.09.27	260 000.00	245 510.20	0.01
USD CAP SA-REG-S 3.90000% 21-27.04.31	850 000.00	659 546.88	0.02
USD CELULOSA ARAUCO Y CONSTITUCION SA-REG-S 5.15000% 19-29.01.50	200 000.00	161 187.50	0.00
USD CHILE ELECTRICITY LUX MPC SARL-REG-S 6.01000% 23-20.01.33	1 907 000.00	1 946 493.97	0.05
USD CIBANCO SA INSTITUCION DE BANCA M-144A 4.37500% 21-22.07.31	2 970 000.00	2 242 350.00	0.06
USD CIFI HOLD GROUP CO LTD-REG-S *DEFAULTED* 4.80000% 21-17.05.28	700 000.00	60 102.00	0.00
USD COLBUN SA-REG-S 3.15000% 20-06.03.30	350 000.00	308 437.50	0.01
USD CSN RESOURCES SA REG-S 5.87500% 22-08.04.32	1 345 000.00	1 146 612.50	0.03
USD DIGICEL INTL FINANC/HOLDINGS-REG-S PIK 13.00000% 23-31.12.25	694 769.00	466 155.26	0.01
USD FIRST QUANTUM MINERALS LTD-144A 6.87500% 20-15.10.27	3 152 000.00	2 833 553.44	0.07
USD FIRST QUANTUM MINERALS LTD-REG-S 6.87500% 20-15.10.27	2 970 000.00	2 637 924.30	0.07
USD FIRST QUANTUM MINERALS LTD-REG-S 8.62500% 23-01.06.31	3 930 000.00	3 608 231.25	0.09
USD INRETAIL CONSUMER-REG-S 3.25000% 21-22.03.28	6 670 000.00	5 923 793.75	0.15
USD INTERCHILE SA-144A 4.50000% 21-30.06.56	904 000.00	720 126.40	0.02
USD INVERSIONES CMPC SA-REG-S 4.75000% 14-15.09.24	240 000.00	237 450.00	0.01
USD INVERSIONES CMPC SA-REG-S 3.85000% 20-13.01.30	1 220 000.00	1 102 575.00	0.03
USD JBS USA LUX SA / JBS USA FOOD CO 3.62500% 23-15.01.32	510 000.00	434 141.58	0.01
USD JBS USA LUX SA / JBS 5.75000% 23-01.04.33	400 000.00	396 023.43	0.01
USD KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV-144A 3.80000% 14-08.04.24	140 000.00	139 073.20	0.00
USD KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV-144A 3.25000% 15-12.03.25	307 000.00	298 419.35	0.01
USD METALSA SA DE CV-REG-S 3.75000% 21-04.05.31	400 000.00	326 125.00	0.01
USD MINERA MEXICO SA DE CV-144A 4.50000% 19-26.01.50	810 000.00	629 775.00	0.02
USD MINERA MEXICO SA DE CV-REG-S 4.50000% 19-26.01.50	5 163 000.00	4 014 232.50	0.10
USD MV24 CAPITAL BV-REG-S 6.74800% 19-01.06.34	9 633 000.00	7 239 464.60	0.18
USD PERU, REPUBLIC OF 5.62500% 10-18.11.50	1 533 000.00	1 542 964.50	0.04
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 6.00000% 13-15.11.26	22 988 469.00	2 471 260.42	0.06
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 6.00000% 14-28.10.22	31 450 000.00	781 164.54	0.02
USD SABLE INTERNATIONAL FINANCE LTD-REG-S 5.75000% 19-07.09.27	1 300 000.00	1 248 000.00	0.03
USD SAMARCO MINERACAO SA-REG-S (PIK) STEP-UP 23-30.06.31	550 000.00	456 775.00	0.01
USD SIERRACOL ENERGY ANDINA LLC-REG-S 6.00000% 21-15.06.28	1 200 000.00	1 003 875.00	0.03
USD TENGIZCHEVROIL FINANCE CO INTL-REG-S 3.25000% 20-15.08.30	1 835 000.00	1 509 012.25	0.04
USD TENGIZCHEVROIL FINANCE CO INTL-REG-S 2.62500% 20-15.08.25	5 470 000.00	5 150 387.90	0.13
米ドル合計		68 970 884.34	1.76
ノート、固定利付債合計		68 970 884.34	1.76

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
ノート、ゼロ・クーポン			
USD			
USD DELTA MERLIN DUNIA TE 0.00000% 21-26.06.32	1 055 000.00	61 770.25	0.00
米ドル合計		61 770.25	0.00
ノート、ゼロ・クーポン合計		61 770.25	0.00
ノート、変動利付債			
USD			
USD BANCO INDUSTRIAL SA/GUATE-REG-S-SUB 4.875%/VAR 21-29.01.31	3 130 000.00	2 956 871.87	0.08
USD CEMEX SAB DE CV-144A-SUB 5.125%/VAR 21-PRP	900 000.00	854 100.00	0.02
米ドル合計		3 810 971.87	0.10
ノート、変動利付債合計		3 810 971.87	0.10
中期債券、固定利付債			
USD			
USD HDFC BANK LTD/GIFT CITY-REG-S 5.68600% 23-02.03.26	400 000.00	403 188.00	0.01
USD JSW INFRASTRUCTURE LTD-REG-S 4.95000% 22-21.01.29	500 000.00	465 625.00	0.01
USD PETRONAS CAPITAL LTD-REG-S 3.50000% 15-18.03.25	2 800 000.00	2 747 150.00	0.07
米ドル合計		3 615 963.00	0.09
中期債券、固定利付債合計		3 615 963.00	0.09
債券、固定利付債			
USD			
USD ARABIAN CENTRES SUKUK LTD-REG-S 5.37500% 19-26.11.24	305 000.00	298 709.38	0.01
USD BORR IHC LTD / BORR FINANCE LLC-REG-S 10.00000% 23-15.11.28	400 000.00	414 000.00	0.01
USD CENTRAL CHINA REAL *DEFAULTED* 7.25000% 23-28.04.25	1 540 000.00	69 492.50	0.00
USD CIA CERVECERIAS UNIDAS SA-144A 3.35000% 22-19.01.32	2 010 000.00	1 703 977.50	0.04
USD MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 3.50000% 21-07.07.27	2 236 000.00	1 987 490.96	0.05
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 9.00000% 11-17.11.21	2 611 961.00	306 905.42	0.01
USD PETROLIAM NASIONALBERHAD-144A 7.62500% 96-28.10.26	3 230 000.00	3 443 664.50	0.09
USD REPUBLIC OF AZERBAIJAN-REG-S 5.12500% 17-01.09.29	1 200 000.00	1 163 796.00	0.03
USD TENGIZCHEVROIL FINANCE CO INT-REG-S 4.00000% 16-15.08.26	2 253 000.00	2 119 002.82	0.05
米ドル合計		11 507 039.08	0.29
債券、固定利付債合計		11 507 039.08	0.29
債券、変動利付債			
USD			
USD BANCO BILBAO VIZCA ARGENTARIA SA 5.862%/VAR 14.09.22-14.09.26	200 000.00	201 192.71	0.01
米ドル合計		201 192.71	0.01
債券、変動利付債合計		201 192.71	0.01
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品 合計		88 167 821.25	2.25
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 OI SA-REG-S 14.00000% 23-07.09.24	1 584 873.34	1 576 948.98	0.04
米ドル合計		1 576 948.98	0.04
ノート、固定利付債合計		1 576 948.98	0.04
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		1 576 948.98	0.04
投資有価証券合計		3 780 421 337.81	96.33

添付の注記は当財務書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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / 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 BTP ITALY GOVERNMENT FUTURE 07.03.24	-59.00	-214 262.81	-0.01
EUR EURO-BUND FUTURE 07.03.24	-667.00	-1 142 800.18	-0.03
EUR EURO-BOBL FUTURE 07.03.24	-214.00	-257 462.97	-0.01
EUR EURO-SCHATZ FUTURE 07.03.24	-1.00	-1 292.64	0.00
EUR EURO-BUXL FUTURE 07.03.24	-158.00	-325 158.07	-0.01
USD US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 19.03.24	283.00	1 380 781.13	0.04
USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 19.03.24	-323.00	-304 993.37	-0.01
USD US LONG BOND FUTURE 19.03.24	818.00	4 025 839.49	0.11
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.03.24	142.00	-644 471.56	-0.02
USD US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 28.03.24	570.00	844 509.85	0.02
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 28.03.24	1 364.00	1 835 362.01	0.05
債券に係る金融先物合計		5 196 050.88	0.13
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		5 196 050.88	0.13
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/MARKIT CDX.EM S40 V1 PAY TP 1.00000% 23-20.12.28	-27 645 000.00	925 591.46	0.03
USD ICE/SAUDI GOVERNMENT INT TP CREDIT DEFAULT SWAP PAY 1.00000% 23-20.12.28	-1 350 000.00	-25 741.92	0.00
USD ICE/TURKEY CREDIT DEFAULT SWAP REC TP 1.00000% 23-20.06.28	2 715 000.00	-211 627.91	-0.01
クレジット・デフォルト・スワップ合計		688 221.63	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		688 221.63	0.02
派生商品合計		5 884 272.51	0.15

* 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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面			米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
先渡為替契約					
購入通貨	購入額	売却通貨	売却額	満期日	
USD	108 173 423.42	EUR	98 607 491.00	4.3.2024	922 098.31 0.02
USD	63 566 570.31	EUR	58 633 661.72	14.2.2024	-157 281.46 0.00
USD	2 065 361.51	EUR	1 908 199.00	4.3.2024	-10 108.31 0.00
USD	1 641 563.91	EUR	1 516 000.00	20.3.2024	-8 563.61 0.00
USD	489 412.44	EUR	451 000.00	20.3.2024	-1 489.61 0.00
USD	584 355.55	EUR	540 000.00	20.3.2024	-3 420.74 0.00
USD	532 272.17	EUR	492 000.00	20.3.2024	-3 257.34 0.00
USD	79 151 067.37	EUR	71 924 000.00	20.3.2024	863 618.89 0.02
USD	5 117 586.51	EUR	4 648 000.00	4.3.2024	62 147.48 0.00
USD	1 071 483.75	EUR	973 000.00	20.3.2024	12 397.95 0.00
USD	728 605.59	EUR	665 000.00	20.3.2024	4 769.97 0.00
USD	4 180 783.01	EUR	3 827 336.17	15.2.2024	20 992.38 0.00
USD	846 630.52	EUR	775 055.68	15.2.2024	4 251.07 0.00
USD	3 859 026.83	EUR	3 518 000.00	20.3.2024	29 773.12 0.00
USD	1 210 558.25	EUR	1 100 000.00	20.3.2024	13 236.17 0.00
EUR	622 000.00	USD	683 633.79	20.3.2024	-6 602.58 0.00
USD	3 543 378.63	EUR	3 232 608.57	14.2.2024	30 136.18 0.00
CHF	525 294 559.13	USD	612 667 000.00	22.2.2024	1 056 005.85 0.03
EUR	1 224 308 158.14	USD	1 335 146 000.00	22.2.2024	-4 064 472.24 -0.10
GBP	45 318 704.23	USD	57 306 000.00	22.2.2024	414 717.10 0.01
SGD	15 037 094.95	USD	11 237 000.00	22.2.2024	26 150.96 0.00
JPY	1 127 570 202.00	USD	7 727 000.00	22.2.2024	12 368.02 0.00
USD	3 000 000.00	EUR	2 754 598.34	22.2.2024	5 169.86 0.00
USD	200 000.00	JPY	29 163 040.00	22.2.2024	-168.02 0.00
USD	2 984 498.97	EUR	2 740 000.00	20.3.2024	2 078.51 0.00
EUR	2 245 000.00	USD	2 443 969.86	20.3.2024	-344.34 0.00
EUR	1 480 000.00	USD	1 610 462.00	20.3.2024	480.44 0.00
EUR	214 000.00	USD	232 656.41	20.3.2024	277.16 0.00
USD	4 691 012.06	EUR	4 311 000.00	20.3.2024	-1 402.02 0.00
EUR	427 000.00	USD	466 649.90	20.3.2024	-1 871.24 0.00
EUR	280 000.00	USD	303 973.94	20.3.2024	798.95 0.00
EUR	2 154 000.00	USD	2 331 278.94	20.3.2024	13 295.39 0.00
EUR	571 000.00	USD	620 412.80	20.3.2024	1 106.21 0.00
USD	2 863 313.75	EUR	2 628 000.00	4.3.2024	4 945.90 0.00
先渡為替契約合計					-758 165.64 -0.02
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					80 778 677.28 2.06
当座借越およびその他の短期負債					-3 799 550.82 -0.10
その他の資産および負債					62 065 821.51 1.58
純資産総額					3 924 592 392.65 100.00

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット・サステナブル

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
株式			
アメリカ合衆国			
USD BK OF AMERICA CORP 5.2%-FRN SUB PERP USD1000 ' U	1 694 000.00	1 701 606.06	0.03
USD GOLDMAN SACHS GRP 5% BDS 31/12/49 USD1000	2 982 000.00	2 980 509.00	0.06
USD TRUIST FINL CORP 5.05%-FR SUB PERP USD1000 ' G	1 256 000.00	1 267 404.48	0.02
アメリカ合衆国合計		5 949 519.54	0.11
株式合計		5 949 519.54	0.11
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	7 075 609.77	0.13
ユーロ合計		7 075 609.77	0.13
USD			
USD MIDOCEAN CREDIT CLO III -144A 3M LIBOR+112BP 18-21.04.31	3 000 000.00	2 126 431.50	0.04
米ドル合計		2 126 431.50	0.04
アセット・バック証券、変動利付債合計		9 202 041.27	0.17
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	1 928 215.25	0.04
EUR PROLOGIS EURO FINANCE LLC 0.37500% 20-06.02.28	5 565 000.00	5 386 561.89	0.10
ユーロ合計		7 314 777.14	0.14
USD			
USD ABBVIE INC 2.95000% 20-21.11.26	3 269 000.00	3 133 059.25	0.06
USD ABBVIE INC 3.20000% 16-14.05.26	2 130 000.00	2 067 087.71	0.04
USD ABBVIE INC 3.20000% 20-21.11.29	7 800 000.00	7 270 352.08	0.14
USD ABBVIE INC 3.60000% 15-14.05.25	3 358 000.00	3 302 611.50	0.06
USD ABBVIE INC 4.05000% 20-21.11.39	1 730 000.00	1 565 091.23	0.03
USD ADVANCE AUTO PARTS INC 5.90000% 23-09.03.26	3 363 000.00	3 358 272.53	0.06
USD AEP TEXAS INC 2.10000% 20-01.07.30	9 100 000.00	7 660 459.35	0.14
USD AEP TEXAS INC 4.70000% 22-15.05.32	3 225 000.00	3 146 086.44	0.06
USD AEP TEXAS INC 5.40000% 23-01.06.33	625 000.00	638 595.94	0.01
USD AERCAP IRE CAP LTD/GLB AVIA TRUST 4.45000% 18-01.10.25	1 075 000.00	1 057 770.35	0.02
USD AERCAP IRE CAP LTD/GLB AVIA TRUST 1.75000% 21-30.01.26	4 600 000.00	4 284 650.59	0.08
USD AERCAP IRELAND CAP/ GLBL AVIATION TRUST 6.50000% 20-15.07.25	640 000.00	649 005.45	0.01
USD AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCAP GLO 3.00000% 21-29.10.28	9 860 000.00	8 946 007.29	0.17
USD AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCAP GLO 3.30000% 21-30.01.32	2 780 000.00	2 382 795.35	0.04
USD AETNA INC 3.50000% 14-15.11.24	1 000 000.00	985 656.83	0.02
USD AGILENT TECHNOLOGIES INC 2.10000% 20-04.06.30	3 150 000.00	2 703 477.14	0.05
USD AGILENT TECHNOLOGIES INC 2.30000% 21-12.02.31	2 000 000.00	1 712 449.22	0.03
USD AIR LEASE CORP 1.87500% 21-15.08.26	2 570 000.00	2 365 264.40	0.04
USD AIR LEASE CORP 3.25000% 18-01.03.25	2 265 000.00	2 211 836.50	0.04
USD AIR LEASE CORP 3.25000% 19-01.10.29	4 825 000.00	4 363 373.92	0.08
USD AIR LEASE CORP 3.62500% 17-01.04.27	1 270 000.00	1 205 699.42	0.02
USD AIR LEASE CORP 3.62500% 17-01.12.27	1 604 000.00	1 522 788.86	0.03
USD AIR LEASE CORP 4.62500% 18-01.10.28	1 500 000.00	1 472 642.46	0.03
USD AIRCASTLE LTD 4.25000% 19-15.06.26	72 000.00	69 780.24	0.00
USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC 3.45000% 17-30.04.25	1 015 000.00	993 952.97	0.02
USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC 2.75000% 19-15.12.29	1 600 000.00	1 420 994.32	0.03
USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITY INC 1.87500% 20-01.02.33	3 500 000.00	2 692 017.51	0.05
USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC 2.95000% 22-15.03.34	5 930 000.00	4 916 766.04	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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD ALIBABA GROUP HOLDING LTD 2.12500% 21-09.02.31	2 571 000.00	2 138 943.45	0.04
USD ALLSTATE CORP 5.25000% 23-30.03.33	3 423 000.00	3 489 340.51	0.07
USD ALLY FINANCIAL INC 3.87500% 19-21.05.24	4 585 000.00	4 558 223.05	0.09
USD ALLY FINANCIAL INC 4.62500% 15-30.03.25	2 114 000.00	2 091 916.12	0.04
USD ALLY FINANCIAL INC 5.80000% 20-01.05.25	7 500 000.00	7 526 198.63	0.14
USD ALLY FINANCIAL INC 8.00000% 08-01.11.31	2 892 000.00	3 199 892.30	0.06
USD ALPHABET INC 1.10000% 20-15.08.30	4 000 000.00	3 311 678.72	0.06
USD AMAZON.COM INC 4.70000% 22-01.12.32	7 295 000.00	7 427 037.31	0.14
USD AMCOR FINANCE USA INC 3.62500% 20-28.04.26	2 950 000.00	2 854 875.86	0.05
USD AMCOR FINANCE USA INC 5.62500% 23-26.05.33	935 000.00	968 876.07	0.02
USD AMERICAN ASSETS TRUST LP 3.37500% 21-01.02.31	1 340 000.00	1 110 844.75	0.02
USD AMERICAN EXPRESS CO 3.12500% 19-20.05.26	4 135 000.00	3 993 534.50	0.07
USD AMERICAN EXPRESS CO 2.55000% 22-04.03.27	3 165 000.00	2 967 755.40	0.06
USD AMERICAN HOMES 4 RENT LP 3.62500% 22-15.04.32	720 000.00	642 809.06	0.01
USD AMERICAN HOMES 4 RENT LP 5.50000% 24-01.02.34	11 875 000.00	11 996 903.88	0.23
USD AMERICAN TOWER CORP 3.37500% 16-15.10.26	1 990 000.00	1 911 577.54	0.04
USD AMERICAN TOWER CORP 3.12500% 16-15.01.27	1 640 000.00	1 560 248.70	0.03
USD AMERICAN TOWER CORP 3.55000% 17-15.07.27	4 000 000.00	3 839 193.32	0.07
USD AMERICAN TOWER CORP 3.80000% 19-15.08.29	4 048 000.00	3 819 391.34	0.07
USD AMERICAN TOWER CORP 2.10000% 20-15.06.30	274 000.00	230 133.11	0.00
USD AMERICAN TOWER CORP 1.87500% 20-15.10.30	4 387 000.00	3 596 208.77	0.07
USD AMERICAN TOWER CORP 2.70000% 21-15.04.31	1 650 000.00	1 414 212.49	0.03
USD AMERICAN TOWER CORP 1.45000% 21-15.09.26	3 765 000.00	3 441 321.33	0.06
USD AMERICAN TOWER CORP 4.05000% 22-15.03.32	4 375 000.00	4 087 686.31	0.08
USD AMERICAN TOWER CORP 5.50000% 23-15.03.28	5 085 000.00	5 197 151.91	0.10
USD AMERICAN TOWER CORP 5.25000% 23-15.07.28	457 000.00	463 567.29	0.01
USD AMERICAN TOWER CORP 5.55000% 23-15.07.33	1 593 000.00	1 636 214.10	0.03
USD AMERICAN TOWER CORP 5.80000% 23-15.11.28	7 170 000.00	7 434 465.88	0.14
USD AMERICAN WATER CAPITAL CORP 2.95000% 17-01.09.27	2 505 000.00	2 366 815.51	0.04
USD AMERICAN WATER CAPITAL CORP 3.45000% 19-01.06.29	5 670 000.00	5 370 178.45	0.10
USD AMGEN INC 1.65000% 21-15.08.28	7 550 000.00	6 670 217.52	0.13
USD AMGEN INC 2.20000% 20-21.02.27	5 845 000.00	5 446 581.60	0.10
USD AMGEN INC 2.30000% 20-25.02.31	1 443 000.00	1 231 883.00	0.02
USD AMGEN INC 2.60000% 16-19.08.26	7 000 000.00	6 660 125.64	0.12
USD AMGEN INC 3.20000% 17-02.11.27	1 464 000.00	1 397 950.95	0.03
USD AMGEN INC 4.20000% 22-01.03.33	5 069 000.00	4 803 669.28	0.09
USD AMGEN INC 5.25000% 23-02.03.30	11 766 000.00	12 046 262.12	0.23
USD AMGEN INC 5.25000% 23-02.03.33	4 150 000.00	4 233 678.49	0.08
USD AMGEN INC 5.60000% 23-02.03.43	1 520 000.00	1 563 915.31	0.03
USD ANALOG DEVICES INC 1.70000% 21-01.10.28	5 145 000.00	4 563 174.74	0.09
USD ANTHEM INC 2.87500% 19-15.09.29	4 065 000.00	3 721 207.62	0.07
USD ANTHEM INC 3.65000% 17-01.12.27	2 000 000.00	1 927 534.70	0.04
USD AON CORP / AON GLOBAL HOLDINGS PLC 2.05000% 21-23.08.31	3 430 000.00	2 805 476.72	0.05
USD APACHE CORP 4.37500% 18-15.10.28	2 965 000.00	2 795 342.70	0.05
USD APPLE INC 1.65000% 20-11.05.30	7 951 000.00	6 796 728.20	0.13
USD APPLE INC 2.05000% 19-11.09.26	4 280 000.00	4 033 909.85	0.08
USD APPLE INC 2.45000% 16-04.08.26	6 005 000.00	5 733 977.66	0.11
USD APPLE INC 3.35000% 22-08.08.32	3 965 000.00	3 689 288.65	0.07
USD APPLIED MATERIALS INC 1.75000% 20-01.06.30	6 067 000.00	5 173 158.84	0.10
USD AQUA AMERICA INC 3.56600% 19-01.05.29	5 070 000.00	4 771 096.83	0.09
USD ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO 3.25000% 20-27.03.30	3 993 000.00	3 667 473.23	0.07
USD ARTHUR J GALLAGHER & CO 6.50000% 23-15.02.34	900 000.00	987 282.03	0.02
USD ASHTEAD CAPITAL INC-144A 4.37500% 17-15.08.27	2 000 000.00	1 931 421.16	0.04
USD ASHTEAD CAPITAL INC-144A 5.95000% 23-15.10.33	6 035 000.00	6 146 499.83	0.12
USD ASTRAZENECA FINANCE LLC 1.75000% 21-28.05.28	3 130 000.00	2 806 996.98	0.05
USD ASTRAZENECA PLC 0.70000% 20-08.04.26	3 435 000.00	3 167 530.32	0.06
USD ASTRAZENECA PLC 1.37500% 20-06.08.30	5 700 000.00	4 725 038.88	0.09
USD AT&T INC 1.65000% 20-01.02.28	3 875 000.00	3 454 902.11	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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD AT&T INC 1.70000% 21-25.03.26	5 050 000.00	4 731 884.85	0.09
USD AT&T INC 2.30000% 20-01.06.27	645 000.00	597 850.62	0.01
USD AT&T INC 2.55000% 21-01.12.33	10 000 000.00	8 112 772.10	0.15
USD AT&T INC 3.50000% 20-01.06.41	1 935 000.00	1 537 313.87	0.03
USD AT&T INC 4.35000% 19-01.03.29	7 860 000.00	7 728 757.49	0.14
USD AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK-REG-S-SUB-4.40000% 16-19.05.26	1 800 000.00	1 758 278.68	0.03
USD AUTOZONE INC 4.50000% 23-01.02.28	4 934 000.00	4 888 824.69	0.09
USD AUTOZONE INC 4.75000% 23-01.02.33	4 925 000.00	4 820 849.20	0.09
USD AUTOZONE INC 6.55000% 23-01.11.33	2 541 000.00	2 802 928.52	0.05
USD AVANGRID INC 3.15000% 17-01.12.24	2 190 000.00	2 142 578.64	0.04
USD AVANGRID INC 3.20000% 20-15.04.25	8 500 000.00	8 276 090.53	0.16
USD AVERY DENNISON CORP 5.75000% 23-15.03.33	2 450 000.00	2 594 071.67	0.05
USD AVOLON HOLDINGS FUNDING LTD-144A 3.25000% 20-15.02.27	850 000.00	789 391.04	0.01
USD BAIDU INC 3.07500% 20-07.04.25	406 000.00	395 212.58	0.01
USD BAKER HUGHES A GE CO/ CO-OBLIGATOR 4.48600% 20-01.05.30	4 013 000.00	3 979 020.32	0.07
USD BALL CORP 6.00000% 23-15.06.29	1 534 000.00	1 547 442.04	0.03
USD BALTIMORE GAS & ELECTRIC CO 2.40000% 16-15.08.26	3 705 000.00	3 507 703.49	0.07
USD BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 1.12500% 20-18.09.25	5 600 000.00	5 242 371.06	0.10
USD BANCO SANTANDER SA 1.84900% 21-25.03.26	2 600 000.00	2 424 790.55	0.05
USD BANCO SANTANDER SA 4.25000% 17-11.04.27	800 000.00	776 593.00	0.01
USD BANCO SANTANDER SA 5.29400% 22-18.08.27	4 200 000.00	4 208 379.09	0.08
USD BANCO SANTANDER SA 5.58800% 23-08.08.28	6 400 000.00	6 513 682.37	0.12
USD BANCO SANTANDER SA-SUB 6.92100% 23-08.08.33	1 400 000.00	1 478 755.60	0.03
USD BANCO SANTANDER SA-SUB 5.17900% 15-19.11.25	3 600 000.00	3 577 715.93	0.07
USD BANCO SANTANDER SA-SUB 2.74900% 20-03.12.30	800 000.00	660 433.78	0.01
USD BANK OF NOVA SCOTIA/THE 4.85000% 23-01.02.30	5 976 000.00	5 966 136.32	0.11
USD BANK OF NOVA SCOTIA/THE 5.35000% 23-07.12.26	9 815 000.00	9 955 776.44	0.19
USD BARCLAYS PLC 3.65000% 15-16.03.25	8 000 000.00	7 848 640.96	0.15
USD BARCLAYS PLC 4.37500% 16-12.01.26	5 040 000.00	4 974 662.35	0.09
USD BARCLAYS PLC 5.50100% 22-09.08.28	730 000.00	733 501.91	0.01
USD BARCLAYS PLC-SUB 5.20000% 16-12.05.26	8 106 000.00	8 064 658.19	0.15
USD BAXALTA INC 4.00000% 16-23.06.25	4 245 000.00	4 184 621.50	0.08
USD BECTON DICKINSON AND CO 3.73400% 14-15.12.24	400 000.00	395 232.31	0.01
USD BECTON DICKINSON AND CO 1.95700% 21-11.02.31	2 650 000.00	2 198 716.24	0.04
USD BEMIS CO INC 2.63000% 20-19.06.30	5 670 000.00	4 917 260.50	0.09
USD BIDVEST GROUP UK PLC/THE-144A 3.625000% 21-23.09.26	951 000.00	884 430.00	0.02
USD BIOGEN INC 2.25000% 20-01.05.30	8 272 000.00	7 051 198.72	0.13
USD BLOCK FINANCIAL CORP 2.50000% 21-15.07.28	3 020 000.00	2 712 336.68	0.05
USD BNP PARIBAS-REG-S 3.37500% 18-09.01.25	1 185 000.00	1 162 344.61	0.02
USD BOOKING HOLDINGS INC 4.62500% 20-13.04.30	6 926 000.00	6 944 963.80	0.13
USD BOSTON PROPERTIES LP 3.25000% 20-30.01.31	127 000.00	109 322.37	0.00
USD BP CAPITAL MARKETS AMERICA INC 4.81200% 23-13.02.33	11 030 000.00	11 019 032.32	0.21
USD BPCE SA-144A-SUB 5.15000% 14-21.07.24	2 685 000.00	2 670 062.24	0.05
USD BRASKEM NETHERLANDS FINANCE BV-144A 4.50000% 19-31.01.30	5 000 000.00	3 940 500.00	0.07
USD BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 3.20000% 20-15.06.26	2 274 000.00	2 205 339.96	0.04
USD BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 2.95000% 22-15.03.32	1 865 000.00	1 644 510.09	0.03
USD BRITISH AIRW CL AA PASS THR TRUST-144A 3.80000% 18-20.09.31	1 500 000.00	903 190.48	0.02
USD BRITISH TELECOMMUNICATIONS PLC-144A 3.25000% 19-08.11.29	3 730 000.00	3 403 122.57	0.06
USD BRIXMOR OPERATING PARTNERSHIP LP 3.85000% 15-01.02.25	417 000.00	409 271.75	0.01
USD BROADCOM CORP/CAYMAN FIN LTD 3.87500% 18-15.01.27	3 200 000.00	3 117 074.34	0.06
USD BROADCOM CORP/CAYMAN FIN LTD 3.50000% 18-15.01.28	618 000.00	590 703.84	0.01
USD BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC 2.90000% 19-01.12.29	4 567 000.00	4 112 761.57	0.08
USD BROADSTONE NET LEASE 2.60000% 21-15.09.31	3 580 000.00	2 814 657.39	0.05
USD BUCKEYE PARTNERS LP 4.12500% 17-01.12.27	2 055 000.00	1 937 434.64	0.04
USD BUNGE LTD FINANCE CORP 3.25000% 16-15.08.26	3 140 000.00	3 024 062.03	0.06
USD BUNGE LTD FINANCE CORP 3.75000% 17-25.09.27	3 035 000.00	2 928 465.00	0.05
USD BUNGE LTD FINANCE CORP 1.63000% 20-17.08.25	3 408 000.00	3 237 500.66	0.06
USD CAMDEN PROPERTY TRUST 5.85000% 23-03.11.26	2 675 000.00	2 755 717.08	0.05

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット・サステナブル

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)	
USD	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 5.00100% 23-28.04.28	7 544 000.00	7 598 796.45	0.14
USD	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP 3.20000% 15-05.02.25	3 000 000.00	2 938 363.95	0.06
USD	CARGILL INC-144A 4.50000% 23-24.06.26	4 758 000.00	4 751 414.17	0.09
USD	CARRIER GLOBAL CORP 2.72200% 20-15.02.30	3 500 000.00	3 125 945.27	0.06
USD	CATERPILLAR INC 2.60000% 20-09.04.30	4 180 000.00	3 787 454.45	0.07
USD	CCO LLC/CAPITAL 2.25000% 21-15.01.29	5 961 000.00	5 147 606.59	0.10
USD	CCO LLC/CAPITAL 2.30000% 20-01.02.32	5 000 000.00	3 911 223.50	0.07
USD	CCO LLC/CAPITAL 2.80000% 20-01.04.31	3 314 000.00	2 738 300.27	0.05
USD	CCO LLC/CAPITAL 3.75000% 17-15.02.28	2 265 000.00	2 138 632.68	0.04
USD	CCO LLC/CAPITAL 4.20000% 17-15.03.28	1 450 000.00	1 393 766.62	0.03
USD	CCO LLC/CAPITAL 6.38400% 16-23.10.35	4 390 000.00	4 426 250.95	0.08
USD	CELANESE US HOLDINGS LLC 6.55000% 23-15.11.30	1 459 000.00	1 543 344.74	0.03
USD	CENTENE CORP 2.45000% 21-15.07.28	2 480 000.00	2 206 803.20	0.04
USD	CENTENE CORP 2.62500% 21-01.08.31	470 000.00	390 123.50	0.01
USD	CENTENE CORP 3.00000% 20-15.10.30	6 212 000.00	5 373 752.72	0.10
USD	CHARLES SCHWAB CORP/THE 2.45000% 22-03.03.27	3 535 000.00	3 300 676.90	0.06
USD	CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING 3.50000% 21-01.06.41	4 800 000.00	3 351 017.18	0.06
USD	CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING LLC 6.15000% 23-10.11.26	1 902 000.00	1 942 866.06	0.04
USD	CHILE, REPUBLIC OF 4.85000% 24-22.01.29	1 724 000.00	1 735 206.00	0.03
USD	CHURCH & DWIGHT CO INC 5.60000% 22-15.11.32	1 760 000.00	1 865 472.40	0.03
USD	CIGNA CORP 1.25000% 21-15.03.26	8 000 000.00	7 405 784.08	0.14
USD	CIGNA CORP 2.40000% 20-15.03.30	4 845 000.00	4 231 387.34	0.08
USD	CIGNA CORP 4.12500% 19-15.11.25	8 087 000.00	7 966 960.38	0.15
USD	CIGNA CORP 4.37500% 19-15.10.28	8 634 000.00	8 513 680.21	0.16
USD	CIGNA GROUP/THE 5.68500% 23-15.03.26	4 600 000.00	4 600 221.35	0.09
USD	CITIGROUP INC 3.20000% 16-21.10.26	2 005 000.00	1 918 007.24	0.04
USD	CITIGROUP INC 3.40000% 16-01.05.26	1 800 000.00	1 743 063.03	0.03
USD	CITIGROUP INC 3.70000% 16-12.01.26	1 825 000.00	1 784 371.96	0.03
USD	CITIGROUP INC-SUB 4.40000% 15-10.06.25	3 120 000.00	3 084 237.34	0.06
USD	CITIGROUP INC-SUB 4.45000% 15-29.09.27	15 510 000.00	15 205 827.34	0.29
USD	CITIGROUP INC-SUB 4.60000% 16-09.03.26	4 250 000.00	4 216 437.92	0.08
USD	CITIZENS BANK NA/PROVIDENCE RI 2.25000% 20-28.04.25	3 200 000.00	3 075 005.06	0.06
USD	CITIZENS FINANCIAL GROUP INC-SUB 4.30000% 15-03.12.25	7 323 000.00	7 198 641.32	0.14
USD	CNH INDUSTRIAL CAPITAL LLC 4.55000% 23-10.04.28	975 000.00	966 800.13	0.02
USD	COACH INC 3.05000% 21-15.03.32	685 000.00	547 856.90	0.01
USD	COACH INC 4.12500% 17-15.07.27	854 000.00	812 051.12	0.02
USD	COCA-COLA CO/THE 1.00000% 20-15.03.28	4 622 000.00	4 072 786.13	0.08
USD	COLORADO INTERSTATE GAS/ ISSUING-REG-S 4.15000% 16-15.08.26	3 030 000.00	2 947 780.19	0.06
USD	COMCAST CORP 2.35000% 16-15.01.27	5 605 000.00	5 274 746.45	0.10
USD	COMCAST CORP 2.65000% 19-01.02.30	1 945 000.00	1 749 228.38	0.03
USD	COMCAST CORP 4.25000% 13-15.01.33	6 515 000.00	6 264 881.33	0.12
USD	COMCAST CORP 4.25000% 18-15.10.30	3 775 000.00	3 694 492.05	0.07
USD	COMCAST CORP 4.40000% 15-15.08.35	2 930 000.00	2 812 582.48	0.05
USD	CONAGRA BRANDS INC 4.85000% 18-01.11.28	2 720 000.00	2 710 368.15	0.05
USD	CONAGRA INC 4.60000% 18-01.11.25	6 795 000.00	6 738 207.53	0.13
USD	CONCENTRIX CORP 6.65000% 23-02.08.26	3 400 000.00	3 481 106.83	0.07
USD	COREBRIDGE FINANCIAL INC 5.75000% 23-15.01.34	1 754 000.00	1 799 124.91	0.03
USD	CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-144A 3.00000% 19-30.09.29	3 711 000.00	3 280 524.00	0.06
USD	CREDIT SUISSE FIRST BOSTON NY 1.25000% 21-07.08.26	5 720 000.00	5 218 190.87	0.10
USD	CROWN CASTLE INC 5.10000% 23-01.05.33	1 500 000.00	1 481 630.34	0.03
USD	CROWN CASTLE INC 5.60000% 23-01.06.29	982 000.00	1 000 573.89	0.02
USD	CROWN CASTLE INC 5.80000% 23-01.03.34	1 050 000.00	1 082 069.66	0.02
USD	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP 3.70000% 16-15.05.26	4 150 000.00	4 019 728.76	0.08
USD	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP 4.30000% 19-15.02.29	3 504 000.00	3 363 818.70	0.06
USD	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP 3.30000% 20-01.07.30	2 530 000.00	2 260 590.45	0.04
USD	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP 1.35000% 20-15.07.25	3 150 000.00	2 980 629.20	0.06
USD	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP 2.25000% 20-15.01.31	5 525 000.00	4 565 473.86	0.09
USD	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP 1.05000% 21-15.07.26	12 407 000.00	11 256 078.79	0.21

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット・サステナブル

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP 2.50000% 21-15.07.31	3 740 000.00	3 116 738.57	0.06
USD CSX CORP 3.25000% 17-01.06.27	3 145 000.00	3 022 986.86	0.06
USD CUBESMART LP 4.37500% 19-15.02.29	1 315 000.00	1 279 627.41	0.02
USD CVS HEALTH CORP 1.30000% 20-21.08.27	6 400 000.00	5 687 579.20	0.11
USD CVS HEALTH CORP 3.75000% 20-01.04.30	6 000 000.00	5 619 679.32	0.11
USD CVS HEALTH CORP 3.87500% 15-20.07.25	1 554 000.00	1 529 299.36	0.03
USD CVS HEALTH CORP 5.25000% 23-21.02.33	2 435 000.00	2 464 940.01	0.05
USD DDR CORP 4.70000% 17-01.06.27	2 850 000.00	2 831 292.23	0.05
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP 5.75000% 23-01.02.33	1 122 000.00	1 178 270.88	0.02
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP 5.30000% 21-01.10.29	2 500 000.00	2 563 422.12	0.05
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP 6.20000% 21-15.07.30	3 750 000.00	4 004 028.27	0.08
USD DH EUROPE FINANCE II SARL 2.20000% 19-15.11.24	5 265 000.00	5 137 674.66	0.10
USD DICK ' S SPORTING GOODS INC 3.15000% 22-15.01.32	5 250 000.00	4 463 873.93	0.08
USD DIGITAL REALTY TRUST LP 3.60000% 19-01.07.29	1 052 000.00	986 283.46	0.02
USD DISCOVER BANK 4.65000% 18-13.09.28	3 310 000.00	3 171 163.24	0.06
USD DISCOVER FINANCIAL SERVICES 6.70000% 22-29.11.32	4 831 000.00	5 060 332.21	0.09
USD DISCOVERY COMMUNICATIONS LLC 3.95000% 17-20.03.28	5 750 000.00	5 493 452.76	0.10
USD DISCOVERY COMMUNICATIONS LLC 4.12500% 19-15.05.29	10 134 000.00	9 617 599.22	0.18
USD DISCOVERY COMMUNICATIONS LLC 3.62500% 20-15.05.30	2 295 000.00	2 079 769.04	0.04
USD DOLLAR TREE INC 4.00000% 18-15.05.25	5 050 000.00	4 972 724.50	0.09
USD DOW CHEMICAL CO/THE 6.30000% 22-15.03.33	2 951 000.00	3 244 442.57	0.06
USD EATON CORP 4.15000% 22-15.03.33	6 235 000.00	6 014 019.45	0.11
USD ECOPEPETROL SA 8.37500% 24-19.01.36	1 683 000.00	1 700 166.60	0.03
USD ECOPEPETROL SA 8.87500% 23-13.01.33	1 404 000.00	1 481 009.40	0.03
USD ELEVANCE HEALTH INC 4.75000% 23-15.02.33	8 860 000.00	8 771 351.54	0.16
USD ELI LILLY & CO 4.70000% 23-27.02.33	4 916 000.00	5 008 151.16	0.09
USD ELI LILLY & CO 5.00000% 23-27.02.26	6 225 000.00	6 224 851.85	0.12
USD EMPRESA DE TRANSPORTE DE PASA MET-144A 3.65000% 20-07.05.30	200 000.00	182 510.00	0.00
USD EMPRESAS PUBLICAS DE MEDELLIN ESP-144A 4.25000% 19-18.07.29	1 131 000.00	967 513.95	0.02
USD ENBRIDGE INC 3.12500% 19-15.11.29	3 025 000.00	2 773 576.97	0.05
USD ENBRIDGE INC 6.20000% 23-15.11.30	835 000.00	892 311.97	0.02
USD ENERGY TRANSFER LP 5.75000% 22-15.02.33	5 490 000.00	5 622 072.93	0.11
USD ENERSIS AMERICAS SA 4.00000% 16-25.10.26	686 000.00	661 166.80	0.01
USD EOG RESOURCES INC 4.37500% 20-15.04.30	1 124 000.00	1 114 097.51	0.02
USD EQT CORP 5.70000% 22-01.04.28	935 000.00	951 214.77	0.02
USD EQT CORP 5.75000% 24-01.02.34	4 362 000.00	4 351 677.76	0.08
USD EQUIFAX INC 3.10000% 20-15.05.30	2 000 000.00	1 799 123.82	0.03
USD EQUINIX INC 1.00000% 20-15.09.25	6 425 000.00	6 020 035.98	0.11
USD EQUINIX INC 1.45000% 21-15.05.26	6 725 000.00	6 237 814.71	0.12
USD EQUINIX INC 2.00000% 21-15.05.28	4 845 000.00	4 321 826.24	0.08
USD EQUINIX INC 2.15000% 20-15.07.30	5 700 000.00	4 814 527.40	0.09
USD EQUINIX INC 2.50000% 21-15.05.31	4 275 000.00	3 631 123.82	0.07
USD EQUINIX INC 3.90000% 22-15.04.32	2 925 000.00	2 706 856.25	0.05
USD EVERSOURCE ENERGY 1.65000% 20-15.08.30	7 700 000.00	6 240 350.42	0.12
USD EVERSOURCE ENERGY 1.40000% 21-15.08.26	10 000 000.00	9 154 054.40	0.17
USD EVERSOURCE ENERGY 2.90000% 22-01.03.27	5 145 000.00	4 850 387.63	0.09
USD EVERSOURCE ENERGY 5.50000% 24-01.01.34	4 334 000.00	4 383 668.26	0.08
USD EVERSOURCE ENERGY 5.00000% 24-01.01.27	4 015 000.00	4 022 756.70	0.08
USD EXELON CORP 4.05000% 20-15.04.30	6 516 000.00	6 214 947.12	0.12
USD EXELON CORP 5.30000% 23-15.03.33	605 000.00	611 438.03	0.01
USD EXTRA SPACE STORAGE LP 5.40000% 24-01.02.34	4 400 000.00	4 399 066.80	0.08
USD FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC 2.90000% 22-01.03.27	1 000 000.00	943 940.17	0.02
USD FIDELITY NATIONAL INFO SERVICES 1.65000% 21-01.03.28	4 350 000.00	3 894 193.78	0.07
USD FIDELITY NATIONAL INFO SERVICES 2.25000% 21-01.03.31	930 000.00	784 302.02	0.01
USD FIDELITY NTL INFO SER INC 5.10000% 22-15.07.32	375 000.00	383 051.05	0.01
USD FISERV INC 2.25000% 20-01.06.27	3 150 000.00	2 921 262.88	0.05
USD FISERV INC 3.20000% 19-01.07.26	4 214 000.00	4 063 083.77	0.08
USD FISERV INC 3.50000% 19-01.07.29	4 950 000.00	4 643 007.68	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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD FISERV INC 5.37500% 23-21.08.28	5 545 000.00	5 685 356.76	0.11
USD FISERV INC 5.45000% 23-02.03.28	8 917 000.00	9 148 185.80	0.17
USD FISERV INC 5.62500% 23-21.08.33	1 701 000.00	1 771 618.63	0.03
USD FLOWSERVE CORP 2.80000% 21-15.01.32	4 251 000.00	3 525 126.36	0.07
USD FMC CORP 3.45000% 19-01.10.29	1 847 000.00	1 678 587.92	0.03
USD FORD MOTOR CO 3.25000% 21-12.02.32	11 907 000.00	9 856 882.27	0.18
USD FORD MOTOR CO 6.10000% 22-19.08.32	3 031 000.00	3 037 268.26	0.06
USD FORD MOTOR CREDIT CO 3.37500% 20-13.11.25	2 260 000.00	2 169 002.70	0.04
USD FORD MOTOR CREDIT CO 4.00000% 20-13.11.30	255 000.00	227 434.96	0.00
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.62500% 21-17.06.31	1 025 000.00	882 025.53	0.02
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.70000% 21-10.08.26	2 351 000.00	2 185 133.37	0.04
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.30000% 22-10.02.25	8 700 000.00	8 398 134.10	0.16
USD FORD MOTOR CREDIT CO 4.95000% 22-28.05.27	1 049 000.00	1 026 593.48	0.02
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 7.35000% 22-04.11.27	2 400 000.00	2 524 510.75	0.05
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 6.95000% 23-06.03.26	1 515 000.00	1 549 013.67	0.03
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 6.80000% 23-12.05.28	2 655 000.00	2 758 835.16	0.05
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 7.12200% 23-07.11.33	1 808 000.00	1 937 578.73	0.04
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 6.05000% 24-05.03.31	11 511 000.00	11 570 357.05	0.22
USD FORTINET INC 1.00000% 21-15.03.26	1 691 000.00	1 558 088.37	0.03
USD FORTIS INC 3.05500% 17-04.10.26	1 154 000.00	1 098 021.87	0.02
USD FOX CORP 6.50000% 23-13.10.33	4 518 000.00	4 872 682.66	0.09
USD FREEPORT-MCMORAN INC 4.55000% 14-14.11.24	3 120 000.00	3 091 764.00	0.06
USD FREEPORT-MCMORAN INC 4.12500% 20-01.03.28	3 341 000.00	3 213 340.39	0.06
USD FREEPORT-MCMORAN INC 4.25000% 20-01.03.30	3 397 000.00	3 188 270.31	0.06
USD FREEPORT-MCMORAN INC 4.37500% 20-01.08.28	5 700 000.00	5 498 476.50	0.10
USD GENERAL MILLS INC 2.25000% 21-14.10.31	9 620 000.00	8 007 656.74	0.15
USD GENERAL MILLS INC 4.95000% 23-29.03.33	10 330 000.00	10 340 231.03	0.19
USD GENERAL MILLS INC 4.70000% 24-30.01.27	1 573 000.00	1 574 739.69	0.03
USD GENERAL MOTORS CO 5.00000% 14-01.04.35	925 000.00	883 117.13	0.02
USD GENERAL MOTORS CO 6.12500% 20-01.10.25	1 485 000.00	1 506 514.07	0.03
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 2.90000% 20-26.02.25	818 000.00	797 490.85	0.01
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO LTD 3.60000% 20-21.06.30	12 976 000.00	11 751 246.88	0.22
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 2.70000% 20-20.08.27	8 200 000.00	7 593 577.69	0.14
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 1.25000% 21-08.01.26	2 775 000.00	2 582 222.08	0.05
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 2.35000% 21-08.01.31	978 000.00	810 987.10	0.02
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 2.70000% 21-10.06.31	3 926 000.00	3 281 208.56	0.06
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 2.40000% 21-15.10.28	1 725 000.00	1 534 328.54	0.03
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 3.10000% 22-12.01.32	995 000.00	845 520.75	0.02
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 4.30000% 22-06.04.29	3 606 000.00	3 464 583.49	0.07
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 6.05000% 22-10.10.25	2 181 000.00	2 212 755.03	0.04
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 5.85000% 23-06.04.30	7 372 000.00	7 570 160.23	0.14
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 5.80000% 23-23.06.28	891 000.00	914 592.50	0.02
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 6.10000% 23-07.01.34	11 739 000.00	12 102 832.58	0.23
USD GENPACT LUXEMBOURG SARL 3.37500% 19-01.12.24	2 355 000.00	2 299 751.70	0.04
USD GILEAD SCIENCES INC 3.65000% 15-01.03.26	4 207 000.00	4 113 434.09	0.08
USD GILEAD SCIENCES INC 2.95000% 16-01.03.27	4 645 000.00	4 431 595.56	0.08
USD GILEAD SCIENCES INC 1.20000% 20-01.10.27	6 565 000.00	5 847 573.98	0.11
USD GILEAD SCIENCES INC 1.65000% 20-01.10.30	3 200 000.00	2 672 977.60	0.05
USD GILEAD SCIENCES INC 5.25000% 23-15.10.33	6 819 000.00	7 077 357.18	0.13
USD GLOBAL PAYMENTS INC 3.20000% 19-15.08.29	4 130 000.00	3 738 042.02	0.07
USD GLOBAL PAYMENTS INC 1.20000% 21-01.03.26	3 576 000.00	3 303 619.23	0.06
USD GLOBAL PAYMENTS INC 5.40000% 22-15.08.32	2 050 000.00	2 069 175.95	0.04
USD GLOBAL PAYMENTS INC 4.45000% 18-01.06.28	2 796 000.00	2 727 388.37	0.05
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC-SUB 4.25000% 15-21.10.25	8 100 000.00	7 984 671.15	0.15
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.50000% 20-01.04.25	3 090 000.00	3 031 551.97	0.06
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.75000% 15-22.05.25	5 965 000.00	5 863 972.40	0.11
USD GRAPHIC PACKAGING INTERNATIONAL INC 4.12500% 16-15.08.24	416 000.00	411 827.45	0.01
USD GSK CONSUMER HEALTHCARE CAPITAL US 3.37500% 22-24.03.27	3 640 000.00	3 504 822.70	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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD GSK CONSUMER HEALTHCARE CAPITAL US LLC 3.62500% 22-24.03.32	4 875 000.00	4 488 623.73	0.08
USD GUARDIAN LIFE GLOBAL FUNDING-144A 1.62500% 21-16.09.28	1 419 000.00	1 249 085.86	0.02
USD HCA INC 2.37500% 21-15.07.31	8 870 000.00	7 351 165.24	0.14
USD HCA INC 3.50000% 20-01.09.30	3 315 000.00	3 007 902.94	0.06
USD HCA INC 4.12500% 19-15.06.29	2 745 000.00	2 621 421.17	0.05
USD HCA INC 5.25000% 14-15.04.25	1 700 000.00	1 698 133.50	0.03
USD HCA INC 5.62500% 18-01.09.28	3 049 000.00	3 106 854.62	0.06
USD HCA INC 5.87500% 15-15.02.26	4 400 000.00	4 441 620.35	0.08
USD HCA INC 5.87500% 19-01.02.29	8 057 000.00	8 309 859.43	0.16
USD HEALTHCARE TRUST OF AMERICA HOLDINGS LP 2.00000% 20-15.03.31	1 499 000.00	1 200 547.81	0.02
USD HEALTHPEAK OP LLC 1.35000% 21-01.02.27	4 060 000.00	3 667 995.75	0.07
USD HEALTHPEAK OP LLC 2.87500% 20-15.01.31	910 000.00	789 509.84	0.01
USD HEALTHPEAK OP LLC 2.12500% 21-01.12.28	8 100 000.00	7 142 427.23	0.13
USD HEALTHPEAK OP LLC 3.40000% 15-01.02.25	209 000.00	204 662.12	0.00
USD HEALTHPEAK OP LLC 3.00000% 19-15.01.30	4 375 000.00	3 906 521.45	0.07
USD HESS CORP 4.30000% 16-01.04.27	5 850 000.00	5 779 858.50	0.11
USD HESS CORP 7.12500% 02-15.03.33	4 500 000.00	5 212 735.65	0.10
USD HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO 5.25000% 23-01.07.28	6 685 000.00	6 793 640.67	0.13
USD HILLENBRAND INC 5.00000% 19-15.09.26	1 725 000.00	1 686 188.11	0.03
USD HOME DEPOT INC 2.70000% 20-15.04.30	3 905 000.00	3 537 961.98	0.07
USD HOST HOTELS & RESORTS LP 3.87500% 17-01.04.24	2 175 000.00	2 168 257.69	0.04
USD HOST HOTELS & RESORTS LP 3.37500% 19-15.12.29	3 342 000.00	3 001 722.37	0.06
USD HOST HOTELS & RESORTS LP 3.50000% 20-15.09.30	3 400 000.00	3 056 993.51	0.06
USD HUDSON PACIFIC PROPERTIES LP 3.95000% 17-01.11.27	100 000.00	90 001.12	0.00
USD HUDSON PACIFIC PROPERTIES LP 4.65000% 19-01.04.29	1 485 000.00	1 312 360.95	0.02
USD HUMANA INC 3.12500% 19-15.08.29	2 750 000.00	2 526 813.32	0.05
USD HUMANA INC 5.70000% 23-13.03.26	1 000 000.00	1 000 320.90	0.02
USD HUMANA INC 5.75000% 22-01.03.28	7 960 000.00	8 226 644.40	0.15
USD HUMANA INC 5.95000% 23-15.03.34	4 034 000.00	4 254 913.94	0.08
USD ILLUMINA INC 2.55000% 21-23.03.31	5 565 000.00	4 658 940.42	0.09
USD ILLUMINA INC 5.75000% 22-13.12.27	4 038 000.00	4 131 594.83	0.08
USD INDUSTRIAL BANK OF KOREA-144A 5.37500% 23-04.10.28	4 700 000.00	4 839 637.00	0.09
USD ING GROEP NV 3.55000% 19-09.04.24	1 550 000.00	1 544 330.08	0.03
USD ING GROEP NV 3.95000% 17-29.03.27	5 400 000.00	5 244 222.91	0.10
USD INGERSOLL RAND INC 5.70000% 23-14.08.33	1 055 000.00	1 101 817.43	0.02
USD INTEL CORP 2.87500% 17-11.05.24	1 600 000.00	1 587 870.50	0.03
USD INTEL CORP 5.12500% 23-10.02.30	6 450 000.00	6 643 129.25	0.12
USD INTEL CORP 5.20000% 23-10.02.33	4 094 000.00	4 214 398.80	0.08
USD INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC 2.10000% 20-15.06.30	1 385 000.00	1 184 814.41	0.02
USD INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC 1.85000% 20-15.09.32	1 250 000.00	988 691.22	0.02
USD INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC 4.60000% 22-15.03.33	3 802 000.00	3 733 442.49	0.07
USD INTERPUBLIC GROUP OF COS INC/THE 5.37500% 23-15.06.33	6 096 000.00	6 185 534.33	0.12
USD INTUIT INC 5.20000% 23-15.09.33	4 493 000.00	4 660 474.78	0.09
USD INVESTMENT ENERGY RESOURCES LTD-144A 6.25000% 21-26.04.29	354 000.00	335 053.92	0.01
USD INVITATION HOMES OPERATING PARTNERSHIP 2.00000% 21-15.08.31	243 000.00	192 221.65	0.00
USD INVITATION HOMES OPERATING PARTNERSHIP 4.15000% 22-15.04.32	65 000.00	59 660.99	0.00
USD INVITATION HOMES OPERATING PARTNER LP 5.45000% 23-15.08.30	6 465 000.00	6 511 622.86	0.12
USD INVITATION HOMES OPERATING PARTNER LP 5.50000% 23-15.08.33	7 086 000.00	7 136 900.16	0.13
USD ITC HOLDINGS CORP 3.65000% 14-15.06.24	1 833 000.00	1 818 000.23	0.03
USD ITC HOLDINGS CORP 3.25000% 16-30.06.26	1 350 000.00	1 298 985.07	0.02
USD J M SMUCKER CO/THE 5.90000% 23-15.11.28	2 234 000.00	2 336 760.74	0.04
USD J M SMUCKER CO/THE 6.20000% 23-15.11.33	1 919 000.00	2 077 019.78	0.04
USD JABIL INC 3.60000% 20-15.01.30	4 440 000.00	4 069 950.33	0.08
USD JEFFERIES FINANCIAL GRP INC 2.62500% 21-15.10.31	2 330 000.00	1 936 748.31	0.04
USD JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC 5.87500% 23-21.07.28	1 690 000.00	1 746 835.46	0.03
USD JM SMUCKER CO/THE 3.37500% 17-15.12.27	5 000 000.00	4 788 120.60	0.09
USD JOHN CON INTER PLC / TY FI & SEC FI SCA 4.90000% 22-01.12-32	4 906 000.00	4 932 603.47	0.09
USD JOHNSON & JOHNSON 1.30000% 20-01.09.30	4 500 000.00	3 763 937.88	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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC 3.90000% 16-14.02.26	7 606 000.00	7 446 391.67	0.14
USD JUNIPER NETWORKS INC 2.00000% 20-10.12.30	4 900 000.00	4 012 291.55	0.08
USD KAISER FOUNDATION HOSPITALS 3.15000% 17-01.05.27	2 820 000.00	2 703 095.21	0.05
USD KB HOME 4.00000% 21-15.06.31	1 660 000.00	1 463 725.21	0.03
USD KELLOGG CO 5.25000% 23-01.03.33	3 875 000.00	3 949 370.82	0.07
USD KILROY REALTY LP 2.50000% 20-15.11.32	1 500 000.00	1 148 515.84	0.02
USD KILROY REALTY LP 2.65000% 21-15.11.33	193 000.00	145 976.96	0.00
USD KIMCO REALTY CORP 2.80000% 16-01.10.26	1 650 000.00	1 559 182.38	0.03
USD KIMCO REALTY CORP 2.25000% 21-01.12.31	4 505 000.00	3 656 889.47	0.07
USD KIMCO REALTY OP LLC 6.40000% 23-01.03.34	5 400 000.00	5 842 337.00	0.11
USD KINDER MORGAN ENERGY PARTNERS LP 7.75000% 02-15.03.32	1 000 000.00	1 137 488.02	0.02
USD KINDER MORGAN ENERGY PARTNERS LP 7.30000% 02-15.08.33	2 586 000.00	2 924 822.15	0.05
USD KINDER MORGAN ENERGY PARTNERS LP 5.80000% 05-15.03.35	1 653 000.00	1 687 192.48	0.03
USD KINDER MORGAN INC 5.20000% 23-01.06.33	3 423 000.00	3 395 965.52	0.06
USD KITE REALTY GROUP LP 5.50000% 24-01.03.34	517 000.00	514 745.52	0.01
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 4.37500% 16-01.06.46	370 000.00	320 142.23	0.01
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 3.00000% 16-01.06.26	4 648 000.00	4 464 853.65	0.08
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 3.87500% 21-15.05.27	5 615 000.00	5 489 563.76	0.10
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 4.25000% 21-01.03.31	2 773 000.00	2 683 395.27	0.05
USD KYNDRYL HOLDINGS INC 3.15000% 22-15.10.31	6 028 000.00	5 018 938.24	0.09
USD L BRANDS INC 6.87500% 15-01.11.35	3 125 000.00	3 116 101.56	0.06
USD LABORATORY CORP AMERICA HOLDINGS 2.95000% 19-01.12.29	430 000.00	390 134.98	0.01
USD LAM RESEARCH CORP 1.90000% 20-15.06.30	7 496 000.00	6 418 586.28	0.12
USD LEAR CORP 3.50000% 20-30.05.30	4 970 000.00	4 513 102.03	0.08
USD LEXINGTON REALTY TRUST 2.70000% 20-15.09.30	1 000 000.00	841 290.35	0.02
USD LEXINGTON REALTY TRUST 2.37500% 21-01.10.31	905 000.00	729 091.49	0.01
USD LINCOLN NATIONAL CORP 3.80000% 18-01.03.28	2 750 000.00	2 645 733.28	0.05
USD LINCOLN NATIONAL CORP 3.05000% 19-15.01.30	1 890 000.00	1 681 394.95	0.03
USD LINCOLN NATIONAL CORP 3.40000% 22-01.03.32	1 350 000.00	1 167 226.78	0.02
USD LKQ CORP 5.75000% 23-15.06.28	2 647 000.00	2 701 143.75	0.05
USD LKQ CORP 6.25000% 23-15.06.33	2 346 000.00	2 447 830.59	0.05
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC-SUB 4.58200% 16-10.12.25	5 400 000.00	5 312 110.30	0.10
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.37500% 18-22.03.28	3 000 000.00	2 928 757.44	0.05
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC-SUB 4.50000% 14-04.11.24	1 885 000.00	1 863 117.35	0.03
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC-SUB 4.65000% 16-24.03.26	4 275 000.00	4 206 386.85	0.08
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 3.75000% 17-11.01.27	2 200 000.00	2 125 004.05	0.04
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 3.90000% 19-12.03.24	5 955 000.00	5 943 059.44	0.11
USD LOWE ' S COS INC 1.30000% 20-15.04.28	10 850 000.00	9 525 008.96	0.18
USD LOWE ' S COS INC 3.65000% 19-05.04.29	1 660 000.00	1 594 432.56	0.03
USD LOWE ' S COS INC 4.80000% 23-01.04.26	1 294 000.00	1 295 489.47	0.02
USD LSEGA FINANCING PLC-144A 1.37500% 21-06.04.26	5 650 000.00	5 236 066.14	0.10
USD LSEGA FINANCING PLC-144A 2.00000% 21-06.04.28	2 900 000.00	2 604 266.52	0.05
USD LYB INTERNATIONAL FINANCE III LLC 5.62500% 23-15.05.33	5 000 000.00	5 190 555.80	0.10
USD MARATHON OIL CORP 4.40000% 17-15.07.27	2 828 000.00	2 767 590.13	0.05
USD MARATHON OIL CORP 6.80000% 02-15.03.32	4 006 000.00	4 351 364.67	0.08
USD MARRIOTT INTERNATIONAL INC/MD 3.12500% 16-15.06.26	5 000 000.00	4 808 478.80	0.09
USD MARRIOTT INTERNATIONAL INC/MD 3.75000% 16-15.03.25	1 371 000.00	1 347 788.97	0.03
USD MARRIOTT INTERNATIONAL INC 4.62500% 20-15.06.30	3 462 000.00	3 413 974.79	0.06
USD MARRIOTT INTERNATIONAL INC/MD 3.50000% 20-15.10.32	6 415 000.00	5 720 671.77	0.11
USD MARRIOTT INTERNATIONAL INC/MD 4.90000% 23-15.04.29	2 416 000.00	2 430 831.00	0.05
USD MARRIOTT INTERNATIONAL INC/MD 5.55000% 23-15.10.28	851 000.00	876 680.69	0.02
USD MARSH & MCLENNAN COS INC 3.87500% 19-15.03.24	1 930 000.00	1 925 945.88	0.04
USD MARSH & MCLENNAN COS INC 4.37500% 19-15.03.29	2 785 000.00	2 761 542.95	0.05
USD MARSH & MCLENNAN COS INC 2.25000% 20-15.11.30	2 530 000.00	2 171 964.60	0.04
USD MARSH & MCLENNAN COS INC 5.75000% 22-01.11.32	1 624 000.00	1 734 947.26	0.03
USD MARSH & MCLENNAN COS INC 5.40000% 23-15.09.33	2 750 000.00	2 878 665.87	0.05
USD MASCO CORP 3.50000% 17-15.11.27	1 500 000.00	1 427 408.28	0.03
USD MCCORMICK & CO 2.50000% 20-15.04.30	6 827 000.00	5 980 340.51	0.11

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット・サステナブル

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD MCKESSON CORP 5.10000% 23-15.07.33	1 915 000.00	1 962 231.56	0.04
USD MDC HOLDINGS INC 3.85000% 20-15.01.30	3 886 000.00	3 608 005.20	0.07
USD MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 4.50000% 23-30.03.33	1 145 000.00	1 134 844.70	0.02
USD MERCK & CO INC 1.90000% 21-10.12.28	4 000 000.00	3 592 751.56	0.07
USD MICRON TECHNOLOGY INC 2.70300% 21-15.04.32	6 446 000.00	5 410 284.05	0.10
USD MICRON TECHNOLOGY INC 6.75000% 22-01.11.29	2 720 000.00	2 936 618.68	0.06
USD MICRON TECHNOLOGY INC 5.87500% 23-15.09.33	3 132 000.00	3 257 888.73	0.06
USD MICRON TECHNOLOGY INC 5.30000% 24-15.01.31	4 950 000.00	5 001 537.77	0.09
USD MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 3.17000% 17-11.09.27	1 088 000.00	1 020 876.00	0.02
USD MIZUHO FINANCIAL GROUP INC-SUB 2.56400% 21-13.09.31	3 405 000.00	2 751 226.72	0.05
USD MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 5.66700% 23-27.05.29	1 030 000.00	1 050 121.43	0.02
USD MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 5.73900% 23-27.05.31	4 850 000.00	4 978 894.79	0.09
USD MONDELEZ INTERNATIONAL INC 2.75000% 20-13.04.30	2 939 000.00	2 652 047.91	0.05
USD MOODY ' S CORP 3.75000% 20-24.03.25	2 315 000.00	2 284 434.85	0.04
USD MOODY ' S CORP 4.25000% 22-08.08.32	2 205 000.00	2 132 518.72	0.04
USD MORGAN STANLEY 3.62500% 17-20.01.27	2 200 000.00	2 139 383.95	0.04
USD MORGAN STANLEY-SUB 5.00000% 13-24.11.25	8 460 000.00	8 457 780.78	0.16
USD MPLX LP 4.12500% 17-01.03.27	2 125 000.00	2 081 932.26	0.04
USD NASDAQ INC 5.35000% 23-28.06.28	2 137 000.00	2 191 578.00	0.04
USD NATIONAL FUEL GAS CO 5.50000% 20-15.01.26	5 025 000.00	5 048 270.13	0.09
USD NATIONAL GRID PLC 5.41800% 24-11.01.34	675 000.00	676 035.47	0.01
USD NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-144A 1.50000% 21-13.10.26	1 990 000.00	1 814 101.44	0.03
USD NATURA&CO LUXEMBOURG HOLDINGS SARL-144A 6.00000% 22-19.04.29	608 000.00	589 158.08	0.01
USD NEC ELECTRONICS CORP-144A 1.54300% 21-26.11.24	9 450 000.00	9 129 262.28	0.17
USD NNN REIT INC 5.60000% 23-15.10.33	2 800 000.00	2 863 916.16	0.05
USD NOMURA HOLDINGS INC 1.85100% 20-16.07.25	3 660 000.00	3 477 560.52	0.07
USD NOMURA HOLDINGS INC 2.32900% 22-22.01.27	6 165 000.00	5 664 608.81	0.11
USD NOMURA HOLDINGS INC 5.09900% 22-03.07.25	3 595 000.00	3 576 309.71	0.07
USD NOMURA HOLDINGS INC 5.84200% 23-18.01.28	2 650 000.00	2 708 938.85	0.05
USD NORDSTROM INC 4.37500% 19-01.04.30	4 700 000.00	4 078 096.00	0.08
USD NORFOLK SOUTHERN CORP 3.00000% 22-15.03.32	2 500 000.00	2 198 690.68	0.04
USD NORFOLK SOUTHERN CORP 5.05000% 23-01.08.30	4 377 000.00	4 466 807.60	0.08
USD NTT FINANCE CORP-144A 1.59100% 21-03.04.28	6 325 000.00	5 579 308.50	0.10
USD NUCOR CORP 3.95000% 22-23.05.25	1 075 000.00	1 060 565.10	0.02
USD NUCOR CORP 4.30000% 22-23.05.27	2 727 000.00	2 707 484.09	0.05
USD NUTRIEN LTD 4.90000% 23-27.03.28	959 000.00	963 779.44	0.02
USD NUTRIEN LTD 5.90000% 22-07.11.24	1 937 000.00	1 940 958.11	0.04
USD NUTRIEN LTD 5.95000% 22-07.11.25	2 730 000.00	2 775 498.29	0.05
USD OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC 3.37500% 20-01.02.31	1 543 000.00	1 322 848.38	0.02
USD ONEOK INC 2.20000% 20-15.09.25	2 325 000.00	2 219 759.58	0.04
USD ONEOK INC 3.40000% 19-01.09.29	8 000 000.00	7 398 417.04	0.14
USD ONEOK INC 4.00000% 17-13.07.27	4 436 000.00	4 314 208.29	0.08
USD ONEOK INC 4.35000% 19-15.03.29	1 475 000.00	1 437 753.87	0.03
USD ONEOK INC 4.55000% 18-15.07.28	615 000.00	608 103.04	0.01
USD ONEOK INC 5.80000% 23-01.11.30	2 121 000.00	2 204 550.81	0.04
USD ONEOK INC 6.05000% 23-01.09.33	6 164 000.00	6 472 202.16	0.12
USD ONEOK INC 6.10000% 22-15.11.32	6 000 000.00	6 314 805.24	0.12
USD ONEOK INC 6.35000% 20-15.01.31	1 220 000.00	1 297 654.84	0.02
USD ONEOK PARTNERS LP 4.90000% 15-15.03.25	1 510 000.00	1 503 130.39	0.03
USD ORACLE CORP 2.30000% 21-25.03.28	10 550 000.00	9 578 268.51	0.18
USD ORACLE CORP 2.80000% 20-01.04.27	2 950 000.00	2 783 112.31	0.05
USD ORACLE CORP 2.87500% 21-25.03.31	8 430 000.00	7 417 816.30	0.14
USD ORACLE CORP 3.85000% 16-15.07.36	2 000 000.00	1 744 057.72	0.03
USD ORACLE CORP 4.50000% 23-06.05.28	2 175 000.00	2 166 388.45	0.04
USD ORACLE CORP 4.65000% 23-06.05.30	9 957 000.00	9 853 235.12	0.18
USD ORACLE CORP 4.90000% 23-06.02.33	5 000 000.00	4 948 451.40	0.09
USD ORACLE CORP 6.25000% 22-09.11.32	10 450 000.00	11 270 581.13	0.21
USD OVINTIV INC 5.65000% 23-15.05.28	7 275 000.00	7 401 918.57	0.14

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット・サステナブル

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD OVINTIV INC 6.25000% 23-15.07.33	1 393 000.00	1 452 943.82	0.03
USD OWENS CORNING 3.40000% 16-15.08.26	1 975 000.00	1 905 742.44	0.04
USD PARK AEROSPACE HOLDINGS LTD-144A 5.50000% 17-15.02.24	75 000.00	75 001.61	0.00
USD PAYPAL HOLDINGS INC 2.30000% 20-01.06.30	5 140 000.00	4 458 941.73	0.08
USD PERKINELMER INC 1.90000% 21-15.09.28	1 500 000.00	1 305 500.08	0.02
USD PERKINELMER INC 2.25000% 21-15.09.31	1 765 000.00	1 461 755.69	0.03
USD PERKINELMER INC 2.55000% 21-15.03.31	1 195 000.00	1 014 611.07	0.02
USD PERRIGO FINANCE UNLIMITED CO STEP-UP 20-15.06.30	3 200 000.00	2 931 184.00	0.05
USD PFIZER INC 2.62500% 20-01.04.30	12 315 000.00	11 093 516.04	0.21
USD PFIZER INVESTMENT ENTERPRISES 4.65000% 23-19.05.30	15 717 000.00	15 765 334.80	0.30
USD PHILLIPS 66 1.30000% 20-15.02.26	4 500 000.00	4 190 382.40	0.08
USD PHILLIPS 66 CO 4.95000% 23-01.12.27	4 135 000.00	4 166 789.18	0.08
USD PHYSICIANS REALTY LP 4.30000% 17-15.03.27	3 515 000.00	3 435 810.43	0.06
USD PIEDMONT NATURAL GAS CO INC 3.50000% 19-01.06.29	8 601 000.00	8 045 074.62	0.15
USD PILGRIM ' S PRIDE CORP 6.87500% 23-15.05.34	2 900 000.00	3 090 773.60	0.06
USD PILGRIMS PRIDE CORP 4.25000% 23-15.04.31	1 676 000.00	1 509 269.84	0.03
USD PILGRIMS PRIDE CORP 6.25000% 23-01.07.33	4 478 000.00	4 571 276.74	0.09
USD PIONEER NATURAL RESOURCES CO 2.15000% 21-15.01.31	1 813 000.00	1 544 407.93	0.03
USD PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE 3.45000% 19-23.04.29	4 400 000.00	4 126 358.94	0.08
USD PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE 1.15000% 21-13.08.26	4 300 000.00	3 930 664.10	0.07
USD POPULAR INC 7.25000% 23-13.03.28	2 235 000.00	2 317 695.00	0.04
USD PRINCIPAL FINANCIAL GROUP 3.10000% 16-15.11.26	4 215 000.00	4 028 980.25	0.08
USD PROSUS NV-144A 3.25700% 22-19.01.27	1 079 000.00	991 870.75	0.02
USD PROSUS NV-144A 3.68000% 20-21.01.30	552 000.00	476 199.36	0.01
USD PROTECTIVE LIVE CORP-REG-S 4.30000% 18-30.09.28	3 700 000.00	3 615 479.90	0.07
USD PUBLIC SERVICE ELECTRIC AND GAS CO 4.65000% 23-15.03.33	10 000 000.00	9 924 946.80	0.19
USD PUBLIC STORAGE 5.12500% 23-15.01.29	2 087 000.00	2 141 055.60	0.04
USD PULTEGROUP INC 6.37500% 03-15.05.33	3 842 000.00	4 153 585.74	0.08
USD PVH CORP 4.62500% 20-10.07.25	5 148 000.00	5 102 290.59	0.10
USD QATAR, STATE OF-144A 4.00000% 19-14.03.29	882 000.00	868 770.00	0.02
USD QUEST DIAGNOSTICS INC 6.40000% 23-30.11.33	1 000 000.00	1 096 221.13	0.02
USD REALTY INCOME CORP 3.00000% 16-15.01.27	790 000.00	752 518.19	0.01
USD REALTY INCOME CORP 4.12500% 14-15.10.26	3 765 000.00	3 707 889.24	0.07
USD REGENCY CENTERS LP 3.75000% 14-15.06.24	1 110 000.00	1 100 226.92	0.02
USD REGENCY CENTERS LP 4.12500% 18-15.03.28	1 600 000.00	1 541 511.86	0.03
USD RELX CAPITAL INC 3.00000% 20-22.05.30	3 200 000.00	2 915 220.77	0.05
USD RELX CAPITAL INC 4.00000% 19-18.03.29	3 635 000.00	3 540 451.14	0.07
USD REPUBLIC SERVICES INC 2.90000% 16-01.07.26	1 845 000.00	1 773 234.94	0.03
USD REPUBLIC SERVICES INC 4.87500% 23-01.04.29	3 495 000.00	3 538 923.76	0.07
USD REPUBLIC SERVICES INC 5.00000% 23-15.12.33	3 314 000.00	3 344 547.06	0.06
USD ROGERS COMMUNICATIONS INC 5.45000% 13-01.10.43	3 550 000.00	3 497 914.04	0.07
USD ROGERS COMMUNICATIONS INC 3.62500% 15-15.12.25	5 920 000.00	5 769 387.26	0.11
USD ROSS STORES INC 4.70000% 20-15.04.27	1 830 000.00	1 817 413.27	0.03
USD ROSS STORES INC 4.80000% 20-15.04.30	2 185 000.00	2 128 066.70	0.04
USD ROYAL BANK OF CANADA 6.00000% 22-01.11.27	8 500 000.00	8 885 470.75	0.17
USD RYDER SYSTEM INC 6.30000% 23-01.12.28	2 825 000.00	2 994 353.75	0.06
USD S&P GLOBAL INC 1.25000% 20-15.08.30	6 548 000.00	5 330 083.86	0.10
USD SABINE PASS LIQUEFACTION LLC 5.62500% 16-01.03.25	1 045 000.00	1 046 884.41	0.02
USD SANTANDER HOLDINGS USA INC 4.40000% 18-13.07.27	9 523 000.00	9 256 274.39	0.17
USD SCHLUMBERGER INVESTMENT SA 2.65000% 20-26.06.30	10 000 000.00	8 961 968.30	0.17
USD SEMpra ENERGY 3.40000% 18-01.02.28	3 877 000.00	3 692 391.14	0.07
USD SHERWIN-WILLIAMS CO 3.45000% 17-01.06.27	2 825 000.00	2 724 577.55	0.05
USD SHERWIN-WILLIAMS CO 2.30000% 20-15.05.30	2 340 000.00	2 033 175.11	0.04
USD SHIRE ACQUISITIONS INVT IRELAND DAC 3.20000% 16-23.09.26	8 500 000.00	8 179 809.34	0.15
USD SIMON PROPERTY GROUP LP 2.20000% 21-01.02.31	3 013 000.00	2 521 039.53	0.05
USD SIMON PROPERTY GROUP LP 6.25000% 23-15.01.34	3 212 000.00	3 475 812.83	0.07
USD SK HYNIX INC-144A 2.37500% 21-19.01.31	658 000.00	540 612.80	0.01
USD SKYWORKS SOLUTIONS INC 1.80000% 21-01.06.26	13 625 000.00	12 692 187.40	0.24

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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD SKYWORKS SOLUTIONS INC 3.00000% 21-01.06.31	7 939 000.00	6 801 560.97	0.13
USD SMITH&NEWPHEW PLC 2.03200% 20-14.10.30	2 550 000.00	2 126 287.94	0.04
USD SOCIETE GENERALE SA-144A-SUB 4.75000% 15-24.11.25	1 980 000.00	1 946 486.30	0.04
USD SONOCO PRODUCTS CO 1.80000% 22-01.02.25	4 725 000.00	4 563 491.99	0.09
USD SONOCO PRODUCTS CO 3.12500% 20-01.05.30	2 900 000.00	2 625 100.10	0.05
USD SOUTHWEST AIRLINES CO 2.62500% 20-10.02.30	4 529 000.00	3 977 067.66	0.07
USD SOUTHWEST AIRLINES CO 5.12500% 20-15.06.27	1 330 000.00	1 339 193.24	0.03
USD SOUTHWEST GAS CORP 3.70000% 18-01.04.28	1 250 000.00	1 195 350.43	0.02
USD SPECTRA ENERGY PARTNERS LP 3.50000% 15-15.03.25	900 000.00	883 775.19	0.02
USD SPECTRA ENERGY PARTNERS LP 3.37500% 16-15.10.26	6 331 000.00	6 103 785.60	0.11
USD SPIRE INC 3.54300% 17-27.02.24	1 500 000.00	1 497 395.42	0.03
USD SPRINT CORP 7.62500% 18-01.03.26	3 715 000.00	3 876 944.28	0.07
USD STANDARD CHARTERED PLS-144A 1.82200% 21-23.11.25	3 760 000.00	3 638 125.84	0.07
USD STERIS IRISH FINCO UNLTD CO 2.70000% 21-15.03.31	3 700 000.00	3 202 762.81	0.06
USD STIFEL FINANCIAL CORP 4.00000% 20-15.05.30	1 720 000.00	1 583 477.81	0.03
USD STORE CAPITAL CORP 4.62500% 19-15.03.29	772 000.00	724 155.79	0.01
USD STRYKER CORP 1.15000% 20-15.06.25	1 446 000.00	1 373 356.60	0.03
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 2.47200% 22-14.01.29	4 000 000.00	3 563 689.01	0.07
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 5.88000% 23-13.07.26	248 000.00	252 967.02	0.00
USD SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC 5.46400% 23-13.01.26	11 197 000.00	11 292 571.21	0.21
USD SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC 5.80000% 23-13.07.28	2 460 000.00	2 540 138.66	0.05
USD SUMITOMO MITSUI TRUST BANK LTD-144A 1.05000% 20-12.09.25	5 240 000.00	4 912 586.00	0.09
USD SUZANO AUSTRIA GMBH 3.75000% 20-15.01.31	5 000 000.00	4 342 187.50	0.08
USD SYNCHRONY FINANCIAL 3.95000% 17-01.12.27	4 639 000.00	4 355 069.54	0.08
USD SYNCHRONY FINANCIAL 2.87500% 21-28.10.31	2 920 000.00	2 322 879.83	0.04
USD SYNCHRONY FINANCIAL-SUB 7.25000% 23-02.02.33	2 150 000.00	2 148 763.99	0.04
USD SYSCO CORP 2.45000% 21-14.12.31	3 000 000.00	2 546 339.70	0.05
USD SYSCO CORP 3.30000% 16-15.07.26	4 621 000.00	4 485 583.53	0.08
USD SYSCO CORP 5.75000% 23-17.01.29	2 394 000.00	2 496 973.86	0.05
USD T-MOBILE USA INC 2.62500% 21-15.02.29	4 122 000.00	3 709 337.11	0.07
USD T-MOBILE USA INC 2.62500% 21-15.04.26	4 263 000.00	4 058 394.33	0.08
USD T-MOBILE USA INC 3.37500% 21-15.04.29	8 018 000.00	7 438 405.23	0.14
USD T-MOBILE USA INC 3.50000% 21-15.04.31	4 250 000.00	3 871 198.78	0.07
USD T-MOBILE USA INC 3.75000% 21-15.04.27	6 700 000.00	6 495 628.76	0.12
USD T-MOBILE USA INC 3.87500% 21-15.04.30	7 880 000.00	7 452 131.84	0.14
USD T-MOBILE USA INC 4.37500% 21-15.04.40	2 965 000.00	2 675 715.65	0.05
USD T-MOBILE USA INC 5.05000% 23-15.07.33	5 205 000.00	5 210 996.26	0.10
USD T-MOBILE USA INC 5.75000% 23-15.01.34	2 529 000.00	2 664 454.15	0.05
USD TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC 3.70000% 22-14.04.27	2 600 000.00	2 525 574.95	0.05
USD TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE 4.00000% 22-14.04.32	2 555 000.00	2 405 881.77	0.05
USD TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 5.00000% 19-26.11.28	2 150 000.00	2 173 554.73	0.04
USD TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 2.05000% 20-31.03.30	11 394 000.00	9 740 283.00	0.18
USD TAPESTRY INC 7.00000% 23-27.11.26	1 719 000.00	1 773 069.74	0.03
USD TAPESTRY INC 7.05000% 23-27.11.25	200 000.00	204 585.28	0.00
USD TAPESTRY INC 7.35000% 23-27.11.28	2 245 000.00	2 351 496.65	0.04
USD TAPESTRY INC 7.70000% 23-27.11.30	2 189 000.00	2 320 115.57	0.04
USD TAPESTRY INC 7.85000% 23-27.11.33	229 000.00	244 740.81	0.00
USD TARGA RESOURCES CORP 6.50000% 23-30.03.34	5 712 000.00	6 158 792.59	0.12
USD TARGET CORP 4.40000% 23-15.01.33	2 985 000.00	2 964 915.43	0.06
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 3.15000% 16-01.10.26	6 750 000.00	6 277 500.00	0.12
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 6.00000% 18-15.04.24	2 607 000.00	2 597 458.38	0.05
USD THE HERSHEY CO 2.45000% 19-15.11.29	4 589 000.00	4 154 240.85	0.08
USD THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 4.97700% 23-10.08.30	2 139 000.00	2 186 628.52	0.04
USD THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 5.08600% 23-10.08.33	2 703 000.00	2 793 976.60	0.05
USD TIME WARNER CABLE LLC 5.50000% 11-01.09.41	200 000.00	176 026.42	0.00
USD TOLL BROTHERS FINANCE CORP 4.87500% 15-15.11.25	965 000.00	959 336.53	0.02
USD TORONTO-DOMINION BANK/THE 5.26400% 23-11.12.26	2 650 000.00	2 694 999.12	0.05
USD TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 3.75000% 14-10.04.24	1 200 000.00	1 196 198.77	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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 3.45500% 19-19.02.29	1 040 000.00	995 189.04	0.02
USD TOTAL CAPITAL SA 3.88300% 18-11.10.28	4 405 000.00	4 306 040.71	0.08
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 4.65000% 24-05.01.29	3 414 000.00	3 428 148.13	0.06
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 4.80000% 24-05.01.34	1 630 000.00	1 628 463.95	0.03
USD TRANE TECHNOLOGIES FINANCING LTD 5.25000% 23-03.03.33	5 300 000.00	5 476 352.41	0.10
USD TRANSCANADA PIPELINES LTD 4.62500% 14-01.03.34	2 720 000.00	2 580 444.47	0.05
USD TRINITY ACQUISITION PLC 4.40000% 16-15.03.26	700 000.00	690 228.55	0.01
USD TSMC ARIZONA CORP 3.87500% 22-22.04.27	565 000.00	551 106.65	0.01
USD TSMC ARIZONA CORP 4.12500% 22-22.04.29	1 340 000.00	1 307 129.80	0.02
USD TYSON FOODS INC 4.00000% 19-01.03.26	1 366 000.00	1 341 269.15	0.03
USD TYSON FOODS INC 4.35000% 19-01.03.29	3 196 000.00	3 118 268.39	0.06
USD UBS GROUP AG 4.55000% 23-17.04.26	405 000.00	400 653.13	0.01
USD UBS GROUP AG-REG-S 4.12500% 15-24.09.25	2 100 000.00	2 059 998.82	0.04
USD UNION PACIFIC CORP 2.80000% 22-14.02.32	5 100 000.00	4 483 387.16	0.08
USD UNITED AIRLINES INC-144A 4.62500% 21-15.04.29	1 565 000.00	1 447 675.91	0.03
USD UNITED PARCEL SERVICE INC 4.87500% 23-03.03.33	2 442 000.00	2 486 501.57	0.05
USD UNITED RENTALS NORTH AMERICA INC 5.50000% 16-15.05.27	1 800 000.00	1 795 381.13	0.03
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 3.37500% 17-15.04.27	2 315 000.00	2 239 939.78	0.04
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 3.85000% 18-15.06.28	2 861 000.00	2 796 650.42	0.05
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 3.87500% 18-15.12.28	2 500 000.00	2 433 872.58	0.05
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 4.20000% 22-15.05.32	115 000.00	111 368.77	0.00
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 4.25000% 23-15.01.29	5 344 000.00	5 306 104.79	0.10
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 4.50000% 23-15.04.33	840 000.00	827 229.01	0.02
USD VENTAS REALITY LP 3.75000% 14-01.05.24	535 000.00	532 461.22	0.01
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 4.50000% 17-10.08.33	2 899 000.00	2 801 103.72	0.05
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 4.01600% 19-03.12.29	3 756 000.00	3 611 667.67	0.07
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.15000% 20-22.03.30	4 450 000.00	4 053 780.76	0.08
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 1.50000% 20-18.09.30	4 585 000.00	3 764 269.96	0.07
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.65000% 20-20.11.40	1 555 000.00	1 110 457.29	0.02
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.10000% 21-22.03.28	8 880 000.00	8 029 534.16	0.15
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.55000% 21-21.03.31	5 394 000.00	4 636 713.31	0.09
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.40000% 21-22.03.41	3 000 000.00	2 372 099.34	0.04
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.85000% 21-03.09.41	950 000.00	695 024.90	0.01
USD VF CORP 2.95000% 20-23.04.30	5 430 000.00	4 557 156.55	0.09
USD VIACOMCBS INC 4.20000% 20-19.05.32	290 000.00	258 054.80	0.00
USD VIACOMCBS INC 4.95000% 20-15.01.31	4 751 000.00	4 492 405.92	0.08
USD VMWARE INC 1.00000% 21-15.08.24	3 750 000.00	3 657 023.28	0.07
USD VMWARE INC 1.40000% 21-15.08.26	3 370 000.00	3 084 636.79	0.06
USD WABTEC CORP/DE 3.20000% 20-15.06.25	2 285 000.00	2 220 639.00	0.04
USD WABTEC CORP/DE 3.45000% 17-15.11.26	4 065 000.00	3 905 662.16	0.07
USD WALMART INC 3.90000% 23-15.04.28	4 175 000.00	4 132 743.78	0.08
USD WALMART INC 4.15000% 22-09.09.32	3 715 000.00	3 675 431.87	0.07
USD WARNERMEDIA HOLDINGS INC 3.63800% 23-15.03.25	5 021 000.00	4 924 895.85	0.09
USD WARNERMEDIA HOLDINGS INC 4.27900% 23-15.03.32	24 798 000.00	22 705 302.00	0.43
USD WARNERMEDIA HOLDINGS INC 5.14100% 23-15.03.52	730 000.00	627 484.20	0.01
USD WASTE MANAGEMENT INC 4.62500% 23-15.02.30	4 000 000.00	4 019 927.56	0.08
USD WELLTOWER INC 2.75000% 20-15.01.31	825 000.00	713 603.98	0.01
USD WELLTOWER INC 3.10000% 19-15.01.30	5 040 000.00	4 562 384.60	0.09
USD WELLTOWER INC 4.00000% 15-01.06.25	5 950 000.00	5 852 629.32	0.11
USD WELLTOWER INC 4.25000% 16-01.04.26	1 230 000.00	1 215 778.27	0.02
USD WELLTOWER OP LLC 2.75000% 21-15.01.32	3 000 000.00	2 543 757.63	0.05
USD WESTERN DIGITAL CORP 2.85000% 21-01.02.29	729 000.00	623 358.57	0.01
USD WESTERN DIGITAL CORP 3.10000% 21-01.02.32	2 138 000.00	1 700 339.43	0.03
USD WESTERN MIDSTREAM OPERATING LP STEP-UP/DOWN 20-01.02.30	3 210 000.00	3 000 499.03	0.06
USD WESTERN MIDSTREAM OPERATING LP 6.15000% 23-01.04.33	5 560 000.00	5 730 902.12	0.11
USD WESTERN MIDSTREAM OPERATING 6.35000% 23-15.01.29	2 750 000.00	2 874 734.50	0.05
USD WESTERN UNION CO/THE 1.35000% 21-15.03.26	4 620 000.00	4 266 324.26	0.08
USD WESTERN UNION CO/THE 2.75000% 21-15.03.31	1 000 000.00	832 195.20	0.02

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット・サステナブル

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD WILLIAMS COMPANIES INC 2.60000% 21-15.03.31	6 500 000.00	5 555 443.40	0.10
USD WILLIAMS COS INC/THE 3.75000% 17-15.06.27	9 770 000.00	9 426 764.46	0.18
USD WILLIS NORTH AMERICA INC 5.35000% 23-15.05.33	3 835 000.00	3 855 960.24	0.07
USD WORKDAY INC 3.70000% 22-01.04.29	1 665 000.00	1 586 551.86	0.03
USD WP CAREY INC 2.25000% 21-01.04.33	1 615 000.00	1 254 360.65	0.02
USD WP CAREY INC 2.45000% 21-01.02.32	2 535 000.00	2 071 074.45	0.04
USD WRKCO INC 4.65000% 19-15.03.26	730 000.00	724 769.34	0.01
USD ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC 3.55000% 15-01.04.25	2 690 000.00	2 641 724.21	0.05
USD ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC 5.35000% 23-01.12.28	2 126 000.00	2 188 924.14	0.04
USD ZOETIS INC 2.00000% 20-15.05.30	3 790 000.00	3 236 402.02	0.06
USD ZOETIS INC 5.40000% 22-14.11.25	95 000.00	95 915.49	0.00
USD ZOETIS INC 5.60000% 22-16.11.32	1 685 000.00	1 782 489.81	0.03
米ドル合計		2 378 369 894.33	44.62
ノート、固定利付債合計		2 385 684 671.47	44.76
ノート、変動利付債			
USD			
USD ABN AMRO BANK NV-144A 2.470%/VAR 21-13.12.29	2 000 000.00	1 760 709.18	0.03
USD ALLY FINANCIAL INC 6.992%/VAR 23-13.06.29	2 885 000.00	2 988 090.54	0.06
USD ALLY FINANCIAL INC 6.848%/VAR 23-03.01.30	1 008 000.00	1 040 621.06	0.02
USD AMERICAN EXPRESS CO 6.489%/VAR 23-30.10.31	8 725 000.00	9 452 406.12	0.18
USD AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING-REG-S-SUB 6.750%/VAR 16-PRP	1 275 000.00	1 283 899.10	0.02
USD BANCO SANTANDER SA 1.722%/VAR 21-14.09.27	4 200 000.00	3 809 236.96	0.07
USD BANCO SANTANDER SA 4.175%/VAR 22-24.03.28	1 000 000.00	963 124.57	0.02
USD BANCO SANTANDER SA-SUB COCO 9.625%/VAR 23-PRP	1 200 000.00	1 287 000.00	0.02
USD BANK OF AMERICA CORP 3.366%/VAR 18-23.01.26	9 925 000.00	9 720 143.43	0.18
USD BANK OF AMERICA CORP 3.419%/VAR 18-20.12.28	3 803 000.00	3 592 499.39	0.07
USD BANK OF AMERICA CORP 2.651%/VAR 21-11.03.32	6 905 000.00	5 858 200.00	0.11
USD BANK OF AMERICA CORP 1.658%/VAR 21-11.03.27	11 805 000.00	10 986 530.55	0.21
USD BANK OF AMERICA CORP 1.734%/VAR 21-22.07.27	12 673 000.00	11 681 100.26	0.22
USD BANK OF AMERICA CORP 2.299%/VAR 21-21.07.32	695 000.00	570 584.63	0.01
USD BANK OF AMERICA CORP 2.972%/VAR 22-04.02.33	4 554 000.00	3 885 041.58	0.07
USD BANK OF AMERICA CORP 4.571%/VAR 22-27.04.33	9 590 000.00	9 176 325.86	0.17
USD BANK OF AMERICA CORP 5.202%/VAR 23-25.04.29	4 050 000.00	4 083 128.60	0.08
USD BANK OF AMERICA CORP 5.468%/VAR 24-23.01.35	7 281 000.00	7 414 602.50	0.14
USD BANK OF IRELAND GROUP-144A 2.029%/VAR 21-30.09.27	13 755 000.00	12 550 337.10	0.24
USD BANK OF MONTREAL-SUB COCO 3.803%/VAR 17-15.12.32	4 830 000.00	4 486 083.23	0.08
USD BANK OF MONTREAL-SUB 3.088%/VAR 22-10.01.37	5 000 000.00	4 057 032.00	0.08
USD BANK OF NEW YORK MELLON CORP/THE 4.543%/VAR 23-01.02.29	3 300 000.00	3 281 957.35	0.06
USD BARCLAYS PLC 3.932%/VAR 19-07.05.25	4 957 000.00	4 933 188.51	0.09
USD BARCLAYS PLC 6.224%/VAR 23-09.05.34	525 000.00	540 702.73	0.01
USD BARCLAYS PLC 7.325%/VAR 22-02.11.26	5 175 000.00	5 343 067.85	0.10
USD BARCLAYS PLC 7.437%/VAR 22-02.11.33	250 000.00	278 648.72	0.01
USD BARCLAYS PLC-SUB 7.119%/VAR 23-27.06.34	1 628 000.00	1 719 712.74	0.03
USD BARCLAYS PLC-SUB COCO 6.125%/VAR 20-PRP	2 223 000.00	2 106 936.95	0.04
USD BBVA BANCOMER SA/TEXAS-144A-SUB 5.875%/VAR 19-13.09.34	2 020 000.00	1 865 167.00	0.04
USD BBVA BANCOMER SA/TEXAS-REG-S-SUB 5.125%/VAR 18-18.01.33	2 270 000.00	2 069 218.50	0.04
USD BNP PARIBAS-REG-S-SUB 7.375%/VAR 15-PRP	211 000.00	211 128.28	0.00
USD CAPITAL ONE FINANCIAL CORP 2.636%/VAR 22-03.03.26	8 740 000.00	8 451 761.70	0.16
USD CAPITAL ONE FINANCIAL CORP 5.468%/VAR 23-01.02.29	4 680 000.00	4 687 638.60	0.09
USD CAPITAL ONE FINANCIAL CORP 6.312%/VAR 23-08.06.29	2 133 000.00	2 198 918.27	0.04
USD CAPITAL ONE FINANCIAL CORP 6.377%/VAR 23-08.06.34	1 030 000.00	1 070 202.33	0.02
USD CAPITAL ONE FINANCIAL CORP 7.624%/VAR 23-30.10.31	4 832 000.00	5 337 479.96	0.10
USD CHARLES SCHWAB CORP-SUB 4.000%/VAR 21-PRP	2 570 000.00	2 335 542.50	0.04
USD CITIGROUP INC 0.981%/VAR 21-01.05.25	3 945 000.00	3 893 828.42	0.07
USD CITIGROUP INC 1.122%/VAR 21-28.01.27	2 550 000.00	2 354 974.95	0.04
USD CITIGROUP INC 1.462%/VAR 21-09.06.27	10 185 000.00	9 359 984.44	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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD CITIGROUP INC 2.520%/VAR 21-03.11.32	2 025 000.00	1 674 209.45	0.03
USD CITIGROUP INC 2.561%/VAR 21-01.05.32	5 801 000.00	4 857 663.78	0.09
USD CITIGROUP INC 2.572%/VAR 20-03.06.31	3 570 000.00	3 075 034.03	0.06
USD CITIGROUP INC 2.666%/VAR 20-29.01.31	5 725 000.00	4 995 554.90	0.09
USD CITIGROUP INC 2.976%/VAR 19-05.11.30	6 815 000.00	6 115 919.00	0.11
USD CITIGROUP INC 3.057%/VAR 22-25.01.33	2 030 000.00	1 738 851.97	0.03
USD CITIGROUP INC 3.070%/VAR 22-24.02.28	1 650 000.00	1 560 002.30	0.03
USD CITIGROUP INC 3.106%/VAR 20-08.04.26	1 370 000.00	1 335 629.03	0.03
USD CITIGROUP INC 3.290%/VAR 22-17.03.26	4 760 000.00	4 652 384.54	0.09
USD CITIGROUP INC 3.352%/VAR 19-24.04.25	4 162 000.00	4 139 478.46	0.08
USD CITIGROUP INC 3.520%/VAR 17-27.10.28	6 500 000.00	6 166 251.39	0.12
USD CITIGROUP INC 3.980%/3M LIBOR+133.8BP 19-20.03.30	4 570 000.00	4 355 337.50	0.08
USD CITIGROUP INC 4.140%/VAR 22-24.05.25	2 550 000.00	2 537 290.09	0.05
USD CITIGROUP INC 6.270%/VAR 22-17.11.33	2 200 000.00	2 361 066.91	0.04
USD CITIGROUP INC-SUB 4.000%/VAR 20-PRP	3 647 000.00	3 407 926.02	0.06
USD CITIGROUP INC-SUB 6.174%/VAR 23-25.05.34	2 981 000.00	3 092 048.06	0.06
USD DANSKE BANK A/S-144A 6.466%/VAR 23-09.01.26	712 000.00	717 613.70	0.01
USD DANSKE BANK AS-144A 4.298%/VAR 22-01.04.28	1 710 000.00	1 661 950.31	0.03
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 3.961%/VAR 19-26.11.25	2 150 000.00	2 115 194.51	0.04
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 2.129%/VAR 20-24.11.26	3 603 000.00	3 392 054.04	0.06
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 2.311%/VAR 21-16.11.27	6 050 000.00	5 535 992.36	0.10
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 6.720%/VAR 23-18.01.29	1 830 000.00	1 905 227.59	0.04
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 6.819%/VAR 23-20.11.29	510 000.00	535 929.93	0.01
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 6.119%/VAR 22-14.07.26	1 512 000.00	1 522 886.65	0.03
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 7.146%/VAR 23-13.07.27	190 000.00	196 786.96	0.00
USD DISCOVER BANK-SUB 4.682%/VAR 18-09.08.28	2 728 000.00	2 634 433.50	0.05
USD DISCOVER FINANCIAL SERVICES 7.964%/VAR 23-02.11.34	105 000.00	117 081.24	0.00
USD ENTERPRISE PRODUCTS-SUB 5.375%/VAR 18-15.02.78	2 450 000.00	2 282 849.48	0.04
USD FIFTH THIRD BANCORP 6.361%/VAR 22-27.10.28	5 000 000.00	5 163 002.35	0.10
USD FIFTH THIRD BANCORP 6.339%/VAR 23-27.07.29	1 465 000.00	1 525 223.45	0.03
USD FIFTH THIRD BANCORP 5.631%/VAR 24-29.01.32	483 000.00	487 542.45	0.01
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.814%/VAR 18-23.04.29	10 095 000.00	9 612 756.29	0.18
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 1.093%/VAR 20-09.12.26	10 210 000.00	9 477 099.14	0.18
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 1.431%/VAR 21-09.03.27	18 023 000.00	16 679 369.31	0.31
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 2.615%/VAR 21-22.04.32	12 335 000.00	10 408 088.35	0.20
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 1.542%/VAR 21-10.09.27	22 875 000.00	20 868 042.66	0.39
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 2.383%/VAR 21-21.07.32	9 955 000.00	8 208 384.11	0.15
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 1.948%/VAR 21-21.10.27	3 680 000.00	3 384 429.94	0.06
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 2.650%/VAR 21-21.10.32	6 795 000.00	5 684 313.63	0.11
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 4.482%/VAR 22-23.08.28	4 620 000.00	4 551 615.13	0.09
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 5.798%/VAR 23-10.08.26	4 370 000.00	4 411 076.42	0.08
USD HASBRO INC 3.900%/RATING LINKED 19-19.11.29	5 693 000.00	5 285 276.39	0.10
USD HSBC HOLDINGS PLC 1.589%/VAR 20-24.05.27	7 000 000.00	6 439 451.69	0.12
USD HSBC HOLDINGS PLC 2.357%/VAR 20-18.08.31	3 351 000.00	2 799 743.41	0.05
USD HSBC HOLDINGS PLC 2.804%/VAR 21-24.05.32	5 275 000.00	4 431 404.96	0.08
USD HSBC HOLDINGS PLC 2.206%/VAR 21-17.08.29	13 115 000.00	11 477 361.30	0.22
USD HSBC HOLDINGS PLC 2.251%/VAR 21-22.11.27	10 570 000.00	9 738 959.23	0.18
USD HSBC HOLDINGS PLC 2.999%/VAR 22-10.03.26	3 665 000.00	3 563 358.85	0.07
USD HSBC HOLDINGS PLC 3.803%/VAR 19-11.03.25	2 400 000.00	2 394 663.64	0.05
USD HSBC HOLDINGS PLC 4.041%/VAR 17-13.03.28	434 000.00	419 302.96	0.01
USD HSBC HOLDINGS PLC 4.583%/VAR 18-19.06.29	15 093 000.00	14 667 183.15	0.28
USD HSBC HOLDINGS PLC 4.292%/VAR 18-12.09.26	2 120 000.00	2 083 196.70	0.04
USD HSBC HOLDINGS PLC 6.161%/VAR 23-09.03.29	4 310 000.00	4 455 255.02	0.08
USD HSBC HOLDINGS PLC 6.254%/VAR 23-09.03.34	6 000 000.00	6 371 606.82	0.12
USD HSBC HOLDINGS PLC 7.336%/VAR 22-03.11.26	4 397 000.00	4 563 667.89	0.09
USD HSBC HOLDINGS PLC 7.390%/VAR 22-03.11.28	7 242 000.00	7 776 191.35	0.15
USD HSBC HOLDINGS PLC-SUB 4.762%/VAR 22-29.03.33	1 536 000.00	1 428 982.63	0.03
USD HSBC HOLDINGS PLC-SUB 8.113%/VAR 22-03.11.33	1 692 000.00	1 943 979.56	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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD HSBC HOLDINGS PLC-SUB 7.399%/VAR 23-13.11.34	2 167 000.00	2 369 333.55	0.04
USD HUNTINGTON BANCSHARES INC 6.208%/VAR 23-21.08.29	3 140 000.00	3 245 386.69	0.06
USD JP MORGAN CHASE & CO 4.005%/VAR 18-23.04.29	4 750 000.00	4 591 640.65	0.09
USD JP MORGAN CHASE & CO 2.580%/VAR 21-22.04.32	7 180 000.00	6 083 151.18	0.11
USD JP MORGAN CHASE & CO 1.470%/VAR 21-22.09.27	44 640 000.00	40 746 995.59	0.76
USD JP MORGAN CHASE & CO 5.040%/VAR 24-23.01.28	5 757 000.00	5 781 623.49	0.11
USD JP MORGAN CHASE & CO 5.336%/VAR 24-23.01.35	1 793 000.00	1 822 151.33	0.03
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.782%/VAR 17-01.02.28	4 250 000.00	4 114 623.01	0.08
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.509%/3M LIBOR+94.5BP 18-23.01.29	5 235 000.00	4 976 128.25	0.09
USD JPMORGAN CHASE & CO 4.452%/3M LIBOR+133BP 18-05.12.29	6 640 000.00	6 518 647.23	0.12
USD JPMORGAN CHASE & CO 2.739%/VAR 19-15.10.30	3 870 000.00	3 445 119.39	0.06
USD JPMORGAN CHASE & CO 2.301%/VAR 19-15.10.25	5 175 000.00	5 061 077.70	0.10
USD JPMORGAN CHASE & CO 2.083%/VAR 20-22.04.26	7 010 000.00	6 741 162.86	0.13
USD JPMORGAN CHASE & CO 2.522%/VAR 20-22.04.31	7 960 000.00	6 921 318.23	0.13
USD JPMORGAN CHASE & CO 1.040%/VAR 21-04.02.27	2 035 000.00	1 878 780.48	0.04
USD JPMORGAN CHASE & CO 1.953%/VAR 21-04.02.32	725 000.00	591 800.36	0.01
USD JPMORGAN CHASE & CO 1.578%/VAR 21-22.04.27	37 645 000.00	34 941 761.49	0.66
USD JPMORGAN CHASE & CO 2.069%/VAR 21-01.06.29	6 450 000.00	5 746 599.38	0.11
USD JPMORGAN CHASE & CO 0.768%/VAR 21-09.08.25	4 500 000.00	4 384 342.75	0.08
USD JPMORGAN CHASE & CO 2.963%/VAR 22-25.01.33	4 675 000.00	4 022 948.91	0.08
USD JPMORGAN CHASE & CO 2.947%/VAR 22-24.02.28	6 796 000.00	6 413 727.45	0.12
USD JPMORGAN CHASE & CO 6.070%/VAR 23-22.10.27	9 226 000.00	9 503 507.38	0.18
USD JPMORGAN CHASE & CO-SUB 2.956%/VAR 20-13.05.31	7 295 000.00	6 438 537.46	0.12
USD JPMORGAN CHASE-SUB 5.717%/VAR 22-14.09.33	6 000 000.00	6 183 296.76	0.12
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 2.438%/VAR 20-05.02.26	3 150 000.00	3 051 476.91	0.06
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 5.985%/VAR 23-07.08.27	4 650 000.00	4 718 108.17	0.09
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 3.870%/VAR 20-09.07.25	3 654 000.00	3 627 469.04	0.07
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 3.511%/VAR 22-18.03.26	2 880 000.00	2 814 879.02	0.05
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.716%/VAR 22-11.08.26	8 561 000.00	8 474 285.37	0.16
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC-SUB COCO 8.000%/VAR 23-PRP	1 299 000.00	1 273 549.60	0.02
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 5.462%/VAR 24-05.01.28	779 000.00	783 572.10	0.01
USD MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GP INC 1.538%/VAR 21-20.07.27	8 070 000.00	7 398 345.01	0.14
USD MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 1.640%/VAR 21-13.10.27	4 773 000.00	4 357 757.74	0.08
USD MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 0.962%/VAR 21-11.10.25	19 484 000.00	18 847 186.70	0.35
USD MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GRP INC 5.719%/VAR 23-20.02.26	2 948 000.00	2 959 471.79	0.06
USD MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 5.242%/VAR 23-19.04.29	1 420 000.00	1 435 182.81	0.03
USD MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 1.554%/VAR 21-09.07.27	1 875 000.00	1 716 572.51	0.03
USD MORGAN STANLEY 0.985%/VAR 20-10.12.26	6 330 000.00	5 847 513.92	0.11
USD MORGAN STANLEY 1.593%/VAR 21-04.05.27	7 526 000.00	6 969 760.80	0.13
USD MORGAN STANLEY 1.928%/VAR 21-28.04.32	11 000 000.00	8 874 330.85	0.17
USD MORGAN STANLEY 2.630%/VAR 22-18.02.26	3 660 000.00	3 557 017.89	0.07
USD MORGAN STANLEY 5.466%/VAR 24-18.01.35	1 080 000.00	1 102 141.95	0.02
USD MORGAN STANLEY-SUB 2.484%/VAR 21-16.09.36	1 341 000.00	1 071 647.51	0.02
USD NATWEST GROUP PLC 1.642%/VAR 21-14.06.27	4 780 000.00	4 391 678.63	0.08
USD NATWEST GROUP PLC 4.892%/VAR 18-18.05.29	3 275 000.00	3 216 445.42	0.06
USD NATWEST GROUP PLC 4.269%/VAR 19-22.03.25	3 119 000.00	3 111 452.02	0.06
USD NIPPON LIFE INSURANCE CO-144A-SUB 2.750%/VAR 21-21.01.51	3 840 000.00	3 176 939.74	0.06
USD NORDEA BANK ABP-REG-S-SUB 6.625%/VAR 19-PRP	2 590 000.00	2 560 215.00	0.05
USD PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE 6.615%/VAR 23-20.10.27	6 633 000.00	6 894 678.15	0.13
USD PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE 6.875%/VAR 23-20.10.34	1 460 000.00	1 622 613.61	0.03
USD PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC 5.300%/VAR 24-21.01.28	4 371 000.00	4 409 700.22	0.08
USD PNC FINANCIAL SERVICES GRP 5.676%/VAR 24-22.01.35	3 405 000.00	3 494 214.16	0.07
USD PRUDENTIAL FINANCIAL-SUB 5.200%/3M LIBOR+304BP 13-15.03.44	1 589 000.00	1 582 915.65	0.03
USD PRUDENTIAL FINANCIAL INC-SUB 5.375%/VAR 15-15.05.45	2 735 000.00	2 695 060.52	0.05
USD PRUDENTIAL FINANCIAL INC-SUB 5.125%/VAR 22-01.03.52	2 311 000.00	2 157 876.84	0.04
USD SANTANDER HOLDINGS USA INC 2.490%/VAR 21-06.01.28	2 999 000.00	2 741 792.63	0.05
USD SANTANDER HOLDINGS USA INC 4.260%/VAR 22-09.06.25	1 449 000.00	1 435 900.59	0.03
USD SANTANDER HOLDINGS USA INC 6.499%/VAR 23-09.03.29	187 000.00	193 530.43	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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD SANTANDER UK GROUP HOLDINGS PLC 1.089%/VAR 21-15.03.25	860 000.00	854 630.31	0.02
USD SANTANDER UK GROUP HOLDINGS PLC 1.673%/VAR 21-14.06.27	2 235 000.00	2 042 455.85	0.04
USD SANTANDER UK GROUP HOLD PLC 2.469%/VAR 22-11.01.28	7 000 000.00	6 428 444.61	0.12
USD SANTANDER UK GROUP HOLDINGS 6.833%/VAR 22-21.11.26	8 020 000.00	8 191 756.24	0.15
USD SANTANDER UK GROUP HOLDINGS PLC 6.534%/VAR 23-10.01.29	5 212 000.00	5 401 043.82	0.10
USD SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-REG-SUB 6.875%/VAR 22-PRP	600 000.00	593 250.00	0.01
USD STANDARD CHARTERED PLC-144A-SUB 6.409%/3M LIBOR+151BP 06-PRP	200 000.00	191 932.96	0.00
USD STANDARD CHARTERED PLC-144A 3.785%/VAR 19-21.05.25	2 256 000.00	2 241 318.79	0.04
USD STANDARD CHARTERED PLC-144A 1.456%/VAR 21-14.01.27	1 223 000.00	1 126 708.31	0.02
USD STANDARD CHARTERED PLC-144A 2.608%/VAR 22-12.01.28	2 573 000.00	2 370 971.18	0.04
USD SVENSKA HANDELSBANKEN AB-REG-S-SUB COCO 4.750%/VAR 20-PRP	1 800 000.00	1 518 418.80	0.03
USD SWEDBANK AB-REG-S-SUB COCO 5.625%/VAR 19-PRP	2 800 000.00	2 768 500.00	0.05
USD SWEDBANK AB-REG-S-SUB 4.000%/VAR 21-PRP	800 000.00	644 016.00	0.01
USD SWISS RE FINANCE LUXEMBOURG-144A-SUB 5.000%/VAR 19-02.04.49	1 224 000.00	1 181 160.00	0.02
USD SWISS RE FINANCE LUXEMBOURG-REG-S-SUB 5.000%/VAR 19-02.04.49	1 000 000.00	965 000.00	0.02
USD TORONTO-DOMINION BANK-SUB COCO 3.625%/VAR 16-15.09.31	6 327 000.00	6 088 426.99	0.11
USD UBS GROUP AG-144A 1.305%/VAR 21-02.02.27	7 190 000.00	6 612 599.86	0.12
USD UBS GROUP AG-144A 1.494%/VAR 21-10.08.27	9 115 000.00	8 279 215.01	0.16
USD UBS GROUP AG-144A 2.193%/VAR 20-05.06.26	1 699 000.00	1 624 547.51	0.03
USD UBS GROUP AG-144A 3.869%/VAR 18-12.01.29	2 320 000.00	2 201 130.18	0.04
USD UBS GROUP AG-144A 4.194%/VAR 20-01.04.31	5 927 000.00	5 552 635.27	0.10
USD UBS GROUP AG-144A 4.703%/VAR 22-05.08.27	1 040 000.00	1 027 107.88	0.02
USD UBS GROUP AG-144A 6.373%/VAR 22-15.07.26	1 178 000.00	1 191 222.48	0.02
USD UBS GROUP AG-144A 6M SORF+173BP 21-14.05.32	4 162 000.00	3 573 534.28	0.07
USD UBS GROUP AG-144A 9.016%/VAR 22-15.11.33	2 440 000.00	2 999 443.64	0.06
USD UBS GROUP AG-REG-S 2.593%/VAR 19-11.09.25	2 375 000.00	2 331 098.96	0.04
USD US BANCORP 4.653%/VAR 23-01.02.29	3 310 000.00	3 260 975.49	0.06
USD US BANCORP 4.839%/VAR 23-01.02.34	8 765 000.00	8 425 314.43	0.16
USD US BANCORP 5.678%/VAR 24-23.01.35	6 822 000.00	6 980 251.85	0.13
USD US BANCORP 5.775%/VAR 23-12.06.29	2 392 000.00	2 450 602.90	0.05
USD US BANCORP 5.836%/VAR 23-12.06.34	365 000.00	376 679.31	0.01
USD US BANCORP 6.787%/VAR 23-26.10.27	5 291 000.00	5 519 763.90	0.10
USD VODAFONE GROUP PLC-SUB 3.250%/VAR 21-04.06.81	1 365 000.00	1 270 477.98	0.02
USD WELLS FARGO & CO 2.188%/VAR 20-30.04.26	10 036 000.00	9 655 031.13	0.18
USD WELLS FARGO & CO 5.198%/VAR 24-23.01.30	13 500 000.00	13 604 968.84	0.26
USD WELLS FARGO & CO 6.303%/VAR 23-23.10.29	2 630 000.00	2 771 882.29	0.05
USD WELLS FARGO & CO 6.491%/VAR 23-23.10.34	13 775 000.00	15 027 778.26	0.28
USD WELLS FARGO & CO-SUB 7.625%/VAR 23-PRP	588 000.00	615 946.46	0.01
USD WESTPAC BANKING CORP-SUB 4.110%/VAR 19-24.07.34	3 350 000.00	3 103 726.27	0.06
USD WESTPAC BANKING CORP-SUB 2.668%/VAR 20-15.11.35	7 700 000.00	6 381 666.90	0.12
米ドル合計		914 204 512.75	17.15
ノート、変動利付債合計		914 204 512.75	17.15

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	970 970.00	0.02
USD AIR LEASE CORP 0.70000% 21-15.02.24	1 900 000.00	1 896 500.86	0.04
USD AIR LEASE CORP 2.87500% 20-15.01.26	5 272 000.00	5 032 548.82	0.09
USD AMERICAN HONDA FINANCE CORP 5.12500% 23-07.07.28	2 750 000.00	2 811 894.95	0.05
USD AMERICAN HONDA FINANCE CORP 4.90000% 24-10.01.34	2 385 000.00	2 383 841.25	0.04
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 3.95000% 15-21.04.25	7 275 000.00	7 158 145.75	0.13
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 4.18300% 16-25.11.27	4 650 000.00	4 538 227.48	0.08
USD BB&T CORP 2.50000% 19-01.08.24	2 950 000.00	2 905 954.17	0.05
USD CBS CORP 7.87500% 00-30.07.30	2 900 000.00	3 163 138.78	0.06
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 3.70000% 18-30.05.24	4 200 000.00	4 179 103.11	0.08
USD JOHN DEERE CAPITAL CORP 1.75000% 20-09.03.27	3 459 000.00	3 188 303.50	0.06
USD JOHN DEERE CAPITAL CORP 2.00000% 21-17.06.31	6 259 000.00	5 283 702.34	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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD JOHN DEERE CAPITAL CORP 4.80000% 23-09.01.26	3 675 000.00	3 694 674.73	0.07
USD JOHN DEERE CAPITAL CORP 4.75000% 23-20.01.28	6 094 000.00	6 183 138.34	0.12
USD JOHN DEERE CAPITAL CORP 4.70000% 23-10.06.30	2 458 000.00	2 486 087.74	0.05
USD JOHN DEERE CAPITAL CORP 4.95000% 23-14.07.28	2 422 000.00	2 475 319.19	0.05
USD MCDONALD ' S CORP 3.50000% 17-01.03.27	5 400 000.00	5 257 776.74	0.10
USD MCDONALD ' S CORP 3.60000% 20-01.07.30	3 322 000.00	3 141 576.73	0.06
USD MORGAN STANLEY 3.87500% 16-27.01.26	6 715 000.00	6 592 297.68	0.12
USD MORGAN STANLEY 4.00000% 15-23.07.25	1 635 000.00	1 614 114.28	0.03
USD MORGAN STANLEY-SUB 3.95000% 15-23.04.27	8 560 000.00	8 330 483.97	0.16
USD MORGAN STANLEY-SUB 4.35000% 14-08.09.26	7 510 000.00	7 397 474.37	0.14
USD NORDEA BANK ABP-144A 1.50000% 21-30.09.26	4 575 000.00	4 186 142.48	0.08
USD PUBLIC SERVICE ELECTRIC & GAS CO 3.00000% 17-15.05.27	455 000.00	435 245.71	0.01
USD PUBLIC SERVICE ELECTRIC & GAS CO 3.70000% 18-01.05.28	835 000.00	810 165.10	0.01
USD PUBLIC SERVICE ELECTRIC & GAS CO 3.65000% 18-01.09.28	1 530 000.00	1 479 034.40	0.03
USD PUBLIC SERVICE ELECTRIC & GAS CO 3.20000% 19-15.05.29	1 685 000.00	1 586 085.26	0.03
USD ROYAL BANK OF CANADA-SUB COCO 4.65000% 16-27.01.26	4 225 000.00	4 202 479.56	0.08
USD ROYAL BANK OF CANADA 1.15000% 21-14.07.26	9 400 000.00	8 629 585.87	0.16
USD RYDER SYSTEM INC 1.75000% 21-01.09.26	7 230 000.00	6 682 376.30	0.12
USD RYDER SYSTEM INC 4.62500% 20-01.06.25	675 000.00	671 011.99	0.01
USD RYDER SYSTEM INC 5.65000% 23-01.03.28	4 465 000.00	4 597 603.05	0.09
USD SHINHAN FIN GROUP CO LTD-144A 1.35000% 20-10.01.26	2 170 000.00	2 016 841.40	0.04
USD SUMITOMO MITSUI TRUST BANK LTD-144A 2.80000% 22-10.03.27	2 770 000.00	2 597 608.35	0.05
USD SUMITOMO TRUST & BANKING CO-144A 5.65000% 23-09.03.26	1 750 000.00	1 771 519.76	0.03
USD TENCENT HOLDINGS LTD-144A 3.97500% 19-11.04.29	3 195 000.00	3 037 103.10	0.06
USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.57500% 19-11.04.26	480 000.00	464 740.80	0.01
USD TORONTO-DOMINION BANK 1.95000% 22-12.01.27	7 570 000.00	7 036 205.54	0.13
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 0.80000% 21-09.01.26	7 400 000.00	6 882 477.00	0.13
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 5.55000% 23-20.11.30	5 382 000.00	5 652 008.05	0.11
米ドル合計		153 423 508.50	2.88
中期債券、固定利付債合計		153 423 508.50	2.88

中期債券、変動利付債

USD BANCO DE CREDITO DEL PERU-144A-SUB 3.125%/VAR 20-01.07.30	3 230 000.00	3 063 978.00	0.06
USD BANK OF AMERICA CO 3.705%/VAR 17-24.04.28	3 489 000.00	3 353 522.65	0.06
USD BANK OF AMERICA CORP 3.593%/VAR 17-21.07.28	2 350 000.00	2 242 099.75	0.04
USD BANK OF AMERICA CORP 3.974%/VAR 19-07.02.30	4 500 000.00	4 293 597.55	0.08
USD BANK OF AMERICA CORP 3.458%/3M LIBOR+97BP 19-15.03.25	13 270 000.00	13 233 878.00	0.25
USD BANK OF AMERICA CORP 3.559%/VAR 19-23.04.27	7 170 000.00	6 928 917.07	0.13
USD BANK OF AMERICA CORP 3.194%/VAR 19-23.07.30	14 525 000.00	13 251 952.75	0.25
USD BANK OF AMERICA CORP 2.456%/VAR 19-22.10.25	2 500 000.00	2 441 557.40	0.05
USD BANK OF AMERICA CORP 2.884%/VAR 19-22.10.30	8 450 000.00	7 535 528.07	0.14
USD BANK OF AMERICA CORP 2.496%/3M LIBOR+99BP 20-13.02.31	3 180 000.00	2 749 303.03	0.05
USD BANK OF AMERICA CORP 1.319%/VAR 20-19.06.26	2 720 000.00	2 573 792.16	0.05
USD BANK OF AMERICA CORP 1.898%/VAR 20-23.07.31	5 695 000.00	4 688 417.70	0.09
USD BANK OF AMERICA CORP 2.087%/VAR 21-14.06.29	26 390 000.00	23 389 644.11	0.44
USD BANK OF AMERICA CORP 3.384%/VAR 22-02.04.26	2 810 000.00	2 746 723.80	0.05
USD BANK OF NEW YORK MELLON CORP 6.317%/VAR 23-25.10.29	5 000 000.00	5 309 446.10	0.10
USD BB&T CORP 6.047%/VAR 23-08.06.27	1 863 000.00	1 897 793.76	0.04
USD MORGAN STANLEY 0.864%/VAR 20-21.10.25	2 075 000.00	2 004 556.36	0.04
USD MORGAN STANLEY 1.164%/VAR 21-21.10.25	2 500 000.00	2 414 657.40	0.05
USD MORGAN STANLEY 1.512%/VAR 21-20.07.27	33 547 000.00	30 789 222.91	0.58
USD MORGAN STANLEY 1.794%/VAR 20-13.02.32	930 000.00	746 602.93	0.01
USD MORGAN STANLEY 2.188%/VAR 20-28.04.26	8 400 000.00	8 097 901.73	0.15
USD MORGAN STANLEY 2.239%/VAR 21-21.07.32	5 816 000.00	4 768 530.43	0.09
USD MORGAN STANLEY 2.475%/VAR 22-21.01.28	624 000.00	581 639.52	0.01
USD MORGAN STANLEY 2.511%/VAR 21-20.10.32	2 220 000.00	1 848 979.79	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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD MORGAN STANLEY 2.699%/VAR 20-22.01.31	17 545 000.00	15 415 860.04	0.29
USD MORGAN STANLEY 2.720%/VAR 19-22.07.25	5 965 000.00	5 882 659.38	0.11
USD MORGAN STANLEY 2.943%/VAR 22-21.01.33	3 250 000.00	2 773 542.03	0.05
USD MORGAN STANLEY 3.622%/VAR 20-01.04.31	6 025 000.00	5 559 012.77	0.10
USD MORGAN STANLEY 3.772%/VAR 18-24.01.29	2 500 000.00	2 390 600.35	0.04
USD MORGAN STANLEY 4.679%/VAR 22-17.07.26	4 743 000.00	4 710 995.42	0.09
USD MORGAN STANLEY 4.889%/VAR 22-20.07.33	4 000 000.00	3 915 765.68	0.07
USD NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-144A 2.972%/VAR 22-16.02.28	2 440 000.00	2 270 376.59	0.04
USD TRUIST FINANCIAL CORP 5.867%/VAR 23-08.06.34	220 000.00	225 342.49	0.00
USD TRUIST FINANCIAL CORP 5.711%/VAR 24-24.01.35	1 316 000.00	1 338 185.84	0.03
USD WELLS FARGO & CO 2.164%/VAR 20-11.02.26	2 600 000.00	2 512 112.70	0.05
USD WELLS FARGO & CO 2.572%/VAR 20-11.02.31	7 050 000.00	6 134 223.54	0.12
USD WELLS FARGO & CO 3.350%/VAR 22-02.03.33	6 464 000.00	5 673 714.91	0.11
米ドル合計		209 754 634.71	3.94
中期債券、変動利付債合計		209 754 634.71	3.94
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	4 888 923.83	0.09
EUR THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 0.50000% 19-01.03.28	1 100 000.00	1 082 652.34	0.02
ユーロ合計		5 971 576.17	0.11
USD			
USD ABU DHABI, GOVERNMENT OF-144A 2.50000% 19-30.09.29	2 840 000.00	2 577 300.00	0.05
USD ACE CAPITAL TRUST II-SUB 9.70000% 00-01.04.30	3 784 000.00	4 439 203.39	0.08
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 8.05000% 97-15.06.27	281 000.00	301 883.91	0.01
USD BRANCH BANKING & TRUST CO-SUB 3.80000% 14-30.10.26	6 200 000.00	5 959 110.96	0.11
USD CANADIAN PACIFIC RAILWAY CO 7.12500% 01-15.10.31	3 991 000.00	4 530 192.17	0.09
USD CENTERPOINT ENERGY HOUSTON ELEC 4.95000% 23-01.04.33	7 775 000.00	7 859 043.79	0.15
USD CITIGROUP INC-SUB 4.30000% 14-20.11.26	1 542 000.00	1 517 781.61	0.03
USD COMMONWEALTH EDISON CO 4.90000% 23-01.02.33	715 000.00	719 792.65	0.01
USD CONSOLIDATED EDISON CO OF NEW YORK 2.90000% 21-01.12.26	1 585 000.00	1 500 545.81	0.03
USD CONSOLIDATED EDISON CO OF NEW YORK INC 3.35000% 20-01.04.30	10 000 000.00	9 330 493.60	0.18
USD CONSUMERS ENERGY CO 4.60000% 24-30.05.29	3 830 000.00	3 837 892.86	0.07
USD CVS CAREMARK CORP 6.25000% 07-01.06.27	1 100 000.00	1 150 234.20	0.02
USD DISCOVER BANK 3.45000% 16-27.07.26	6 058 000.00	5 759 751.33	0.11
USD ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LLC 3.75000% 14-15.02.25	4 390 000.00	4 338 342.04	0.08
USD EQUINOR ASA 7.15000% 95-15.11.25	3 000 000.00	3 121 809.66	0.06
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 4.30000% 15-13.07.25	3 233 000.00	3 188 367.43	0.06
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 4.35000% 17-17.01.27	2 035 000.00	2 004 130.39	0.04
USD MMI CAPITAL TRUST I-SUB 7.62500% 98-15.12.27	3 050 000.00	3 274 593.55	0.06
USD NBD BANK NA MICHIGAN-SUB 8.25000% 94-01.11.24	1 110 000.00	1 130 189.52	0.02
USD PECO ENERGY CO 4.90000% 23-15.06.33	3 045 000.00	3 072 243.74	0.06
USD PERU, REPUBLIC OF 2.78300% 20-23.01.31	900 000.00	777 150.00	0.01
USD PPL ELECTRIC UTILITIES CORP 4.85000% 24-15.02.34	645 000.00	646 960.34	0.01
USD PUBLIC SERVICE ELECTRIC & GAS CO 4.90000% 22-15.12.32	3 035 000.00	3 064 638.54	0.06
USD PULTEGROUP INC 7.87500% 02-15.06.32	2 692 000.00	3 155 943.91	0.06
USD REALTY INCOME CORP 5.87500% 05-15.03.35	773 000.00	799 277.84	0.02
USD SAN DIEGO GAS & ELECTRIC CO 4.95000% 23-15.08.28	3 890 000.00	3 947 972.28	0.07
USD SPIRE MISSOURI INC 4.80000% 23-15.02.33	890 000.00	884 973.58	0.02
USD TRANSCANADA PIPELINES LTD 5.85000% 06-15.03.36	50 000.00	51 577.80	0.00
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 6.87500% 08-15.02.38	1 500 000.00	1 798 213.61	0.03
USD UNIVERSITY OF NOTRE DAME DU LAC 3.39400% 17-15.02.48	1 826 000.00	1 467 514.94	0.03
USD WALT DISNEY CO/THE 3.00000% 16-13.02.26	6 860 000.00	6 651 071.98	0.12
USD WILLIAMS COMPANIES INC 7.50000% 01-15.01.31	150 000.00	168 925.22	0.00
米ドル合計		93 027 122.65	1.75
債券、固定利付債合計		98 998 698.82	1.86

添付の注記は当財務書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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / 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 CITIGROUP INC-SUB 4.700%/VAR 20-PRP	485 000.00	461 657.65	0.01
USD CLOVERIE PLC VIA SWISS RE-REG-S-SUB 4.500%/VAR 14-11.09.44	3 815 000.00	3 764 146.05	0.07
USD DANSKE BANK AS-REG-S-SUB COCO 7.000%/VAR 18-PRP	1 661 000.00	1 646 632.35	0.03
USD DEMETER INVESTMENTS BV-REG-S-SUB 5.125%/VAR 18-01.06.48	4 020 000.00	3 912 328.32	0.07
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 1.44700%/VAR 21-01.04.25	2 575 000.00	2 554 005.38	0.05
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 2.552%/VAR 22-07.01.28	612 000.00	562 421.70	0.01
USD DEUTSCHE TELEKOM INTL FIN 8.250%/RATING LINKED 00-15.06.30	3 450 000.00	4 109 411.12	0.08
USD DNB BANK ASA-REG-S-SUB COCO 4.875%/VAR 19-PRP	1 669 000.00	1 639 792.50	0.03
USD JP MORGAN CHASE & CO 2.005%/VAR 20-13.03.26	3 275 000.00	3 153 252.40	0.06
USD JPMORGAN CHASE & CO-SUB 5.150%/3M LIBOR+325BP 13-PRP	924 000.00	928 815.89	0.02
USD JPMORGAN CHASE & CO-SUB 6.000%/3M LIBOR+330BP 13-PRP	2 064 000.00	2 070 051.64	0.04
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC-SUB COCO 7.500%/VAR 14-PRP	357 000.00	353 563.41	0.01
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC-SUB COCO 7.500%/VAR 18-PRP	706 000.00	689 055.30	0.01
USD QBE INSURANCE GROUP LTD-REG-S-SUB 6.750%/VAR 14-02.12.44	3 540 000.00	3 535 575.00	0.07
USD SANTANDER HOLDINGS USA INC 7.660%/VAR 23-09.11.31	3 212 000.00	3 490 496.46	0.06
米ドル合計		32 871 205.17	0.62
債券、変動利付債合計		32 871 205.17	0.62
財務省証券 (T-note)、固定利付債			
USD			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 4.50000% 23-15.11.33	66 000 000.00	68 918 437.50	1.29
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.75000% 24-31.12.28	35 929 000.00	35 724 092.61	0.67
USD AMERICA, UNITED STATES OF 4.00000% 24-15.01.27	3 425 000.00	3 424 197.25	0.07
USD AMERICA, UNITES STATES OF 4.00000% 24-31.01.29	53 715 000.00	54 038 129.03	1.01
USD AMERICA, UNTED STATES OF 4.25000% 24-31.01.26	8 975 000.00	8 979 207.03	0.17
米ドル合計		171 084 063.42	3.21
財務省証券 (T-note)、固定利付債合計		171 084 063.42	3.21
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		3 981 172 855.65	74.70
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			
パミューダ			
USD AIRCASTLE LIMITED 5.25%-FRN JNR PERP USD ' 144A	2 003 000.00	1 759 735.65	0.03
パミューダ合計		1 759 735.65	0.03
株式合計		1 759 735.65	0.03
財務省証券 (T-bill)、ゼロ・クーポン			
USD			
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 10.08.23-08.02.24	13 700 000.00	13 686 019.97	0.26
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 10.10.23-06.02.24	9 800 000.00	9 792 853.45	0.18
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 17.10.23-13.02.24	1 200 000.00	1 197 897.00	0.02
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 28.11.23-26.03.24	1 600 000.00	1 587 388.00	0.03
USD UNITED STATES TB 0.00000% 24.10.23-20.02.24	2 450 000.00	2 443 195.79	0.05
米ドル合計		28 707 354.21	0.54
財務省証券 (T-bill)、ゼロ・クーポン合計		28 707 354.21	0.54

添付の注記は当財務書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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
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	1 016 945.52	0.02
USD ROMARK CLO II-144A 3M LIBOR+117.5BP 18-25.07.31	5 500 000.00	4 849 737.45	0.09
米ドル合計		5 866 682.97	0.11
アセット・バック証券、変動利付債合計		5 866 682.97	0.11
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	4 345 752.50	0.08
USD MORGAN STANLEY BK OF AMERICA MERRI TRT 3.29500% 17-01.05.50	5 000 000.00	4 120 879.53	0.08
USD MORGAN STANLEY CAPITAL I TRUST 3.15300% 17-01.06.50	2 800 000.00	2 704 838.95	0.05
米ドル合計		11 171 470.98	0.21
モーゲージ・バック証券、固定利付債合計		11 171 470.98	0.21
モーゲージ・バック証券、変動利付債			
USD			
USD AMERICAN HOME MORTGAGE INVEST 6M TSFR+242.826BP 05-01.06.45	29 470 000.00	284 102.85	0.01
USD BANC OF AMERICA FUND TRUST 1M LIBOR+30BP 05-20.05.35	16 952 000.00	15 245.46	0.00
USD WAMU MORTGAGE PASS-TH TRUST 1M LIBOR+54BP 05-25.12.45	12 000 000.00	526 622.73	0.01
米ドル合計		825 971.04	0.02
モーゲージ・バック証券、変動利付債合計		825 971.04	0.02
ノート、固定利付債			
USD			
USD ABBVIE INC 4.55000% 20-15.03.35	2 000 000.00	1 958 934.18	0.04
USD AIR CANADA CLASS AA PASS THR TRT-144A 3.30000% 17-15.01.30	1 750 000.00	1 139 086.06	0.02
USD AIRCASTLE LTD-144A 5.25000% 20-11.08.25	2 470 000.00	2 443 743.90	0.05
USD AIRCASTLE LTD-144A 5.95000% 24-15.02.29	601 000.00	600 687.48	0.01
USD AIRCASTLE LTD-144A 6.50000% 23-18.07.28	1 524 000.00	1 558 899.60	0.03
USD AKER BP ASA-144A 2.00000% 21-15.07.26	5 650 000.00	5 231 861.07	0.10
USD AKER BP ASA-144A 3.10000% 21-15.07.31	19 284 000.00	16 537 528.96	0.31
USD ALBERTSONS COS LLC / SAFEWAY INC-144A 3.50000% 20-15.03.29	3 635 000.00	3 284 238.50	0.06
USD ALCON FINANCE CORP-144A 2.75000% 19-23.09.26	4 375 000.00	4 139 103.37	0.08
USD ALCON FINANCE CORP-144A 5.37500% 22-06.12.32	5 968 000.00	6 137 394.33	0.12
USD AMERICAN TRANSMISSION SYSTEMS INC-144A 2.65000% 21-15.01.32	4 745 000.00	3 988 910.50	0.07
USD ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC-144A 5.50000% 23-02.05.33	2 100 000.00	2 100 252.00	0.04
USD ANTHEM INC 5.35000% 22-15.10.25	5 911 000.00	5 948 042.94	0.11
USD ANTHEM INC 5.50000% 22-15.10.32	3 420 000.00	3 549 884.42	0.07
USD ARCH CAPITAL FINANCE LLC 4.01100% 16-15.12.26	1 615 000.00	1 568 608.37	0.03
USD ATHENE GLOBAL FUNDING-144A 1.60800% 21-29.06.26	2 365 000.00	2 159 648.78	0.04
USD AUTODESK INC 2.40000% 21-15.12.31	19 538 000.00	16 539 297.99	0.31
USD AVIATION CAPITAL GROUP LLC-144A 6.37500% 23-15.07.30	1 016 000.00	1 054 486.02	0.02
USD AVIATION CAPITAL GROUP-144A 3.50000% 17-01.11.27	741 000.00	690 240.04	0.01
USD AVIATION CAPITAL GROUP-144A 4.12500% 18-01.08.25	4 390 000.00	4 274 425.35	0.08
USD AVIATION CAPITAL GROUP-144A 1.95000% 21-30.01.26	4 783 000.00	4 464 676.86	0.08
USD AVIATION CAPITAL GROUP-144A 1.95000% 21-20.09.26	2 198 000.00	2 007 018.15	0.04
USD AVOLON HOLDINGS FUNDING LTD-144A 2.52800% 21-18.11.27	2 275 000.00	2 023 476.00	0.04
USD BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL-144A 1.60400% 21-04.10.26	6 365 000.00	5 840 156.74	0.11
USD BAXTER INTERNATIONAL INC 1.91500% 22-01.02.27	4 270 000.00	3 915 437.39	0.07
USD BAXTER INTERNATIONAL INC 2.27200% 22-01.12.28	4 800 000.00	4 278 840.67	0.08
USD BBVA BANCOMER SA/TEXAS-144A 1.87500% 20-18.09.25	3 500 000.00	3 277 225.00	0.06
USD BERRY GLOBAL INC 1.57000% 21-15.01.26	1 650 000.00	1 540 257.55	0.03
USD BERRY GLOBAL INC 1.65000% 21-15.01.27	1 500 000.00	1 354 631.30	0.03

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット・サステナブル

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD BERRY GLOBAL INC-144A 4.87500% 19-15.07.26	1 500 000.00	1 475 551.61	0.03
USD BERRY GLOBAL INC-REG-S 4.87500% 19-15.07.26	1 250 000.00	1 229 626.34	0.02
USD BIMBO BAKERIES USA INC-144A 6.05000% 23-15.01.29	4 873 000.00	5 073 743.23	0.10
USD BOSTON GAS CO-144A 3.75700% 22-16.03.32	3 700 000.00	3 290 320.53	0.06
USD BPCE SA-144A 2.37500% 20-14.01.25	1 250 000.00	1 212 615.43	0.02
USD BROADCOM INC-144A 1.95000% 21-15.02.28	4 675 000.00	4 197 457.96	0.08
USD BROADCOM INC-144A 2.45000% 21-15.02.31	1 604 000.00	1 365 954.62	0.03
USD BROADCOM INC-144A 3.41900% 21-15.04.33	7 557 000.00	6 636 374.52	0.12
USD BROADCOM INC-144A 3.13700% 21-15.11.35	4 372 000.00	3 593 865.02	0.07
USD BROADCOM INC-144A 4.00000% 22-15.04.29	301 000.00	289 735.69	0.01
USD BROADCOM INC-144A 4.15000% 22-15.04.32	1 448 000.00	1 365 666.82	0.03
USD BUILDERS FIRSTSOURCE INC-144A 6.37500% 22-15.06.32	1 531 000.00	1 561 450.06	0.03
USD CARGILL INC-144A 3.62500% 22-22.04.27	4 015 000.00	3 905 497.42	0.07
USD CARGILL INC-144A 5.12500% 22-11.10.32	1 277 000.00	1 298 557.76	0.02
USD CARRIER GLOBAL CORP 2.24200% 20-15.02.25	4 000 000.00	3 877 315.68	0.07
USD CARRIER GLOBAL CORP-144A 5.90000% 23-15.03.34	1 777 000.00	1 898 895.42	0.04
USD CCO HOLDINGS LLC 4.50000% 21-01.05.32	1 325 000.00	1 105 394.27	0.02
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.00000% 17-01.02.28	1 190 000.00	1 118 403.19	0.02
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 4.50000% 20-15.08.30	815 000.00	708 773.04	0.01
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-REG-S 4.50000% 20-15.08.30	1 585 000.00	1 378 411.37	0.03
USD CDW LLC / CDW FINANCE CORP 2.67000% 21-01.12.26	8 015 000.00	7 495 337.86	0.14
USD CDW LLC/CDW FINANCE CORP 4.12500% 20-01.05.25	2 195 000.00	2 158 266.67	0.04
USD CDW LLC/CDW FINANCE CORP 3.25000% 20-15.02.29	3 825 000.00	3 458 040.47	0.06
USD CDW LLC/CDW FINANCE CORP 3.27600% 21-01.12.28	4 416 000.00	4 031 749.97	0.08
USD CELULOSA ARAUCO Y CONSTITUCION SA 4.50000% 14-01.08.24	650 000.00	642 281.25	0.01
USD CELULOSA ARAUCO Y CONSTITUCION SA-144A 4.20000% 19-29.01.30	511 000.00	469 225.75	0.01
USD CENTENE CORP 3.37500% 20-15.02.30	3 620 000.00	3 241 961.95	0.06
USD CHARLES RIVER LABORATORIES INTL-144A 3.75000% 21-15.03.29	2 120 000.00	1 928 078.78	0.04
USD CHENIERE CORPUS CHRISTI HLDGS LLC 5.87500% 17-31.03.25	6 410 000.00	6 427 669.23	0.12
USD CHENIERE ENERGY INC 4.62500% 21-15.10.28	850 000.00	822 387.16	0.02
USD CHENIERE ENERGY PARTNERS LP 4.50000% 20-01.10.29	1 890 000.00	1 803 023.53	0.03
USD CHENIERE ENERGY PARTNERS LP 4.00000% 21-01.03.31	925 000.00	839 202.27	0.02
USD CIGNA CORP 3.25000% 20-15.04.25	4 550 000.00	4 451 549.51	0.08
USD CITIBANK NA 5.80300% 23-29.09.28	6 000 000.00	6 252 253.86	0.12
USD CITIZENS FINANCIAL GROUP INC-SUB 2.63800% 21-30.09.32	3 960 000.00	3 077 786.73	0.06
USD CLEAN HARBORS INC-144A 5.12500% 19-15.07.29	528 000.00	505 062.24	0.01
USD CLEVELAND ELECTRIC ILLUMINATING CO-144A 3.50000% 17-01.04.28	530 000.00	498 805.68	0.01
USD CLEVELAND-CLIFFS INC-144A 6.75000% 23-15.04.30	1 400 000.00	1 412 269.08	0.03
USD COLUMBIA PIPELINES OPERATNG CO LLC-144A 5.92700% 23-15.08.30	4 360 000.00	4 532 160.97	0.09
USD COLUMBIA PIPELINES OPERATNG CO LLC-144A 6.03600% 23-15.11.33	65 000.00	68 241.00	0.00
USD COMMONWEALTH BANK OF AUS-144A-SUB 2.68800% 21-11.03.31	3 275 000.00	2 716 414.77	0.05
USD CONTINENTAL AIRLINES 4.00000% 12-29.10.24	2 170 000.00	1 073 577.71	0.02
USD COOPERATIVE RADOBANK UA-144A 1.00400% 20-24.09.26	14 000 000.00	13 047 136.34	0.24
USD COREBRIDGE FINANCIAL INC 3.85000% 23-05.04.29	3 650 000.00	3 447 154.68	0.06
USD COREBRIDGE FINANCIAL INC 3.90000% 23-05.04.32	3 420 000.00	3 080 765.72	0.06
USD CORP FINANCIERA DE DESARROLLO SA-144A 2.40000% 20-28.09.27	1 744 000.00	1 566 460.80	0.03
USD COX COMMUNICATIONS INC-144A 3.50000% 17-15.08.27	6 165 000.00	5 880 001.73	0.11
USD COX COMMUNICATIONS INC-144A 2.60000% 21-15.06.31	1 035 000.00	865 206.55	0.02
USD COX COMMUNICATIONS INC-144A 5.45000% 23-15.09.28	3 375 000.00	3 444 127.80	0.06
USD COX COMMUNICATIONS INC-144A 5.70000% 23-15.06.33	1 718 000.00	1 757 497.97	0.03
USD CSC HOLDINGS INC-144A 5.37500% 18-01.02.28	300 000.00	257 725.50	0.00
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 6.50000% 19-01.02.29	1 529 000.00	1 299 746.94	0.02
USD DAIMLER TRUCK FINANCE NORTH AMERIC-144A 5.37500% 24-18.01.34	4 650 000.00	4 731 254.19	0.09
USD DANSKE BANK A/S-144A 1.62100% 20-11.09.26	1 635 000.00	1 535 330.72	0.03
USD DANSKE BANK A/S-144A 1.54900% 21-10.09.27	3 410 000.00	3 108 580.18	0.06
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP 5.85000% 21-15.07.25	3 775 000.00	3 814 756.34	0.07
USD DELTA AIR LINES INC / SKYMILES LTD-144A 4.50000% 20-20.10.25	754 578.00	652 457.30	0.01
USD DELTA AIR LINES INC / SKYMILES LTD-144A 4.75000% 20-20.10.28	9 075 000.00	8 936 591.91	0.17

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット・サステナブル

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD DELTA AIR LN 2020-1 CLS AA PAS THRU TRT 2.00000% 20-10.06.28	2 015 000.00	1 425 303.68	0.03
USD DEVON ENERGY CORP 5.25000% 21-15.10.27	2 855 000.00	2 874 809.48	0.05
USD DIAMONDBACK ENERGY INC 6.25000% 22-15.03.33	2 678 000.00	2 854 221.26	0.05
USD DIGITAL REALTY TRUST LP 5.55000% 22-15.01.28	5 800 000.00	5 930 168.24	0.11
USD DISCOVER BANK 2.70000% 20-06.02.30	2 900 000.00	2 480 553.37	0.05
USD ENEL FINANCE AMERICA LLC-144A 7.10000% 22-14.10.27	5 000 000.00	5 343 271.85	0.10
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-144A 1.37500% 21-12.07.26	4 155 000.00	3 798 681.20	0.07
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-144A 2.25000% 21-12.07.31	1 310 000.00	1 068 322.53	0.02
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-144A 5.00000% 22-15.06.32	2 968 000.00	2 904 355.57	0.05
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-144A 7.50000% 22-14.10.32	1 395 000.00	1 582 557.35	0.03
USD EQT CORP-144A 3.62500% 21-15.05.31	3 435 000.00	3 060 511.49	0.06
USD EQUITABLE FINANCIAL LIFE GLOBAL FU-144A 1.80000% 21-08.03.28	931 000.00	824 509.05	0.02
USD EQUITABLE FINANCIAL LIFE GLOBAL-144A 0.80000% 21-12.08.24	740 000.00	721 285.50	0.01
USD ERAC USA FINANCE LLC-144A 4.60000% 23-01.05.28	7 000 000.00	6 965 071.47	0.13
USD ERAC USA FINANCE LLC-144A 4.90000% 23-01.05.33	6 569 000.00	6 563 478.43	0.12
USD EXELON CORP 3.35000% 22-15.03.32	1 535 000.00	1 362 739.84	0.03
USD EXPERIAN FINANCE PLC-144A 2.75000% 19-08.03.30	3 865 000.00	3 406 816.78	0.06
USD EXTRA SPACE STORAGE LP 5.70000% 23-01.04.28	458 000.00	468 743.51	0.01
USD EXTRA SPACE STORAGE LP 3.87500% 23-15.12.27	535 000.00	515 191.01	0.01
USD EXTRA SPACE STORAGE LP 4.00000% 23-15.06.29	625 000.00	593 848.82	0.01
USD EXTRA SPACE STORAGE LP 2.20000% 23-15.10.30	904 000.00	752 708.70	0.01
USD EXTRA SPACE STORAGE LP 2.40000% 23-15.10.31	145 000.00	118 796.26	0.00
USD F&G GLOBAL FUNDING-144A 0.90000% 21-20.09.24	5 050 000.00	4 884 194.06	0.09
USD FAIRFAX FINANCIAL HOLDINGS LTD 4.85000% 19-17.04.28	3 000 000.00	2 970 901.38	0.06
USD FAIRFAX FINANCIAL HOLDINGS LTD 4.62500% 20-29.04.30	1 500 000.00	1 446 898.90	0.03
USD FAIRFAX FINANCIAL HOLDINGS LTD 3.37500% 21-03.03.31	3 375 000.00	2 964 264.18	0.06
USD FARMERS EXCHANGE CAPITAL-144A-SUB 7.05000% 98-15.07.28	1 915 000.00	1 943 960.37	0.04
USD FEDERATION DES CAIS DESJD DU QUEBEC-144A 4.40000% 22-23.08.25	2 405 000.00	2 380 560.30	0.04
USD FLORIDA GAS TRANSMISSION CO-144A 2.55000% 20-01.07.30	2 165 000.00	1 861 672.82	0.03
USD FMG RESOURCES AUGUST 2006 PTY LTD-144A 4.37500% 21-01.04.31	530 000.00	478 828.50	0.01
USD FOX CORP 4.70900% 20-25.01.29	464 000.00	460 202.65	0.01
USD FRESENIUS MED CAR US FIN III INC-144A 1.87500% 21-01.12.26	1 890 000.00	1 713 024.69	0.03
USD GEORGIA-PACIFIC LLC-144A 2.30000% 20-30.04.30	250 000.00	216 576.46	0.00
USD GFL ENVIRONMENTAL INC-144A 3.50000% 20-01.09.28	3 373 000.00	3 053 252.08	0.06
USD GRAY ESCROW II INC-144A 5.37500% 21-15.11.31	2 375 000.00	1 858 870.85	0.03
USD HARLEY-DAVIDSON FINANCIAL SERVICES-144A 3.05000% 22-14.02.27	5 657 000.00	5 275 879.37	0.10
USD HEALTH CARE SER CORP A MUT LGL RES-144A 2.20000% 20-01.06.30	1 368 000.00	1 169 974.65	0.02
USD HEALTHCARE REALTY HOLDINGS LP 2.05000% 22-15.03.31	81 000.00	62 863.73	0.00
USD IBM INTERNATIONAL CAPITAL PTE LTD 4.75000% 24-05.02.31	12 000 000.00	11 983 332.36	0.22
USD INFOR INC-144A 1.75000% 20-15.07.25	1 983 000.00	1 877 200.98	0.04
USD INTERNATIONAL FLAVORS & FRAG INC-144A 1.23000% 21-01.10.25	7 785 000.00	7 254 695.22	0.14
USD INTERNATIONAL FLAVORS & FRAG INC-144A 1.83200% 21-15.10.27	6 300 000.00	5 582 166.47	0.10
USD INTERNATIONAL FLAVORS & FRAG INC-144A 2.30000% 21-01.11.30	6 000 000.00	4 994 148.12	0.09
USD INTESA SANPAOLO SPA-144A 3.25000% 19-23.09.24	2 975 000.00	2 927 861.00	0.05
USD INTESA SANPAOLO SPA-144A-SUB 4.19800% 21-01.06.32	2 350 000.00	1 946 099.81	0.04
USD INTESA SANPAOLO SPA-144A 7.00000% 22-21.11.25	330 000.00	337 978.89	0.01
USD INVERSIONES CMPC SA-144A 4.37500% 17-04.04.27	1 464 000.00	1 406 904.00	0.03
USD IQVIA INC-144A 5.70000% 23-15.05.28	1 990 000.00	2 026 606.83	0.04
USD IQVIA INC-144A 6.25000% 23-01.02.29	9 196 000.00	9 570 424.33	0.18
USD IRON MOUNTAIN INC-144A 4.87500% 19-15.09.29	3 977 000.00	3 716 330.72	0.07
USD ITC HOLDINGS CORP-144A 2.95000% 20-14.05.30	500 000.00	443 974.15	0.01
USD ITC HOLDINGS CORP-144A 4.95000% 22-22.09.27	3 200 000.00	3 212 966.88	0.06
USD JABIL INC 3.00000% 20-15.01.31	3 690 000.00	3 196 283.20	0.06
USD JABIL INC 5.45000% 23-01.02.29	3 020 000.00	3 083 203.01	0.06
USD JDE PEET ' S NV-144A 0.80000% 21-24.09.24	4 240 000.00	4 101 259.53	0.08
USD JDE PEET ' S NV-144A 1.37500% 21-15.01.27	8 200 000.00	7 388 423.36	0.14
USD JERSEY CENTRAL POWER & LIGHT CO-144A 4.70000% 13-01.04.24	1 573 000.00	1 569 995.08	0.03
USD JERSEY CENTRAL POWER & LIGHT CO-144A 4.30000% 15-15.01.26	2 026 000.00	1 989 864.08	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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)	
USD	JOHNS HOPKINS UNIVERSITY 4.70500% 22-01.07.32	3 550 000.00	3 609 579.51	0.07
USD	KENVUE INC 4.90000% 23-22.03.33	2 000 000.00	2 040 146.34	0.04
USD	KEYSPAN GAS EAST CORP-144A 2.74200% 16-15.08.26	2 500 000.00	2 348 691.77	0.04
USD	KINDER MORGAN INC 5.40000% 24-01.02.34	5 000 000.00	5 018 265.15	0.09
USD	KLA CORP 4.70000% 24-01.02.34	2 290 000.00	2 281 736.56	0.04
USD	KYNDRYL HOLDINGS INC 2.05000% 22-15.10.26	7 000 000.00	6 412 116.69	0.12
USD	LOWE ' S COS INC 5.00000% 22-15.04.33	1 939 000.00	1 965 015.85	0.04
USD	LPL HOLDINGS INC 6.75000% 23-17.11.28	1 040 000.00	1 093 372.80	0.02
USD	MACY ' S RETAIL HOLDINGS-144A 5.87500% 22-15.03.30	1 557 000.00	1 476 425.25	0.03
USD	MANUFACTURERS & TRADERS TRUST CO 5.40000% 22-21.11.25	7 175 000.00	7 159 600.15	0.13
USD	MARRIOTT INTERNATIONAL INC/MD 5.00000% 22-15.10.27	1 983 000.00	2 002 070.88	0.04
USD	MATTEL INC-144A 3.37500% 21-01.04.26	1 678 000.00	1 601 017.39	0.03
USD	MERCEDES-BENZ FINACE NORTH AMERICA-144A 4.80000% 23-30.03.28	3 852 000.00	3 876 548.41	0.07
USD	MERCEDES-BENZ FINANCE NORTH AMERI-144A 5.05000% 23-03.08.33	8 481 000.00	8 585 775.04	0.16
USD	MERITAGE HOMES CORP-144A 3.87500% 21-15.04.29	4 000 000.00	3 684 120.00	0.07
USD	METROPOLITAN EDISON CO-144A 5.20000% 23-01.04.28	2 250 000.00	2 275 130.34	0.04
USD	METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-144A 3.45000% 16-18.12.26	12 000 000.00	11 598 292.20	0.22
USD	METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING I-144A 1.55000% 21-07.01.31	10 000 000.00	8 017 321.50	0.15
USD	MICROCHIP TECHNOLOGY INC 4.25000% 20-01.09.25	5 980 000.00	5 898 474.66	0.11
USD	MID-ATLANTIC INTERSTATE TRANS-144A 4.10000% 18-15.05.28	2 030 000.00	1 962 839.54	0.04
USD	MIDAS OPCO HOLDINGS LLC-144A 5.62500% 21-15.08.29	3 755 000.00	3 436 050.30	0.06
USD	MIDWEST CONNECTOR CAPITAL CO LLC-144A 3.90000% 19-01.04.24	7 020 000.00	6 994 252.25	0.13
USD	MONDELEZ INTERNATIONAL HOLDING NET-144A 0.75000% 21-24.09.24	2 785 000.00	2 700 776.08	0.05
USD	MONDELEZ INTERNATIONAL HOLDING NET-144A 1.25000% 21-24.09.26	5 620 000.00	5 137 624.22	0.10
USD	MPLX LP 4.25000% 20-01.12.27	525 000.00	514 243.96	0.01
USD	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD/NEW YORK 4.94400% 23-12.01.28	7 675 000.00	7 746 824.65	0.15
USD	NATURA COSMETICOS SA-144A 4.12500% 21-03.05.28	783 000.00	713 753.44	0.01
USD	NEWELL BRANDS INC 6.37500% 22-15.09.27	2 075 000.00	2 038 082.02	0.04
USD	NGPL PIPECO LLC-144A 3.25000% 21-15.07.31	2 250 000.00	1 951 073.95	0.04
USD	NIAGARA MOHAWK POWER CORP-144A 3.50800% 14-01.10.24	1 139 000.00	1 120 777.43	0.02
USD	NIAGARA MOHAWK POWER CORP-144A 2.75900% 22-10.01.32	12 000 000.00	10 034 757.36	0.19
USD	NIAGARA MOHAWK POWER CORP-144A 5.29000% 24-17.01.34	7 112 000.00	7 116 382.56	0.13
USD	NORDEA BANK ABP-144A 5.37500% 22-22.09.27	1 400 000.00	1 422 598.01	0.03
USD	NORDSTROM INC 2.30000% 21-08.04.24	4 800 000.00	4 752 000.00	0.09
USD	NUTRIEN LTD 4.00000% 18-15.12.26	1 451 000.00	1 420 086.81	0.03
USD	NXP BV / NXP FUNDING LLC 5.55000% 22-01.12.28	3 945 000.00	4 018 061.40	0.08
USD	NXP BV / NXP FUNDING LLC 5.00000% 22-15.01.33	4 000 000.00	3 935 840.00	0.07
USD	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 6.95000% 19-01.07.24	315 000.00	316 260.00	0.01
USD	OHIO EDISON CO-144A 5.50000% 22-15.01.33	1 280 000.00	1 290 298.66	0.02
USD	OLD NATIONAL BANCORP/IN-SUB 5.87500% 16-29.09.26	6 300 000.00	6 334 213.03	0.12
USD	ONTARIO TEACHERS CADILLAC FAIRVIEW-144A 3.87500% 17-20.03.27	5 075 000.00	4 812 957.70	0.09
USD	ONTARIO TEACHERS CADILLAC FAIRVIEW-144A 4.12500% 19-01.02.29	1 467 000.00	1 381 518.17	0.03
USD	ONTARIO TEACHERS CADILLAC FAIRVIEW-144A 2.50000% 21-15.10.31	2 360 000.00	1 900 001.22	0.04
USD	ORGANON FINANCE 1 LLC-144A 4.12500% 21-30.04.28	3 500 000.00	3 202 323.60	0.06
USD	OTIS WORLDWIDE CORP 2.56500% 20-15.02.30	1 140 000.00	1 009 206.15	0.02
USD	PARKLAND CORP-144A 4.50000% 21-01.10.29	2 500 000.00	2 299 018.23	0.04
USD	PARSLEY ENERGY LLC/FINANCE CORP-144A 4.12500% 20-15.02.28	1 080 000.00	1 033 900.01	0.02
USD	PEIDMONT OPERATING PARTNERSHIP LP 2.75000% 21-01.04.32	1 650 000.00	1 154 255.72	0.02
USD	PENNSYLVANIA ELECTRIC CO-144A 3.25000% 17-15.03.28	305 000.00	284 101.45	0.01
USD	PENNSYLVANIA ELECTRIC CO-144A 5.15000% 23-30.03.26	2 445 000.00	2 440 205.67	0.05
USD	PENSKE TRUCK LEASING/PTL FIN CORP-144A 4.45000% 19-29.01.26	2 680 000.00	2 626 889.69	0.05
USD	PHILLIPS EDISON GROCERY CENTER 2.62500% 21-15.11.31	7 950 000.00	6 486 890.35	0.12
USD	PHYSICIANS REALTY LP 2.62500% 21-01.11.31	4 895 000.00	4 030 840.96	0.08
USD	PIEDMONT NATURAL GAS CO INC 5.40000% 23-15.06.33	4 000 000.00	4 092 573.76	0.08
USD	PILGRIMS PRIDE CORP 3.50000% 23-01.03.32	6 510 000.00	5 493 203.10	0.10
USD	PRINCIPAL FINANCIAL GROUP INC 2.12500% 20-15.06.30	435 000.00	369 742.53	0.01
USD	PROLOGIS LP 1.75000% 22-01.02.31	3 450 000.00	2 840 368.30	0.05
USD	PROTECTIVE LIFE GLOBAL FUNDING-144A 1.61800% 21-15.04.26	1 135 000.00	1 055 553.95	0.02

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット・サステナブル

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD PROTECTIVE LIFE GLOBAL FUNDING-144A 1.90000% 21-06.07.28	2 880 000.00	2 561 320.05	0.05
USD REALTY INCOME CORP 4.85000% 23-15.03.30	1 065 000.00	1 064 732.46	0.02
USD REGAL REXNORD CORP-144A 6.05000% 23-15.04.28	6 550 000.00	6 645 942.63	0.12
USD REGAL REXNORD CORP-144A 6.30000% 23-15.02.30	679 000.00	697 937.12	0.01
USD REGENCY CENTERS LP 5.25000% 24-15.01.34	1 860 000.00	1 861 463.93	0.03
USD REGENERON PHARMACEUTICALS INC 1.75000% 20-15.09.30	2 885 000.00	2 383 203.93	0.04
USD REXFORD INDUSTRIAL REALTY LP 2.15000% 21-01.09.31	130 000.00	104 563.71	0.00
USD REXFORD INDUSTRIAL REALTY LP 5.00000% 23-15.06.28	4 661 000.00	4 679 444.23	0.09
USD ROCHE HOLDINGS INC-144A 2.07600% 21-13.12.31	2 150 000.00	1 799 464.54	0.03
USD ROCKIES EXPRESS PIPELINE LLC-144A 4.95000% 19-15.07.29	975 000.00	932 136.17	0.02
USD ROCKIES EXPRESS PIPELINE LLC-144A 3.60000% 20-15.05.25	1 260 000.00	1 222 700.35	0.02
USD ROCKIES EXPRESS PIPELINE LLC-144A 4.80000% 20-15.05.30	900 000.00	840 368.21	0.02
USD ROGERS COMMUNICATIONS INC 3.20000% 23-15.03.27	3 475 000.00	3 321 568.71	0.06
USD ROGERS COMMUNICATIONS INC 3.80000% 23-15.03.32	8 841 000.00	8 041 672.99	0.15
USD ROSS STORES INC 1.87500% 20-15.04.31	1 545 000.00	1 271 040.78	0.02
USD S&P GLOBAL INC 2.45000% 23-01.03.27	4 175 000.00	3 929 856.60	0.07
USD S&P GLOBAL INC 2.70000% 23-01.03.29	2 858 000.00	2 630 091.82	0.05
USD S&P GLOBAL INC 4.25000% 23-01.05.29	483 000.00	477 548.89	0.01
USD S&P GLOBAL INC 4.75000% 23-01.08.28	96 000.00	97 453.39	0.00
USD S&P GLOBAL INC-144A 5.25000% 23-15.09.33	3 235 000.00	3 345 085.82	0.06
USD SEALED AIR CORP-144A 1.57300% 21-15.10.26	3 325 000.00	3 014 026.35	0.06
USD SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-144A 1.20000% 21-09.09.26	3 715 000.00	3 381 504.45	0.06
USD SLM CORP 4.20000% 20-29.10.25	1 422 000.00	1 382 219.12	0.03
USD SMITHFIELD FOODS INC-144A 5.20000% 19-01.04.29	2 760 000.00	2 665 502.84	0.05
USD SMITHFIELD FOODS INC-144A 3.00000% 20-15.10.30	1 350 000.00	1 121 056.27	0.02
USD SMITHFIELD FOODS INC-144A 2.62500% 21-13.09.31	7 194 000.00	5 637 634.43	0.11
USD SPRINT SPECTRUM CO III LLC-144A 4.73800% 18-20.03.25	2 820 000.00	874 600.57	0.02
USD STELLANTIS FINANCE US INC-144A 2.69100% 21-15.09.31	3 228 000.00	2 703 875.99	0.05
USD STELLANTIS FINANCE US INC-144A 6.37500% 22-12.09.32	2 500 000.00	2 684 888.80	0.05
USD SWEDBANK AB-144A 5.33700% 22-20.09.27	5 000 000.00	5 038 556.65	0.09
USD T-MOBILE USA INC 5.15000% 24-15.04.34	2 371 000.00	2 388 741.39	0.04
USD TALLGRASS ENRGY PART LP/FIN-144A 7.37500% 24-15.02.29	2 870 000.00	2 862 863.40	0.05
USD TARGA RESOURCES PARTNERS 4.00000% 21-15.01.32	1 600 000.00	1 442 112.00	0.03
USD TELEFLEX INC-144A 4.25000% 20-01.06.28	600 000.00	569 202.00	0.01
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 4.70000% 23-12.01.33	1 900 000.00	1 920 805.41	0.04
USD TRACTOR SUPPLY CO 1.75000% 20-01.11.30	3 250 000.00	2 662 418.79	0.05
USD TRANSCONTINENTAL GAS PIPE LINE 4.60000% 18-15.03.48	1 955 000.00	1 758 568.11	0.03
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 5.25000% 22-15.02.28	3 500 000.00	3 612 589.26	0.07
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 5.35000% 22-15.02.33	6 385 000.00	6 680 319.98	0.13
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.35500% 22-15.03.32	5 067 000.00	4 208 041.30	0.08
USD VIATRIS INC 2.30000% 21-22.06.27	3 500 000.00	3 187 958.90	0.06
USD WARNERMEDIA HOLDINGS INC 3.75500% 23-15.03.27	7 818 000.00	7 510 247.71	0.14
USD WARNERMEDIA HOLDINGS INC 4.05400% 23-15.03.29	6 448 000.00	6 105 140.56	0.11
USD WARNERMEDIA HOLDINGS 5.05000% 23-15.03.42	510 000.00	452 068.28	0.01
USD WEA FIN LLC/ WESTF UK&EUR FIN PLC-144A 3.75000% 14-17.09.24	3 809 000.00	3 747 979.56	0.07
USD WEA FINANCE LLC-144A 4.12500% 18-20.09.28	2 620 000.00	2 347 381.48	0.04
USD WEIR GROUP PLC/THE-144A 2.20000% 21-13.05.26	2 565 000.00	2 385 505.40	0.04
USD WESTPAC NEW ZEALAND LTD-144A 4.90200% 23-15.02.28	4 100 000.00	4 105 706.95	0.08
USD WEYERHAEUSER CO 3.37500% 22-09.03.33	1 240 000.00	1 092 117.55	0.02
USD WILLIS NORTH AMERICA INC 4.50000% 18-15.09.28	500 000.00	488 777.79	0.01
USD WILLIS NORTH AMERICA INC 2.95000% 19-15.09.29	3 200 000.00	2 877 096.35	0.05
USD WRKCO INC 3.75000% 19-15.03.25	2 795 000.00	2 746 940.03	0.05
USD WRKCO INC 4.00000% 19-15.03.28	5 909 000.00	5 701 697.33	0.11
USD XPO INC-144A 6.25000% 23-01.06.28	1 625 000.00	1 626 941.60	0.03
USD YARA INTERNATIONAL ASA-144A 3.14800% 20-04.06.30	2 475 000.00	2 155 551.75	0.04
米ドル合計		795 950 614.41	14.93
ノート、固定利付債合計		795 950 614.41	14.93

添付の注記は当財務書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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / 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 6.608%/VAR 23-13.09.29	518 000.00	544 187.35	0.01
USD AIB GROUP PLC-144A 7.583%/VAR 22-14.10.26	2 732 000.00	2 819 532.08	0.05
USD ASB BANK LTD-144A-SUB 5.284%/VAR 22-17.06.32	4 800 000.00	4 728 976.45	0.09
USD ATHENE GLOBAL FUNDING-144A 3M SOFR+70BP 21-24.02.24	2 210 000.00	2 211 950.59	0.04
USD BANK OF AMERICA CORP 6.204%/VAR 22-10.11.28	6 095 000.00	6 372 317.92	0.12
USD BANK OF IRELAND GROUP-144A 6.253%/VAR 22-16.09.26	856 000.00	864 900.23	0.02
USD BNP PARIBAS SA-144A 1.323%/VAR 21-13.01.27	2 550 000.00	2 361 530.64	0.04
USD BNP PARIBAS SA-144A 1.675%/VAR 21-30.06.27	5 280 000.00	4 849 512.62	0.09
USD BNP PARIBAS SA-144A 2.159%/VAR 21-15.09.29	9 630 000.00	8 412 200.79	0.16
USD BNP PARIBAS SA-144A 5.125%/VAR 23-13.01.29	5 275 000.00	5 301 182.47	0.10
USD BNP PARIBAS SA-144A-SUB COCO 8.500%/VAR 23-PRP	1 535 000.00	1 589 428.03	0.03
USD CAIXABANK SA-144A 6.684%/VAR 23-13.09.27	4 066 000.00	4 177 691.40	0.08
USD CAPITAL ONE FINANCIAL CORP-SUB 2.359%/VAR 21-29.07.32	1 770 000.00	1 339 927.68	0.03
USD CAPITAL ONE FINANCIAL CORP 5.700%/VAR 24-01.02.30	794 000.00	801 737.13	0.01
USD CITIZENS BANK NA/PROVIDENCE RI 5.284%/VAR 23-26.01.26	971 000.00	956 329.56	0.02
USD CREDIT AGRICOLE SA-144A 6.316%/VAR 23-03.10.29	4 544 000.00	4 738 502.15	0.09
USD DNB BANK ASA-144A 1.605%/VAR 21-30.03.28	3 265 000.00	2 924 020.70	0.05
USD FARMERS EXCHANGE CAPITAL II-144A-SUB 6.151%/VAR 13-01.11.53	1 000 000.00	922 000.00	0.02
USD FIFTH THIRD BANCORP 4.337%/VAR 22-25.04.33	2 598 000.00	2 402 339.13	0.05
USD HARTFORD FINANCIAL-144A-SUB 3M LIBOR+212.5BP 17-12.02.47	5 055 000.00	4 370 422.38	0.08
USD HUNTINGTON NATIONAL BANK 5.699%/VAR 22-18.11.25	10 000 000.00	9 946 101.40	0.19
USD MACQUARIE GROUP LTD-144A 1.340%/VAR 21-12.01.27	4 554 000.00	4 204 131.34	0.08
USD PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC-SUB 4.626%/VAR 22-06.06.33	1 375 000.00	1 291 755.19	0.02
USD PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE 6.037%/VAR 22-28.10.33	5 815 000.00	6 081 058.17	0.11
USD PNC FINANCIAL SERVICES GROUP 4.758%/VAR 23-26.01.27	16 500 000.00	16 396 321.42	0.31
USD PNC FINANCIAL SERVICES GROUP 5.068%/VAR 23-24.01.34	4 690 000.00	4 616 841.12	0.09
USD RABOBANK NEDERLAND NV-144A 3.649%/VAR 22-06.04.28	6 504 000.00	6 218 322.99	0.12
USD SOCIETE GENERALE SA-144A 0/N SOFR+105BP 22-21.01.26	1 670 000.00	1 667 217.46	0.03
USD SOCIETE GENERALE-144A 2.797%/VAR 22-19.01.28	3 085 000.00	2 853 806.76	0.05
USD SOCIETE GENERALE-144A 5.519%/VAR 24-19.01.28	2 386 000.00	2 386 497.57	0.04
USD STATE STREET CORP 2.901%/VAR 20-30.03.26	3 220 000.00	3 133 418.29	0.06
USD STATE STREET CORP-SUB 6.700%/VAR 24-PRP	3 295 000.00	3 286 757.85	0.06
USD TEACHER INS&AN-144A-SUB 4.375%/3M LIBOR+266.1BP 14-15.09.54	4 900 000.00	4 806 328.32	0.09
USD UBS GROUP AG-144A 4.751%/VAR 22-12.05.28	2 000 000.00	1 971 368.66	0.04
USD UNICREDIT SPA-144A 1.982%/VAR 21-03.06.27	4 910 000.00	4 523 715.08	0.08
USD UNICREDIT SPA-144A 2.56900% 20-22.09.26	3 171 000.00	3 004 013.30	0.06
USD UNICREDIT SPA-144A 3.127%/VAR 21-03.06.32	900 000.00	759 309.43	0.01
USD US BANCORP 5.850%/VAR 22-21.10.33	7 500 000.00	7 758 797.10	0.15
米ドル合計		147 594 450.75	2.77
ノート、変動利付債合計		147 594 450.75	2.77
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	6 120 750.88	0.11
USD BRIGHTHOUSE FINANCIAL GLOBAL FUND-144A 1.75000% 22-13.01.25	3 100 000.00	2 981 929.28	0.06
USD CREDIT AGRICOLE SA-144A 5.51400% 23-05.07.33	2 940 000.00	3 054 825.38	0.06
USD INTESA SANPAOLO SPA-144A-SUB 5.01700% 14-26.06.24	2 186 000.00	2 172 211.13	0.04
USD INTESA SANPAOLO SPA-144A-SUB 5.71000% 16-15.01.26	4 582 000.00	4 566 496.62	0.09
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING 144A I 5.05000% 23-06.01.28	2 500 000.00	2 528 213.10	0.05
USD NATIONAL RURAL UTILITIES COOP FIN CORP 3.45000% 22-15.06.25	2 630 000.00	2 579 515.23	0.05
USD NBN CO LTD-144A 5.75000% 23-06.10.28	1 680 000.00	1 745 608.55	0.03
USD NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-144A 4.85000% 23-09.01.28	6 500 000.00	6 550 792.23	0.12
USD PRINCIPAL LIFE GLOBAL FUNDING-144A 1.25000% 21-16.08.26	3 000 000.00	2 736 847.77	0.05
USD RELIANCE STANDARD LIFE GLOBAL-144A 1.51200% 21-28.09.26	2 258 000.00	2 023 142.23	0.04
USD ROYAL BANK OF CANADA 5.00000% 23-01.02.33	3 420 000.00	3 420 564.03	0.06
USD SOCIETE GENERALE SA-144A 2.62500% 20-22.01.25	5 360 000.00	5 212 175.87	0.10
米ドル合計		45 693 072.30	0.86
中期債券、固定利付債合計		45 693 072.30	0.86

添付の注記は当財務書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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
中期債券、変動利付債			
USD			
USD AIB GROUP PLC-144A 4.263%/3M LIBOR+187.4BP 19-10.04.25	2 938 000.00	2 927 360.18	0.05
USD BANK OF NEW YORK MELLON/THE 5.224%/VAR 22-21.11.25	3 500 000.00	3 503 235.58	0.07
USD SOCIETE GENERALE SA-144A 1.792%/VAR 21-09.06.27	2 385 000.00	2 179 508.11	0.04
USD TRUIST FINANCIAL CORP 4.12300%/VAR 22-06.06.28	4 925 000.00	4 793 316.83	0.09
USD TRUIST FINANCIAL CORP 5.900%/VAR 22-28.10.26	4 997 000.00	5 055 053.20	0.09
USD TRUIST FINANCIAL CORP 4.873%/VAR 23-26.01.29	5 250 000.00	5 189 992.45	0.10
USD TRUIST FINANCIAL CORP 5.122%/VAR 23-26.01.34	4 725 000.00	4 599 819.25	0.09
USD TRUIST FINANCIAL CORP 7.161%/VAR 23-30.10.29	3 443 000.00	3 718 320.77	0.07
USD TRUIST FINANCIAL CORP 5.435%/VAR 24-24.01.30	1 000 000.00	1 008 522.83	0.02
USD WELLS FARGO & CO 4.897%/VAR 22-25.07.33	530 000.00	517 949.42	0.01
米ドル合計		33 493 078.62	0.63
中期債券、変動利付債合計		33 493 078.62	0.63
債券、固定利付債			
USD			
USD ADVOCATE HEALTH & HOSPITALS CORP 3.82900% 18-15.08.28	1 215 000.00	1 180 059.81	0.02
USD AMERICAN AIRLINES 3.20000% 16-15.06.28	2 000 000.00	1 236 727.59	0.02
USD ASCENSION HEALTH 2.53200% 19-15.11.29	1 495 000.00	1 350 595.46	0.02
USD ATLANTIC CITY ELECTRIC CO 2.30000% 21-15.03.31	710 000.00	599 966.19	0.01
USD BARNABAS HEALTH INC 4.00000% 12-01.07.28	2 000 000.00	1 931 610.06	0.04
USD BERRY GLOBAL INC-144A 5.65000% 24-15.01.34	545 000.00	551 065.35	0.01
USD BON SECOURS MERCY HEALTH INC 2.09500% 20-01.06.31	925 000.00	762 095.18	0.01
USD COMMONSPIRIT HEALTH 2.78200% 20-01.10.30	1 010 000.00	886 620.12	0.02
USD FARMERS INSURANCE EXCHANGE-144A-SUB 8.62500% 94-01.05.24	700 000.00	704 278.55	0.01
USD INTERSTATE POWER & LIGHT CO 3.60000% 19-01.04.29	2 245 000.00	2 127 030.75	0.04
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-144A 5.05000% 22-07.12.27	4 900 000.00	4 958 898.34	0.09
USD METROPOLITAN EDISON CO-144A 4.00000% 14-15.04.25	2 650 000.00	2 586 234.85	0.05
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING I-144A 2.95000% 20-09.04.30	3 060 000.00	2 731 201.84	0.05
USD NGPL PIPECO LLC-144A 4.87500% 17-15.08.27	1 000 000.00	982 466.46	0.02
USD NIAGARA MOHAWK POWER CORP-144A 4.27800% 14-01.10.34	3 000 000.00	2 754 176.88	0.05
USD OHIOHEALTH CORP 2.29700% 21-15.11.31	3 530 000.00	2 989 044.62	0.06
USD PEACEHEALTH OBLIGATED GROUP 1.37500% 20-15.11.25	3 780 000.00	3 531 884.13	0.07
USD PIEDMONT HEALTHCARE 2.04400% 21-01.01.32	1 605 000.00	1 312 895.81	0.02
USD PRINCIPAL LIFE GLOBAL FUNDING II-144A 0.75000% 21-12.04.24	1 565 000.00	1 550 549.81	0.03
USD ROCHESTER GAS & ELECTRIC CORP-144A 3.10000% 17-01.06.27	2 000 000.00	1 890 683.38	0.03
USD STANFORD HEALTH CARE 3.31000% 20-15.08.30	990 000.00	910 801.81	0.02
USD SUTTER HEALTH 3.69500% 18-15.08.28	2 015 000.00	1 937 523.13	0.04
USD SUTTER HEALTH 5.16400% 23-15.08.33	1 574 000.00	1 602 542.28	0.03
USD SYDNEY AIRPORT FINANCE CO PTY LTD-144A 3.62500% 16-28.04.26	7 547 000.00	7 298 832.62	0.14
USD UNITED AIRLINES PASS THRU TRUST 4.30000% 13-15.08.25	4 000 000.00	2 158 193.41	0.04
USD UPMC 5.03500% 23-15.05.33	2 450 000.00	2 466 249.48	0.05
USD YALE UNIVERSITY 0.87300% 20-15.04.25	4 500 000.00	4 302 587.25	0.08
米ドル合計		57 294 815.16	1.07
債券、固定利付債合計		57 294 815.16	1.07
債券、変動利付債			
USD			
USD BPCE SA-144A 2.045%/VAR 21-19.10.27	1 815 000.00	1 657 506.04	0.03
USD BPCE SA-144A 5.975%/VAR 23-18.01.27	3 006 000.00	3 031 783.48	0.06
USD METLIFE CAPITAL TRUST IV-144A-SUB 7.875%/VAR 07-15.12.37	1 510 000.00	1 630 869.46	0.03
米ドル合計		6 320 158.98	0.12
債券、変動利付債合計		6 320 158.98	0.12

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット・サステナブル

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
地方債、固定利付債			
USD			
USD	CAMPBELL UNION SCHOOL DISTRICT 5.40600% 11-01.08.27	2 865 000.00	0.06
USD	CITY OF BALTIMORE MD 5.00000% 10-15.10.25	2 140 000.00	0.04
USD	COUNTY OF MIAMI-DADE FL AVIATION REV 3.50400% 17-01.10.31	865 000.00	0.02
USD	HOUSTON TEXAS WATER & SEWER SYSTEM 3.82800% 14-15.05.28	800 000.00	0.01
USD	LOS ANGELES DEPARTMENT OF POWER 5.51600% 10-01.07.27	1 520 000.00	0.03
USD	MASSACHUSETTS, STATE OF-SUB-S 2.96600% 19-15.10.32	850 000.00	0.01
USD	NEW YORK CITY TRANS FINANCE AUTH REV 5.26700% 10-01.05.27	1 400 000.00	0.03
USD	NEW YORK CITY TRANS FINANCE AUTH REV 5.76700% 09-01.08.36	1 020 000.00	0.02
USD	NEW YORK CITY TRANS FIN AUTH REV-SUB 3.95000% 18-01.08.32	1 000 000.00	0.02
USD	NEW YORK CITY TRANSITIONAL FIN AUTH-SUB 1.25000% 20-01.26	2 000 000.00	0.03
USD	NEW YORK CITY TRANSITIONAL FINANCE 1.97000% 21-01.02.33	1 615 000.00	0.02
USD	NEW YORK N Y, CITY OF 5.96800% 10-01.03.36	1 000 000.00	0.02
USD	NEW YORK STATE DORMITORY AUTHORITY 5.50000% 10-15.03.30	4 755 000.00	0.09
USD	NEW YORK STATE DORMITORY AUTHORITY 1.95200% 21-15.03.29	2 300 000.00	0.04
USD	NEW YORK STATE URBAN DEVELOPMENT CORP 2.54000% 21-15.03.34	1 930 000.00	0.03
USD	NEW YORK STATE URBAN DEV CORP 3.37000% 17-15.03.30	1 295 000.00	0.02
USD	UNIVERSITY OF CALIFORNIA REVS 1.31600% 20-15.05.27	3 650 000.00	0.06
USD	UNIVERSITY OF CALIFORNIA 1.61400% 20-15.05.30	2 255 000.00	0.04
米ドル合計		31 642 699.84	0.59
地方債、固定利付債合計		31 642 699.84	0.59
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		1 166 320 104.91	21.88
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	ONCOR ELECTRIC DELIVERY CO LLC 5.65000% 24-15.11.33	3 525 000.00	0.07
米ドル合計		3 734 520.00	0.07
ノート、固定利付債合計		3 734 520.00	0.07
中期債券、変動利付債			
USD			
USD	KEYCORP 3.878%/VAR 22-23.05.25	2 545 000.00	0.05
米ドル合計		2 523 470.65	0.05
中期債券、変動利付債合計		2 523 470.65	0.05
地方債、固定利付債			
USD			
USD	CALIFORNIA STATE UNIVERSITY 1.99400% 21-01.11.32	910 000.00	0.01
USD	CALIFORNIA STATE UNIVERSITY 2.37400% 21-01.11.35	935 000.00	0.01
USD	COMMONWEALTH OF MASSACHUSETTS 4.11000% 22-15.7.31	2 410 000.00	0.03
USD	REGENTS OF THE UNIV OF CALIFOR MED CPR 4.13200% 22-15.05.32	1 090 000.00	0.02
米ドル合計		4 096 532.72	0.07
地方債、固定利付債合計		4 096 532.72	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		10 354 523.37	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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / 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 AKER BP ASA-144A 5.60000% 23-13.06.28	7 680 000.00	7 815 639.56	0.15
USD BANK OF NEW ZEALAND-144A 4.84600% 23-07.02.28	4 225 000.00	4 206 895.59	0.08
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 11.75000% 24-31.01.29	82 000.00	83 289.88	0.00
USD FEDERATION DES CAISSES-144A 5.25000% 24-26.04.29	4 600 000.00	4 642 561.82	0.09
USD GFL ENVIRONMENTAL INC-144A 6.75000% 23-15.01.31	1 813 000.00	1 854 297.18	0.03
USD INTESA SANPAOLO SPA-144A 6.62500% 23-20.06.33	3 631 000.00	3 734 121.38	0.07
USD MERCEDES-BENZ FIN NORTH AMERICA-144A 5.00000% 24-11.01.34	1 250 000.00	1 249 323.19	0.02
USD NEW YORK STATE ELECTRIC & GAS CORP-144A 5.85000% 23-15.08.33	5 497 000.00	5 748 703.29	0.11
USD NGL ENERGY OPERATING LLC-144A 8.12500% 24-15.02.29	1 850 000.00	1 859 302.84	0.04
USD ROCHE HOLDINGS INC-144A 5.59300% 23-13.11.33	5 470 000.00	5 860 981.65	0.11
USD US FOODS INC-144A 6.87500% 23-15.09.28	1 274 000.00	1 307 875.66	0.02
USD XPO INC-144A 7.12500% 23-01.02.32	234 000.00	238 535.62	0.00
米ドル合計		38 601 527.66	0.72
ノート、固定利付債合計		38 601 527.66	0.72
ノート、変動利付債			
USD			
USD MACQUARIE GROUP LTD-144A 6.255%/VAR 23-07.12.34	3 800 000.00	3 980 311.70	0.08
USD NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-144A 6.557%/VAR 23-18.10.27	4 140 000.00	4 274 209.82	0.08
米ドル合計		8 254 521.52	0.16
ノート、変動利付債合計		8 254 521.52	0.16
中期債券、固定利付債			
USD			
USD MET TOWER GLOBAL FUNDING-144A 4.85000% 24-16.01.27	3 750 000.00	3 769 062.41	0.07
USD TTX CO-144A 5.50000% 23-25.09.26	5 606 000.00	5 684 237.11	0.11
米ドル合計		9 453 299.52	0.18
中期債券、固定利付債合計		9 453 299.52	0.18
最近発行された譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		56 309 348.70	1.06
投資有価証券合計		5 214 156 832.63	97.83

派生商品

公認の証券取引所に上場されている派生商品

債券に係る金融先物

EUR EURO-BUND FUTURE 07.03.24	-57.00	-157 743.31	0.00
EUR EURO-BOBL FUTURE 07.03.24	-11.00	-11 648.24	0.00
USD US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 19.03.24	-20.00	-157 031.20	0.00
USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 19.03.24	-317.00	-641 652.08	-0.01
USD US LONG BOND FUTURE 19.03.24	-198.00	-1 303 215.16	-0.02
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.03.24	450.00	1 416 601.53	0.02
USD US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 28.03.24	438.00	789 780.48	0.01
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 28.03.24	934.00	1 093 501.23	0.02
債券に係る金融先物合計		1 028 593.25	0.02

通貨に係る金融先物

USD EURO FX CURRENCY FUTURE 18.03.24	-97.00	-6 426.25	0.00
通貨に係る金融先物合計		-6 426.25	0.00
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		1 022 167.00	0.02
派生商品合計		1 022 167.00	0.02

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - US マルチ・クレジット・サステナブル

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面			米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
先渡為替契約					
購入通貨	購入額	売却通貨	売却額	満期日	
USD	8 933 878.61	EUR	8 143 969.00	2.2.2024	87 492.29 0.00
CHF	1 522 614 894.08	USD	1 775 872 000.00	22.2.2024	3 060 930.69 0.06
EUR	985 295 236.91	USD	1 074 495 000.00	22.2.2024	-3 270 994.40 -0.06
GBP	130 479 687.40	USD	164 993 000.00	22.2.2024	1 194 035.85 0.02
JPY	1 530 617 814.00	USD	10 489 000.00	22.2.2024	16 788.94 0.00
USD	8 000 000.00	EUR	7 357 526.11	22.2.2024	815.29 0.00
USD	300 000.00	JPY	44 150 190.00	22.2.2024	-3 036.18 0.00
USD	8 839 106.43	EUR	8 143 969.00	4.3.2024	-18 754.75 0.00
EUR	8 143 969.00	USD	8 828 147.09	2.2.2024	18 239.23 0.00
USD	6 000 000.00	EUR	5 513 965.96	22.2.2024	5 154.51 0.00
先渡為替契約合計					1 090 671.47 0.02
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					83 202 334.44 1.56
当座借越およびその他の短期負債					-1 882 082.10 -0.04
その他の資産および負債					32 152 952.97 0.61
純資産総額					5 329 742 876.41 100.00

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

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

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
株式			
イギリス			
USD NOBLE CORPORATION COM USD0.0001 CL A	9 228.00	407 231.64	0.02
イギリス合計		407 231.64	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	398 200.00	0.01
アメリカ合衆国合計		398 200.00	0.01
株式合計		805 431.64	0.03

ノート、固定利付債

EUR			
EUR ACCOR SA-REG-S 2.37500% 21-29.11.28	1 100 000.00	1 132 297.01	0.04
EUR ADIENT GLOBAL HOLDINGS LTD-REG-S 3.50000% 16-15.08.24	2 284 000.00	367 289.45	0.01
EUR ADLER PELZER HOLDING GMBH-REG-S 9.50000% 23-01.04.27	1 490 000.00	1 642 563.60	0.06
EUR AGPS BONDCO PLC-REG-S 1.87500% 21-14.01.26	1 400 000.00	600 696.25	0.02
EUR AGPS BONDCO PLC-REG-S 2.25000% 21-14.01.29	4 000 000.00	1 698 026.00	0.06
EUR AGPS BONDCO PLC-REG-S 2.25000% 21-27.04.27	1 100 000.00	467 913.05	0.02
EUR AIR FRANCE KLM-REG-S 1.87500% 20-16.01.25	1 100 000.00	1 166 496.71	0.04
EUR AIR FRANCE-KLM-REG-S 3.00000% 21-01.07.24	2 000 000.00	2 155 554.50	0.07
EUR AIR FRANCE-KLM-REG-S 3.87500% 21-01.07.26	500 000.00	539 079.80	0.02
EUR AIR FRANCE-KLM-REG-S 8.12500% 23-31.05.28	500 000.00	613 716.04	0.02
EUR ALTICE FINCO SA-REG-S 4.75000% 17-15.01.28	1 486 000.00	1 356 701.33	0.05
EUR ALTICE FRANCE HOLDING SA-REG-S 8.00000% 19-15.05.27	8 112 000.00	4 609 960.92	0.16
EUR ALTICE FRANCE SA/FRANCE-REG-S 11.50000% 24-01.02.27	275 000.00	293 117.77	0.01
EUR ALTICE FRANCE-REG-S 5.87500% 18-01.02.27	3 425 000.00	3 174 816.12	0.11
EUR AMERICAN TOWER CORP 4.62500% 23-16.05.31	1 100 000.00	1 256 554.45	0.04
EUR AMS-OSRAM AG-REG-S 10.50000% 23-30.03.29	749 000.00	878 689.35	0.03
EUR APCOA PARKING HOLDINGS GMBH-REG-S 4.62500% 21-15.01.27	1 325 000.00	1 376 096.80	0.05
EUR ARAMARK INTERNATIONAL FIN SARL-REG-S 3.12500% 17-01.04.25	300 000.00	322 215.42	0.01
EUR ARD FINANCE SA-REG-S (PIK) 5.00000% 19-30.06.27	2 608 400.00	1 367 103.19	0.05
EUR ARDAGH METAL PACKAGING FINANCE -REG-S 3.00000% 21-01.09.29	4 325 000.00	3 664 464.37	0.12
EUR ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-REG-S 2.12500% 19-15.08.26	2 625 000.00	2 558 996.36	0.09
EUR ARENA LUXEMBOURG FINANCE SARL-REG-S 1.87500% 20-01.02.28	4 092 000.00	3 931 989.50	0.13
EUR ASHLAND SERVICES BV-REG-S 2.00000% 20-30.01.28	1 820 000.00	1 813 874.56	0.06
EUR AUTOSTRADA PER L'ITALIA SPA-REG-S 2.00000% 20-04.12.28	618 000.00	619 801.51	0.02
EUR AVANTOR FUNDING INC-REG-S 3.87500% 20-15.07.28	600 000.00	634 641.57	0.02
EUR AZELIS FINANCE NV-REG-S 5.75000% 23-15.03.28	1 700 000.00	1 902 023.76	0.06
EUR BALL CORP 0.87500% 19-15.03.24	2 690 000.00	2 907 402.44	0.10
EUR BANFF MERGER SUB INC-REG-S 8.37500% 18-01.09.26	950 000.00	1 024 053.49	0.03
EUR BELDEN INC-REG-S 3.37500% 21-15.07.31	728 000.00	713 643.70	0.02
EUR BLITZ F18-674 GMBH-REG-S 6.00000% 18-30.07.26	1 875 000.00	1 783 695.15	0.06
EUR BOXER PARENT CO INC-REG-S 6.50000% 20-02.10.25	775 000.00	841 843.75	0.03
EUR CANPACK SA AND EASTERN PA-REG-S 2.37500% 20-01.11.27	3 391 000.00	3 374 651.31	0.12
EUR CARNIVAL PLC 1.00000% 19-28.10.29	3 604 000.00	2 956 412.66	0.10
EUR CATALENT PHARMA SOLUTIONS INC-REG-S 2.37500% 20-01.03.28	5 987 000.00	5 771 748.64	0.20
EUR CECONOMY AG-REG-S 1.75000% 21-24.06.26	800 000.00	772 367.20	0.03
EUR CELLNEX TELECOM SA-REG-S1.87500% 20-26.06.29	7 600 000.00	7 562 384.74	0.26
EUR CHROME HOLDCO REG-S-SUB 5.00000% 21-31.05.29	2 011 000.00	1 695 678.35	0.06
EUR CONSOLIDATED ENERGY FINANCE SA-REG-S 5.00000% 21-15.10.28	3 500 000.00	3 217 184.65	0.11
EUR CONSTELLIUM SE-REG-S 4.25000% 17-15.02.26	1 500 000.00	1 619 712.81	0.06
EUR CONSTELLIUM SE-REG-S 3.12500% 21-15.07.29	1 200 000.00	1 198 255.41	0.04
EUR COTY INC-REG-S 5.75000% 23-15.09.28	3 471 000.00	3 918 172.41	0.13
EUR CROWN EUROPEAN HOLDINGS SA-REG-S 5.00000% 23-15.05.28	1 430 000.00	1 597 141.62	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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / 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 4.75000% 23-15.03.29	1 675 000.00	1 843 576.71	0.06
EUR DANA FINANCING LUXEMBOURG SARL-REG-S 3.00000% 21-15.07.29	1 295 000.00	1 240 338.15	0.04
EUR DANA FINANCING LUXEMBOURG SARL-REG-S 8.50000% 23-15.07.31	500 000.00	592 419.03	0.02
EUR DEMIRE DUTCH MITSTND REL EST AG-REG-S 1.87500% 19-15.10.24	1 500 000.00	1 100 107.08	0.04
EUR DOUGLAS GMBH-REG-S 6.00000% 21-08.04.26	5 185 000.00	5 582 924.44	0.19
EUR DOVALUE SPA-REG-S 5.00000% 20-04.08.25	1 000 000.00	1 058 822.19	0.04
EUR DUFYR ONE BV-REG-S 2.50000% 17-15.10.24	895 000.00	958 581.10	0.03
EUR DUFYR ONE BV-REG-S 2.00000% 19-15.02.27	4 350 000.00	4 415 876.72	0.15
EUR EDREAMS ODIGEO SA-REG-S 5.50000% 22-15.07.27	1 700 000.00	1 818 925.62	0.06
EUR ELIOR GROUP SA-REG-S 3.75000% 21-15.07.26	1 600 000.00	1 623 222.48	0.06
EUR EP INFRASTRUCTURE AS-REG-S 1.69800% 19-30.07.26	1 500 000.00	1 483 480.77	0.05
EUR FAURECIA SE-REG-S 3.75000% 20-15.06.28	500 000.00	524 794.53	0.02
EUR FAURECIA-REG-S 2.75000% 21-15.02.27	5 070 000.00	5 213 143.28	0.18
EUR FORD MOTOR CREDIT CO LLC 6.12500% 23-15.05.28	500 000.00	585 162.87	0.02
EUR GOODYEAR DUNLOP TIRES EUROPE BV-REG-S 2.75000% 21-15.08.28	850 000.00	818 222.92	0.03
EUR GRIFOLS SA-REG-S 1.62500% 19-15.02.25	3 065 000.00	3 229 475.56	0.11
EUR GRIFOLS SA-REG-S 3.87500% 21-15.10.28	6 275 000.00	5 751 866.19	0.20
EUR IHO VERWALTUNGS GMBH-REG-S (PIK) 3.87500% 19-15.05.27	3 625 000.00	3 813 620.09	0.13
EUR ILIAD HOLDING SASU-REG-S 5.12500% 21-15.10.26	832 000.00	902 232.65	0.03
EUR ILIAD HOLDING SASU-REG-S 5.62500% 21-15.10.28	1 500 000.00	1 633 546.20	0.06
EUR ILIAD SA-REG-S 5.37500% 23-15.02.29	4 600 000.00	5 117 671.35	0.17
EUR ILIAD SA-REG-S 5.62500% 23-15.02.30	4 200 000.00	4 727 339.58	0.16
EUR INEOS QUATTRO FINANCE 2 PLC-REG-S 8.50000% 23-15.03.29	600 000.00	690 046.83	0.02
EUR INTERMEDIATE CAPITAL GROUP-REG-S 2.50000% 22-28.01.30	2 239 000.00	2 135 196.44	0.07
EUR INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC-REG-S 2.37500% 19-15.04.28	1 000 000.00	1 015 643.75	0.03
EUR INTL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP-REG-S 2.75000% 21-25.03.25	2 000 000.00	2 133 855.57	0.07
EUR INTL CONSOLIDATED AIRLINES GP-REG-S 3.75000% 21-25.03.29	5 500 000.00	5 776 850.22	0.20
EUR INTRUM AB-REG-S 4.87500% 20-15.08.25	2 000 000.00	1 892 942.70	0.06
EUR INTRUM AB-REG-S 9.25000% 22-15.03.28	100 000.00	86 189.71	0.00
EUR IQVIA INC-REG-S 2.25000% 19-15.01.28	3 925 000.00	3 975 572.34	0.14
EUR IQVIA INC-REG-S 2.87500% 20-15.06.28	2 725 000.00	2 801 403.18	0.10
EUR JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-REG-S 4.50000% 18-15.01.26	700 000.00	759 462.55	0.03
EUR JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-REG-S 6.87500% 19-15.11.26	150 000.00	173 519.32	0.01
EUR JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-REG-S 5.87500% 19-15.11.24	1 110 000.00	1 211 628.74	0.04
EUR JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-REG-S 4.50000% 21-15.07.28	1 075 000.00	1 147 937.59	0.04
EUR JAMES HARDIE INTERNATIONAL LTD-REG-S 3.62500% 18-01.10.26	500 000.00	534 380.69	0.02
EUR KAIKO BONDCO TELECOM SA-REG-S 5.12500% 21-30.09.29	1 900 000.00	1 989 303.06	0.07
EUR KLEOPATRA HOLDINGS 2 SCA-REG-S-SUB 6.50000% 21-01.09.26	2 325 000.00	1 613 463.70	0.05
EUR KRONOS INTERNATIONAL INC-REG-S 3.75000% 17-15.09.25	1 500 000.00	1 642 784.75	0.06
EUR LA FINANCIERE ATALIAN SA-REG-S 5.12500% 18-15.05.25	1 965 000.00	1 600 860.94	0.05
EUR LABORATOIRE EIMER SELARL-REG-S 5.00000% 21-01.02.29	1 600 000.00	1 486 824.24	0.05
EUR LOXAM SAS-REG-S 4.50000% 22-15.02.27	655 000.00	707 852.31	0.02
EUR LOXAM SAS-REG-S-SUB 5.75000% 19-15.07.27	625 000.00	670 347.97	0.02
EUR LUNE HOLDINGS SARL-REG-S 5.62500% 21-15.11.28	4 100 000.00	3 610 642.86	0.12
EUR MATTERHORN TELECOM SA-REG-S 4.00000% 17-15.11.27	1 250 000.00	1 337 445.31	0.05
EUR MAXEDA DIY HOLDING BV-REG-S 5.87500% 20-01.10.26	500 000.00	438 573.43	0.01
EUR MOTION BONDCO DAC-REG-S 4.50000% 19-15.11.27	1 250 000.00	1 283 230.57	0.04
EUR MYTILINEOS FINANCIAL PARTNERS SA-REG-S 2.50000% 19-01.12.24	300 000.00	320 647.96	0.01
EUR NEMAK SAB DE CV-REG-S 2.25000% 21-20.07.28	700 000.00	662 172.57	0.02
EUR NEXANS SA-REG-S 5.50000% 23-05.04.28	1 000 000.00	1 143 365.02	0.04
EUR NIDDA HEALTHCARE HOLDING GMBH-REG-S 7.50000% 22-21.08.26	12 164 000.00	13 675 605.08	0.47
EUR NITROGENMUEK RT-REG-S 7.00000% 18-14.05.25	700 000.00	532 262.50	0.02
EUR OI EUROPEAN GROUP BV-REG-S 6.25000% 23-15.05.28	726 000.00	820 619.60	0.03
EUR OLYMPUS WATER US HOLDING CORP-REG-S 3.87500% 21-01.10.28	2 100 000.00	2 118 719.79	0.07
EUR OLYMPUS WATER US HOLDING CORP-REG-S 9.62500% 23-15.11.28	2 000 000.00	2 343 427.96	0.08
EUR ONTEX GROUP N.V-REG-S 3.50000% 21-15.07.26	3 450 000.00	3 569 028.62	0.12
EUR ORGANON FINANCE 1 LLC-REG-S 2.87500% 21-30.04.28	2 459 000.00	2 483 311.21	0.08
EUR PEACH PROPERTY FINANCE GMBH-REG-S 4.37500% 20-15.11.25	500 000.00	437 215.62	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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)	
EUR	PIAGGIO & C SPA-REG-S 6.50000% 23-05.10.30	1 270 000.00	1 448 398.50	0.05
EUR	PICARD BONDCO SA-REG-S 5.37500% 21-01.07.27	1 025 000.00	1 057 624.60	0.04
EUR	PLAYTECH PLC-REG-S 4.25000% 19-07.03.26	1 175 000.00	1 247 985.94	0.04
EUR	PREEM HOLDINGS AB-REG-S 12.00000% 22-30.06.27	600 000.00	635 703.00	0.02
EUR	PROGROUP AG-REG-S 3.00000% 18-31.03.26	2 709 000.00	2 846 720.83	0.10
EUR	QUINTILES IMS INC-REG-S 2.87500% 17-15.09.25	1 800 000.00	1 918 143.26	0.07
EUR	RENAULT SA-REG-S 1.12500% 19-04.10.27	500 000.00	490 985.00	0.02
EUR	REXEL SA-REG-S 2.12500% 21-15.12.28	500 000.00	501 239.20	0.02
EUR	REXEL SA-REG-S 5.25000% 23-15.09.30	300 000.00	336 071.63	0.01
EUR	ROLLS-ROYCE PLC-REG-S 4.62500% 20-16.02.26	1 300 000.00	1 422 009.88	0.05
EUR	SECHE ENVIRONNEMENT SA-REG-S 2.25000% 04.11.21.28	1 500 000.00	1 485 501.19	0.05
EUR	SELECTA GROUP BV-REG-S (PAY IN KIND) 8.00000% 20-01.04.26	2 435 275.00	2 585 797.82	0.09
EUR	SILGAN HOLDINGS INC 3.25000% 18-15.03.25	3 369 000.00	3 618 103.32	0.12
EUR	SILGAN HOLDINGS INC 2.25000% 20-01.06.28	3 500 000.00	3 450 201.57	0.12
EUR	SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 3.12500% 17-19.09.25	500 000.00	528 209.62	0.02
EUR	SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 5.00000% 18-15.04.28	500 000.00	542 706.79	0.02
EUR	SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 2.12500% 21-06.07.24	2 600 000.00	2 781 886.25	0.09
EUR	SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 2.87500% 21-06.01.27	1 300 000.00	1 327 397.50	0.05
EUR	SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 3.37500% 21-06.07.29	943 000.00	936 210.32	0.03
EUR	STANDARD INDUSTRIES INC/NJ-REG-S 2.25000% 19-21.11.26	5 872 000.00	5 977 777.88	0.20
EUR	SYNTHOMER PLC-REG-S 3.87500% 20-01.07.25	1 200 000.00	1 277 430.00	0.04
EUR	TELE COLUMBUS AG-REG-S 3.87500% 18-02.05.25	1 500 000.00	1 015 996.78	0.03
EUR	TELECOM ITALIA SPA/MILANO-REG-S 6.87500% 23-15.02.28	6 945 000.00	8 021 164.64	0.27
EUR	TELECOM ITALIA SPA/MILANO-REG-S 7.87500% 23-31.07.28	7 155 000.00	8 555 159.71	0.29
EUR	TELENET FINANCE LUXEMBOURG-REG-S 3.50000% 17-01.03.28	1 000 000.00	1 033 479.97	0.04
EUR	TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 3.75000% 21-09.05.27	2 750 000.00	2 880 544.92	0.10
EUR	TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 4.37500% 21-09.05.30	14 465 000.00	14 727 268.70	0.50
EUR	TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NETHERLANDS 7.87500% 23-15.09.31	925 000.00	1 132 016.70	0.04
EUR	TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 7.37500% 23-15.09.29	2 800 000.00	3 291 541.72	0.11
EUR	TI AUTOMOTIVE FINANCE PLC-REG-S 3.75000% 21-15.04.29	4 119 000.00	4 089 477.07	0.14
EUR	TITAN HOLDINGS II BV-REG-S 5.12500% 21-15.07.29	4 140 000.00	3 971 366.93	0.14
EUR	TUI CRUISES GMBH-REG-S 6.50000% 21-15.05.26	3 881 000.00	4 173 578.88	0.14
EUR	UGI INTERNATIONAL LLC-REG-S 2.50000% 21-01.12.29	2 000 000.00	1 917 426.78	0.07
EUR	VERISURE HOLDING AB-REG-S 7.12500% 23-01.02.28	275 000.00	312 912.68	0.01
EUR	VERISURE MIDHOLDING AB-REG-S 5.25000% 21-15.02.29	6 575 000.00	6 806 058.24	0.23
EUR	VERTICAL HOLDCO GMBH-REG-S 6.62500% 20-15.07.28	1 941 000.00	1 818 961.38	0.06
EUR	VIRGIN MEDIA FINANCE PLC-REG-S 3.75000% 20-15.07.30	2 900 000.00	2 874 287.46	0.10
EUR	VOLVO CAR REG-S 4.25000% 22-31.05.28	1 740 000.00	1 880 329.78	0.06
EUR	WEBUILD SPA-REG-S 3.87500% 22-28.07.26	1 500 000.00	1 602 806.41	0.05
EUR	WEBUILD SPA-REG-S 5.87500% 20-15.12.25	600 000.00	665 462.82	0.02
EUR	WEBUILD SPA-REG-S 7.00000% 23-27.09.28	1 120 000.00	1 282 296.40	0.04
EUR	WMG ACQUISITION CORP-REG-S 2.75000% 20-15.07.28	775 000.00	797 562.77	0.03
EUR	WMG ACQUISITION CORP-REG-S 2.25000% 21-15.08.31	919 000.00	858 506.82	0.03
EUR	WP/AP TELECOM HOLDINGS III BV-REG-S 5.50000% 21-15.01.30	5 248 000.00	5 194 708.20	0.18
EUR	ZF EUROPE FINANCE BV-REG-S 3.00000% 19-23.10.29	1 100 000.00	1 083 871.12	0.04
EUR	ZF EUROPE FINANCE BV-REG-S 2.50000% 19-23.10.27	300 000.00	302 249.06	0.01
EUR	ZIGGO BOND CO BV-REG-S 3.37500% 20-28.02.30	2 444 000.00	2 250 358.21	0.08
ユーロ合計			322 912 210.18	11.00
GBP	ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-REG-S 4.75000% 17-15.07.27	150 000.00	141 410.47	0.00
GBP	CONSTELLATION AUTOMOTIVE FINANCI-REG-S 4.87500% 21-15.07.27	1 350 000.00	1 437 016.25	0.05
GBP	INSPIRED ENTERTAINMENT FINANCING-REG-S 7.87500% 21-01.06.26	500 000.00	604 252.02	0.02
GBP	OCADO GROUP PLC-REG-S 3.87500% 21-08.10.26	800 000.00	882 500.86	0.03
GBP	TALKTALK TELECOM GROUP PLC-REG-S 3.87500% 20-20.02.25	1 250 000.00	1 316 428.94	0.05
GBP	VIRGIN MEDIA SECURED FINANCE PLC-REG-S 5.25000% 19-15.05.29	1 025 000.00	1 222 074.25	0.04
GBP	VIRGIN MEDIA SECURED FINANCE PLC-REG-S 4.25000% 19-15.01.30	2 000 000.00	2 230 269.39	0.08
英ポンド合計			7 833 952.18	0.27

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD			
USD ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC 4.87500% 21-01.10.29	2 488 000.00	2 298 762.72	0.08
USD ALLY FINANCIAL INC-SUB 5.75000% 15-20.11.25	553 000.00	554 498.12	0.02
USD ALLY FINANCIAL INC-SUB 6.70000% 23-14.02.33	4 585 000.00	4 602 621.02	0.16
USD ALTICE FINANCING SA-144A 5.00000% 20-15.01.28	3 372 000.00	3 030 189.80	0.10
USD ALTICE FRANCE HOLDING SA 6.00000% 20-15.02.28	200 000.00	89 284.28	0.00
USD ALTICE FRANCE SA/FRANCE-144A 5.50000% 21-15.10.29	4 292 000.00	3 162 191.95	0.11
USD ALTICE FRANCE-144A 8.12500% 18-01.02.27	3 445 000.00	3 079 172.00	0.10
USD AMC NETWORKS INC 4.25000% 21-15.02.29	1 810 000.00	1 392 306.30	0.05
USD AMERICAN AIRLINES INC-144A 7.25000% 23-15.02.28	2 790 000.00	2 827 832.90	0.10
USD AMERIGAS PARTNERS LP/FINANCE CORP 5.75000% 17-20.05.27	760 000.00	726 976.10	0.02
USD ARD FINANCE SA-144A (PIK) 6.50000% 19-30.06.27	5 134 000.00	2 480 697.46	0.08
USD ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-144A 4.12500% 19-15.08.26	1 707 000.00	1 533 210.33	0.05
USD ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-144A 5.25000% 19-15.08.27	1 601 000.00	1 196 718.39	0.04
USD AVIS BUDGET CAR RENT LLC/FIN INC-144A 5.37500% 21-01.03.29	373 000.00	345 346.82	0.01
USD BALL CORP 2.87500% 20-15.08.30	1 540 000.00	1 312 522.90	0.04
USD BALL CORP 6.00000% 23-15.06.29	1 090 000.00	1 099 551.39	0.04
USD BANIJAY ENTERTAINMENT SASU-144A 8.12500% 23-01.05.29	1 615 000.00	1 669 905.76	0.06
USD BEAZER HOMES USA INC 5.87500% 18-15.10.27	1 301 000.00	1 267 187.01	0.04
USD BRANDYWINE OPERATING PARTNERSHIP LP 4.55000% 14-01.10.29	1 580 000.00	1 373 149.56	0.05
USD BUCKEYE PARTNERS LP 3.95000% 16-01.12.26	783 000.00	742 871.25	0.03
USD CARNIVAL CORP-144A 5.75000% 21-01.03.27	5 367 000.00	5 279 786.25	0.18
USD CATALENT PHARMA SOLUTIONS INC-144A 3.50000% 21-01.04.30	3 394 000.00	2 982 681.14	0.10
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 7.37500% 23-01.03.31	2 050 000.00	2 071 781.25	0.07
USD CENTENE CORP 2.50000% 21-01.03.31	800 000.00	665 000.00	0.02
USD CENTRAL GARDEN & PET CO 4.12500% 20-15.10.30	1 529 000.00	1 370 998.65	0.05
USD CHEPLAPHARM ARZNEIMITTEL GMBH-144A 5.50000% 20-15.01.28	3 476 000.00	3 328 791.40	0.11
USD CIMPRESS PLC 7.00000% 18-15.06.26	2 725 000.00	2 684 125.00	0.09
USD CLEVELAND-CLIFFS INC 6.25000% 10-01.10.40	253 000.00	222 787.73	0.01
USD COMMERCIAL METALS CO 3.87500% 21-15.02.31	1 954 000.00	1 723 283.60	0.06
USD COMMERCIAL METALS CO 4.37500% 22-15.03.32	630 000.00	562 518.24	0.02
USD CONCENTRIX CORP 6.65000% 23-02.08.26	755 000.00	773 010.49	0.03
USD CONSOLIDATED ENERGY FINANCE SA-144A 5.62500% 21-15.10.28	2 537 000.00	2 073 997.50	0.07
USD COVANTA HOLDING CORP 5.00000% 20-01.09.30	1 550 000.00	1 317 678.25	0.04
USD CROWDSTRIKE HOLDINGS INC 3.00000% 21-15.02.29	703 000.00	628 293.53	0.02
USD DANA INC 4.25000% 21-01.09.30	590 000.00	515 878.30	0.02
USD DANAOS CORP-144A 8.50000% 21-01.03.28	1 280 000.00	1 305 753.65	0.04
USD DRAX FINCO PLC-144A 6.62500% 18-01.11.25	1 000 000.00	992 900.00	0.03
USD ENCOMPASS HEALTH CORP 4.75000% 19-01.02.30	1 600 000.00	1 500 585.22	0.05
USD ENCOMPASS HEALTH CORP 4.62500% 20-01.04.31	1 310 000.00	1 203 533.29	0.04
USD ENLINK MIDSTREAM LLC 5.37500% 19-01.06.29	348 000.00	339 081.98	0.01
USD ENLINK MIDSTREAM PARTNERS LP 5.45000% 17-01.06.47	1 590 000.00	1 382 168.78	0.05
USD ENQUEST PLC-144A 11.62500% 22-01.11.27	696 000.00	659 943.56	0.02
USD FORD MOTOR CO 4.75000% 13-15.01.43	253 000.00	208 525.53	0.01
USD FORD MOTOR CREDIT CO 4.12500% 20-17.08.27	970 000.00	921 333.85	0.03
USD FORD MOTOR CREDIT CO 4.00000% 20-13.11.30	1 251 000.00	1 115 769.16	0.04
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.30000% 22-10.02.25	2 213 000.00	2 136 215.03	0.07
USD FORD MOTOR CREDIT CO 4.95000% 22-28.05.27	1 349 000.00	1 320 185.51	0.05
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 6.80000% 23-12.05.28	300 000.00	311 732.78	0.01
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.81500% 17-02.11.27	2 521 000.00	2 366 361.13	0.08
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 5.11300% 19-03.05.29	820 000.00	796 688.35	0.03
USD GEMS MENASA CAYMAN LTD/GEDL-144A 7.12500% 19-31.07.26	1 928 000.00	1 896 067.50	0.06
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 2.35000% 21-08.01.31	700 000.00	580 461.12	0.02
USD GENESIS ENERGY LP 6.25000% 17-15.05.26	162 000.00	161 251.01	0.01
USD GENESIS ENERGY LP 7.75000% 20-01.02.28	3 097 000.00	3 105 268.99	0.11
USD GENESIS ENERGY LP 8.00000% 20-15.01.27	3 625 000.00	3 667 673.50	0.12
USD GLOBAL PARTNERS LP 7.00000% 20-01.08.27	1 520 000.00	1 528 679.20	0.05
USD GOODYEAR TIRE & RUBBER CO/THE 5.62500% 21-30.04.33	611 000.00	552 846.61	0.02

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD GRIFOLS SA-144A 4.75000% 21-15.10.28	2 149 000.00	1 848 268.94	0.06
USD HB FULLER CO 4.25000% 20-15.10.28	654 000.00	607 326.12	0.02
USD HERENS HOLDCO SARL-144A 4.75000% 21-15.05.28	872 000.00	734 527.41	0.04
USD HILLENBRAND INC 3.75000% 21-01.03.31	1 711 000.00	1 480 209.35	0.05
USD IHEARTCOMMUNICATIONS INC-144A 4.75000% 19-15.01.28	891 000.00	666 022.50	0.02
USD IHO VERWALTUNGS GMBH-144A (PIK) 6.37500% 19-15.05.29	573 000.00	569 617.46	0.02
USD JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-144A 7.75000% 20-15.10.25	1 000 000.00	1 009 583.00	0.03
USD JAMES HARDIE INTERNATIONAL FIN LTD-144A 5.00000% 17-15.01.28	858 000.00	831 187.50	0.03
USD KB HOME 4.00000% 21-15.06.31	2 100 000.00	1 851 700.56	0.06
USD KOHL ' S CORP 3.37500% 21-01.05.31	2 175 000.00	1 740 000.00	0.06
USD L BRANDS INC 6.75000% 16-01.07.36	600 000.00	591 159.84	0.02
USD L BRANDS INC 6.87500% 15-01.11.35	1 365 000.00	1 361 113.16	0.05
USD LABL INC-144A 9.50000% 23-01.11.28	48 000.00	47 875.57	0.00
USD LAREDO PETROLEUM INC 10.12500% 20-15.01.28	588 000.00	615 819.46	0.02
USD LAS VEGAS SANDS CORP 3.90000% 19-08.08.29	1 987 000.00	1 834 020.87	0.06
USD MACYS RETAIL HOLDINGS INC 4.50000% 14-15.12.34	1 290 000.00	1 081 890.75	0.04
USD MELCO RESORTS FINANCE LTD-144A 5.37500% 19-04.12.29	2 179 000.00	1 940 581.09	0.07
USD MELCO RESORTS FINANCE LTD-144A 5.75000% 20-21.07.28	691 000.00	643 817.69	0.02
USD METHANEX CORP 5.12500% 20-15.10.27	1 005 000.00	969 481.49	0.03
USD METHANEX CORP 5.25000% 19-15.12.29	1 010 000.00	964 764.83	0.03
USD MOTION BONDCO DAC-144A 6.62500% 19-15.11.27	200 000.00	191 140.21	0.01
USD MPT OPERATING PARTNERSHIP LP/FIN CORP 4.62500% 19-01.08.29	2 525 000.00	1 707 311.32	0.06
USD MURPHY OIL USA INC 4.75000% 19-15.09.29	3 274 000.00	3 101 132.80	0.11
USD NAVIENT CORP 4.87500% 21-15.03.28	4 250 000.00	3 860 955.00	0.13
USD NAVIENT CORP 5.00000% 20-15.03.27	2 004 000.00	1 911 517.93	0.07
USD NAVIENT CORP 5.50000% 21-15.03.29	914 000.00	825 165.87	0.03
USD NEWELL BRANDS INC STEP-UP/DOWN 16-01.04.26	748 000.00	728 154.45	0.02
USD NGL ENRGY PARTNRS LP/ FINANCE CORP 6.12500% 17-01.03.25	2 026 000.00	2 024 546.75	0.07
USD NORDSTROM INC 5.00000% 14-15.01.44	1 990 000.00	1 440 219.71	0.05
USD NOVA CHEMICALS CORP-144A 8.50000% 23-15.11.28	1 767 000.00	1 849 130.16	0.06
USD NRG ENERGY INC 5.75000% 18-15.01.28	1 272 000.00	1 258 445.11	0.04
USD NRG ENERGY INC-144A 3.87500% 21-15.02.32	1 191 000.00	1 021 353.96	0.03
USD NUSTAR LOGISTICS LP 5.62500% 17-28.04.27	1 920 000.00	1 903 910.40	0.06
USD NUSTAR LOGISTICS LP 5.75000% 20-01.10.25	2 045 000.00	2 039 887.50	0.07
USD NUSTAR LOGISTICS LP 6.37500% 20-01.10.30	2 521 000.00	2 533 605.00	0.09
USD OCEANEERING INTERNATIONAL INC 6.00000% 18-01.02.28	1 575 000.00	1 538 633.25	0.05
USD OLIN CORP 5.62500% 19-01.08.29	2 036 000.00	1 994 748.55	0.07
USD ONEMAIN FINANCE CORP 4.00000% 20-15.09.30	1 294 000.00	1 095 861.94	0.04
USD ONEMAIN FINANCE CORP 3.50000% 21-15.01.27	2 001 000.00	1 830 773.53	0.06
USD ONEMAIN FINANCE CORP 3.87500% 21-15.09.28	845 000.00	741 567.86	0.03
USD ONEMAIN FINANCE CORP 7.87500% 23-15.03.30	2 287 000.00	2 323 364.31	0.08
USD PENSKE AUTOMOTIVE GROUP INC-SUB 3.75000% 21-15.06.29	1 398 000.00	1 245 932.69	0.04
USD PERRIGO FINANCE UNLIMITED CO 4.37500% 16-15.03.26	1 249 000.00	1 221 124.45	0.04
USD PERRIGO FINANCE UNLIMITED CO STEP-UP 20-15.06.30	1 032 000.00	945 306.84	0.03
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.70000% 22-16.02.32	677 000.00	549 351.65	0.02
USD PETROLEOS MEXICANOS 5.35000% 18-12.02.28	2 950 000.00	2 577 326.50	0.09
USD PITNEY BOWES INC-144A 7.25000% 21-15.03.29	690 000.00	587 362.50	0.02
USD POPULAR INC 7.25000% 23-13.03.28	2 150 000.00	2 229 550.00	0.08
USD PRIMO WATER HOLDINGS INC-144A 4.37500% 21-30.04.29	3 666 000.00	3 337 535.30	0.11
USD RAKUTEN GROUP INC-REG-S 10.25000% 22-30.11.24	570 000.00	583 965.00	0.02
USD RESORTS WORLD LAS VEGAS LLC/RWL-REG-S 8.45000% 23-27.07.30	1 200 000.00	1 249 464.00	0.04
USD ROLLS-ROYCE PLC-144A 5.75000% 20-15.10.27	7 237 000.00	7 240 931.58	0.25
USD ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD 7.50000% 97-15.10.27	850 000.00	893 611.80	0.03
USD ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD 3.70000% 17-15.03.28	2 500 000.00	2 304 179.50	0.08
USD ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD-144A 5.50000% 21-01.04.28	5 681 000.00	5 608 705.86	0.19
USD SEAGATE HDD CAYMAN 5.75000% 15-01.12.34	1 168 000.00	1 131 943.84	0.04
USD SEAGATE HDD CAYMAN 9.62500% 22-01.12.32	1 220 370.00	1 401 997.66	0.05
USD SERVICE CORP 3.37500% 20-15.08.30	1 830 000.00	1 595 760.00	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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD SERVICE CORP INTERNATIONAL/US 4.00000% 21-15.05.31	2 049 000.00	1 823 835.39	0.06
USD SERVICE PROPERTIES TRUST 4.95000% 17-15.02.27	800 000.00	731 985.92	0.02
USD SERVICE PROPERTIES TRUST 4.75000% 19-01.10.26	1 250 000.00	1 159 690.12	0.04
USD SERVICE PROPERTIES TRUST 4.95000% 19-01.10.29	1 000 000.00	831 081.10	0.03
USD SIGMA HOLDCO BV-144A 7.87500% 18-15.05.26	2 683 000.00	2 529 911.88	0.09
USD SIRIUS XM RADIO INC-144A 3.87500% 21-01.09.31	3 817 000.00	3 182 229.08	0.11
USD SM ENERGY CO 6.50000% 21-15.07.28	245 000.00	245 000.00	0.01
USD SM ENERGY CO 6.75000% 16-15.09.26	497 000.00	496 329.05	0.02
USD SOUTHWESTERN ENERGY CO 5.37500% 21-15.03.30	1 895 000.00	1 831 280.63	0.06
USD SPCM SA-144A 3.37500% 21-15.03.30	1 095 000.00	940 457.95	0.03
USD SPIRIT AEROSYSTEMS INC 4.60000% 18-15.06.28	2 900 000.00	2 479 674.00	0.08
USD SPRINGLEAF FINANCE CORP 6.62500% 19-15.01.28	1 240 000.00	1 235 657.89	0.04
USD SPRINGLEAF FINANCE CORP 5.37500% 19-15.11.29	1 857 000.00	1 718 201.50	0.06
USD STEELCASE INC 5.12500% 19-18.01.29	2 465 000.00	2 361 543.95	0.08
USD STUDIO CITY FINANCE LTD-144A 5.00000% 21-15.01.29	1 540 000.00	1 316 282.80	0.04
USD SYMANTEC CORP-144A 5.00000% 17-15.04.25	3 764 000.00	3 743 787.32	0.13
USD SYNCHRONY FINANCIAL-SUB 7.25000% 23-02.02.33	3 920 000.00	3 917 746.43	0.13
USD TAPESTRY INC 7.35000% 23-27.11.28	1 150 000.00	1 204 552.85	0.04
USD TELECOM ITALIA CAPITAL 6.37500% 04-15.11.33	270 000.00	261 695.78	0.01
USD TELECOM ITALIA CAPITAL 7.20000% 06-18.07.36	1 282 000.00	1 287 166.46	0.04
USD TELECOM ITALIA CAPITAL 7.72100% 08-06.04.38	1 400 000.00	1 444 914.80	0.05
USD TELENET FINANCE LUXEMBOURG-144A 5.50000% 17-01.03.28	1 200 000.00	1 135 073.28	0.04
USD TENET HEALTHCARE CORP-144A 4.25000% 21-01.06.29	965 000.00	895 840.96	0.03
USD TENET HEALTHCARE CORP 6.12500% 22-15.06.30	1 750 000.00	1 749 347.78	0.06
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 4.75000% 21-09.05.27	1 185 000.00	1 137 635.55	0.04
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 5.12500% 21-09.05.29	412 000.00	395 647.72	0.01
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NETHERLANDS 7.87500% 23-15.09.29	1 424 000.00	1 530 800.00	0.05
USD TRANSDIGM INC-SUB 4.62500% 21-15.01.29	6 060 000.00	5 666 524.20	0.19
USD TRANSDIGM INC-SUB 4.87500% 21-01.05.29	4 940 000.00	4 616 947.22	0.16
USD TRANSDIGM INC-SUB 5.50000% 20-15.11.27	2 807 000.00	2 730 954.55	0.09
USD TRANSOCEAN LTD 7.50000% 01-15.04.31	1 000 000.00	882 500.00	0.03
USD TRI POINTE GROUP INC 5.70000% 20-15.06.28	3 400 000.00	3 343 967.02	0.11
USD TRIVIUM PACKAGING FINANCE BV-144A 5.50000% 19-15.08.26	3 025 000.00	2 953 159.45	0.10
USD TRIVIUM PACKAGING FINANCE BV-144A 8.50000% 19-15.08.27	1 727 000.00	1 685 202.99	0.06
USD TWILIO INC 3.87500% 21-15.03.31	839 000.00	739 602.33	0.03
USD UNITED AIRLINES INC-144A 4.62500% 21-15.04.29	2 693 000.00	2 491 112.59	0.08
USD UNITED RENTALS NORTH AMERICA INC-144A 6.00000% 22-15.12.29	435 000.00	440 968.41	0.03
USD VERITAS US INC / BERMUDA LTD-144A 7.50000% 20-01.09.25	1 300 000.00	1 110 905.37	0.04
USD VIASAT INC-144A 7.50000% 23-30.05.31	3 648 000.00	2 704 080.00	0.09
USD VIRGIN MEDIA VENDOR FINANC-144A 5.00000% 20-15.07.28	1 725 000.00	1 623 834.24	0.06
USD VISTRA OPERATIONS CO LLC-144A 4.37500% 21-01.05.29	4 048 000.00	3 716 906.63	0.13
USD VITAL ENERGY INC 9.75000% 23-15.10.30	1 900 000.00	2 018 531.14	0.07
USD VORNADO REALTY LP 3.40000% 21-01.06.31	1 180 000.00	930 291.78	0.03
USD WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC 3.45000% 16-01.06.26	780 000.00	746 031.43	0.03
USD WYNN MACAU LTD-144A 5.12500% 19-15.12.29	1 305 000.00	1 164 451.50	0.04
USD YUM BRANDS INC 3.62500% 20-15.03.31	2 825 000.00	2 493 162.62	0.08
USD YUM BRANDS INC 4.62500% 21-31.01.32	700 000.00	649 328.20	0.02
USD YUM BRANDS 5.37500% 22-01.04.32	1 507 000.00	1 465 623.65	0.05
USD ZIGGO BOND CO BV-144A 6.00000% 16-15.01.27	3 180 000.00	3 119 909.29	0.11
USD ZIGGO BV-144A 4.87500% 19-15.01.30	1 061 000.00	948 649.61	0.03
米ドル合計		270 883 089.92	9.22
ノート、固定利付債合計		601 629 252.28	20.49
ノート、変動利付債			
EUR ABERTIS INFRA FINANCE BV-REG-S-SUB 3.248%/VAR 20-PRP	4 900 000.00	5 136 333.11	0.17
EUR ABERTIS INFRA FINANCE BV-REG-S-SUB 2.625%/VAR 20-PRP	2 000 000.00	2 012 495.38	0.07
EUR ACCOR SA-REG-S-SUB 2.625%/VAR 19-PRP	2 000 000.00	2 121 533.15	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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR ACCOR SA-REG-S-SUB 7.250%/VAR 23-PRP	1 800 000.00	2 131 222.50	0.07
EUR AIB GROUP PLC-REG-S-SUB 6.250%/VAR 19-PRP	500 000.00	536 828.00	0.02
EUR ALLIANZ SE-REG-S-SUB 2.625%/VAR 20-PRP	600 000.00	512 383.69	0.02
EUR BANCO BPM SPA-REG-S-SUB 5.000%/VAR 20-14.09.30	1 120 000.00	1 226 279.27	0.04
EUR BANCO COMERCIAL PORTUGUES-REG-S-SUB COCO 8.125%/VAR 24-PRP	800 000.00	869 695.20	0.03
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB 2.000%/VAR 20-17.01.30	1 000 000.00	1 047 970.54	0.04
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB COCO 5.750%/VAR 21-PRP	1 000 000.00	1 029 964.87	0.03
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB COCO 9.375%/VAR 23-PRP	400 000.00	463 654.95	0.02
EUR BANK OF IRELAND GROUP PLC-REG-S-SUB COCO 7.500%/VAR 20-PRP	260 000.00	284 539.79	0.01
EUR BANK OF IRELAND GROUP PLC-REG-S-SUB COCO 6.000%/VAR 20-PRP	300 000.00	320 172.19	0.01
EUR BANKINTER SA-REG-S-SUB COCO 7.375%/VAR 23-PRP	1 400 000.00	1 549 264.06	0.05
EUR BAYER AG-REG-S-SUB 5.375%/VAR 22-25.03.82	7 000 000.00	7 170 929.34	0.24
EUR BAYNGR AG-REG-S-SUB 7.000%/VAR 23-25.09.83	600 000.00	666 173.23	0.02
EUR BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC-REG-S-SUB 3.000%/VAR 21-PRP	1 000 000.00	986 249.82	0.03
EUR BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC-REG-S-SUB 3.750%/VAR 21-PRP	500 000.00	474 414.25	0.02
EUR CAIXABANK SA-REG-S-SUB COCO 8.250%/VAR 23-PRP	600 000.00	689 225.63	0.02
EUR CAIXABANK SA-REG-S-SUB COCO 7.500%/VAR 24-PRP	1 000 000.00	1 113 013.03	0.04
EUR CASTELLUM AB-REG-S 3.125%/VAR 21-PRP	1 550 000.00	1 383 637.55	0.05
EUR COMMERZBANK AG-REG-S-SUB 6.125%/VAR 20-PRP	1 400 000.00	1 477 028.44	0.05
EUR EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA-REG-S-SUB 1.700%/VAR 20-20.07.80	3 600 000.00	3 734 480.57	0.13
EUR EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL-REG-S-SUB 1.500%/VAR 21-14.03.82	1 200 000.00	1 181 622.75	0.04
EUR EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA-REG-S-SUB 1.875%/VAR 21-14.03.82	7 500 000.00	6 884 304.90	0.23
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 3.000%/VAR 19-PRP	200 000.00	199 976.45	0.01
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 3.375%/VAR 20-PRP	9 600 000.00	9 254 850.00	0.32
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 2.875%/VAR 20-PRP	8 400 000.00	8 530 495.04	0.29
EUR ELECTRICITE DE FRANCE-REG-S-SUB 2.625%/VAR 21-PRP	8 000 000.00	7 860 035.48	0.27
EUR ELM BV FOR FIRMENICH INTL SA-REG-S-SUB 3.750%/VAR 20-PRP	5 263 000.00	5 596 878.14	0.19
EUR ENEL SPA-REG-S-SUB 1.875%/VAR 21-PRP	3 300 000.00	2 925 950.17	0.10
EUR ENEL SPA-REG-S-SUB 2.250%/VAR 20-PRP	750 000.00	755 826.98	0.03
EUR ENERGIAS DE PORTUGAL SA-REG-S-SUB 1.875%/VAR 21-02.08.81	1 700 000.00	1 724 286.09	0.06
EUR ENI SPA-REG-S-SUB 2.625%/VAR 20-PRP	2 900 000.00	3 033 727.88	0.10
EUR FASTIGHETS AB BALDER-REG-S-SUB 2.873%/VAR 21-02.06.81	348 000.00	317 381.39	0.01
EUR FIBER BIDCO SPA-REG-S 3M EURIBOR+400BP 24-15.01.30	740 000.00	809 870.32	0.03
EUR GALAPAGO SA/LUX-REG-S *DEFAULT* 3M EURIBOR+475BP 14-15.06.21	1 066 000.00	578.97	0.00
EUR HEIMSTADEN BOSTAD AB-REG-S-SUB 3.000%/VAR 21-PRP	2 696 000.00	1 427 658.38	0.05
EUR INTESA SANPAOLO SPA-REG-S-SUB COCO 6.375%/VAR 20-PRP	1 550 000.00	1 621 222.69	0.06
EUR INTESA SANPAOLO SPA-REG-S-SUB COCO 9.125%/VAR 23-PRP	360 000.00	431 132.62	0.01
EUR KAPLA HOLDING SAS-REG-S 3M EURIBOR+350BP 24-31.07.30	1 120 000.00	1 216 600.00	0.04
EUR KBC GROUP NV-REG-S-SUB COCO 8.000%/VAR 23-PRP	400 000.00	462 175.04	0.02
EUR KONINKLIJKE KPN NV-REG-S-SUB 2.000%/VAR 19-PRP	1 000 000.00	1 061 114.18	0.04
EUR LENZING AG-REG-S-SUB 5.750%/VAR 20-PRP	1 400 000.00	1 329 327.11	0.05
EUR PERMANENT TSB GROUP HOLD PLC-REG-S 6.625%/VAR 23-25.04.28	600 000.00	690 196.73	0.02
EUR PERMANENT TSB GROUP HLDINGS PLC-REG-S 6.625%/VAR 23-30.06.29	575 000.00	673 870.45	0.02
EUR REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S-SUB 3.750%/VAR 20-PRP	479 000.00	508 060.37	0.02
EUR REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S-SUB 4.247%/VAR 20-PRP	2 497 000.00	2 629 394.96	0.09
EUR REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S-SUB 2.500%/VAR 21-PRP	7 523 000.00	7 640 687.93	0.26
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 2.502%/VAR 20-PRP	300 000.00	303 471.10	0.01
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 2.376%/VAR 21-PRP	2 500 000.00	2 379 566.40	0.08
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 2.880%/VAR 21-PRP	3 300 000.00	3 315 849.82	0.11
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 7.125%/VAR 22-PRP	2 000 000.00	2 354 468.60	0.08
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 6.135%/VAR 23-PRP	1 700 000.00	1 902 201.02	0.06
EUR TELEFONICA EUROPE-REG-S-SUB 6.750%/VAR 23-PRP	1 200 000.00	1 404 698.53	0.05
EUR UNICREDIT SPA-REG-S-SUB 2.731%/VAR 20-15.01.32	3 262 000.00	3 325 233.19	0.11
EUR VEOLIA ENVIRONNEMENT SA-REG-S-SUB 2.500%/VAR 20-PRP	1 000 000.00	972 888.95	0.03
EUR VEOLIA ENVIRONNEMENT SA-REG-S-SUB 5.993%/VAR 23-PRP	3 700 000.00	4 226 391.27	0.14
EUR VODAFONE GROUP PLC-REG-S-SUB 2.625%/VAR 20-27.08.80	1 025 000.00	1 060 519.45	0.04
EUR VODAFONE GROUP PLC-REG-S-SUB 3.000%/VAR 20-27.08.80	1 450 000.00	1 409 680.94	0.05
EUR WINTERSHALL DEA FINANCE 2BV-REG-S-SUB 3.000%/VAR 21-PRP	4 000 000.00	3 823 600.00	0.13
ユーロ合計		132 183 282.85	4.50

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
GBP			
GBP LEGAL & GENERAL GROUP PLC-REG-S-SUB COCO 5.625%/VAR 20-PRP	900 000.00	999 976.62	0.03
GBP LLOYDS BANKING GROUP-SUB COCO 8.500%/VAR 22-PRP	780 000.00	1 000 641.35	0.03
GBP NATWEST GROUP PLC-SUB 5.125%/VAR 20-PRP	2 000 000.00	2 295 266.28	0.08
GBP NATWEST GROUP PLC-SUB 4.500%/VAR 21-PRP	1 225 000.00	1 309 303.66	0.05
GBP UTMOST GROUP PLC-REG-S-SUB 6.125%/VAR 22-PRP	2 100 000.00	2 197 812.21	0.08
英債券合計		7 803 000.12	0.27
USD			
USD AERCAP GLOBAL AVIATION TRUST-144A-SUB 6.500%/VAR 15-15.06.45	1 635 000.00	1 624 768.52	0.05
USD AMERICAN EXPRESS CO-SUB 3.550%/VAR 21-PRP	125 000.00	111 437.03	0.00
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 2.482%/VAR 21-21.09.36	1 103 000.00	885 202.77	0.03
USD BNP PARIBAS SA-REG-S-SUB COCO 9.250%/VAR 22-PRP	1 200 000.00	1 278 102.00	0.04
USD BNP PARIBAS SA-REG-S-SUB COCO 8.500%/VAR 23-PRP	1 325 000.00	1 371 981.85	0.05
USD BNP PARIBAS SA-REG-S-SUB COCO 7.000%/VAR 18-PRP	325 000.00	316 345.41	0.01
USD BNP PARIBAS SA-REG-S-SUB 6.625%/VAR 19-PRP	460 000.00	459 311.75	0.02
USD CAPITAL ONE FINANCIAL CORP-SUB 3.950%/VAR 21-PRP	860 000.00	744 932.00	0.03
USD CITIGROUP INC-SUB 4.000%/VAR 20-PRP	430 000.00	401 811.95	0.01
USD COMMERZBANK AG-REG-S-SUB 7.000%/VAR 19-PRP	600 000.00	577 790.40	0.02
USD DANSKE BANK A/S-REG-S-SUB 4.375%/VAR 21-PRP	1 475 000.00	1 344 093.75	0.05
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY-SUB 3.729%/VAR 21-14.01.32	700 000.00	587 678.86	0.02
USD ING GROEP NV-REG-S-SUB COCO 7.500%/VAR 23-PRP	1 600 000.00	1 584 960.00	0.05
USD ING GROEP NV-SUB 3.875%/VAR 21-PRP	700 000.00	573 938.05	0.02
USD MORGAN STANLEY-SUB 2.484%/VAR 21-16.09.36	1 107 000.00	884 648.62	0.03
USD NORDEA BANK ABP-REG-S-SUB 6.125%/VAR 14-PRP	300 000.00	298 442.64	0.01
USD PARAMOUNT GLOBAL-SUB 6.375%/VAR 22-30.03.62	927 000.00	827 871.26	0.03
USD PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE-SUB 6.200%/VAR 22-PRP	1 136 000.00	1 112 693.03	0.04
USD SOCIETE GENERALE SA-REG-S-SUB COCO 10.000%/VAR 23-PRP	590 000.00	629 469.23	0.02
USD STANDARD CHARTERED PLC-REG-S-SUB 6.000%/VAR 20-PRP	1 000 000.00	988 065.40	0.03
USD SWEDBANK AB-REG-S-SUB 7.625%/VAR 23-PRP	1 400 000.00	1 399 720.00	0.05
USD UBS GROUP AG-144A-SUB COCO 9.250%/VAR 23-PRP	240 000.00	256 725.36	0.01
USD UBS GROUP AG-REG-S-SUB COCO 3.875%/VAR 21-PRP	2 325 000.00	2 078 918.28	0.07
USD UBS GROUP AG-REG-S-SUB COCO 9.250%/VAR 23-PRP	400 000.00	427 875.60	0.01
USD VODAFONE GROUP PLC-SUB 4.125%/VAR 21-04.06.81	490 000.00	425 050.16	0.01
USD VODAFONE GROUP PLC-SUB 5.125%/VAR 21-04.06.81	600 000.00	452 882.73	0.02
USD WELLS FARGO & CO-SUB 7.625%/VAR 23-PRP	565 000.00	591 853.32	0.02
USD WYNDHAM WORLDWIDE CORP STEP UP/RATING LINKED 17-01.04.27	1 701 000.00	1 701 394.63	0.06
米ドル合計		23 937 964.60	0.81
ノート、変動利付債合計		163 924 247.57	5.58

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	584 958.93	0.02
EUR AUTOSTRADE PER L'ITALIA SPA-REG-S 1.87500% 17-26.09.29	800 000.00	783 194.94	0.03
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB 2.50000% 21-15.04.31	800 000.00	822 291.25	0.03
EUR CASINO GUICHARD PERRACHON SA-REG-S STEP-UP 14-07.02.25	700 000.00	4 790.37	0.00
EUR CELLNEX FINANCE CO SA -REG-S 1.25000% 21-15.01.29	5 100 000.00	4 978 430.83	0.17
EUR CELLNEX FINANCE CO SA-REG-S 2.00000% 21-15.02.33	3 400 000.00	3 174 437.01	0.11
EUR CELLNEX FINANCE CO SA-REG-S 1.50000% 21-08.06.28	1 000 000.00	1 000 577.46	0.03
EUR CELLNEX FINANCE CO SA-REG-S 2.00000% 21-15.09.32	1 700 000.00	1 601 980.42	0.05
EUR CELLNEX FINANCE CO SA-REG-S 2.25000% 22-12.04.26	2 100 000.00	2 217 627.61	0.08
EUR CELLNEX TELECOM SA-REG-S 1.75000% 20-23.10.30	7 000 000.00	6 727 265.74	0.23
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA AG-REG-S 3.00000% 20-29.05.26	3 800 000.00	4 031 111.13	0.14
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA AG-REG-S 3.75000% 21-11.02.28	2 000 000.00	2 145 343.75	0.07
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA AG-REG-S 3.50000% 21-14.07.29	1 000 000.00	1 049 426.12	0.04
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA AG-REG-S 2.00000% 21-14.07.24	4 800 000.00	5 155 186.08	0.18
EUR DEUTSCHE LUFTHANSA AG-REG-S 2.87500% 21-16.05.27	3 600 000.00	3 769 409.16	0.13

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR DOMETIC GROUP AB-REG-S 3.00000% 19-08.05.26	700 000.00	730 233.74	0.02
EUR DOMETIC GROUP AB-REG-S 2.00000% 21-29.09.28	300 000.00	285 140.62	0.01
EUR ELIS SA-REG-S 1.00000% 19-03.04.25	1 900 000.00	1 991 680.65	0.07
EUR ELIS SA-REG-S 1.62500% 19-03.04.28	800 000.00	801 676.83	0.03
EUR ELIS SA-REG-S 1.75000% 19-11.04.24	2 900 000.00	3 132 383.50	0.11
EUR ELIS SA-REG-S 4.12500% 22-24.05.27	400 000.00	441 326.00	0.01
EUR FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.25000% 20-15.09.25	1 150 000.00	1 231 485.68	0.04
EUR FORD MOTOR CREDIT CO LLC 5.12500% 23-20.02.29	438 000.00	495 411.88	0.02
EUR HEIMSTADEN BOSTAD TREASURY BV-REG-S 0.75000% 21-06.09.29	800 000.00	614 817.50	0.02
EUR INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALI SPA-REG-S 1.87500% 20-08.07.26	2 475 000.00	2 588 452.34	0.09
EUR INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALI SPA-REG-S 1.62500% 20-21.10.28	300 000.00	301 077.87	0.01
EUR INTESA SANPAOLO SPA-REG-S-SUB 2.92500% 20-14.10.30	2 100 000.00	2 054 559.11	0.07
EUR INTRUM JUSTITIA AB-REG-S 3.50000% 19-15.07.26	3 000 000.00	2 444 062.51	0.08
EUR LOXAM SAS-REG-S 6.37500% 23-15.05.28	1 700 000.00	1 907 770.45	0.06
EUR MAHLE GMBH-REG-S 2.37500% 21-14.05.28	1 900 000.00	1 746 554.22	0.06
EUR MUNDYS SPA-REG-S 4.75000% 24-24.01.29	1 355 000.00	1 479 487.14	0.05
EUR NOVELIS SHEET INGOT GMBH-REG-S 3.37500% 21-15.04.29	6 755 000.00	6 840 245.59	0.23
EUR PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 2.75000% 15-21.04.27	1 500 000.00	1 389 042.18	0.05
EUR PPF ARENA 1 BV-REG-S 2.12500% 19-31.01.25	700 000.00	744 407.12	0.03
EUR PPF TELECOM GROUP BV-REG-S 3.25000% 20-29.09.27	1 924 000.00	2 026 444.11	0.07
EUR RCI BANQUE SA-REG-S 4.75000% 22-06.07.27	650 000.00	730 190.07	0.02
EUR RCI BANQUE SA-REG-S 4.62500% 23-13.07.26	283 000.00	312 763.19	0.01
EUR RCI BANQUE SA-REG-S 4.62500% 23-02.10.26	1 034 000.00	1 145 805.64	0.04
EUR RENAULT SA-REG-S 2.00000% 18-28.09.26	600 000.00	617 729.96	0.02
EUR RENAULT SA-REG-S 2.37500% 20-25.05.26	1 200 000.00	1 251 360.00	0.04
EUR RENAULT SA-REG-S 2.50000% 21-01.04.28	2 200 000.00	2 255 288.33	0.08
EUR RENAULT SA-REG-S 2.50000% 21-02.06.27	500 000.00	515 983.96	0.02
EUR ROLLS-ROYCE PLC-REG-S 0.87500% 18-09.05.24	4 554 000.00	4 894 346.61	0.17
EUR SAIPEM FINANCE INTERNATIONAL BV-REG-S 3.12500% 21-31.03.28	500 000.00	518 345.46	0.02
EUR SAMHALLSBYGGNADSBOLAGET I NORDEN-REG-S STEP-UP 19-04.09.26	600 000.00	499 832.29	0.02
EUR SAMHALLSBYGGNADSBOLAGET I NORDEN-REG-S 1.00000% 20-12.08.27	500 000.00	374 756.25	0.01
EUR SBB TREASURY OYJ-REG-S 0.75000% 20-14.12.28	640 000.00	437 107.00	0.01
EUR SCHAEFFLER AG-REG-S 1.87500% 19-26.03.24	4 100 000.00	4 433 761.83	0.15
EUR SCHAEFFLER AG-REG-S 4.50000% 24-14.08.26	700 000.00	766 990.26	0.03
EUR SCHAEFFLER AG-REG-S 4.75000% 24-14.08.29	2 900 000.00	3 189 873.27	0.11
EUR SHAEFFLER AG-REG-S 3.37500% 20-12.10.28	2 400 000.00	2 515 755.00	0.09
EUR TDC NET A/S-REG-S 5.05600% 22-31.05.28	175 000.00	196 705.03	0.01
EUR TDC NET A/S-REG-S 6.50000% 23-01.06.31	1 950 000.00	2 273 128.68	0.08
EUR TELECOM ITALIA FINANCE SA 7.75000% 03-24.01.33	1 000 000.00	1 264 481.90	0.04
EUR TELECOM ITALIA SPA-REG-S 3.00000% 16-30.09.25	100 000.00	106 246.11	0.00
EUR TELECOM ITALIA SPA-REG-S 2.37500% 17-12.10.27	1 444 000.00	1 463 452.49	0.05
EUR TELECOM ITALIA SPA-REG-S 2.87500% 18-28.01.26	825 000.00	867 595.75	0.03
EUR TELECOM ITALIA SPA-REG-S 4.00000% 19-11.04.24	4 197 000.00	4 548 049.68	0.15
EUR TELECOM ITALIA SPA-REG-S 2.75000% 19-15.04.25	700 000.00	743 564.63	0.03
EUR TELECOM ITALIA SPA/MILANO-REG-S 1.62500% 21-18.01.29	3 610 000.00	3 352 215.95	0.11
EUR TEOLLISUUDEN VOIMA OYJ-REG-S 1.37500% 21-23.06.28	1 000 000.00	989 389.09	0.03
EUR THYSSENKRUPP AG-REG-S 2.87500% 19-22.02.24	1 051 000.00	1 138 927.05	0.04
EUR TRAFIGURA FUNDING SA-REG-S 3.87500% 21-02.02.26	960 000.00	1 016 730.00	0.03
EUR VALEO SA-REG-S 5.37500% 22-28.05.27	1 500 000.00	1 679 022.05	0.06
EUR VALEO SE-REG-S 5.87500% 23-12.04.29	600 000.00	691 030.98	0.02
EUR VIVION INVESTMENTS SARL-REG-S PIK 7.90000% 23-31.08.28	720 000.00	631 702.17	0.02
EUR VOLVO CAR AB-REG-S 2.00000% 17-24.01.25	500 000.00	530 079.14	0.02
EUR VOLVO CAR AB-REG-S 2.12500% 19-02.04.24	2 571 000.00	2 778 785.00	0.09
EUR ZF EUROPE FINANCE BV-REG-S 6.12500% 23-13.03.29	4 500 000.00	5 140 811.74	0.18
EUR ZF EUROPE FINANCE BV-REG-S 4.75000% 24-31.01.29	3 200 000.00	3 457 785.75	0.12
EUR ZF FINANCE GMBH-REG-S 3.75000% 20-21.09.28	10 000 000.00	10 363 259.49	0.35
EUR ZF FINANCE GMBH-REG-S 3.00000% 20-21.09.25	1 500 000.00	1 591 834.20	0.05
EUR ZF FINANCE GMBH-REG-S 2.75000% 20-25.05.27	2 500 000.00	2 563 278.44	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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR ZF FINANCE GMBH-REG-S 2.00000% 21-06.05.27	3 200 000.00	3 206 610.01	0.11
EUR ZF FINANCE GMBH-REG-S 2.25000% 21-03.05.28	1 900 000.00	1 865 990.67	0.06
EUR ZF FINANCE GMBH-REG-S 5.75000% 23-03.08.26	600 000.00	668 434.80	0.02
ユーロ合計		148 881 289.76	5.07
GBP			
GBP FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.53500% 19-06.03.25	800 000.00	1 003 376.74	0.04
GBP FORD MOTOR CREDIT CO LLC 6.86000% 23-05.06.26	680 000.00	888 517.75	0.03
英ポンド合計		1 891 894.49	0.07
USD			
USD NAVIENT CORP 5.62500% 03-01.08.33	2 665 000.00	2 116 383.10	0.07
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.87500% 17-04.08.26	1 500 000.00	1 457 100.00	0.05
米ドル合計		3 573 483.10	0.12
中期債券、固定利付債合計		154 346 667.35	5.26
中期債券、変動利付債			
EUR			
EUR AIB GROUP PLC-REG-S-SUB 1.875%/VAR 19-19.11.29	1 825 000.00	1 937 651.45	0.07
EUR AIB GROUP PLC-REG-S-SUB 2.875%/VAR 20-30.05.31	400 000.00	418 214.94	0.01
EUR AXA SA-REG-S-SUB 6.375%/VAR 24-PRP	1 085 000.00	1 200 679.64	0.04
EUR BANCA MONT DEI PAS DI SIENA-REG-S-SUB 5.375%/VAR 18-18.01.28	650 000.00	725 603.48	0.02
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB 6.000%/VAR 23-16.08.33	300 000.00	330 731.19	0.01
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S 5.500%/VAR 23-08.09.29	400 000.00	454 315.81	0.02
EUR BANK OF IRELAND GROUP PLC-REG-S-SUB 6.750%/VAR 22-01.03.33	1 465 000.00	1 703 133.11	0.06
EUR BNP PARIBAS SA-REG-S-SUB 1.125%/VAR 20-15.01.32	1 000 000.00	989 174.01	0.03
EUR BPER BANCA-REG-S-SUB 3.875%/VAR 22-25.07.32	2 119 000.00	2 184 834.15	0.07
EUR CAIXABANK SA-REG-S-SUB 6.250%/VAR 22-23.02.33	600 000.00	685 569.30	0.02
EUR COMMERZBANK AG-REG-S-SUB 4.000%/VAR 20-05.12.30	1 200 000.00	1 285 175.40	0.04
EUR COMMERZBANK AG-REG-S-SUB 1.375%/VAR 21-29.12.31	3 800 000.00	3 739 741.50	0.13
EUR CREDIT AGRICOLE SA-SUB-REG-S 7.250%/VAR 23-PRP	1 000 000.00	1 135 092.14	0.04
EUR DEUTSCHE BANK AG-REG-S-SUB 4.000%/VAR 22-24.06.32	700 000.00	733 249.38	0.03
EUR EDP - ENERGIAS DE PORT SA-REG-S-SUB 5.943%/VAR 23-23.04.83	400 000.00	451 880.00	0.02
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 5.000%/VAR 14-PRP	3 500 000.00	3 779 824.12	0.13
EUR ENEL SPA-REG-S-SUB 6.625%/VAR 23-PRP	3 912 000.00	4 603 162.76	0.16
EUR ERSTE GROUP BANK AG-REG-S-SUB COCO 5.125%/VAR 19-PRP	2 000 000.00	2 077 148.97	0.07
EUR INTESA SANPAOLO SPA-REG-S-SUB 5.875%/VAR 19-04.03.29	1 000 000.00	1 086 662.77	0.04
EUR INTESA SANPAOLO SPA-REG-S-SUB 4.375%/VAR 19-12.07.29	625 000.00	677 141.10	0.02
EUR INTESA SANPAOLO SPA-REG-S-SUB COCO 5.875%/VAR 20-PRP	2 125 000.00	2 286 135.58	0.08
EUR INTESA SANPAOLO SPA-REG-S-SUB COCO 5.500%/VAR 20-PRP	275 000.00	279 319.96	0.01
EUR JYSKE BANK A/S-REG-S-SUB 3.625%/VAR 21-PRP	1 375 000.00	1 274 609.00	0.04
EUR MEDIUMBANCA SPA-REG-S-SUB 2.300%/VAR 20-23.11.30	870 000.00	901 310.61	0.03
EUR NATIONAL BANK OF GREECE SA-REG-S-SUB 8.000%/VAR 23-03.01.34	500 000.00	587 797.04	0.02
EUR OTP BANK NYRT-REG-S-SUB 2.875%/VAR 19-15.07.29	715 000.00	755 690.93	0.03
EUR PERMANENT TSB GRUP HOLD-REG-S-SUB 3.000%/VAR 21-19.08.31	500 000.00	508 310.69	0.02
EUR TRAFIGURA GROUP PTE LTD-REG-S-SUB 7.500%/VAR 19-PRP	499 000.00	546 279.05	0.02
EUR UNICREDIT SPA-REG-S-SUB 5.375%/VAR 24-16.04.34	810 000.00	887 913.24	0.03
EUR UNICREDIT SPA-REG-S-SUB 4.875%/VAR 19-20.02.29	400 000.00	434 462.63	0.01
EUR UNICREDIT SPA-REG-S-SUB 2.000%/VAR 19-23.09.29	900 000.00	960 027.75	0.03
EUR VODAFONE GROUP PLC-REG-S-SUB 6.500%/VAR 23-30.08.84	825 000.00	957 202.42	0.03
ユーロ合計		40 578 044.12	1.38
GBP			
GBP BANK OF IRELAND-REG-S-SUB 7.594%/VAR 22-06.12.32	2 280 000.00	3 005 226.67	0.10
GBP BARCLAYS PLC-REG-S-SUB 8.407%/VAR 22-14.11.32	1 000 000.00	1 355 460.18	0.05
GBP ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 6.000%/VAR 13-PRP	2 700 000.00	3 353 106.68	0.11
GBP QUILTER PLC-REG-S-SUB 8.625%/VAR 23-18.04.33	600 000.00	787 500.97	0.03
英ポンド合計		8 501 294.50	0.29

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 - ハイ・イールド

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD			
USD NATWEST GROUP PLC-SUB 8.000%/VAR 15-PRP	600 000.00	602 268.00	0.02
USD NORDEA BANK ABP-REG-S 3.750%/VAR 21-PRP	2 000 000.00	1 617 608.00	0.06
米ドル合計		2 219 876.00	0.08
中期債券、変動利付債合計		51 299 214.62	1.75
債券、固定利付債			
CHF			
CHF DUFYR ONE BV-REG-S 3.62500% 21-15.04.26	175 000.00	203 217.46	0.01
スイスフラン合計		203 217.46	0.01
EUR			
EUR 888 ACQUISITIONS LTD-REG-S 7.5580% 22-15.07.27	2 000 000.00	2 079 386.65	0.07
EUR ADEVINTA ASA-REG-S 2.62500% 20-15.11.25	900 000.00	972 736.88	0.03
EUR ADEVINTA ASA-REG-S 3.00000% 20-15.11.27	1 018 000.00	1 105 802.50	0.04
EUR ADLER REAL ESTATE AG-REG-S 3.00000% 18-27.04.26	300 000.00	263 931.38	0.01
EUR AFFLELOU SAS-REG-S 4.25000% 21-19.05.26	1 000 000.00	1 072 237.37	0.04
EUR AGPS BONDCO PLC-REG-S STEP-UP 17-31.07.25	900 000.00	685 070.72	0.02
EUR ALBION FINANCING-REG-S 5.25000% 21-15.10.26	500 000.00	536 335.94	0.02
EUR ALLIED UNIVERSAL HOLDCO/FIN/ATLAS-REG-S 3.62500% 21-01.06.28	3 592 000.00	3 559 699.30	0.12
EUR ALMAVIVA-THE ITALIAN INNOVATION-REG-S 4.87500% 21-30.10.26	500 000.00	533 843.77	0.02
EUR ALTICE FINANCING SA-REG-S 2.25000% 20-15.01.25	3 679 000.00	3 851 447.39	0.13
EUR ALTICE FINANCING SA-REG-S 3.00000% 20-15.01.28	5 610 000.00	5 332 129.69	0.18
EUR ALTICE FINANCING SA-REG-S 4.25000% 21-15.08.29	1 000 000.00	951 544.14	0.03
EUR ALTICE FRANCE-REG-S 2.50000% 19-15.01.25	400 000.00	411 060.47	0.01
EUR ALTICE FRANCE-REG-S 2.12500% 20-15.02.25	1 173 000.00	1 203 949.12	0.04
EUR ALTICE FRANCE-REG-S 4.12500% 20-15.01.29	2 135 000.00	1 763 082.65	0.06
EUR AVANTOR FUNDING INC-REG-S 2.62500% 20-01.11.25	2 770 000.00	2 937 450.83	0.10
EUR AVIS BUDGET FINANCE PLC-REG-S 7.25000% 23-31.07.30	500 000.00	566 886.71	0.02
EUR BANIJAY ENTERTAINMENT SASU-REG-S 7.00000% 23-01.05.29	2 982 000.00	3 406 890.76	0.12
EUR BANIJAY GROUP SAS-REG-S 6.50000% 20-01.03.26	4 150 000.00	4 547 381.95	0.15
EUR BCP V MODULAR SERVICES-REG-S 4.75000% 21-30.11.28	2 272 000.00	2 285 947.95	0.08
EUR BELDEN INC-REG-S-SUB 3.37500% 17-15.07.27	1 400 000.00	1 468 387.54	0.05
EUR BELDEN INC-REG-S-SUB 3.87500% 18-15.03.28	4 032 000.00	4 242 568.40	0.14
EUR BENTELER INTERNATIONAL AG-REG-S 9.37500% 23-15.05.28	1 685 000.00	1 956 166.52	0.07
EUR BERRY GLOBAL INC-REG-S 1.00000% 20-15.01.25	3 000 000.00	3 152 475.64	0.11
EUR BERRY GLOBAL INC-REG-S 1.50000% 20-15.01.27	450 000.00	454 253.46	0.02
EUR BK LC LUX FINCO1 SARL-REG-S 5.25000% 21-30.04.29	2 500 000.00	2 690 912.81	0.09
EUR BOELS TOPHOLDING BV-REG-S 6.25000% 23-15.02.29	1 160 000.00	1 313 602.13	0.04
EUR CAB SELAS-REG-S 3.37500% 21-01.02.28	4 400 000.00	4 337 874.20	0.15
EUR CARNIVAL CORP-REG-S 7.62500% 20-01.03.26	2 612 000.00	2 884 100.20	0.10
EUR CERVED GROUP SPA-REG-S 6.00000% 22-15.02.29	1 150 000.00	1 134 899.33	0.04
EUR CHEMOURS CO/THE 4.00000% 18-15.05.26	4 355 000.00	4 608 152.49	0.16
EUR CHEPLAPHARM ARZNEIMITTEL GMBH-REG-S 4.37500% 20-15.01.28	622 000.00	652 884.94	0.02
EUR CHEPLAPHARM ARZNEIMITTEL GMBH-REG-S 7.50000% 23-15.05.30	1 815 000.00	2 073 117.68	0.07
EUR CHROME BIDCO SASU-REG-S 3.50000% 21-31.05.28	1 079 000.00	1 025 555.78	0.03
EUR CIRSA FINANCE INTERNATIONAL-REG-S 4.75000% 19-22.05.25	2 125 000.00	2 305 940.65	0.08
EUR CIRSA FINANCE INTERNATIONAL SARL-REG-S 10.37500% 22-30.11.27	1 495 000.00	1 745 739.53	0.06
EUR CIRSA FINANCE INTERNATIONAL SARL-REG-S 7.87500% 23-31.07.28	740 000.00	839 024.49	0.03
EUR CONTOURGLOBAL POWER HOLDINGS SA-REG-S 3.12500% 20-01.01.28	2 000 000.00	1 960 437.93	0.07
EUR COTY INC-REG-S 3.87500% 21-15.04.26	1 050 000.00	1 130 525.54	0.04
EUR CROWN EUROPEAN HOLDINGS SA-REG-S 2.62500% 16-30.09.24	5 800 000.00	6 226 222.06	0.21
EUR CTEC II GMBH-REG-S 5.25000% 22-15.02.30	4 281 000.00	4 164 528.36	0.14
EUR CULLINAN HOLDCO SCSP REG-S 4.62500% 21-15.10.26	1 500 000.00	1 393 203.61	0.05
EUR DERICHEBOURG SA-REG-S 2.25000% 21-15.07.28	1 050 000.00	1 038 082.96	0.04
EUR DIC ASSET AG-REG-S 2.25000% 21-22.09.26	2 000 000.00	640 887.50	0.02
EUR DOVALUE SPA-REG-S 3.37500% 21-31.07.26	800 000.00	782 751.75	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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR DRAX FINCO PLC-REG-S 2.62500% 20-01.11.25	780 000.00	821 856.75	0.03
EUR DUFFRY ONE BV-REG-S 3.37500% 21-15.04.28	755 000.00	784 238.56	0.03
EUR EC FINANCE PLC-REG-S 3.00000% 21-15.10.26	400 000.00	421 256.44	0.01
EUR EG GLOBAL FINANCE PLC-REG-S 11.00000% 23-30.11.28	584 000.00	671 956.43	0.02
EUR EMERIA SASU-REG-S 7.75000% 23-31.03.28	3 250 000.00	3 386 981.81	0.12
EUR ENERGIA GROUP ROI FINANCECO DAC-REG-S 6.87500% 23-31.07.28	2 000 000.00	2 261 020.67	0.08
EUR ENERGIZER GAMMA ACQUISITION BV-REG-S 3.50000% 21-30.06.29	4 500 000.00	4 326 837.35	0.15
EUR ENGINEERING-INGEGNERIA INFO-REG-S 5.87500% 20-30.09.26	1 828 000.00	1 916 166.72	0.07
EUR ENGINEERING-INGEGNERIA INFORMATI-REG-S 11.12500% 23-15.05.28	625 000.00	729 824.22	0.02
EUR EPHIOS SUBCO 3 SARL-REG-S 7.87500% 23-31.01.31	1 020 000.00	1 168 401.74	0.04
EUR EXPLORER II AS 3.37500% 20-24.02.25	950 000.00	945 873.91	0.03
EUR FAURECIA SA-REG-S 3.12500% 19-15.06.26	1 525 000.00	1 604 764.65	0.05
EUR FAURECIA SE-REG-S 2.37500% 19-15.06.27	2 050 000.00	2 070 356.67	0.07
EUR FAURECIA SE-REG-S 7.25000% 22-15.06.26	3 800 000.00	4 300 455.04	0.15
EUR FIS FABBRICA ITALIANA SINTETICI S-REG-S 5.62500% 22-01.08.27	1 547 000.00	1 609 265.95	0.05
EUR FONCIA MANAGEMENT SASU-REG-S 3.37500% 21-31.03.28	2 375 000.00	2 204 579.68	0.08
EUR FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.86700% 23-03.08.27	544 000.00	605 950.64	0.02
EUR FRIGO DEBTCO PLC-REG-S (PIK) 10.00000% 23-20.04.28	1 826 074.00	882 689.94	0.03
EUR GALAPAGO SA/LUX-REG-S *DEFAULT* 5.37500% 14-15.06.21	1 680 000.00	912.45	0.00
EUR GETLINK SE-REG-S 3.50000% 20-30.10.25	2 400 000.00	2 578 323.00	0.09
EUR GREEN BIDCO SA-REG-S 10.25000% 23-15.07.28	1 000 000.00	894 820.16	0.03
EUR GRIFOLS SA-REG-S 3.20000% 17-01.05.25	1 690 000.00	1 748 214.99	0.06
EUR GRUENENTHAL GMBH-REG-S 4.12500% 21-15.05.28	2 000 000.00	2 138 161.46	0.07
EUR GRUENENTHAL GMBH-REG-S 6.75000% 23-15.05.30	1 000 000.00	1 155 498.44	0.04
EUR GRUPO ANTOLIN-IRAUSA SA-REG-S 3.50000% 21-30.04.28	575 000.00	500 293.34	0.02
EUR GRUPO-ANTOLIN IRAUSA SA-REG-S 3.37500% 18-30.04.26	225 000.00	224 658.71	0.01
EUR GUALA CLOSURES SPA-REG-S 3.25000% 21-15.06.28	3 200 000.00	3 215 300.00	0.11
EUR HELIXH HOLDCO SA-SUB (PIK) 10.00000% 20-19.04.26	268 390.00	2 434.35	0.00
EUR HUHTAMAKI OYJ-REG-S 4.25000% 22-09.06.27	1 500 000.00	1 632 144.94	0.06
EUR HUHTAMAKI OYJ-REG-S 5.12500% 23-24.11.28	400 000.00	449 598.88	0.02
EUR IHO VERWALTUNGS GMBH-REG-S (PIK) 3.75000% 16-15.09.26	1 875 000.00	1 998 110.71	0.07
EUR IHO VERWALTUNGS GMBH-REG-S (PIK) 8.75000% 23-15.05.28	3 405 000.00	3 994 760.67	0.14
EUR ILIAD SA-REG-S 5.37500% 22-14.06.27	2 800 000.00	3 116 880.54	0.11
EUR INEOS FINANCE PLC-REG-S 6.62500% 23-15.05.28	1 000 000.00	1 113 666.95	0.04
EUR INEOS STYROLUTION GROUP GMBH-REG-S 2.25000% 20-16.01.27	500 000.00	502 504.68	0.02
EUR INPOST SA-REG-S 2.25000% 21-15.07.27	1 225 000.00	1 242 220.83	0.04
EUR INTERNATIONAL DESIGN GROUP SPA-REG-S 10.00000% 23-15.11.28	600 000.00	676 086.35	0.02
EUR INTRALOT CAPITAL LUXEMBOURG SA-REG-S 5.25000% 17-15.09.24	2 000 000.00	1 385 114.17	0.05
EUR INTRUM JUSTITIA AB-REG-S 3.12500% 17-15.07.24	1 650 000.00	895 233.20	0.03
EUR IPD 3 BV-REG-S 8.00000% 23-15.06.28	3 194 000.00	3 642 859.48	0.12
EUR IQVIA INC-REG-S 2.25000% 21-15.03.29	2 150 000.00	2 119 344.14	0.07
EUR ITALMATCH CHEMICALS SPA-REG-S 10.00000% 23-06.02.28	100 000.00	114 599.38	0.00
EUR ITELYUM REGENERATION SPA-REG-S 4.62500% 21-01.10.26	1 675 000.00	1 748 614.99	0.06
EUR KANE BIDCO LTD-REG-S 5.00000% 22-15.02.27	625 000.00	652 523.95	0.02
EUR KAPLA HOLDING SAS-REG-S 3.37500% 19-15.12.26	1 350 000.00	1 405 782.71	0.05
EUR KIRK BEAUTY SUN GMBH-REG-S (PIK) 8.25000% 21-01.10.26	933 185.00	1 003 393.59	0.03
EUR KLEOPATRA FINCO SARL-REG-S 4.25000% 21-01.03.26	3 120 000.00	2 973 935.26	0.10
EUR KONGSBERG ACTUATION SYSTEMS BV-REG-S 5.00000% 18-15.07.25	2 355 000.00	1 813 566.67	0.06
EUR LA FINANCIERE ATALIAN SA-REG-S 4.00000% 17-15.05.24	370 000.00	314 681.41	0.01
EUR LHMC FINCO 2 SARL-REG-S (PIK) 7.25000% 19-02.10.25	1 402 255.00	1 520 457.74	0.05
EUR LKQ ITALIA BONDCO SPA-REG-S 3.87500% 16-01.04.24	2 009 000.00	2 179 002.84	0.07
EUR LOARRE INVESTMENTS SARL-REG-S 6.50000% 22-15.05.29	1 300 000.00	1 403 121.67	0.05
EUR LORCA TELECOM BONDCO SAU-REG-S 4.00000% 20-18.09.27	15 035 000.00	15 865 660.06	0.54
EUR LOTTOMATICA SPA-REG-S 9.75000% 22-30.09.27	700 000.00	818 353.60	0.03
EUR LOTTOMATICA SPA/ROMA-REG-S 7.12500% 23-01.06.28	2 000 000.00	2 294 507.60	0.08
EUR LOXAM SAS-REG-S 6.37500% 23-31.05.29	4 170 000.00	4 652 416.35	0.16
EUR LSF XI MAGPIE BIDCO SARL-REG-S 7.25000% 22-30.06.27	2 000 000.00	2 030 853.01	0.07
EUR MANGROVE LUXCO III-REG-S (PIK) 7.77500% 19-09.10.25	1 671 547.00	1 836 405.76	0.06

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR MATTERHORN TELECOM SA-REG-S 3.12500% 19-15.09.26	2 000 000.00	2 103 245.05	0.07
EUR MOBILUX FINANCE SAS-REG-S 4.25000% 21-15.07.28	1 000 000.00	961 331.25	0.03
EUR MONICHEM HOLDCO 3 SA-REG-S 8.75000% 23-01.05.28	650 000.00	732 257.43	0.02
EUR MOTION FINCO SARL-REG-S 7.37500% 23-15.06.30	2 850 000.00	3 195 992.99	0.11
EUR NEXI SPA-REG-S 2.12500% 21-30.04.29	1 000 000.00	958 832.88	0.03
EUR NOBIAN FINANCE BV-REG-S 3.62500% 21-15.07.26	775 000.00	804 465.89	0.03
EUR NOMAD FOODS BONDCO PLC-REG-S 2.50000% 21-24.06.28	1 000 000.00	1 000 436.25	0.03
EUR O1 EUROPEAN GROUP BV-REG-S 2.87500% 19-15.02.25	3 075 000.00	3 284 036.27	0.11
EUR PAPREC HOLDING SA-REG-S 6.50000% 23-17.11.27	1 177 000.00	1 352 030.94	0.05
EUR PARTS EUROPE SA-REG-S 6.50000% 20-16.07.25	900 000.00	976 539.84	0.03
EUR PAYSAFE FINANCE PLC-REG-S 3.00000% 21-15.06.29	1 392 000.00	1 339 685.16	0.05
EUR PEU FIN PLC-REG-S 7.25000% 23-01.07.28	1 020 000.00	1 142 765.41	0.04
EUR PFLEIDERER GMBH-REG-S 4.75000% 21-15.04.26	950 000.00	838 005.48	0.03
EUR PHM GROUP HOLDING OY-144A-REG-S 4.75000% 21-18.06.26	300 000.00	300 293.81	0.01
EUR PICARD GROUPE SAS-REG-S 3.87500% 21-01.07.26	9 842 000.00	10 343 419.14	0.35
EUR PINNACLE BIDCO PLC-REG-S 8.25000% 23-11.10.28	1 959 000.00	2 221 062.17	0.08
EUR PLAYTECH PLC-REG-S 5.87500% 23-28.06.28	766 000.00	827 907.16	0.03
EUR PLT VII FINANCE SARL-REG-S 4.62500% 20-05.01.26	2 700 000.00	2 914 544.52	0.10
EUR PRIMO WATER HOLDINGS INC-REG-S 3.87500% 20-31.10.28	2 625 000.00	2 748 156.83	0.09
EUR PRO-GEST SPA-REG-S 3.25000% 17-15.12.24	3 500 000.00	1 890 269.94	0.06
EUR Q-PARK HOLDING I BV-REG-S 2.00000% 20-01.03.27	2 300 000.00	2 338 743.83	0.08
EUR Q-PARK HOLDING I BV-REG-S 5.12500% 24-01.03.29	1 784 000.00	1 942 482.14	0.07
EUR RCS & RDS SA-REG-S 2.50000% 20-05.02.25	2 300 000.00	2 446 258.90	0.08
EUR RCS & RDS SA-REG-S 3.25000% 20-05.02.28	2 000 000.00	1 965 395.58	0.07
EUR REBECCA BIDCO GMBH-REG-S 5.75000% 20-15.07.25	2 575 000.00	2 790 391.91	0.09
EUR ROSSINI SARL-REG-S 6.75000% 18-30.10.25	2 000 000.00	2 170 927.98	0.07
EUR SCIL IV LLC / SCIL USA HOLDINGS-REG-S 4.37500% 21-01.11.26	975 000.00	1 035 370.05	0.04
EUR SCIL IV LLC / SCIL USA HLDNGS LLC-REG-S 9.50000% 23-15.07.28	970 000.00	1 136 901.84	0.04
EUR SELECTA GROUP BV-REG-S (PAY IN KIND) 10.00000% 20-01.07.26	881 304.00	838 609.24	0.03
EUR SHERWOOD FINANCING PLC-REG-S 4.50000% 21-15.11.26	1 275 000.00	1 312 257.89	0.04
EUR SIGMA HOLDCO BV-REG-S 5.75000% 18-15.05.26	3 045 000.00	3 078 412.40	0.10
EUR SIGMA DEVELOPMENT FINANCE SCS-REG-S 5.50000% 21-23.07.26	1 200 000.00	81 898.90	0.00
EUR SOFIMA HOLDING SPA-REG-S 3.75000% 20-15.01.28	3 325 000.00	3 470 271.66	0.12
EUR SPA HOLDINGS 3 OY-REG-S 3.62500% 21-04.02.28	1 775 000.00	1 783 101.10	0.06
EUR SPCM SA-REG-S 2.62500% 20-01.02.29	3 750 000.00	3 752 654.30	0.13
EUR SPECTRUM BRANDS INC-REG-S 4.00000% 16-01.10.26	2 190 000.00	2 343 204.19	0.08
EUR STANDARD PROFIL AUTOMOTIVE GMBH-REG-S 6.25000% 21-30.04.26	973 000.00	865 618.50	0.03
EUR STENA INTERNATIONAL SA-REG-S 7.25000% 23-15.02.28	1 600 000.00	1 839 794.66	0.06
EUR SUMMER BC HOLDCO B SARL-REG-S 5.75000% 19-31.10.26	5 200 000.00	5 511 930.56	0.19
EUR SUMMER BIDCO BV-REG-S (PIK) 9.00000% 19-15.11.25	475 000.00	655 429.21	0.02
EUR SUMMER BIDCO BV-REG-S (PIK) 9.00000% 20-15.11.25	1 000 000.00	1 351 189.99	0.05
EUR SUPERIOR INDUSTRIES INTERNATIONAL-REG-S 6.00000% 17-15.06.25	1 200 000.00	1 205 701.00	0.04
EUR SYNTHOS SA-REG-S 2.50000% 21-07.06.28	500 000.00	469 520.70	0.02
EUR TEAMSYSTEM SPA-REG-S 3.50000% 21-15.02.28	1 975 000.00	2 011 603.01	0.07
EUR TECHEM VERWALTUNGSGESELLSCHAFT-REG-S 2.00000% 20-15.07.25	5 494 000.00	5 819 066.89	0.20
EUR TEREOS FINANCE GROUPE I SA-REG-S 7.50000% 20-30.10.25	1 000 000.00	1 105 368.00	0.04
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV-REG-S 1.87500% 15-31.03.27	2 500 000.00	2 480 017.37	0.08
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV-REG-S 1.12500% 16-15.10.24	839 000.00	886 337.70	0.03
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV-REG-S 1.62500% 16-15.10.28	3 750 000.00	3 488 247.47	0.12
EUR TIKEHAU CAPITAL SCA-REG-S 6.62500% 23-14.03.30	800 000.00	944 658.61	0.03
EUR TRIVIUM PACKAGING FINANCE BV-REG-S 3.75000% 19-15.08.26	5 755 000.00	6 063 827.69	0.21
EUR UNITED GROUP BV-REG-S 4.62500% 21-15.08.28	1 180 000.00	1 201 048.81	0.04
EUR UNITED GROUP BV-REG-S 4.00000% 20-15.11.27	2 025 000.00	2 063 057.59	0.07
EUR UNITED GROUP BV-REG-S 3.12500% 20-15.02.26	4 394 000.00	4 593 461.07	0.16
EUR UNITED GROUP BV-REG-S 5.25000% 22-01.02.30	825 000.00	830 960.89	0.03
EUR UNITED GROUP BV-REG-S 6.75000% 24-15.02.31	940 000.00	1 014 693.28	0.03
EUR UPC HOLDING BV-REG-S 3.87500% 17-15.06.29	500 000.00	515 414.76	0.02
EUR UPCB FINANCE VII LTD-REG-S 3.62500% 17-15.06.29	2 114 000.00	2 194 361.57	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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR VERISURE HOLDING AB-REG-S 3.87500% 20-15.07.26	8 401 000.00	8 954 481.51	0.30
EUR VERISURE HOLDING AB-REG-S 3.25000% 21-15.02.27	1 100 000.00	1 147 916.42	0.04
EUR VERTICAL MIDCO GMBH-REG-S 4.37500% 20-15.07.27	4 165 000.00	4 402 077.00	0.15
EUR VICTORIA PLC-REG-S 3.62500% 21-24.08.26	250 000.00	229 321.50	0.01
EUR VILLA DUTCH BIDCO BV-REG-S 9.00000% 22-03.11.29	2 925 000.00	3 248 770.08	0.11
EUR VMED O2 UK FINANCING I PLC-REG-S 3.25000% 20-31.01.31	1 240 000.00	1 220 447.15	0.04
EUR VZ SECURED FINANCING BV-REG-S 3.50000% 22-15.01.32	1 000 000.00	980 575.26	0.03
EUR VZ VENDOR FINANCING II BV-REG-S 2.87500% 20-15.01.29	4 958 000.00	4 685 495.92	0.16
EUR WEPA HYGIENEPRODUKTE GMBH-REG-S 2.87500% 19-15.12.27	1 875 000.00	1 901 582.45	0.06
EUR WEPA HYGIENEPRODUKTE GMBH-REG-S 5.62500% 24-15.01.31	1 200 000.00	1 308 427.23	0.04
EUR WP/AP TELECOM HOLDINGS IV BV-REG-S 3.75000% 21-15.01.29	1 275 000.00	1 301 870.63	0.04
EUR ZIGGO BV-REG-S 2.87500% 19-15.01.30	1 049 000.00	1 033 675.88	0.04
ユーロ合計		350 804 718.55	11.94
GBP			
GBP ALLIED UNIVERSAL HOLDCO/FIN/ATLAS-REG-S 4.87500% 21-01.06.28	1 511 000.00	1 691 733.96	0.06
GBP B&M EUROPEAN VALUE RETAIL SA-REG-S 8.12500% 23-15.11.30	410 000.00	554 094.01	0.02
GBP GTCR W-2 MERGER SUB LLC / GTCR-REG-S 8.50000% 23-15.01.31	670 000.00	915 675.11	0.03
GBP HEATHROW FINANCE PLC-REG-S STEP-UP 17-01.03.2027	1 100 000.00	1 318 842.90	0.04
GBP HEATHROW FINANCE PLC-REG-S STEP-UP 19-01.09.29	1 875 000.00	2 177 537.42	0.07
GBP KANE BIDCO LTD-REG-S 6.50000% 22-15.02.27	1 150 000.00	1 396 662.66	0.05
GBP PINEWOOD FINCO PLC-REG-S 3.25000% 19-30.09.25	925 000.00	1 148 775.42	0.04
GBP PREMIER FOODS FINANCE PLC-REG-S 3.50000% 21-15.10.26	400 000.00	482 937.06	0.02
GBP SHERWOOD FINANCING PLC-REG-S 6.00000% 21-15.11.26	300 000.00	349 393.93	0.01
GBP TVL FINANCE PLC-REG-S 10.25000% 23-28.04.28	550 000.00	735 417.37	0.03
GBP VIRGIN MEDIA SECURED FINANCE PLC-REG-S 5.00000% 17-15.04.27	900 000.00	1 115 604.85	0.04
GBP VIRGIN MEDIA SECURED FINANCE PLC-REG-S 4.12500% 20-15.08.30	1 125 000.00	1 218 982.95	0.04
GBP VIRGIN MEDIA VENDOR FINANCING-REG-S 4.87500% 20-15.07.28	1 525 000.00	1 772 085.27	0.06
GBP VMED O2 UK FINANCING I PLC-REG-S 4.00000% 20-31.01.29	875 000.00	988 958.09	0.03
GBP VMED O2 UK FINANCING I PLC-REG-S 4.50000% 21-15.07.31	1 715 000.00	1 875 765.36	0.06
英ポンド合計		17 742 466.36	0.60
USD			
USD ALCATEL-LUCENT USA INC 6.45000% 99-15.03.29	1 230 000.00	1 180 800.00	0.04
USD ALTICE FINANCING SA-144A 5.75000% 21-15.08.29	2 782 000.00	2 424 447.34	0.08
USD BELO CORP 7.75000% 97-01.06.27	1 594 000.00	1 629 865.00	0.06
USD CANPACK SA AND EASTERN PA-144A 3.12500% 20-01.11.25	800 000.00	759 000.00	0.03
USD CLOUD SOFTWARE GROUP INC-144A 9.00000% 23-30.09.29	4 038 000.00	3 821 791.71	0.13
USD EDISON INTERNATIONAL 5.37500% 21-PRP	865 000.00	832 246.08	0.03
USD IHO VERWALTUNGS GMBH-144A (PIK) 6.00000% 19-15.05.27	2 175 000.00	2 153 467.50	0.07
USD INEOS QUATTRO FINANCE 2 PLC-144A 3.37500% 21-15.01.26	2 041 000.00	1 915 153.26	0.07
USD INEOS QUATTRO FINANCE 2 PLC-144A 9.62500% 23-15.03.29	850 000.00	892 602.00	0.03
USD NEW ALBERTSONS LP 7.45000% 99-01.08.29	633 000.00	666 232.50	0.02
USD NUSTAR LOGISTICS LP 6.00000% 19-01.06.26	2 092 000.00	2 087 188.40	0.07
USD TELECOM ITALIA CAPITAL 6.00000% 05-30.09.34	1 405 000.00	1 317 004.29	0.04
USD VZ SECURED FINANCING BV-144A 5.00000% 22-15.01.32	5 019 000.00	4 387 563.62	0.15
米ドル合計		24 067 361.70	0.82
債券、固定利付債合計		392 817 764.07	13.37
債券、ゼロ・クーポン			
USD			
USD NYRSTAR HOLDINGS PLC-REG-S 0.00000% 19-31.07.26	763 000.00	330 734.17	0.01
米ドル合計		330 734.17	0.01
債券、ゼロ・クーポン合計		330 734.17	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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / 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				
EUR				
EUR	ABN AMRO BANK NV-REG-S-SUB 4.750%/VAR 17-PRP	2 200 000.00	2 198 570.00	0.08
EUR	ALLWYN EMNT FG UK PLC 3M EURIBOR+412.5BP 22-15.02.28	300 000.00	328 319.06	0.01
EUR	APCOA PARKING HOLDINGS GM-REG-S 3M EURIBOR+500BP 21-15.01.27	2 300 000.00	2 508 368.50	0.09
EUR	APOLLO SWEDISH BIDCO AB-REG-S 3M EURIBOR+500BP 23-05.07.29	1 150 000.00	1 276 169.94	0.04
EUR	BACH BIDCO SPA-REG-S 3M EURIBOR+425BP 21-15.10.28	1 275 000.00	1 381 783.33	0.05
EUR	BORMIOLI PHARMA SPA-REG-S 3M EURIBOR+550BP 23-15.05.28	2 000 000.00	2 172 500.00	0.07
EUR	BURGER KING FRANCE SAS-REG-S 3M EURIBOR+475BP 21-01.11.26	1 500 000.00	1 639 593.13	0.06
EUR	CHEPLAPARM ARZTEL GMBH-REG-S 3M EURIBOR+475BP 23-15.05.30	410 000.00	451 152.21	0.02
EUR	CIRSA FINANCE INTERNA-REG-S 3M EURIBOR+450BP 23-31.07.28	560 000.00	615 903.75	0.02
EUR	CREDIT AGRICOLE SA-REG-S-SUB COCO 6.500%/VAR 24-PRP	800 000.00	874 431.26	0.03
EUR	CULLINAN HOLDCO SCSP-REG-S 3M EURIBOR+475BP 21-15.10.26	600 000.00	581 849.82	0.02
EUR	ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S-SUB 4.000%/VAR 18-PRP	4 400 000.00	4 731 705.00	0.16
EUR	GAS NATURAL FENOSA FINANCE-REG-S-SUB 3.375%/VAR 15-PRP	500 000.00	539 822.80	0.02
EUR	GUALA CLOSURES SPA-REG-S 3M EURIBOR+400BP 23-29.06.29	650 000.00	713 687.98	0.02
EUR	INTESA SANPAOLO SPA-REG-S-SUB COCO 7.750%/VAR 17-PRP	1 500 000.00	1 678 256.25	0.06
EUR	IPD 3 BV-REG-S 3M EURIBOR+475BP 23-15.06.28	1 137 000.00	1 252 048.41	0.04
EUR	ITALMATCH CHEMICALS SPA-REG-S 3M EURIBOR+550BP 23-06.02.28	2 000 000.00	2 167 068.75	0.07
EUR	LA POSTE SA-REG-S-SUB 3.125%/VAR 18-PRP	1 000 000.00	1 045 515.62	0.04
EUR	LOTTOMATICA SPA/ROMA-REG-S 3M EURIBOR+400BP 23-15.12.30	600 000.00	660 385.68	0.02
EUR	NATURGY FINANCE BV-REG-S-SUB 2.374%/VAR 21-PRP	700 000.00	704 844.80	0.02
EUR	PAGANINI BIDCO SPA-REG-S 3M EURIBOR+425BP 21-30.10.28	2 450 000.00	2 665 171.41	0.09
EUR	PFLIDERER GMBH-REG-S EURO03M+475BP 21-15.04.26	700 000.00	630 350.88	0.02
EUR	PRESTIGEIBIDCO GMBH-REG-S 3M EURIBOR+600BP 22-15.07.27	375 000.00	415 490.62	0.01
EUR	Q-PARK HOLDING I BV-REG-S 3M EURIBOR+200BP 20-01.03.26	525 000.00	569 884.34	0.02
EUR	RABOBANK NEDERLAND NV-REG-S-SUB 3.250%/VAR 19-PRP	5 000 000.00	4 924 253.68	0.17
EUR	RENO DE MEDICI SPA-REG-S 3M EURIBOR+525BP 21-14.12.26	500 000.00	545 080.25	0.02
EUR	SCIL IV / SCIL USA REG-S 3M EURIBOR+437.5BP 21-01.11.26	425 000.00	461 610.08	0.02
EUR	SOFIMA HOLDING SPA-REG-S 3M EURIBOR+400BP 20-15.01.28	490 000.00	533 380.25	0.02
EUR	TEAMSYS SPA-REG-S 3M EURIBOR+371BP 21-15.02.28	1 200 000.00	1 300 241.25	0.04
EUR	TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 3.875%/VAR 18-PRP	3 600 000.00	3 819 228.93	0.13
EUR	TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 4.375%/VAR 19-PRP	9 600 000.00	10 366 474.80	0.35
EUR	TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 2.875%/VAR 19-PRP	1 300 000.00	1 323 147.00	0.04
EUR	TENDAM BRANDS SAU-REG-S 3M EURIBOR+750BP 22-31.03.28	1 500 000.00	606 399.06	0.02
EUR	TRIVIUM PACKAGING FIN BV-REG-S 3M EURIBOR+375BP 19-15.08.26	170 000.00	184 813.55	0.01
EUR	TVL FINANCE PLC-REG-S 3M EURIBOR+550BP 23-28.04.28	2 000 000.00	2 199 656.25	0.07
EUR	UNITED GROUP BV-REG-S 3M EURIBOR+487.5BP 22-01.02.29	200 000.00	217 250.00	0.01
EUR	VERTICAL MIDCO GMBH-REG-S 3M EURIBOR+475BP 20-15.07.27	875 000.00	962 634.75	0.03
EUR	VODAFONE GROUP PLC-REG-S-SUB 4.200%/VAR 18-03.10.78	2 000 000.00	2 120 903.12	0.07
EUR	WEPA HYGIENEPDUKTE-REG-S 3M EURIBOR+287.5BP 19-15.12.26	425 000.00	459 925.04	0.02
ユーロ合計			61 827 871.55	2.10
GBP				
GBP	BARCLAYS PLC-REG-S-SUB COCO 5.875%/VAR 17-PRP	1 300 000.00	1 612 111.30	0.05
GBP	BARCLAYS PLC-SUB COCO 7.125%/VAR 19-PRP	800 000.00	990 744.10	0.03
GBP	LLOYDS BANKING GROUP PLC-REG-S-SUB COCO 5.125%/VAR 20-PRP	2 050 000.00	2 515 485.01	0.09
GBP	NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-REG-S-SUB COCO 5.750%/VAR 20-PRP	1 050 000.00	1 234 220.22	0.04
GBP	VODAFONE GROUP PLC-REG-S-SUB 4.875%/VAR 18-03.10.78	200 000.00	248 121.55	0.01
英ポンド合計			6 600 682.18	0.22
USD				
USD	ALLIANZ SE-REG-S-SUB 3.200%/VAR 21-PRP	200 000.00	159 555.46	0.01
USD	ALLY FINANCIAL INC-SUB 4.700%/VAR 21-PRP	1 503 000.00	1 218 124.63	0.04
USD	CEMEX SAB DE CV-REG-S-SUB 9.125%/VAR 23-PRP	581 000.00	614 668.95	0.02
USD	DANSKE BANK AS-REG-S-SUB COCO 7.000%/VAR 18-PRP	575 000.00	570 026.25	0.02
USD	ING GROEP NV-SUB 5.750%/VAR 19-PRP	500 000.00	470 162.33	0.02

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN-REG-S-SUB 5.125%/VAR 19-PRP	1 600 000.00	1 552 000.00	0.05
USD VODAFONE GROUP PLC-REG-S-SUB 6.250%/VAR 18-03.10.78	1 455 000.00	1 449 267.30	0.05
米ドル合計		6 033 804.92	0.21
債券、変動利付債合計		74 462 358.65	2.53
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	1 101 124.91	0.04
スイスフラン合計		1 101 124.91	0.04
転換社債型新株予約権付社債、固定利付債合計		1 101 124.91	0.04
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		1 440 716 795.26	49.06

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 1011778 BC ULC/NEW RED FINANCE INC-144A 3.87500% 19-15.01.28	760 000.00	715 225.44	0.01
USD 1011778 BC ULC/NEW RED FINANCE INC-144A 5.75000% 20-15.04.25	1 265 000.00	1 262 434.33	0.04
USD 1011778 BC ULC/NEW RED FINANCE INC-144A 4.00000% 20-15.10.30	861 000.00	769 552.92	0.03
USD ACADIA HEALTHCARE CO INC-144A 5.00000% 20-15.04.29	1 170 000.00	1 115 887.50	0.04
USD ACCO BRANDS CORP-144A 4.25000% 21-15.03.29	2 148 000.00	1 947 556.91	0.07
USD ACI WORLDWIDE INC-144A 5.75000% 18-15.08.26	4 260 000.00	4 210 958.02	0.14
USD ACRISURE LLC / FINANCE INC-144A 4.25000% 21-15.02.29	1 215 000.00	1 089 481.26	0.04
USD ACURIS FINANCE US INC / ACURIS-144A 5.00000% 21-01.05.28	1 134 000.00	991 218.06	0.03
USD ADAPTHEALTH LLC-144A 6.12500% 20-01.08.28	2 220 000.00	1 943 565.60	0.07
USD ADAPTHEALTH LLC-144A 5.12500% 21-01.03.30	2 150 000.00	1 681 192.50	0.06
USD ADT CORP-144A 4.87500% 16-15.07.32	1 912 000.00	1 751 870.00	0.06
USD ADT SECURITY CORP/THE-144A 4.12500% 21-01.08.29	498 000.00	459 556.89	0.02
USD ADTALEM GLOBAL EDUCATION INC-144A 5.50000% 21-01.03.28	2 094 000.00	1 976 359.08	0.07
USD ADVANCED DRAINAGE SYSTEMS INC-144A 6.37500% 22-15.06.30	1 271 000.00	1 281 523.88	0.04
USD ADVANTAGE SALES & MARKETING INC-144A 6.50000% 20-15.11.28	4 015 000.00	3 775 790.96	0.13
USD AETHON UNITED/AETHON UNITED FIN C-144A-8.25000% 21-15.02.26	3 220 000.00	3 192 050.40	0.11
USD AG ISSUER LLC-144A 6.25000% 20-01.03.28	1 082 000.00	1 066 672.50	0.04
USD AHEAD DB HOLDINGS LLC-144A 6.62500% 21-01.05.28	5 278 000.00	4 638 042.50	0.16
USD AIR CANADA-144A 3.87500% 21-15.08.26	3 255 000.00	3 095 761.13	0.11
USD ALBERTSONS COS INC / SAFEWAY INC-144A 5.87500% 19-15.02.28	2 218 000.00	2 215 285.65	0.08
USD ALBERTSONS COS LLC / SAFEWAY INC-144A 3.50000% 20-15.03.29	600 000.00	542 102.64	0.02
USD ALLEN MEDIA CO-ISS INC-144A 10.50000% 20-15.02.28	2 249 000.00	1 137 589.18	0.04
USD ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP-144A 7.00000% 20-15.01.26	1 212 000.00	1 222 417.14	0.04
USD ALLIANT HLDG INTER LLC/CO ISSUER-144A 6.75000% 19-15.10.27	2 382 000.00	2 325 594.24	0.08
USD ALLIANT HOLDINGS INTERMEDIATE LLC-144A 6.75000% 23-15.04.28	795 000.00	802 338.64	0.03
USD ALLIED UNIVERSAL HOLDCO/FIN CORP-144A 6.62500% 19-15.07.26	4 071 000.00	4 011 416.61	0.14
USD ALLIED UNIVERSAL HOLDCO LLC-144A 9.75000% 19-15.07.27	3 420 000.00	3 344 044.36	0.11
USD ALLIED UNIVERSAL HOLDCO/FIN CORP-144A 6.00000% 21-01.06.29	1 952 000.00	1 620 726.08	0.06
USD ALLISON TRANSMISSION INC-144A 3.75000% 20-30.01.31	8 406 000.00	7 351 955.69	0.25
USD ALTERYX INC-144A 8.75000% 23-15.03.28	2 424 000.00	2 595 667.68	0.09
USD ALTICE FRANCE HOLDING SA 10.50000% 20-15.05.27	2 705 000.00	1 554 400.65	0.05
USD ALTICE FRANCE SA/FRANCE-144A 5.12500% 20-15.01.29	200 000.00	148 014.68	0.00
USD AMERICAN AIRLINES INC-144A 5.75000% 21-20.04.29	1 072 000.00	1 052 736.17	0.04
USD AMERICAN AIRLINES INC-144A 8.50000% 23-15.05.29	410 000.00	434 605.33	0.01
USD AMERICAN BUILDERS & CONTRAC SUPPLY-144A 3.87500% 21-15.11.29	840 000.00	748 478.64	0.03
USD AMERITEX HOLDCO INTERMEDIATE LLC-144A 10.25000% 23-15.10.28	2 033 000.00	2 087 708.03	0.07
USD AMKOR TECHNOLOGY INC-144A 6.62500% 19-15.09.27	881 000.00	887 686.79	0.03
USD AMSTED INDUSTRIES INC-144A 5.62500% 19-01.07.27	1 043 000.00	1 028 773.48	0.04
USD AMSTED INDUSTRIES INC-144A 4.62500% 19-15.05.30	553 000.00	499 069.72	0.02

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD ANGI GROUP LLC-144A 3.87500% 20-15.08.28	2 624 000.00	2 256 412.25	0.08
USD ANTERO MIDSTREAM PARTNERS/FIN CORP-144A 5.75000% 19-01.03.27	1 185 000.00	1 176 192.77	0.04
USD ANTERO MIDSTREAM PARTNERS/FIN CORP-144A 5.75000% 19-15.01.28	1 315 000.00	1 290 849.10	0.04
USD ANTERO MIDSTREAM PARTNERS LP-144A 5.37500% 21-15.06.29	2 100 000.00	2 016 193.62	0.07
USD ANTERO RESOURCES CORP-144A 5.37500% 21-01.03.30	1 030 000.00	982 165.05	0.03
USD ANTERO RESOURCES FIN CORP-144A 7.62500% 21-01.02.29	1 238 000.00	1 274 710.41	0.04
USD API GROUP DE INC-144A 4.75000% 21-15.10.29	794 000.00	743 438.08	0.03
USD API GROUP DE INC-144A 4.12500% 21-15.07.29	1 455 000.00	1 331 412.30	0.05
USD APOLLO COMMERCIAL REAL ESTATE FINA-144A 4.62500% 21-15.06.29	5 140 000.00	4 305 125.73	0.15
USD APX GROUP INC-144A 5.75000% 21-15.07.29	1 377 000.00	1 307 728.91	0.04
USD ARAMARK SERVICES INC-144A 5.00000% 17-01.04.25	2 672 000.00	2 653 679.03	0.09
USD ARCHROCK PARTNERS LP/FIN CORP-144A 6.25000% 19-01.04.28	5 707 000.00	5 643 195.74	0.19
USD ARDAGH METAL PACKAGING FINANCE PLC-144A 3.25000% 21-01.09.28	1 873 000.00	1 636 940.38	0.06
USD ARDAGH METAL PACKAGING FINANCE PLC-144A 4.00000% 21-01.09.29	5 525 000.00	4 477 855.04	0.15
USD ARDAGH PACKAGING FINANCE PLC-144A 5.25000% 20-30.04.25	763 000.00	745 866.25	0.03
USD ARDAGH PACKAGING FINANCE PLC-144A 5.25000% 20-15.08.27	280 000.00	209 294.91	0.01
USD ARETEC ESCROW ISSUER INC-144A 7.50000% 21-01.04.29	1 060 000.00	986 671.00	0.03
USD ARKO CORP-144A 5.12500% 21-15.11.29	3 647 000.00	3 214 137.57	0.11
USD ARMOR HOLDCO INC-144A 8.50000% 21-15.11.29	1 746 000.00	1 632 388.90	0.06
USD ASBURY AUTOMOTIVE GROUP INC-144A 4.62500% 21-15.11.29	2 369 000.00	2 182 527.24	0.07
USD ASBURY AUTOMOTIVE GROUP INC-144A 5.00000% 21-15.02.32	2 980 000.00	2 693 335.03	0.09
USD ASCENT RESOURCES UTICA HOLDINGS-144A 7.00000% 18-01.11.26	3 148 000.00	3 146 157.16	0.11
USD ASGN INC-144A 4.62500% 19-15.05.28	700 000.00	662 039.00	0.02
USD ASHLAND INC-144A 3.37500% 21-01.09.31	1 880 000.00	1 586 525.04	0.05
USD ATHENAHEALTH GROUP INC-144A 6.50000% 22-15.02.30	5 266 000.00	4 703 923.49	0.16
USD ATLANTICA SUSTAINABLE INFRASTRUCTU-144A 4.12500% 21-15.06.28	1 830 000.00	1 694 145.19	0.06
USD ATLAS LUXCO 4 SARL-144A 4.62500% 21-01.06.28	1 150 000.00	1 036 223.49	0.04
USD ATS AUTOMATION TOOLING SYSTEMS INC-144A 4.12500% 20-15.12.28	4 012 000.00	3 642 313.17	0.12
USD AVIENT CORP-144A 7.12500% 22-01.08.30	3 119 000.00	3 199 245.63	0.11
USD AVOLON HOLDINGS FUNDING LTD-144A 6.37500% 23-04.05.28	1 308 000.00	1 337 583.53	0.05
USD AXALTA COAT SYS LLC/AXALTA COAT-144A 4.75000% 20-15.06.27	2 646 000.00	2 547 065.79	0.09
USD AXALTA COATING SYSTEMS DUTCH-144A 7.25000% 23-15.02.31	210 000.00	218 736.00	0.01
USD BAUSCH HEALTH COS INC-144A 4.87500% 21-01.06.28	479 000.00	270 838.76	0.01
USD BAUSCH HEALTH COS INC-144A 6.12500% 22-01.02.27	853 000.00	539 744.28	0.02
USD BAUSCH HEALTH COS INC-144A 11.00000% 22-30.09.28	2 923 000.00	1 988 516.90	0.07
USD BAUSCH HEALTH COS INC-144A 14.00000% 22-15.10.30	291 000.00	162 678.90	0.01
USD BCPE EMPIRE HOLDINGS INC-144A 7.62500% 21-01.05.27	717 000.00	678 002.37	0.02
USD BEACON ROOFING SUPPLY INC-144A 4.12500% 21-15.05.29	816 000.00	738 526.76	0.03
USD BEACON ROOFING SUPPLY INC-144A 6.50000% 23-01.08.30	1 649 000.00	1 673 156.20	0.06
USD BEAZER HOMES USA INC 7.25000% 20-15.10.29	2 340 000.00	2 350 506.60	0.08
USD BLOCK COMMUNICATIONS INC-144A 4.87500% 20-01.03.28	1 953 000.00	1 754 750.97	0.06
USD BLOCK INC 2.75000% 21-01.06.26	766 000.00	716 978.16	0.02
USD BLOOMIN' BRANDS INC-144A 5.12500% 21-15.04.29	1 234 000.00	1 147 620.00	0.04
USD BLUE RACER MIDSTREAM / FINANC CORP-144A 6.62500% 18-15.07.26	2 607 000.00	2 593 848.12	0.09
USD BLUE RACER MIDSTREAM LLC-144A 7.62500% 20-15.12.25	1 247 000.00	1 259 064.73	0.04
USD BLUELINX HOLDINGS INC-144A 6.00000% 21-15.11.29	1 500 000.00	1 418 745.75	0.05
USD BONANZA CREEK ENERGY INC-144A 5.00000% 21-15.10.26	1 687 000.00	1 643 046.22	0.06
USD BOXER PARENT CO INC-144A 7.12500% 20-02.10.25	3 508 000.00	3 514 217.23	0.12
USD BOYNE USA INC-144A 4.75000% 21-15.05.29	335 000.00	306 857.94	0.01
USD BRAND INDUSTRIAL SERVICES INC-144A 10.37500% 23-01.08.30	522 000.00	551 362.50	0.02
USD BREAD FINANCIAL HOLDINGS INC-144A 9.75000% 23-15.03.29	3 160 000.00	3 156 176.40	0.11
USD BRINKER INTERNATIONAL INC-144A 5.00000% 16-01.10.24	1 095 000.00	1 086 021.00	0.04
USD BROADCOM INC-144A 3.13700% 21-15.11.35	720 000.00	591 853.34	0.02
USD BROADSTREET PARTNERS INC-144A 5.87500% 21-15.04.29	2 611 000.00	2 475 843.86	0.08
USD BUILDERS FIRSTSOURCE INC-144A 5.00000% 20-01.03.30	790 000.00	758 331.95	0.03
USD BUILDERS FIRSTSOURCE INC-144A 4.25000% 21-01.02.32	3 036 000.00	2 714 925.76	0.09
USD BURFORD CAPITAL GLOBAL FINANCE LLC-144A 6.25000% 21-15.04.28	1 299 000.00	1 253 788.50	0.04
USD BURFORD CAPITAL GLOBAL FINANCE-144A 6.87500% 22-15.04.30	2 199 000.00	2 130 525.01	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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD BURFORD CAPITAL GLOBAL FINANCE LLC-144A 9.25000% 23-01.07.31	500 000.00	521 250.00	0.02
USD BWX TECHNOLOGIES INC-144A 4.12500% 21-15.04.29	676 000.00	626 192.32	0.02
USD C&S GROUP ENTERPRISES LLC-144A 5.00000% 20-15.12.28	4 044 000.00	3 284 132.40	0.11
USD C&W SENIOR FIN DESIGNATD ACTIVI CO-144A 6.87500% 17-15.09.27	619 000.00	584 503.13	0.02
USD CABLE ONE INC-144A 4.00000% 20-15.11.30	2 105 000.00	1 694 525.00	0.06
USD CAESARS ENTERTAINMENT INC-144A 4.62500% 21-15.10.29	2 147 000.00	1 962 610.90	0.07
USD CAESARS ENTERTAINMENT INC-144A 6.25000% 20-01.07.25	4 718 000.00	4 734 111.96	0.16
USD CAESARS ENTERTAINMENT INC-144A 8.12500% 20-01.07.27	720 000.00	738 897.12	0.03
USD CALLON PETROLEUM CO-144A 7.50000% 22-15.06.30	495 000.00	521 455.77	0.02
USD CALPINE CORP-144A 5.12500% 19-15.03.28	2 347 000.00	2 239 545.30	0.08
USD CALPINE CORP-144A 5.00000% 20-01.02.31	1 000 000.00	907 215.30	0.03
USD CALUMET SPECIALTY PRODUCTS PARTNER-144A 8.12500% 22-15.01.27	870 000.00	856 343.22	0.03
USD CALUMET SPECIALTY PROD PART LP/FIN-144A 9.75000% 23-15.07.28	1 286 000.00	1 289 215.00	0.04
USD CAMELOT FINANCE SA-144A 4.50000% 19-01.11.26	3 890 000.00	3 750 633.74	0.13
USD CAMELOT RETURN MERGER SUB INC-144A 8.75000% 22-01.08.28	1 536 000.00	1 574 655.30	0.05
USD CAPSTONE BORROWER INC-144A 8.00000% 23-15.06.30	3 098 000.00	3 214 833.33	0.11
USD CARGO AIRCRAFT MANAGEMENT INC-144A 4.75000% 20-01.02.28	2 339 000.00	2 134 337.50	0.07
USD CARNIVAL CORP-144A 6.00000% 21-01.05.29	10 622 000.00	10 271 474.00	0.35
USD CARNIVAL CORP-144A 9.87500% 20-01.08.27	205 000.00	214 993.75	0.01
USD CARNIVAL HOLDINGS BERMUDA-144A 10.37500% 22-01.05.28	1 474 000.00	1 612 497.27	0.05
USD CASTLE US HOLDING CORP-144A 9.50000% 20-15.02.28	600 000.00	295 500.00	0.01
USD CASTLELAKE AVIATION FINANCE DAC-144A 5.00000% 21-15.04.27	1 355 000.00	1 286 225.13	0.04
USD CATALENT PHARMA SOLUTIONS INC-144A 5.00000% 19-15.07.27	2 649 000.00	2 548 637.39	0.09
USD CCO HOLD LLC / CCO HOLD CAP CORP-144A 6.37500% 22-01.09.29	3 432 000.00	3 341 608.05	0.11
USD CCO HOLDINGS LLC 4.50000% 21-01.05.32	5 409 000.00	4 512 511.41	0.15
USD CCO HOLDINGS LLC-144A 4.25000% 20-01.02.31	2 650 000.00	2 240 697.46	0.08
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.50000% 16-01.05.26	1 652 000.00	1 636 830.18	0.06
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.00000% 17-01.02.28	2 441 000.00	2 294 136.28	0.08
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.37500% 19-01.06.29	2 015 000.00	1 873 515.39	0.06
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 4.75000% 19-01.03.30	4 159 000.00	3 695 717.83	0.13
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 4.50000% 20-15.08.30	3 925 000.00	3 413 416.16	0.12
USD CCO HOLDINGS LLC/CAP-144A 4.75000% 22-01.02.32	3 032 000.00	2 600 728.32	0.09
USD CCO HOLDINGS LLC/CCO HOLDINGS CAP-144A 4.50000% 21-01.06.33	4 193 000.00	3 439 082.92	0.12
USD CD&R SMOKEY BUYER INC-144A 6.75000% 20-15.07.25	2 522 000.00	2 471 736.54	0.08
USD CDI-144A *ESCROW* 5.75000% 22-01.04.30	3 324 000.00	3 215 736.19	0.11
USD CEC ENTERTAINMENT INC-144A 6.75000% 21-01.05.26	4 262 000.00	4 233 950.50	0.14
USD CENTRAL GARDEN & PET CO-144A 4.12500% 21-30.04.31	2 320 000.00	2 049 786.12	0.07
USD CENTURY COMMUNITIES INC-144A 3.87500% 21-15.08.29	3 900 000.00	3 509 033.97	0.12
USD CENTURYLINK INC-144A 5.12500% 19-15.12.26	2 746 000.00	1 692 909.00	0.06
USD CHART INDUSTRIES INC-144A 7.50000% 22-01.01.30	5 455 000.00	5 599 659.84	0.19
USD CHEMOURS CO/THE-144A 5.75000% 20-15.11.28	554 000.00	522 530.10	0.02
USD CHENIERE ENERGY PARTNERS LP 4.00000% 21-01.03.31	770 000.00	698 579.19	0.02
USD CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC-144A 5.62500% 20-15.03.27	6 673 000.00	6 164 409.30	0.21
USD CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC-144A 6.87500% 21-15.04.29	1 396 000.00	949 280.00	0.03
USD CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC-144A 6.12500% 21-01.04.30	140 000.00	91 122.21	0.00
USD CHURCHILL DOWNS INC-144A 4.75000% 17-15.01.28	2 200 000.00	2 095 359.86	0.07
USD CHURCHILL DOWNS INC-144A 5.50000% 19-01.04.27	1 604 000.00	1 584 595.13	0.05
USD CHURCHILL DOWNS INC-144A 6.75000% 23-01.05.31	760 000.00	768 645.00	0.03
USD CINEMARK USA INC-144A 8.75000% 20-01.05.25	331 000.00	333 919.42	0.01
USD CIVITAS RESOURCES INC-144A 8.75000% 23-01.07.31	1 345 000.00	1 429 874.88	0.05
USD CLARIOS GLOBAL LP-144A 6.75000% 23-15.05.28	4 023 000.00	4 076 385.21	0.14
USD CLARIVATE SCIENCE HOLDINGS CORP-144A 4.87500% 21-01.07.2029	3 632 000.00	3 390 621.68	0.12
USD CLEAR CHANNEL WORLDWIDE HODGS INC-144A 7.75000% 21-15.04.28	2 530 000.00	2 193 376.83	0.07
USD CLEAR CHANNEL WORLDWIDE HODGS INC-144A 7.50000% 21-01.06.29	1 760 000.00	1 454 182.40	0.05
USD CLEARWAY ENERGY OPERATING LLC-144A 3.75000% 21-15.01.32	1 150 000.00	976 750.20	0.03
USD CLEVELAND-CLIFFS INC-144A 4.62500% 21-01.03.29	1 180 000.00	1 106 250.00	0.04
USD CLEVELAND-CLIFFS INC-144A 6.75000% 23-15.04.30	735 000.00	741 441.26	0.03
USD CLOUD SOFTWARE GROUP INC-144A 6.50000% 22-31.03.29	2 661 000.00	2 484 664.47	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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)	
USD	CLYDESDALE ACQUISITION HOLDINGS-144A 6.62500% 22-15.04.29	1 740 000.00	1 731 359.34	0.06
USD	CLYDESDALE ACQUISITION HOLDINGS-144A 8.75000% 22-15.04.30	4 537 000.00	4 309 927.22	0.15
USD	CNT PRNT / CDK GB II LLC / CDK FNC-144A 8.00000% 23-15.06.29	2 026 000.00	2 079 324.32	0.07
USD	CNTL PNT INC /CNTL MRG SBRDNAT INC 144A-7.25000% 22-15.06.29	3 122 000.00	3 180 940.24	0.11
USD	CNX MIDSTREAM PARTNERS LP-144A 4.75000% 21-15.04.30	275 000.00	239 636.29	0.01
USD	CNX RESOURCES CORP-144A 6.00000% 20-15.01.29	4 146 000.00	4 006 054.84	0.14
USD	CNX RESOURCES CORP-144A 6.37500% 26-15.01.31	1 325 000.00	1 345 614.35	0.05
USD	COBRA ACQUISITIONCO LLC-144A 6.37500% 21-01.11.29	2 896 000.00	2 353 000.00	0.08
USD	COGENT COMMUNI GRP INC-144A 7.00000% 22-15.06.27	3 926 000.00	3 938 513.77	0.13
USD	COMMSCOPE INC-144A 4.75000% 21-01.09.29	4 142 000.00	2 738 359.04	0.09
USD	COMMSCOPE INC-144A 6.00000% 19-01.03.26	3 248 000.00	2 813 352.64	0.10
USD	COMMSCOPE INC-144A 8.25000% 19-01.03.27	2 692 000.00	1 221 468.08	0.04
USD	COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC-144A 6.50000% 21-15.02.29	5 720 000.00	4 034 846.82	0.14
USD	COMPASS GROUP DIVERSIFIED HOLDINGS-144A 5.25000% 21-15.04.29	1 510 000.00	1 437 867.00	0.05
USD	COMSTOCK RESOURCES INC-144A 6.75000% 21-01.03.29	445 000.00	408 620.80	0.01
USD	COMSTOCK RESOURCES INC-144A 5.87500% 21-15.01.30	1 935 000.00	1 676 782.77	0.06
USD	CONNECT FINCO SARL / US FINCO LLC-144A 6.75000% 19-01.10.26	1 926 000.00	1 882 342.61	0.06
USD	CONSOLIDATED COMMUNICATIONS INC-144A 6.50000% 20-01.10.28	1 590 000.00	1 367 400.00	0.05
USD	COTY INC-144A 5.00000% 21-15.04.26	1 019 000.00	1 001 147.12	0.03
USD	COTY INC/HFC PRESTIGE PRODUCTS-144A 6.62500% 23-15.07.30	525 000.00	534 749.25	0.02
USD	CP ATLAS BUYER INC-144A 7.00000% 20-01.12.28	2 689 000.00	2 396 732.59	0.08
USD	CREDIT ACCEPTANCE CORP-144A 9.25000% 23-15.12.28	1 565 000.00	1 643 260.86	0.06
USD	CRESCENT ENERGY FINANCE LLC-144A 9.25000% 23-15.02.28	1 360 000.00	1 411 874.45	0.05
USD	CROCS INC-144A 4.12500% 21-15.08.31	2 380 000.00	2 028 635.87	0.07
USD	CROWN AMERICAS LLC 5.25000% 23-01.04.30	3 674 000.00	3 550 002.50	0.12
USD	CROWNROCK LP / CROWNROCK FIN INC-144A 5.62500% 17-15.10.25	3 342 000.00	3 325 590.78	0.11
USD	CROWNROCK LP / CROWNROCK FINANCE-144A 5.00000% 21-01.05.29	480 000.00	474 033.60	0.02
USD	CSC HOLDINGS LLC-144A 5.25000% 14-01.06.24	757 000.00	756 018.85	0.03
USD	CSC HOLDINGS LLC-144A 5.50000% 16-15.04.27	1 753 000.00	1 575 043.33	0.05
USD	CSC HOLDINGS LLC-144A 7.50000% 18-01.04.28	1 113 000.00	740 899.19	0.03
USD	CSC HOLDINGS LLC-144A 5.75000% 19-15.01.30	6 601 000.00	3 493 843.29	0.12
USD	CSC HOLDINGS LLC-144A 3.37500% 20-15.02.31	1 181 000.00	808 723.76	0.03
USD	CSC HOLDINGS LLC-144A 11.25000% 23-15.05.28	2 960 000.00	2 999 296.78	0.10
USD	CTR PAR LP/CARETRUST CAP CORP-144A 3.87500% 21-30.06.28	631 000.00	575 036.61	0.02
USD	CUSHMAN & WAKEFIELD US BORROWER-144A 6.75000% 20-15.05.28	5 543 000.00	5 467 171.76	0.19
USD	CUSHMAN & WAKEFIELD US BORROWER LLC-144A 8.87500% 23-01.09.31	138 000.00	144 047.16	0.00
USD	DAVE & BUSTER ' S INC-144A 7.62500% 20-01.11.25	3 548 000.00	3 588 163.36	0.12
USD	DAVITA INC-144A 3.75000% 20-15.02.31	400 000.00	329 755.44	0.01
USD	DAVITA INC-144A 4.62500% 20-01.06.30	6 085 000.00	5 383 847.35	0.18
USD	DELEK LOGISTICS PARTNERS LP-144A 7.12500% 21-01.06.28	3 436 000.00	3 273 921.92	0.11
USD	DELUXE CORP-144A 8.00000% 21-01.06.29	3 069 000.00	2 763 174.15	0.09
USD	DIAMOND SPORTS GRP LLC-144A *DEFAULTED* 6.62500% 19-15.08.27	570 000.00	39 900.00	0.00
USD	DIAMOND SPORTS GRP LLC-144A *DEFAULTED* 5.37500% 22-15.08.26	910 000.00	60 287.50	0.00
USD	DIRECTV FINANCING CO INC-144A 5.87500% 21-15.08.27	1 802 000.00	1 713 144.64	0.06
USD	DISH DBS CORP-144A 5.25000% 21-01.12.26	1 248 000.00	982 806.24	0.03
USD	DISH NETWORK CORP-144A 11.75000% 22-15.11.27	514 000.00	536 464.84	0.02
USD	DREAM FINDERS HOMES INC-144A 8.25000% 23-15.08.28	1 525 000.00	1 603 517.06	0.05
USD	DT MIDSTREAM INC-144A 4.37500% 21-15.06.31	1 355 000.00	1 213 770.51	0.04
USD	DUN & BRADSTREET CORP-144A 5.00000% 21-15.12.29	2 577 000.00	2 395 679.93	0.08
USD	DYCOM INDUSTRIES INC-144A 4.50000% 21-15.04.29	3 438 000.00	3 206 175.66	0.11
USD	EARTHSTONE ENERGY HOLDINGS LLC-144A 8.00000% 22-15.04.27	660 000.00	683 118.48	0.02
USD	EARTHSTONE ENERGY HOLDINGS LLC-144A 9.87500% 23-15.07.31	799 000.00	885 060.29	0.03
USD	EDGEWELL PERSONAL CARE CO-144A 5.50000% 20-01.06.28	100 000.00	97 882.00	0.00
USD	ELASTIC NV-144A 4.12500% 21-15.07.29	660 000.00	598 812.06	0.02
USD	ELDORADO GOLD CORP-144A 6.25000% 21-01.09.29	2 690 000.00	2 555 688.30	0.09
USD	ENCINO ACQUISITION PARTNERS HOLDIN-144A 8.50000% 21-01.05.28	2 355 000.00	2 337 337.50	0.08
USD	ENERGIZER HOLDINGS INC-144A 4.12500% 21-01.04.29	1 910 000.00	1 721 502.10	0.06
USD	ENERGIZER HOLDINGS INC-144A 4.75000% 20-15.06.28	5 391 000.00	5 016 325.50	0.17

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD ENERGIZER HOLDINGS INC-144A 4.37500% 20-31.03.29	300 000.00	271 563.00	0.01
USD ENERSYS-144A 4.37500% 19-15.12.27	1 430 000.00	1 344 815.34	0.05
USD ENLINK MIDSTREAM LLC-144A 5.62500% 20-15.01.28	670 000.00	662 238.59	0.02
USD ENLINK MIDSTREAM LLC-144A 6.50000% 22-01.09.30	490 000.00	500 029.81	0.02
USD ENOVA INTERNATIONAL INC-144A 8.50000% 18-15.09.25	1 694 000.00	1 674 927.53	0.06
USD ENTEGRIS ESCROW CORP-144A 4.75000% 22-15.04.29	1 135 000.00	1 084 962.58	0.04
USD ENTEGRIS ESCROW CORP-144A 5.95000% 22-15.06.30	1 768 000.00	1 746 389.03	0.06
USD EQM MIDSTREAM PARTNERS LP-144A 7.50000% 22-01.06.27	848 000.00	872 503.81	0.03
USD EQM MIDSTREAM PARTNERS LP-144A 7.50000% 22-01.06.30	859 000.00	921 301.55	0.03
USD EQUIPMENTSHARE.COM INC-144A 9.00000% 23-15.05.28	1 928 000.00	1 956 341.60	0.07
USD FAIR ISAAC CORP-144A 4.00000% 19-15.06.28	5 151 000.00	4 796 898.06	0.16
USD FERRELLGAS LP / FERRELLGAS FINANCE-144A 5.37500% 21-01.04.26	1 619 000.00	1 595 058.88	0.05
USD FIRSTCASH INC-144A 4.62500% 20-01.09.28	2 433 000.00	2 274 251.13	0.08
USD FMG RESOURCES AUGUST 2006 PTY LTD-144A 4.37500% 21-01.04.31	6 460 000.00	5 836 287.00	0.20
USD FMG RESOURCES AUGUST 2006 PTY-144A 5.87500% 22-15.04.30	1 318 000.00	1 296 756.48	0.04
USD FMG RESOURCES AUGUST 2006 PTY-144A 6.12500% 22-15.04.32	4 788 000.00	4 728 598.87	0.16
USD FOOT LOCKER INC-144A 4.00000% 21-01.10.29	1 000 000.00	844 720.00	0.03
USD FORESTAR GROUP INC-144A 3.85000% 21-15.05.26	3 590 000.00	3 410 033.30	0.12
USD FORTREA HOLDINGS INC-144A 7.50000% 23-01.07.30	1 287 000.00	1 308 003.84	0.04
USD FOUNDATION BUILDING MATERIALS INC-144A 6.00000% 21-01.03.29	848 000.00	745 180.00	0.03
USD FREEDOM MORTGAGE CORP-144A 6.62500% 23-15.01.27	1 957 000.00	1 879 543.31	0.06
USD FREEDOM MORTGAGE CORP-144A 12.00000% 23-01.10.28	1 782 000.00	1 956 074.67	0.07
USD FRONTIER COMMUNICATIONS CORP-144A 5.00000% 20-01.05.28	970 000.00	895 189.72	0.03
USD FRONTIER COMMUNICATIONS CORP-144A 6.75000% 20-01.05.29	3 670 000.00	3 252 444.02	0.11
USD FRONTIER COMMUNICATIONS HOLDINGS 5.87500% 21-01.11.29	1 540 000.00	1 304 973.05	0.04
USD FRONTIER COMMUNICATIONS HOLDINGS L-144A 6.00000% 21-15.01.30	3 230 000.00	2 738 942.79	0.09
USD GANNETT CO INC 5.00000% 19-15.09.29	1 725 000.00	1 593 175.50	0.05
USD GAP INC/THE-144A 3.62500% 21-01.10.29	4 530 000.00	3 879 739.34	0.13
USD GAP INC/THE-144A 3.87500% 21-01.10.31	3 510 000.00	2 895 386.37	0.10
USD GARDA WORLD SECURITY CORP-144A 9.50000% 19-01.11.27	5 789 000.00	5 823 940.09	0.20
USD GARDA WORLD SECURITY CORP-144A 6.00000% 21-01.06.29	4 017 000.00	3 527 535.38	0.12
USD GARDA WORLD SECURITY CORP-144A 7.75000% 23-15.02.28	717 000.00	729 649.93	0.02
USD GARDEN SPINCO CORP-144A 8.62500% 22-20.07.30	2 831 000.00	3 029 170.00	0.10
USD GARTNER INC-144A 3.62500% 21-15.06.29	891 000.00	809 892.14	0.03
USD GENESIS ENERGY LP / GENESI ERGY FINANCE 8.87500% 23-15.04.30	2 989 000.00	3 127 157.56	0.11
USD GENESIS ENERGY LP / GENESIS EN FIN CORP 8.25000% 23-15.01.29	2 990 000.00	3 073 764.94	0.10
USD GENWORTH MORTGAGE HOLDINGS INC-144A 6.50000% 20-15.08.25	1 178 000.00	1 175 373.06	0.04
USD GETTY IMAGES INC-144A 9.75000% 19-01.03.27	5 889 000.00	5 888 508.26	0.20
USD GFL ENVIRONMENTAL INC-144A 5.12500% 19-15.12.26	1 318 000.00	1 286 804.13	0.04
USD GFL ENVIRONMENTAL INC-144A 3.50000% 20-01.09.28	784 000.00	709 679.70	0.02
USD GGAM FINANCE LTD-144A 8.00000% 23-15.06.28	2 552 000.00	2 655 863.85	0.09
USD GGAM FINANCE LTD-144A 8.00000% 23-15.02.27	1 930 000.00	1 988 343.90	0.07
USD GLATFELTER CORP-144A 4.75000% 21-15.11.29	1 892 000.00	1 366 970.00	0.05
USD GLOBAL AIRCRAFT LEASING CO-144A (PIK) 6.50000% 19-15.09.24	1 091 188.00	1 051 632.43	0.04
USD GLOBAL INFRASTRUCTURE SOLUTION INC-144A 5.62500% 21-01.06.29	2 555 000.00	2 308 067.75	0.08
USD GLOBAL INFRASTRUCTURE SOLUTIONS-144A 7.50000% 22-15.04.32	840 000.00	773 947.81	0.03
USD GLOBAL PARTNERS LP / GLP FINANCE CORP 6.87500% 21-15.01.29	2 118 000.00	2 080 935.00	0.07
USD GN BONDCO LLC-144A 9.50000% 23-15.10.31	1 551 000.00	1 529 673.75	0.05
USD GO DADDY OPRTRNG CO LLC/GD FNE INC-144A-3.50000% 21-01.03.29	2 060 000.00	1 865 123.79	0.06
USD GOEASY LTD-144A 4.37500% 21-01.05.26	1 062 000.00	1 012 768.54	0.03
USD GOEASY LTD-144A 9.25000% 23-01.12.28	5 094 000.00	5 410 955.10	0.18
USD GRAY ESCROW II INC-144A 5.37500% 21-15.11.31	2 746 000.00	2 149 246.04	0.07
USD GRAY TELEVISION INC-144A 4.75000% 20-15.10.30	6 169 000.00	4 827 447.49	0.16
USD GREAT LAKES DREDGE & DOCK CORP-144A 5.25000% 21-01.06.29	1 498 000.00	1 288 330.08	0.04
USD GREYSTAR REAL ESTATE PARTNERS LLC-144A 7.75000% 23-01.09.30	4 037 000.00	4 243 169.59	0.14
USD GRIFFON CORP 5.75000% 20-01.03.28	4 422 000.00	4 333 559.98	0.15
USD GROUP 1 AUTOMOTIVE INC-144A 4.00000% 20-15.08.28	800 000.00	737 526.56	0.03
USD GRUBHUB HOLDINGS INC-144A 5.50000% 19-01.07.27	2 289 000.00	1 997 152.50	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 - ハイ・イールド

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD GTCR W-2 MERGER SUB LLC-144A 7.50000% 23-15.01.31	1 619 000.00	1 681 849.58	0.06
USD GYP HOLDINGS III CORP-144A 4.62500% 21-01.05.29	788 000.00	729 932.28	0.02
USD H&E EQUIPMENT SERVICES INC-144A 3.87500% 20-15.12.28	679 000.00	616 526.90	0.02
USD HANESBRANDS INC-144A 9.00000% 23-15.02.31	1 919 000.00	1 934 718.53	0.07
USD HARSCO CORP-144A 5.75000% 19-31.07.27	2 675 000.00	2 514 559.60	0.09
USD HARVEST MIDSTREAM-144A 7.50000% 20-01.09.28	2 564 000.00	2 589 909.22	0.09
USD HAT HOLDINGS I LLC / II LLC-144A 3.37500% 21-15.06.26	2 468 000.00	2 293 534.83	0.08
USD HAT HOLDINGS I LLC-144A 8.00000% 23-15.06.27	775 000.00	802 600.91	0.03
USD HAWAIIAN BRAND INTELLECTUAL PROP-144A 5.75000% 21-20.01.26	4 166 904.00	3 920 639.97	0.13
USD HEALTHEQUITY INC-144A 4.50000% 21-01.10.29	4 044 000.00	3 775 679.79	0.13
USD HEARTLAND DENTAL LLC / HETLAND DENTAL 10.50000% 23-30.04.28	2 398 000.00	2 500 082.86	0.09
USD HELIOS SOFTWARE HOLDINGS INC-144A 4.62500% 21-01.05.28	3 280 000.00	2 985 568.18	0.10
USD HELIX ENERGY SOLUTIONS GROUP INC-144A 9.75000% 23-01.03.29	1 603 000.00	1 681 960.41	0.06
USD HERBALIFE NTRTON LTD/HLF FING INC-144A 7.87500% 20-01.09.25	2 781 000.00	2 760 337.17	0.09
USD HERC HOLDINGS INC-144A 5.50000% 19-15.07.27	618 000.00	606 832.61	0.02
USD HERTZ CORP-144A 4.62500% 21-01.12.26	1 495 000.00	1 344 573.10	0.05
USD HESS MIDSTREAM PARTNERS LP-144A 4.25000% 21-15.02.30	3 130 000.00	2 879 136.10	0.10
USD HF SINCLAIR CORP-144A 5.00000% 23-01.02.28	1 745 000.00	1 693 554.85	0.06
USD HILCORP ENERGY I LP/FINANCE CO-144A 5.75000% 21-01.02.29	3 042 000.00	2 936 552.93	0.10
USD HILTON DOMESTIC OPERATING CO INC-144A 5.75000% 20-01.05.28	2 619 000.00	2 622 192.56	0.09
USD HILTON DOMESTIC OPERATING CO INC-144A 3.75000% 20-01.05.29	4 220 000.00	3 872 651.80	0.13
USD HILTON DOMESTIC OPERATING CO INC-144A 4.00000% 20-01.05.31	505 000.00	453 897.48	0.02
USD HILTON DOMESTIC OPERATING CO INC-144A 3.62500% 21-15.02.32	4 846 000.00	4 160 196.60	0.14
USD HILTON GRAND VACATIONS BORROWER-144A 5.00000% 21-01.06.29	1 745 000.00	1 612 425.72	0.05
USD HILTON GRAND VACATIONS BORROWER-144A 4.87500% 21-01.07.31	2 901 000.00	2 572 609.11	0.09
USD HLF FIN SARL/HERBALIFE INTL INC-144A 4.87500% 21-01.06.29	3 174 000.00	2 479 687.50	0.08
USD HOLOGIC INC-144A 3.25000% 20-15.02.29	2 580 000.00	2 319 902.46	0.08
USD HOSPITALITY PROPERTIES TRUST 4.50000% 14-15.03.25	932 000.00	908 680.98	0.03
USD HOSPITALITY PROPERTIES TRUST 5.50000% 20-15.12.27	218 000.00	205 055.46	0.01
USD HOWARD HUGHES CORP-144A 5.37500% 20-01.08.28	1 800 000.00	1 724 422.50	0.06
USD HOWARD HUGHES CORP/THE-144A 4.12500% 21-01.02.29	1 900 000.00	1 713 510.25	0.06
USD HOWARD HUGHES CORP/THE-144A 4.37500% 21-01.02.31	5 013 000.00	4 339 272.60	0.15
USD HOWARD MIDSTREAM ENERGY PARTNERS-144A 6.75000% 21-15.01.27	3 587 000.00	3 571 757.04	0.12
USD HOWARD MIDSTREAM ENERGY-144A 8.87500% 23-15.07.28	1 308 000.00	1 373 753.31	0.05
USD HUSKY III HOLDING LTD-144A (PIK) 13.00000% 20-15.02.25	677 000.00	677 325.46	0.02
USD IAMGOLD CORP-144A 5.75000% 20-15.10.28	640 000.00	559 353.60	0.02
USD IHEARTCOMMUNICATIONS INC 8.37500% 19-01.05.27	3 700 000.00	2 292 097.09	0.08
USD II-VI INC-144A 5.00000% 21-15.12.29	805 000.00	753 737.60	0.03
USD ILIAD HOLDING SASU-144A 7.00000% 21-15.10.28	1 642 000.00	1 628 918.40	0.06
USD ILLUMINATE BUYER LLC / ILLUMI HOLD-144A 9.00000% 20-01.07.28	5 977 000.00	5 841 954.82	0.20
USD IMOLA MERGER CORP-144A 4.75000% 21-15.05.29	3 218 000.00	2 996 438.61	0.10
USD INDEPENDENCE ENERGY FINANCE LLC-144A 7.25000% 21-01.05.26	5 071 000.00	5 051 983.75	0.17
USD INDIGO MERGER SUB INC-144A 2.87500% 21-15.07.26	490 000.00	457 713.90	0.02
USD INGEVITY CORP-144A 3.87500% 20-01.11.28	1 155 000.00	1 017 606.98	0.03
USD INGLES MARKETS INC-144A 4.00000% 21-15.06.31	1 000 000.00	883 810.00	0.03
USD INTELLIGENT PACKGING LTD FINCO INC-144A 6.00000% 20-15.09.28	2 652 000.00	2 493 413.72	0.08
USD INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES-144A 3.26800% 20-15.11.40	725 000.00	518 613.01	0.02
USD INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC-144A 5.25000% 20-15.01.29	683 000.00	666 545.10	0.02
USD INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC-144A 4.12500% 21-15.04.26	1 018 000.00	985 942.44	0.03
USD ION TRADING TECHNOLOGIES SARL-144A 5.75000% 21-15.05.28	4 990 000.00	4 572 087.50	0.16
USD IQVIA INC-144A 5.00000% 19-15.05.27	1 316 000.00	1 286 172.69	0.04
USD IQVIA INC-144A 5.70000% 23-15.05.28	2 772 000.00	2 822 992.02	0.10
USD IQVIA INC-144A 6.25000% 23-01.02.29	2 900 000.00	3 018 076.40	0.10
USD IRON MOUNTAIN INC-144A 4.87500% 19-15.09.29	2 204 000.00	2 059 540.59	0.07
USD IRON MOUNTAIN INC-144A 5.00000% 20-15.07.28	3 121 000.00	2 985 811.70	0.10
USD IRON MOUNTAIN INC-144A 5.25000% 20-15.07.30	889 000.00	838 509.96	0.03
USD IRON MOUNTAIN INC-144A 5.62500% 20-15.07.32	2 760 000.00	2 591 958.23	0.09
USD IRON MOUNTAIN INC-144A 4.50000% 20-15.02.31	1 355 000.00	1 214 951.67	0.04

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD IRON MOUNTAIN INC-144A 7.00000% 23-15.02.29	1 330 000.00	1 363 835.20	0.05
USD ITT HOLDINGS LLC-144A 6.50000% 21-01.08.29	3 655 000.00	3 197 065.05	0.11
USD J2 GLOBAL INC-144A 4.62500% 20-15.10.30	1 738 000.00	1 591 476.00	0.05
USD JAZZ SECURITIES DAC-144A 4.37500% 21-15.01.29	1 788 000.00	1 649 221.34	0.06
USD JEFFERIES FINANCE LLC / JFIN CO-144A 5.00000% 21-15.08.28	920 000.00	830 579.29	0.03
USD JELD-WEN INC-144A 4.87500% 17-15.12.27	1 911 000.00	1 812 041.41	0.06
USD JONES DESLAURIERS INSURANCE MANAGE-144A 8.50000% 23-15.03.30	1 741 000.00	1 806 287.50	0.06
USD KAISER ALUMINUM CORP-144A 4.50000% 21-01.06.31	2 431 000.00	2 075 560.82	0.07
USD KAR AUCTION SERVICES INC-144A 5.12500% 17-01.06.25	430 000.00	423 667.18	0.01
USD KBR INC-144A 4.75000% 20-30.09.28	1 417 000.00	1 306 799.91	0.04
USD KEN GARFF AUTOMOTIVE LLC-144A 4.87500% 20-15.09.28	2 291 000.00	2 142 245.37	0.07
USD KENNEDY-WILSON INC 4.75000% 21-01.03.29	2 771 000.00	2 319 881.20	0.08
USD KENNEDY-WILSON INC 4.75000% 21-01.02.30	130 000.00	105 574.30	0.00
USD KINETIK HOLDINGS INC-144A 5.87500% 22-15.06.30	6 128 000.00	6 019 259.26	0.20
USD KINETIK HOLDINGS LP-144A 6.62500% 23-15.12.28	565 000.00	572 737.68	0.02
USD KODIAK GAS SERVICES LLC-144A 7.25000% 24-15.02.29	991 000.00	1 002 853.16	0.03
USD KRONOS ACQUISITION HOLDINGS INC-144A 7.00000% 20-31.12.27	2 193 000.00	2 141 069.76	0.07
USD LABL ESCROW ISSUER LLC-144A 10.50000% 19-15.07.27	4 190 000.00	4 006 236.45	0.14
USD LABL ESCROW ISSUER LLC-144A 6.75000% 19-15.07.26	3 236 000.00	3 147 932.26	0.11
USD LABL INC-144A 5.87500% 21-01.11.28	3 773 000.00	3 378 014.06	0.12
USD LADDER CAPITAL FIN HLDG LLLP/CORP-144A 4.25000% 20-01.02.27	1 636 000.00	1 514 241.68	0.05
USD LAMB WESTON HOLDINGS INC-144A 4.12500% 21-31.01.30	2 690 000.00	2 454 691.44	0.08
USD LBM ACQUISITION LLC-144A 6.25000% 20-15.01.29	4 800 000.00	4 356 000.00	0.15
USD LCM INVESTMENTS HOLDINGS II LLC-144A 4.87500% 21-01.05.29	3 674 000.00	3 311 003.28	0.11
USD LEVEL 3 FINANCING INC-144A 3.87500% 19-15.11.29	285 000.00	206 625.00	0.01
USD LEVEL 3 FINANCING INC-144A 4.25000% 20-01.07.28	2 851 000.00	955 085.00	0.03
USD LEVEL 3 FINANCING INC-144A 3.62500% 20-15.01.29	342 000.00	100 890.00	0.00
USD LFS TOPCO LLC-144A 5.87500% 21-15.10.26	1 388 000.00	1 276 322.36	0.04
USD LGI HOMES INC-144A 4.00000% 21-15.07.29	1 419 000.00	1 214 124.18	0.04
USD LGI HOMES INC-144A 8.75000% 23-15.12.28	1 676 000.00	1 769 357.39	0.06
USD LIFE TIME INC-144A 5.75000% 21-15.01.26	3 502 000.00	3 462 158.44	0.12
USD LIFEPOINT HEALTH INC-144A 4.37500% 20-15.02.27	1 039 000.00	967 641.48	0.03
USD LIKEWIZE CORP-144A 9.75000% 20-15.10.25	2 285 000.00	2 315 992.17	0.08
USD LITHIA MOTORS INC-144A 4.37500% 20-15.01.31	1 150 000.00	1 031 153.43	0.04
USD LITHIA MOTORS INC-144A 3.87500% 21-01.06.29	1 447 000.00	1 298 682.50	0.04
USD LIVE NATION ENTERTAINMENT INC-144A 4.87500% 16-01.11.24	2 007 000.00	1 994 958.00	0.07
USD LIVE NATION ENTERTAINMENT INC-144A 6.50000% 20-15.05.27	1 921 000.00	1 940 726.75	0.07
USD LIVE NATION ENTERTAINMENT INC-144A 3.75000% 21-15.01.28	2 614 000.00	2 414 682.50	0.08
USD LOUISIANA-PACIFIC CORP-144A 3.62500% 21-15.03.29	1 526 000.00	1 369 541.82	0.05
USD LSF11 A5 HOLDCO LLC-144A 6.62500% 21-15.10.29	2 282 000.00	1 932 024.03	0.07
USD M/I HOMES INC 3.95000% 21-15.02.30	3 068 000.00	2 722 850.00	0.09
USD M/I HOMES INC 4.95000% 20-01.02.28	821 000.00	789 243.72	0.03
USD MACQUARIE AIRFINANCE HOLDINGS-144A 8.37500% 23-01.05.28	911 000.00	956 959.95	0.03
USD MADISON IAQ LLC-144A 5.87500% 21-30.06.29	1 518 000.00	1 348 879.39	0.05
USD MAJORDRIVE HOLDINGS IV LLC-144A 6.37500% 21-01.06.29	5 089 000.00	4 304 636.19	0.15
USD MARRIOTT OWNERSHIP RESORTS INC 4.75000% 20-15.01.28	1 086 000.00	1 001 835.00	0.03
USD MARRIOTT OWNERSHIP RESORTS INC-144A 4.50000% 21-15.06.29	405 000.00	364 086.90	0.01
USD MASONITE INTERNATIONAL CORP-144A 3.50000% 21-15.02.30	492 000.00	423 262.53	0.01
USD MATCH GROUP HOLDINGS II LLC-144A 5.62500% 19-15.02.29	125 000.00	121 556.25	0.00
USD MATCH GROUP HOLDINGS II LLC-144A 4.62500% 20-01.06.28	719 000.00	676 809.08	0.02
USD MATCH GROUP HOLDINGS II LLC-144A 3.62500% 21-01.10.31	95 000.00	81 225.00	0.00
USD MATTAMY GROUP CORP-144A 5.25000% 19-15.12.27	1 207 000.00	1 164 601.96	0.04
USD MATTHEWS INTERNATIONAL CORP-144A 5.25000% 17-01.12.25	6 104 000.00	5 968 614.56	0.20
USD MAUSER PACKAGING SOLUTIONS HOLDING-144A 7.87500% 23-15.08.26	4 418 000.00	4 464 178.93	0.15
USD MAUSER PACKAGING SOLUTIONS HOLD-144A 9.25000% 23-15.04.27	5 854 000.00	5 650 603.94	0.19
USD MAV ACQUISITION CORP-144A 8.00000% 21-01.08.29	3 393 000.00	3 147 007.50	0.11
USD MCAFEE CORP-144A 7.37500% 22-15.02.30	5 997 000.00	5 434 556.06	0.19
USD MEDLINE BORROWER LP-144A 3.87500% 21-01.04.29	4 909 000.00	4 444 625.83	0.15

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD MEDLINE BORROWER LP-144A 5.25000% 21-01.10.29	2 531 000.00	2 359 927.48	0.08
USD MEG ENERGY CORP-144A 5.87500% 21-01.02.29	375 000.00	365 910.86	0.01
USD MERCER INTERNATIONAL INC 5.12500% 21-01.02.29	1 020 000.00	875 692.64	0.03
USD METIS MERGER SUB LLC-144A 6.50000% 21-15.05.29	1 108 000.00	1 018 114.03	0.03
USD MICROSTRATEGY INC-144A 6.12500% 21-15.06.28	2 725 000.00	2 599 786.25	0.09
USD MIDAS OPCO HOLDINGS LLC-144A 5.62500% 21-15.08.29	3 497 000.00	3 199 964.82	0.11
USD MINERAL RESOURCES LTD-144A 8.12500% 19-01.05.27	175 000.00	176 750.00	0.01
USD MINERAL RESOURCES LTD-144A 9.25000% 23-01.10.28	1 699 000.00	1 787 624.83	0.06
USD MINERALS TECHNOLOGIES INC-144A 5.00000% 20-01.07.28	4 770 000.00	4 561 598.70	0.16
USD MOBIUS MERGER SUB INC-144A 9.00000% 23-01.06.30	1 265 000.00	1 248 555.00	0.04
USD MOLINA HEALTHCARE INC-144A 3.87500% 20-15.11.30	1 460 000.00	1 279 737.54	0.04
USD MOOG INC-144A 4.25000% 19-15.12.27	1 305 000.00	1 221 897.60	0.04
USD MPH ACQUISITION HOLDINGS LLC-144A 5.75000% 20-01.11.28	3 098 000.00	2 464 985.66	0.08
USD MUELLER WATER PRODUCTS INC-144A 4.00000% 21-15.06.29	911 000.00	824 192.30	0.03
USD MURPHY OIL USA INC-144A 3.75000% 21-15.02.31	3 879 000.00	3 345 870.24	0.11
USD NABORS INDUSTRIES INC-144A 7.37500% 21-15.05.27	4 689 000.00	4 607 585.54	0.16
USD NABORS INDUSTRIES LTD-144A 7.50000% 20-15.01.28	115 000.00	104 075.00	0.00
USD NATIONAL FINANCIAL PARTNERS CORP-144A 4.87500% 21-15.08.28	1 129 000.00	1 119 855.10	0.04
USD NATIONSTAR MORTGAGE HOLDINGS INC-144A 5.12500% 20-15.12.30	1 000 000.00	898 814.68	0.03
USD NATIONSTAR MORTGAGE HOLDINGS INC-144A 5.75000% 21-15.11.31	2 260 000.00	2 083 093.12	0.07
USD NAVIENT CORP 9.37500% 23-25.07.30	762 000.00	794 471.86	0.03
USD NCL CORP LTD-144A 5.87500% 20-15.03.26	2 595 000.00	2 525 259.38	0.09
USD NCL CORP LTD-144A 7.75000% 22-15.02.29	2 480 000.00	2 495 500.00	0.08
USD NCL CORP LTD-144A 8.37500% 23-01.02.28	1 900 000.00	1 986 336.00	0.07
USD NCR ATLEOS ESCROW CORP-144A 9.50000% 23-01.04.29	3 193 000.00	3 424 811.80	0.12
USD NCR CORP-144A 5.12500% 21-15.04.29	6 444 000.00	6 029 179.87	0.21
USD NCR ESCROW CORP-144A 5.00000% 20-01.10.28	2 643 000.00	2 491 736.35	0.08
USD NEPTUNE BIDCO UNITED STATE INCORP-144A 9.29000% 22-15.04.29	2 119 000.00	2 024 090.63	0.07
USD NESCO HOLDINGS II INC-144A 5.50000% 21-15.04.29	4 106 000.00	3 848 923.34	0.13
USD NEW ENTERPRISE STONE&LIME CO INC-144A 5.25000% 21-15.07.28	1 676 000.00	1 610 300.80	0.05
USD NEW RESIDENTIAL INVESTMENT CORP-144A 6.25000% 20-15.10.25	1 500 000.00	1 482 465.00	0.05
USD NEWELL BRANDS INC 6.62500% 22-15.09.29	1 823 000.00	1 767 455.31	0.06
USD NEWS CORP-144A 3.87500% 21-15.05.29	1 412 000.00	1 297 981.00	0.04
USD NEWS CORP-144A 5.12500% 22-15.02.32	599 000.00	562 888.25	0.02
USD NEXSTAR BROADCASTING INC-144A 4.75000% 20-01.11.28	130 000.00	119 074.58	0.00
USD NEXSTAR BROADCASTING INC-144A 5.62500% 19-15.07.27	3 598 000.00	3 504 109.47	0.12
USD NEXTERA ENERGY PARTNERS LP-144A 4.50000% 17-15.09.27	1 040 000.00	976 598.14	0.03
USD NFP CORP-144A 7.50000% 22-01.10.30	428 000.00	449 549.12	0.02
USD NGL ENERGY OPERATING LLC-144A 7.50000% 21-01.02.26	1 186 000.00	1 207 116.92	0.04
USD NISSAN MOTOR ACCEPTANCE CORP-144A 2.00000% 21-09.03.26	505 000.00	466 676.33	0.02
USD NMI HOLDINGS INC-144A 7.37500% 20-01.06.25	1 026 000.00	1 036 260.00	0.04
USD NORTHERN OIL AND GAS INC-144A 8.12500% 21-01.03.28	698 000.00	708 864.95	0.02
USD NORTH RIVER MIDSTREAM FINANCE LP-144A 5.62500% 20-15.02.26	770 000.00	750 449.52	0.03
USD NORTHWEST FIBER LLC / FINANCE-144A 6.00000% 21-15.02.28	2 969 000.00	2 827 972.50	0.10
USD NORTONLIFELOCK INC-144A 6.75000% 22-30.09.27	2 103 000.00	2 134 910.92	0.07
USD NORTONLIFELOCK INC-144A 7.12500% 22-30.09.30	2 635 000.00	2 733 520.01	0.09
USD NOVA CHEMICALS CORP-144A 4.87500% 17-01.06.24	779 000.00	775 096.52	0.03
USD NOVELIS CORP-144A 4.75000% 20-30.01.30	2 405 000.00	2 230 627.04	0.08
USD NRG ENERGY INC-144A 5.25000% 19-15.06.29	1 265 000.00	1 212 957.83	0.04
USD NRG ENERGY INC-144A 3.37500% 20-15.02.29	3 626 000.00	3 198 659.21	0.11
USD NRG ENERGY INC-144A 3.62500% 20-15.02.31	1 345 000.00	1 153 663.79	0.04
USD NUFARM AUSTRALIA LTD-144A 5.00000% 22-27.01.30	3 496 000.00	3 193 080.35	0.11
USD OASIS PETROLEUM INC-144A 6.37500% 21-01.06.26	1 700 000.00	1 699 894.35	0.06
USD OLYMPUS WATER US HOLDING CORP-144A 9.75000% 23-15.11.28	2 835 000.00	2 999 357.60	0.10
USD OLYMPUS WATER US HOLDING CORP-144A 4.25000% 21-01.10.28	4 937 000.00	4 505 999.90	0.15
USD OLYMPUS WATER US HOLDING CORP-144A 6.25000% 21-01.10.29	2 729 000.00	2 497 994.66	0.09
USD ON SEMICONDUCTOR CORP-144A 3.87500% 20-01.09.28	920 000.00	840 705.20	0.03
USD ONTARIO GAMING GTA LP-144A 8.00000% 23-01.08.30	3 212 000.00	3 348 510.00	0.11

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD OPEN TEXT CORP / OPEN TEXT-144A 3.87500% 21-01.12.29	3 179 000.00	2 867 068.58	0.10
USD OPEN TEXT CORP / OPEN TEXT-144A 4.12500% 21-01.12.31	3 311 000.00	2 940 406.72	0.10
USD OPEN TEXT CORP-144A 3.87500% 20-15.02.28	2 311 000.00	2 146 571.83	0.07
USD OPEN TEXT CORP-144A 6.90000% 22-01.12.27	1 552 000.00	1 610 013.57	0.05
USD ORGANON FINANCE 1 LLC-144A 4.12500% 21-30.04.28	1 169 000.00	1 069 576.08	0.04
USD ORGANON FINANCE 1 LLC-144A 5.12500% 21-30.04.31	4 847 000.00	4 164 187.60	0.14
USD OUTFRONT MEDIA CAPITAL LLC/CORP-144A 5.00000% 19-15.08.27	2 726 000.00	2 609 341.66	0.09
USD OUTFRONT MEDIA CAPITAL LLC / OUTFR-144A 4.25000% 21-15.01.29	557 000.00	496 459.67	0.02
USD OWENS-BROCKWAY GLASS CONTAINER INC-144A 6.62500% 20-13.05.27	2 414 000.00	2 403 624.92	0.08
USD OWENS-BROCKWAY GLASS CONTAINER-144A 7.25000% 23-15.05.31	1 643 000.00	1 651 330.01	0.06
USD PARK INTERMEDIATE HOLDINGS/PK DOME-144A 5.87500% 20-01.10.28	1 749 000.00	1 700 902.50	0.06
USD PARK INTERMEDIATE HOLDINGS LLC-144A 4.87500% 21-15.05.29	2 510 000.00	2 299 787.50	0.08
USD PARK RIVER HOLDINGS INC-144A 6.75000% 21-01.08.29	2 089 000.00	1 771 095.69	0.06
USD PARK-OHIO INDUSTRIES INC 6.62500% 17-15.04.27	500 000.00	457 615.00	0.02
USD PARKLAND CORP-144A 4.50000% 21-01.10.29	5 102 000.00	4 691 836.39	0.16
USD PARKLAND CORP-144A 4.62500% 21-01.05.30	4 714 000.00	4 343 102.48	0.15
USD PATRICK INDUSTRIES INC-144A 4.75000% 21-01.05.29	3 560 000.00	3 279 899.20	0.11
USD PATTERN ENERGY OPERATIONS LP/INC-144A 4.50000% 20-15.08.28	1 952 000.00	1 819 197.77	0.06
USD PBF HOLDING CO LLC/FIN CORP-144A 7.87500% 23-15.09.30	2 175 000.00	2 252 908.50	0.08
USD PENNYMAC FINANCIAL SERVICES INC-144A 4.25000% 21-15.02.29	1 920 000.00	1 740 507.26	0.06
USD PENNYMAC FINANCIAL SERVICES INC-144A 5.75000% 21-15.09.31	4 610 000.00	4 269 703.17	0.15
USD PENNYMAC FINANCIAL SERVICES INC-144A 7.87500% 23-15.12.29	1 425 000.00	1 467 681.60	0.05
USD PERFORMANCE FOOD GROUP INC-144A 5.50000% 19-15.10.27	892 000.00	869 966.77	0.03
USD PERFORMANCE FOOD GROUP INC-144A 6.87500% 20-01.05.25	2 328 000.00	2 333 913.12	0.08
USD PERFORMANCE FOOD GROUP INC-144A 4.25000% 21-01.08.29	1 724 000.00	1 579 760.78	0.05
USD PERMIAN RESOURCES OPERATING LLC-144A 5.87500% 21-01.07.29	1 903 000.00	1 861 285.37	0.06
USD PERMIAN RESOURCES OPERATING LLC-144A 7.00000% 23-15.01.32	335 000.00	345 854.94	0.01
USD PHH MORTGAGE CORP-144A 7.87500% 21-15.03.26	2 281 000.00	2 104 222.50	0.07
USD PIKE CORP-144A 5.50000% 20-01.09.28	3 628 000.00	3 463 506.48	0.12
USD PITNEY BOWES INC-144A 6.87500% 21-15.03.27	630 000.00	568 575.00	0.02
USD PMHC II INC-144A 9.00000% 22-15.02.30	550 000.00	456 500.00	0.02
USD POST HOLDINGS INC-144A 5.75000% 17-01.03.27	1 531 000.00	1 523 583.07	0.05
USD POST HOLDINGS INC-144A 5.50000% 19-15.12.29	1 400 000.00	1 353 255.96	0.05
USD POST HOLDINGS INC-144A 4.62500% 20-15.04.30	1 921 000.00	1 766 644.96	0.06
USD POST HOLDINGS INC-144A 4.50000% 21-15.09.31	5 080 000.00	4 563 089.17	0.16
USD PRA GROUP INC-144A 8.37500% 23-01.02.28	720 000.00	685 828.33	0.02
USD PRECISION DRILLING CORP-144A 6.87500% 21-15.01.29	1 760 000.00	1 731 523.20	0.06
USD PREMIER ENTMT-144A 5.625000 21-01.09.29	645 000.00	483 698.40	0.02
USD PRESIDIO HOLDINGS INC-144A 8.25000% 20-01.02.28	2 089 000.00	2 071 517.60	0.07
USD PRESTIGE BRANDS INC-144A 3.75000% 21-01.04.31	3 534 000.00	3 064 603.31	0.10
USD PRIME SEC SER BORROWER LLC/FIN INC-144A 5.75000% 19-15.04.26	966 000.00	965 547.23	0.03
USD PRIME SEC SER BORROWER LLC/FIN INC-144A 6.25000% 20-15.01.28	643 000.00	637 206.25	0.02
USD PRIME SEC SER BORROWER LLC/FIN INC-144A 3.37500% 20-31.08.27	1 565 000.00	1 441 601.32	0.05
USD PROG HOLDINGS INC-144A 6.00000% 21-15.11.29	2 232 000.00	2 038 388.37	0.07
USD QUICKEN LOANS LLC-144A 2.87500% 21-15.10.26	1 519 000.00	1 393 788.83	0.05
USD RACKSPACE TECHNOLOGY GLOBAL INC-144A 5.37500% 20-01.12.28	1 500 000.00	466 756.54	0.02
USD RACKSPACE TECHNOLOGY GLOBAL INC-144A 3.50000% 21-15.02.28	2 756 000.00	1 079 260.35	0.04
USD RAISING CANE 'S RESTAURANTS LLC-144A 9.37500% 23-01.05.29	1 246 000.00	1 335 098.43	0.05
USD RANGE RESOURCES CORP-144A 4.75000% 22-15.02.30	1 830 000.00	1 701 900.00	0.06
USD REALOGY GROUP/CO ISSUER-144A 5.75000% 21-15.01.29	3 030 000.00	2 250 593.10	0.08
USD REGIONALCARE HOSPITAL PTRS HLDNGS-144A 9.75000% 18-01.12.26	1 990 000.00	1 986 541.18	0.07
USD RENT-A-CENTER INC/TX-144A 6.37500% 21-15.02.29	3 611 000.00	3 442 799.62	0.12
USD RITCHIE BROS HOLDING INC-144A 6.75000% 23-15.03.28	1 501 000.00	1 531 125.07	0.05
USD RITCHIE BROS HOLDING INC-144A 7.75000% 23-15.03.31	2 409 000.00	2 538 652.38	0.09
USD ROBLOX CORP-144A 3.87500% 21-01.05.30	925 000.00	812 621.75	0.03
USD ROCKCLIFF ENERGY II LLC-144A 5.50000% 21-15.10.29	59 000.00	54 931.07	0.00
USD ROCKET SOFTWARE INC-144A 6.50000% 21-15.02.29	3 424 000.00	2 936 525.12	0.10
USD ROLLER BEARING CO OF AMERICA INC-144A 4.37500% 21-15.10.29	1 367 000.00	1 256 467.77	0.04

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD-144A 4.25000% 21-01.07.26	1 777 000.00	1 709 882.53	0.06
USD ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD-144A 5.3750% 22-15.07.27	3 850 000.00	3 788 444.66	0.13
USD ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD-144A 11.62500% 22-15.08.27	1 740 000.00	1 892 686.49	0.06
USD ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD-144A 7.25000% 23-15.01.30	1 270 000.00	1 323 606.70	0.05
USD RXO INC-144A 7.50000% 22-15.11.27	1 682 000.00	1 732 468.39	0.06
USD RYAN SPECIALTY GROUP LLC-144A 4.37500% 22-01.02.30	1 235 000.00	1 144 286.03	0.04
USD SABLE INTERNATIONAL FINANCE LTD-144A 5.75000% 19-07.09.27	7 000.00	6 720.00	0.00
USD SABRE GBL INC-144A 11.25000% 22-15.12.27	650 000.00	650 812.50	0.02
USD SABRE GBL INC-144A 8.62500% 23-01.06.27	1 400 000.00	1 309 000.57	0.04
USD SBA COMMUNICATIONS CORP 3.12500% 22-01.02.29	1 460 000.00	1 301 200.03	0.04
USD SCIENCE APPLICATIONS INTRNTNL CORP-144A 4.87500% 20-01.04.28	3 763 000.00	3 551 594.66	0.12
USD SCIENTIFIC GAMES HOLDINGS LP/SCIEN-144A 6.62500% 22-01.03.30	1 831 000.00	1 721 140.00	0.06
USD SCIENTIFIC GAMES INTERNATIONAL INC-144A 7.50000% 23-01.09.31	1 023 000.00	1 064 484.70	0.04
USD SCRIPPS ESCROW II INC-144A 5.37500% 20-15.01.31	1 736 000.00	1 318 839.20	0.04
USD SCRIPPS ESCROW INC-144A 5.87500% 19-15.07.27	418 000.00	376 739.22	0.01
USD SEAGATE HDD CAYMAN 4.09100% 20-01.06.29	1 085 000.00	999 981.94	0.03
USD SEAGATE HDD CAYMAN 4.12500% 20-15.01.31	1 300 000.00	1 147 250.00	0.04
USD SEAGATE HDD CAYMAN-144A 8.25000% 23-15.12.29	380 000.00	408 975.00	0.01
USD SEALED AIR CORP-144A 6.12500% 23-01.02.28	1 249 000.00	1 253 427.34	0.04
USD SEALED AIR CORP/US-144A 7.25000% 23-15.02.31	360 000.00	376 358.72	0.01
USD SEAWORLD PARKS & ENTERTAINMENT INC-144A 8.75000% 20-01.05.25	364 000.00	367 210.48	0.01
USD SEAWORLD PARKS & ENTERTAINMENT INC-144A 5.25000% 21-15.08.29	2 455 000.00	2 286 390.60	0.08
USD SELECT MEDICAL CORP-144A 6.25000% 19-15.08.26	1 760 000.00	1 759 529.91	0.06
USD SENSATA TECHNOLOGIES BV-144A 5.00000% 15-01.10.25	550 000.00	547 511.18	0.02
USD SENSATA TECHNOLOGIES INC-144A 4.37500% 19-15.02.30	1 060 000.00	976 731.05	0.03
USD SERVICE PROPERTIES TRUST 3.95000% 17-15.01.28	2 762 000.00	2 329 858.31	0.08
USD SERVICE PROPERTIES TRUST 4.37500% 18-15.02.30	1 054 000.00	816 329.00	0.03
USD SHIFT4 PAYMENTS LLC / SHIFT4 PAY-144A 4.62500% 20-01.11.26	3 590 000.00	3 502 045.00	0.12
USD SILGAN HOLDINGS INC 4.12500% 20-01.02.28	1 804 000.00	1 689 301.68	0.06
USD SIMMONS FOODS INC-144A 4.62500% 21-01.03.29	2 500 000.00	2 149 430.50	0.07
USD SINCLAIR TELEVISION GROUP INC-144A 5.50000% 19-01.03.30	2 663 000.00	2 051 894.76	0.07
USD SINCLAIR TELEVISION GROUP INC-144A 4.12500% 20-01.12.30	920 000.00	710 700.00	0.02
USD SIRIUS XM RADIO INC-144A 5.00000% 17-01.08.27	742 000.00	713 232.66	0.02
USD SIRIUS XM RADIO INC-144A 4.00000% 21-15.07.28	3 435 000.00	3 119 351.78	0.11
USD SIRIUS XM RADIO INC-144A 3.12500% 21-01.09.26	3 804 000.00	3 550 615.56	0.12
USD SIX FLAGS ENTERTAINMENT CORP-144A 7.25000% 23-15.05.31	1 580 000.00	1 611 600.00	0.05
USD SMBC AVIATION CAPITAL FINANCE DAC-144A 5.45000% 23-03.05.28	525 000.00	531 230.39	0.02
USD SMYRNA READY MIX CONCRETE LLC-144A 8.87500% 23-15.11.31	555 000.00	583 061.49	0.02
USD SMYRNA READY MIX CONCRETE-144A 6.00000% 20-01.11.28	1 388 000.00	1 356 700.11	0.05
USD SOLARIS MIDSTREAM HOLDINGS LLC-144A 7.62500% 21-01.04.26	5 238 000.00	5 246 485.56	0.18
USD SONIC AUTOMOTIVE INC-144A 4.62500% 21-15.11.29	1 461 000.00	1 323 390.88	0.05
USD SONIC AUTOMOTIVE INC-144A 4.87500% 21-15.11.31	2 068 000.00	1 794 857.91	0.06
USD SOTHEBY BIDFAIR HOLDINGS INC-144A 5.87500% 21-01.06.29	1 896 000.00	1 636 691.30	0.06
USD SOUTHWESTERN ENERGY CO 5.37500% 21-01.02.29	1 555 000.00	1 518 302.77	0.05
USD SPECIALTY BUILDING PRODUCTS HLD LLC-144A 6.37500% 20-30.09.26	4 817 000.00	4 735 207.34	0.16
USD SPEEDY GROUP HOLDINGS CORP-144A 7.50000% 21-01.08.28	1 143 000.00	277 810.00	0.01
USD SPIRIT AEROSYSTEMS INC-144A 9.37500% 22-30.11.29	657 000.00	711 843.73	0.02
USD SRS DISTRIBUTION INC-144A 6.00000% 21-01.12.29	2 242 000.00	2 096 270.00	0.07
USD SS&C TECHNOLOGIES INC-144A 5.50000% 19-30.09.27	3 282 000.00	3 221 736.57	0.11
USD STANDARD INDUSTRIES INC/NJ-144A 4.75000% 17-15.01.28	377 000.00	360 571.43	0.01
USD STANDARD INDUSTRIES INC/NJ-144A 4.37500% 20-15.07.30	4 534 000.00	4 120 283.20	0.14
USD STAR PARENT INC-144A 9.00000% 23-01.10.30	1 681 000.00	1 767 577.11	0.06
USD STARWOOD PROPERTY TRUST INC-144A 3.62500% 21-15.07.26	3 484 000.00	3 220 793.42	0.11
USD STARWOOD PROPERTY TRUST INC-144A 4.37500% 22-15.01.27	5 490 000.00	5 082 477.30	0.17
USD STATION CASINOS LLC-144A 4.50000% 20-15.02.28	2 461 000.00	2 313 404.53	0.08
USD STATION CASINOS LLC-144A 4.62500% 21-01.12.31	1 448 000.00	1 299 580.00	0.04
USD STRATHCONA RESOURCES LTD-144A 6.87500% 21-01.08.26	2 890 000.00	2 862 227.10	0.10
USD SUBURBAN PROPANE PARTN/ENERGY FIN-144A 5.00000% 21-01.06.31	5 260 000.00	4 727 740.60	0.16

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD SUMMIT MIDSTREAM FINANCE CORP-144A STEP-UP 21-15.10.26	3 867 000.00	3 867 386.70	0.13
USD SUNCOKE ENERGY INC-144A 4.87500% 21-30.06.29	2 590 000.00	2 339 080.80	0.08
USD SUNOCO LP / SUNOCO FINANCE CORP 4.50000% 21-15.05.29	7 684 000.00	7 158 768.63	0.24
USD SUNOCO LP / SUNOCO FINANCE CORP 4.50000% 22-30.04.30	5 377 000.00	4 970 118.05	0.17
USD SUNOCO LP/FINANCE CORP-144A 7.00000% 23-15.09.28	345 000.00	352 636.23	0.01
USD SUPERIOR PLUS/SUPE GEN PARTNER INC-144A 4.50000% 21-15.03.29	1 955 000.00	1 771 836.05	0.06
USD TALLGRASS ENERGY PARTNERS-144A 6.00000% 21-01.09.31	715 000.00	658 581.33	0.02
USD TALLGRASS ENRGY PART LP/FIN-144A 7.37500% 24-15.02.29	755 000.00	753 122.60	0.03
USD TAYLOR MORRISON COMMUNITIES INC-144A 5.75000% 19-15.01.28	2 920 000.00	2 898 798.32	0.10
USD TAYLOR MORRISON COMMUNITIES INC-144A 5.12500% 20-01.08.30	3 180 000.00	3 028 765.24	0.10
USD TECHNIPFMC PLC-144A 6.50000% 21-01.02.26	460 000.00	458 495.51	0.02
USD TELESAT CANADA/TELESAT LLC-144A 4.87500% 19-01.06.27	1 682 000.00	977 242.00	0.03
USD TEMPUR SEALY INTERNATIONAL INC-144A 4.00000% 21-15.04.29	5 185 000.00	4 677 986.85	0.16
USD TEMPUR SEALY INTERNATIONAL INC-144A 3.87500% 21-15.10.31	1 990 000.00	1 679 262.55	0.06
USD TENET HEALTHCARE CORP-144A 6.75000% 23-15.05.31	750 000.00	767 128.13	0.03
USD THOR INDUSTRIES INC-144A 4.00000% 21-15.10.29	1 100 000.00	973 552.91	0.03
USD TITAN INTERNATIONAL INC 7.00000% 21-30.04.28	850 000.00	847 424.93	0.03
USD TOPBUILD CORP-144A 3.62500% 21-15.03.29	2 998 000.00	2 712 206.30	0.09
USD TOPBUILD CORP-144A 4.12500% 21-15.02.32	1 649 000.00	1 440 912.69	0.05
USD TRANSDIGM INC-144A 6.87500% 23-15.12.30	555 000.00	567 992.55	0.02
USD TRANSOCEAN INC-144A 11.50000% 20-30.01.27	440 000.00	459 800.00	0.02
USD TRANSOCEAN INC-144A 8.75000% 23-15.02.30	3 961 000.00	3 899 620.34	0.13
USD TRAVEL + LEISURE CO-144A 4.50000% 21-01.12.29	825 000.00	752 725.88	0.03
USD TRIMAS CORP-144A 4.12500% 21-15.04.29	805 000.00	716 708.34	0.02
USD TRINET GROUP INC-144A 3.50000% 21-01.03.29	3 786 000.00	3 341 335.81	0.11
USD TRINSEO MATERIALS OPERATING SCA-144A 5.12500% 21-01.04.29	1 889 000.00	735 066.57	0.03
USD TRIUMPH GROUP INC-144A 9.00000% 23-15.03.28	1 030 000.00	1 086 803.47	0.04
USD TRONOX INC-144A 4.62500% 21-15.03.29	831 000.00	733 694.88	0.02
USD TTM TECHNOLOGIES INC-144A 4.00000% 21-01.03.29	1 748 000.00	1 575 629.32	0.05
USD UKG INC-144A 6.87500% 24-01.02.31	1 000 000.00	1 011 250.00	0.03
USD UNISYS CORP-144A 6.87500% 20-01.11.27	3 533 000.00	3 201 781.25	0.11
USD UNITED AIRLINES INC-144A 4.37500% 21-15.04.26	921 000.00	888 434.09	0.03
USD UNITED NATURAL FODDS INC-144A 6.75000% 20-15.10.28	2 876 000.00	2 415 840.00	0.08
USD UNITI GROUP LP/FIBER HLDG/CSL CAP-144A 6.00000% 21-15.01.30	550 000.00	364 375.00	0.01
USD UNITI GROUP LP/FINANCE/CAPITAL-144A 10.50000% 23-15.02.28	810 000.00	824 540.31	0.03
USD UNIVISION COMMUNICATIONS INC-144A 6.62500% 20-01.06.27	950 000.00	939 725.85	0.03
USD UNIVISION COMMUNICATIONS INC-144A 7.37500% 22-30.06.30	3 927 000.00	3 850 039.17	0.13
USD UPC BROADBAND FINCO BV-144A 4.87500% 21-15.07.31	1 488 000.00	1 305 686.98	0.04
USD URBAN ONE INC-144A 7.37500% 21-01.02.28	3 698 000.00	3 277 574.38	0.11
USD US ACUTE CARE SOLUTIONS LLC-144A 6.37500% 21-01.03.26	3 432 000.00	2 998 915.92	0.10
USD US FOODS INC-144A 4.62500% 21-01.06.30	2 963 000.00	2 761 761.58	0.09
USD USA COMPRESSION PARTNERS LLC 6.87500% 19-01.04.26	1 460 000.00	1 451 424.84	0.05
USD USI INC/NY-144A 7.50000% 23-15.01.32	335 000.00	339 606.25	0.01
USD VALARIS LTD-144A 8.37500% 23-30.04.30	4 960 000.00	5 065 548.80	0.17
USD VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-144A 5.50000% 17-01.11.25	2 710 000.00	2 490 476.45	0.08
USD VALVOLINE INC-144A 3.62500% 20-15.06.31	5 650 000.00	4 831 089.00	0.16
USD VALVOLINE INC-144A 4.25000% 20-15.02.30	534 000.00	530 427.17	0.02
USD VAREX IMAGING CORP-144A 7.87500% 20-15.10.27	1 590 000.00	1 615 614.90	0.06
USD VENTURE GLOBAL CALCASIEU PASS LLC-144A 3.87500% 21-15.08.29	1 700 000.00	1 519 397.44	0.05
USD VENTURE GLOBAL CALCASIEU PASS LLC-144A 4.12500% 21-15.08.31	835 000.00	738 408.03	0.03
USD VENTURE GLOBAL LNG INC-144A 8.12500% 23-01.06.28	1 120 000.00	1 131 971.27	0.04
USD VENTURE GLOBAL LNG INC-144A 9.50000% 23-01.02.29	1 420 000.00	1 508 095.38	0.05
USD VERDE PURCHASER LLC-144A 10.50000% 23-30.11.30	1 713 000.00	1 768 912.32	0.06
USD VERSCEND ESCROW CORP-144A 9.75000% 18-15.08.26	5 851 000.00	5 874 316.23	0.20
USD VERTIV GROUP CORP-144A 4.12500% 21-15.11.28	1 728 000.00	1 603 488.27	0.05
USD VIASAT INC-144A 6.50000% 20-15.07.28	200 000.00	154 362.00	0.01
USD VIAVI SOLUTIONS INC-144A 3.75000% 21-01.10.29	1 920 000.00	1 672 915.20	0.06
USD VICI PROPERTIES LP /VCI NTE CO INC-144A 4.62500% 22-15.06.25	1 830 000.00	1 802 943.45	0.06

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD VICTORIA ' S SECRET & CO-144A 4.62500% 21-15.07.29	1 900 000.00	1 606 409.91	0.05
USD VIDEOTRON LTD / VIDEOTRON LTEE-144A 3.62500% 21-15.06.29	2 245 000.00	2 048 450.25	0.07
USD VIPER ENERGY PARTNERS LP-144A 5.37500% 19-01.11.27	733 000.00	721 279.33	0.02
USD VISTAJET MALTA FIN PLC/XO MANAGE-144A 9.50000% 23-01.06.28	770 000.00	652 474.90	0.02
USD VISTAJET MALTA FINANCE PLC-144A 6.37500% 22-01.02.30	855 000.00	618 849.00	0.02
USD VISTAJET MALTA FINANCE-144A 7.87500% 22-01.05.27	1 914 000.00	1 598 630.22	0.05
USD VISTRA OPERATIONS CO LLC-144A 5.00000% 19-31.07.27	2 120 000.00	2 053 841.44	0.07
USD VISTRA OPERATIONS CO LLC-144A 7.75000% 23-15.10.31	2 270 000.00	2 358 064.65	0.08
USD VM CONSOLIDATED INC-144A 5.50000% 21-15.04.29	1 333 000.00	1 271 442.06	0.04
USD VMED O2 UK FINANCING I PLC-144A 4.75000% 21-15.07.31	2 455 000.00	2 200 196.54	0.07
USD WABASH NATIONAL CORP-144A 4.50000% 21-15.10.28	170 000.00	154 700.00	0.01
USD WATCO COS LLC / WATCO FINANCE CORP-144A 6.50000% 20-15.06.27	4 506 000.00	4 478 152.92	0.15
USD WEEKLEY HOMES LLC / WEEKLEY FIN-144A 4.87500% 20-15.09.28	1 975 000.00	1 840 731.66	0.06
USD WESCO DISTRIBUTION INC-144A 7.25000% 20-15.06.28	2 509 000.00	2 577 247.31	0.09
USD WHITE CAP BUYER LLC-144A 6.87500% 20-15.10.28	2 082 000.00	2 037 903.24	0.07
USD WILLIAMS SCOTSMAN INC-144A 6.12500% 20-15.06.25	824 000.00	821 940.00	0.03
USD WILLIAMS SCOTSMAN INC-144A 7.37500% 23-01.10.31	2 580 000.00	2 702 428.74	0.09
USD WINDSOR HOLDINGS III LLC-144A 8.50000% 23-15.06.30	4 786 000.00	4 927 207.97	0.17
USD WINDSTREAM ESCROW LLC/FINANCE CORP-144A 7.75000% 20-15.08.28	2 527 000.00	2 215 582.63	0.08
USD WMG ACQUISITION CORP-144A 3.00000% 20-15.02.31	1 568 000.00	1 328 880.00	0.05
USD WMG ACQUISITION CORP-144A 3.75000% 21-01.12.29	1 275 000.00	1 148 838.75	0.04
USD WR GRACE HOLDINGS LLC-144A 5.62500% 21-15.08.29	5 201 000.00	4 585 877.73	0.16
USD WR GRACE HOLDINGS LLC-144A 4.87500% 21-15.06.27	754 000.00	720 995.43	0.02
USD WR GRACE HOLDINGS LLC-144A 7.37500% 23-01.03.31	494 000.00	503 297.08	0.02
USD WYNDHAM DESTINATIONS INC-144A 6.62500% 20-31.07.26	1 102 000.00	1 112 953.88	0.04
USD WYNDHAM HOTELS & RESORTS INC-144A 4.37500% 20-15.08.28	2 337 000.00	2 181 948.23	0.07
USD WYNN RESORTS FINANCE LLC / CAP CO-144A 5.12500% 19-01.10.29	623 000.00	588 552.15	0.02
USD WYNN RESORTS FINANCE/WYNN RESORTS-144A 7.12500% 23-15.02.31	490 000.00	505 302.21	0.02
USD XEROX HOLDINGS CORP-144A 5.50000% 20-15.08.28	8 830 000.00	8 044 602.40	0.27
USD XHR LP-144A 4.87500% 21-01.06.29	1 439 000.00	1 327 204.09	0.05
USD XHR LP-144A 6.37500% 20-15.08.25	2 460 000.00	2 460 810.52	0.08
USD YUM BRANDS INC-144A 4.75000% 19-15.01.30	2 940 000.00	2 822 899.80	0.10
USD ZAYO GROUP HOLDINGS INC-144A 4.00000% 20-01.03.27	3 562 000.00	2 708 661.28	0.09
USD ZAYO GROUP HOLDINGS INC-144A 6.12500% 20-01.03.28	2 750 000.00	1 831 197.50	0.06
USD ZOOMINFO TECHNOLOGIES LLC-144A 3.87500% 21-01.02.29	7 127 000.00	6 332 417.89	0.22
米ドル合計		1 311 402 888.56	44.65
ノート、固定利付債合計		1 311 402 888.56	44.65
中期債券、固定利付債			
USD			
USD INTESA SANPAOLO SPA-144A-SUB 5.01700% 14-26.06.24	2 552 000.00	2 535 902.47	0.09
USD INTESA SANPAOLO SPA-144A-SUB 5.71000% 16-15.01.26	5 434 000.00	5 415 613.85	0.19
USD MINERAL RESOURCES LTD-144A 8.00000% 22-01.11.27	670 000.00	684 425.94	0.02
USD MINERAL RESOURCES LTD-144A 8.50000% 22-01.05.30	1 215 000.00	1 250 003.40	0.04
米ドル合計		9 885 945.66	0.34
中期債券、固定利付債合計		9 885 945.66	0.34
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	581 447.88	0.02
米ドル合計		581 447.88	0.02
中期債券、変動利付債合計		581 447.88	0.02
債券、固定利付債			
EUR			
EUR EMERALD DEBT MERGER SUB LLC-REG-S 6.37500% 23-15.12.30	2 180 000.00	2 486 412.04	0.08
EUR PANTHER BF AGGR 2/PANTHER FIN CO-REG-S 4.37500% 19-15.05.26	785 000.00	844 407.71	0.03
ユーロ合計		3 330 819.75	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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
GBP			
GBP PINEWOOD FINANCE-REG-S 3.62500% 21-15.11.27	375 000.00	440 214.15	0.02
英債券合計		440 214.15	0.02
USD			
USD ADIENT GLOBAL HOLDINGS LTD-144A 7.00000% 23-15.04.28	764 000.00	781 099.85	0.03
USD CAESARS ENTERTAINMENT INC-144A 7.00000% 23-15.02.30	2 068 000.00	2 125 178.13	0.07
USD CVR ENERGY INC-144A 5.75000% 20-15.02.28	2 596 000.00	2 398 236.72	0.08
USD DELEK LOGISTICS PARTNERS LP 6.75000% 18-15.05.25	2 163 000.00	2 139 775.48	0.07
USD EMERALD DEBT MERGER SUB LLC-144A 6.62500% 23-15.12.30	2 605 000.00	2 631 232.35	0.09
USD HESS MIDSTREAM OPERATIONS-144A 5.50000% 22-15.10.30	3 370 000.00	3 294 175.00	0.11
USD HUDBAY MINERALS INC-144A 6.12500% 20-01.04.29	985 000.00	970 225.00	0.03
USD RAND PARENT LLC-144A 8.50000% 23-15.02.30	1 562 000.00	1 546 482.15	0.05
USD TENET HEALTHCARE CORP 4.87500% 19-01.01.26	2 228 000.00	2 208 185.95	0.08
USD WARRIOR MET COAL INC-144A 7.87500% 21-01.12.28	797 000.00	803 222.90	0.03
米ドル合計		18 897 813.53	0.64
債券、固定利付債合計		22 668 847.43	0.77
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		1 344 539 129.53	45.78
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	58 608.00	1 592 203.54	0.05
USD REORGANIZED ISA S.A.	1 600 000.00	16 000.00	0.00
ルクセンブルグ合計		1 608 203.54	0.05
株式合計		1 608 203.54	0.05
ノート、固定利付債			
EUR			
EUR SUMMER BIDCO BV-REG-S (PIK)10.00000% 24-15.02.29	490 000.00	536 786.73	0.02
ユーロ合計		536 786.73	0.02
USD			
USD CAESARS ENTERTAINMENT INC-144A 6.50000% 24-15.02.32	716 000.00	723 919.79	0.02
USD FERTITTA ENTERTAINMENT LLC-144A 6.75000% 22-15.01.30	1 325 000.00	1 191 237.28	0.04
USD FREEDOM MORTGAGE HOLDINGS LLC-144A 9.25000% 24-01.02.29	902 000.00	913 365.20	0.03
USD HILCORP ENERGY I LP / HILCORP FINA-144A 6.00000% 21-01.02.31	44 000.00	42 241.83	0.00
USD VIRGIN MEDIA FINANCE PLC-144A 5.00000% 20-15.07.30	838 000.00	748 425.95	0.03
米ドル合計		3 619 190.05	0.12
ノート、固定利付債合計		4 155 976.78	0.14
債券、固定利付債			
USD			
USD CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC-144A 10.87500% 23-15.01.32	450 000.00	470 739.60	0.02
米ドル合計		470 739.60	0.02
債券、固定利付債合計		470 739.60	0.02
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されて いない譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		6 234 919.92	0.21

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / 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	ACRISURE LLC / ACRISURE FINANCE IN-144A 8.25000% 24-01.02.29	2 429 000.00	2 435 225.53 0.08
USD	ACUSHNET CO-144A 7.37500% 23-15.10.28	90 000.00	93 606.30 0.00
USD	ANTERO MIDSTREAM PARTNERS LP/ANT-144A 6.62500% 24-01.02.32	2 035 000.00	2 022 545.80 0.07
USD	CARNIVAL CORP-144A 7.00000% 23-15.08.29	2 059 000.00	2 131 065.00 0.07
USD	CIVITAS RESOURCES INC-144A 8.37500% 23-01.07.28	1 276 000.00	1 341 984.52 0.05
USD	CIVITAS RESOURCES INC-144A 8.62500% 23-01.11.30	337 000.00	359 430.57 0.01
USD	CSC HOLDINGS LLC-144A 11.75000% 24-31.01.29	3 115 000.00	3 163 999.66 0.11
USD	EG GLOBAL FINANCE PLC-144A 12.00000% 23-30.11.28	1 466 000.00	1 549 532.68 0.05
USD	ENERSYS-144A 6.62500% 24-15.01.32	1 811 000.00	1 832 046.72 0.06
USD	ENOVA INTERNATIONAL INC-144A 11.25000% 23-15.12.28	200 000.00	209 150.00 0.01
USD	GLOBAL PARTNERS LP / GLP FIN CORP-144A 8.25000% 24-15.01.32	45 000.00	46 158.39 0.00
USD	HILTON GRAND VACATIONS BORROWER ES-144A 6.62500% 24-15.01.32	580 000.00	581 222.00 0.02
USD	HUB INTERNATIONAL LTD-144A 7.37500% 24-31.01.32	3 185 000.00	3 261 745.09 0.11
USD	LIFEPOINT HEALTH INC-144A 11.00000% 23-15.10.30	700 000.00	744 851.32 0.03
USD	MATADOR RESOURCES CO-144A 6.87500% 23-15.04.28	724 000.00	741 390.48 0.03
USD	NATIONSTAR MORTGAGE HOLDINGS INC-144A 7.12500% 24-01.02.32	3 903 000.00	3 871 153.86 0.13
USD	NEWMARK GROUP INC-144A 7.50000% 24-12.01.29	638 000.00	651 391.62 0.02
USD	NEXTERA ENERGY OPERATING PARTNERS-144A 7.25000% 23-15.01.29	1 920 000.00	1 977 607.68 0.07
USD	NGL ENERGY OPERATING LLC-144A 8.12500% 24-15.02.29	904 000.00	908 545.82 0.03
USD	NGL ENERGY OPERATING LLC-144A 8.37500% 24-15.02.32	2 241 000.00	2 257 512.96 0.08
USD	NOBLE FINANCE II LLC-144A 8.00000% 23-15.04.30	805 000.00	835 947.42 0.03
USD	NORTHERN OIL & GAS INC-144A 8.75000% 23-15.06.31	3 955 000.00	4 133 594.36 0.14
USD	PIKE CORP-144A 8.62500% 23-31.01.31	1 558 000.00	1 648 230.01 0.06
USD	SITIO ROYALTIES OPERATING-144A 7.87500% 23-01.11.28	748 000.00	767 055.30 0.03
USD	TALOS PRODUCTION INC-144A 9.00000% 24-01.02.29	250 000.00	253 335.50 0.01
USD	TALOS PRODUCTION INC-144A 9.37500% 24-01.02.31	669 000.00	684 071.61 0.02
USD	US FOODS INC-144A 7.25000% 23-15.01.32	1 395 000.00	1 461 262.50 0.05
USD	VT TOPCO INC-144A 8.50000% 23-15.08.30	1 794 000.00	1 874 855.58 0.06
USD	WAND NEWCO 3 INC-144A 7.62500% 24-30.01.32	1 791 000.00	1 849 744.80 0.06
USD	XPO INC-144A 7.12500% 23-01.02.32	1 583 000.00	1 613 683.29 0.05
USD	XPO INC-144A 7.12500% 23-01.06.31	2 027 000.00	2 075 810.16 0.07
米ドル合計			47 377 756.53 1.61
ノート、固定利付債合計			47 377 756.53 1.61
債券、固定利付債			
USD			
USD	ARETEC ESCROW ISSUER 2 INC-144A 10.00000% 23-15.08.30	1 041 000.00	1 124 303.08 0.04
USD	MERLIN ENTERTA GRP US HOLDINGS INC-144A 7.37500% 24-15.02.31	550 000.00	550 747.14 0.02
USD	OUTFRNT MEDIA CAP LLC/OUTFRONT CAP-144A 7.37500% 23-15.02.31	35 000.00	36 664.95 0.00
米ドル合計			1 711 715.17 0.06
債券、固定利付債合計			1 711 715.17 0.06
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			49 089 471.70 1.67
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			
USD			
USD	INTELSAT EMERGENCE SA CALL WARRANT 77.220000 17.02.27	1 368.00	513.00 0.00
ルクセンブルグ合計			513.00 0.00

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
イギリス			
USD NOBLE CORP PLC CALL WARRANT 19.27000 23-04.02.28	462.00	12 045.26	0.00
USD NOBLE CORP PLC CALL WARRANT 23.13000 22-04.02.28	462.00	10 070.54	0.00
イギリス合計		22 115.80	0.00
株式に係るワラント債合計		22 628.80	0.00
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されて いない派生商品合計		22 628.80	0.00
投資有価証券合計		2 840 602 945.21	96.72

派生商品

公認の証券取引所に上場されている派生商品

債券に係る金融先物

EUR EURO-BUND FUTURE 07.03.24	15.00	34 379.81	0.00
EUR EURO-BOBL FUTURE 07.03.24	-117.00	-115 653.04	0.00
EUR EURO-SCHATZ FUTURE 07.03.24	151.00	23 783.44	0.00
EUR EURO-BUXL FUTURE 07.03.24	1.00	5 322.62	0.00
USD US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 19.03.24	26.00	146 745.00	0.00
USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 19.03.24	-216.00	-257 416.09	-0.01
USD US LONG BOND FUTURE 19.03.24	5.00	-187.50	0.00
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.03.24	-383.00	-477 698.47	-0.02
USD US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 28.03.24	382.00	201 485.02	0.01
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 28.03.24	-628.00	-356 304.84	-0.01
債券に係る金融先物合計		-795 544.05	-0.03
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		-795 544.05	-0.03

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 BC/IBOXX EUR LIQUID HY TR EQS REC PERF 23-20.03.24	2 700 000.00	141 250.10	0.01
EUR BC/IBOXX EUR LIQUID HY TR EQS PAY 3ML 23-20.03.24			
EUR BC/IBOXX EUR LIQUID HY TR EQS REC PERF 23-20.03.24	2 700 000.00	111 281.75	0.00
EUR BC/IBOXX EUR LIQUID HY TR EQS PAY 3ML 23-20.03.24			
EUR BC/IBOXX EUR LIQUID HY TR EQS REC PERF 23-20.03.24	2 700 000.00	124 159.36	0.01
EUR BC/IBOXX EUR LIQUID HY TR EQS PAY 3ML 23-20.03.24			
EUR JP/IBOXX EUR LIQUID HY TR EQS REC PERF 23-20.03.24	2 700 000.00	64 737.14	0.00
EUR JP/IBOXX EUR LIQUID HY TR EQS PAY 3ML 23-20.03.24			
EUR BNP/IBOXX EUR LIQUID HY INDEX SWAP 23-20.03.24	2 700 000.00	62 606.76	0.00
EUR BNP/IBOXX EUR LIQUID HY INDEX SWAP 23-20.03.24			
EUR BNP/IBOXX EUR LIQUID HY TR EQS REC PERF 23-20.06.24	2 800 000.00	10 691.31	0.00
EUR BNP/IBOXX EUR LIQUID HY INDEX SWAP 23-20.06.24			
指数に係るスワップおよびフォワード・スワップ合計		514 726.42	0.02

クレジット・デフォルト・スワップ*

EUR BARCLAYS/INTL CONSOLIDATED AIRL CDS REC 5.00000% 24-20.12.28	1 400 000.00	190 480.24	0.01
クレジット・デフォルト・スワップ合計		190 480.24	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		705 206.66	0.03
派生商品合計		-90 337.39	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 - ハイ・イールド

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄				数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
先渡為替契約						
購入通貨	購入額	売却通貨	売却額	満期日		
USD	39 765 852.50	EUR	36 875 000.00	7.2.2024	-297 359.24	-0.01
USD	13 386 448.80	GBP	10 800 000.00	7.2.2024	-367 279.19	-0.01
USD	456 224.75	EUR	425 000.00	7.2.2024	-5 520.74	0.00
USD	1 259 289.80	EUR	1 175 000.00	7.2.2024	-17 300.68	0.00
USD	720 688.86	GBP	580 000.00	7.2.2024	-17 937.27	0.00
USD	7 090 843.20	GBP	5 600 000.00	22.2.2024	-41 664.70	0.00
USD	45 557 067.60	EUR	41 800 000.00	22.2.2024	111 639.92	0.00
USD	181 183 905.84	EUR	167 123 627.90	14.2.2024	-448 299.60	-0.02
USD	388 780.71	EUR	359 568.97	14.2.2024	-2 003.68	0.00
USD	1 137 102.75	EUR	1 050 000.00	22.2.2024	-4 469.00	0.00
USD	2 164 084.00	EUR	2 000 000.00	22.2.2024	-10 338.38	0.00
USD	673 718.75	EUR	625 000.00	22.2.2024	-5 788.24	0.00
USD	1 162 050.28	EUR	1 075 000.00	7.2.2024	-5 894.20	0.00
USD	540 757.00	EUR	500 000.00	7.2.2024	-2 472.99	0.00
USD	1 941 420.45	EUR	1 775 000.00	7.2.2024	12 953.99	0.00
USD	2 599 064.39	EUR	2 376 506.90	14.2.2024	16 244.74	0.00
USD	519 293.70	GBP	410 000.00	6.3.2024	-2 960.02	0.00
USD	1 206 592.80	CHF	1 041 000.00	22.2.2024	-9 649.85	0.00
USD	17 563 175.65	EUR	16 025 000.00	6.3.2024	130 537.35	0.00
USD	1 978 808.40	EUR	1 800 000.00	6.3.2024	20 696.14	0.00
EUR	949 963.86	USD	1 045 557.77	14.2.2024	-13 124.28	0.00
EUR	30 648.82	USD	33 850.82	14.2.2024	-541.27	0.00
USD	498 051.45	EUR	450 000.00	7.2.2024	9 144.46	0.00
USD	1 081 486.84	GBP	850 244.22	10.4.2024	-1 735.62	0.00
USD	712 607.84	GBP	560 000.00	10.4.2024	-839.62	0.00
USD	92 518.35	CHF	78 000.00	6.3.2024	1 254.55	0.00
USD	52 859 244.53	EUR	48 025 000.00	10.4.2024	539 478.25	0.02
USD	812 056.22	EUR	740 835.28	14.2.2024	6 906.48	0.00
USD	1 089 767.26	EUR	995 383.96	14.2.2024	7 970.59	0.00
CHF	401 777 240.95	USD	468 605 000.00	22.2.2024	807 697.53	0.03
EUR	898 863 030.95	USD	980 238 000.00	22.2.2024	-2 984 055.78	-0.10
SGD	9 780 735.69	USD	7 309 000.00	22.2.2024	17 009.64	0.00
JPY	1 168 429 482.00	USD	8 007 000.00	22.2.2024	12 816.19	0.00
GBP	35 290 321.71	USD	44 625 000.00	22.2.2024	322 946.12	0.01
USD	200 000.00	JPY	29 163 040.00	22.2.2024	-168.02	0.00
USD	190 154.52	GBP	150 000.00	29.2.2024	-906.68	0.00
USD	217 770 980.00	EUR	200 000 000.00	29.2.2024	259 089.00	0.01
USD	59 914 569.00	EUR	55 000 000.00	29.2.2024	98 798.97	0.00
EUR	972 394.73	USD	1 059 959.85	14.2.2024	-3 148.19	0.00
USD	1 119 464.22	EUR	1 027 739.50	14.2.2024	2 503.12	0.00
USD	63 757 798.78	EUR	58 325 000.00	24.4.2024	179 813.10	0.01
USD	8 447 354.88	GBP	6 640 000.00	24.4.2024	-12 687.97	0.00
USD	1 800 000.00	EUR	1 649 255.57	29.2.2024	6 336.51	0.00
USD	3 180 438.00	GBP	2 500 000.00	29.2.2024	-3 915.40	0.00
USD	1 656 568.57	EUR	1 529 841.12	14.2.2024	-6 083.32	0.00
USD	18 788 999.11	GBP	14 793 120.00	29.2.2024	-53 609.67	0.00
USD	383 753 208.63	EUR	353 989 130.00	29.2.2024	-1 231 016.67	-0.04
USD	800 000.00	EUR	738 414.05	29.2.2024	-3 069.18	0.00
USD	5 418 041.00	EUR	5 000 000.00	29.2.2024	-19 756.28	0.00
USD	456 517.44	GBP	360 000.00	24.4.2024	-2 159.58	0.00
EUR	1 197 416.16	USD	1 300 000.00	5.2.2024	693.30	0.00
USD	1 300 000.00	EUR	1 196 668.84	22.2.2024	-1 031.75	0.00
先渡為替契約合計					-3 012 257.11	-0.10
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					85 608 932.08	2.92
当座借越およびその他の短期負債					-771 577.77	-0.03
その他の資産および負債					14 493 075.39	0.49
純資産総額					2 936 830 780.41	100.00

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

2024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2024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
2,479,110.7860 (11,042)	6,058,097.6940 (48,183)	12,969,948.5760 (103,890)

(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
2,150 (2,150)	31,103 (48,803)	123,999 (123,999)

(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
3,272,477.4760 (18,045)	5,375,571.8170 (68,373)	14,027,729.9410 (134,238)

(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
257 (257)	43,426 (69,451)	157,496 (157,496)

(ハイ・イールド)

(クラスF - a c c 投資証券)

販売口数	買戻し口数	発行済口数
4,675,627.9330 (12,493)	2,070,045.9990 (45,126)	9,306,342.3370 (95,381)

(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
0 (0)	28,479 (43,512)	107,783 (107,783)

(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

第二部 ファンド情報

第1 ファンドの状況

4 手数料等及び税金

(4) その他の手数料等

<訂正前>

(前略)

管理会社の報酬方針

(中略)

関連する開示は、UCITS指令2014/91/EUの規定に従い、管理会社の年次報告書において行うものとする。

投資家は、報酬方針に関する詳細(報酬および給付金の算定方法の概要、報酬および給付金を付与する責任を負う者の資格(報酬委員会(該当する場合。))の構成を含む。)を含むが、それらに限らない。)を、https://www.ubs.com/lu/en/asset_management/investor_information.htmlで閲覧することができる。

かかる文書の書面による写しは、請求することにより管理会社から無料で入手できる。

<訂正後>

(前略)

管理会社の報酬方針

(中略)

関連する開示は、UCITS指令2014/91/EUの規定に従い、管理会社の年次報告書において行うものとする。

投資家は、報酬方針に関する詳細(報酬および給付金の算定方法の概要、報酬および給付金を付与する責任を負う者の資格(報酬委員会(該当する場合。))の構成を含む。)を含むが、それらに限らない。)を、<https://www.ubs.com/global/en/assetmanagement/capabilities/white-labelling/fund-management-companyservices/fml-procedures.html>で閲覧することができる。

かかる文書の書面による写しは、請求することにより管理会社から無料で入手できる。

第三部 外国投資法人の詳細情報

第3 管理及び運営

2 利害関係人との取引制限

<訂正前>

(前略)

管理会社が相当な注意および最善の努力を払ったとしても、利益相反を管理するために管理会社が講じる組織的・事務的な措置が、本投資法人またはその投資主の利益を損なうリスクを回避するとの合理的な信頼を確保するには不十分であるというリスクがある。このような場合、かかる軽減されない利益相反および下された決定が、管理会社の以下のウェブサイトにおいて投資家に報告される。

<https://www.ubs.com/global/en/legalinfo2/luxembourg.html>

各情報は、管理会社の登録事務所においても無料で入手可能である。

(後略)

<訂正後>

(前略)

管理会社が相当な注意および最善の努力を払ったとしても、利益相反を管理するために管理会社が講じる組織的・事務的な措置が、本投資法人またはその投資主の利益を損なうリスクを回避するとの合理的な信頼を確保するには不十分であるというリスクがある。このような場合、かかる軽減されない利益相反および下された決定が、管理会社の以下のウェブサイトにおいて投資家に報告される。

<https://www.ubs.com/global/en/assetmanagement/capabilities/white-labeling/fund-management-companyservices/fml-procedures.html>

各情報は、管理会社の登録事務所においても無料で入手可能である。

(後略)

第4 関係法人の状況

2 その他の関係法人の概況

(2) 関係業務の概要

<訂正前>

UBSヨーロッパSE ルクセンブルグ支店

(中略)

終了

本投資法人および保管受託銀行は、3か月前に書留郵便にて通知を行うことにより、いつでも保管受託契約を終了することができる。保管受託契約は、例えば一方の当事者によるその義務の重大な違反が生じた場合等の一定の状況において、これより短い期間による通知をもって終了することもできる。後任の預託機関の任命(保管受託契約の終了が効力を発生してから少なくとも2か月以内に行わなければならない。)までの間、保管受託銀行は本投資法人の投資主の権利の適切な保護を確保するために必要なあらゆる措置を講ずるものとする。本投資法人が期限内にかかる後任の預託機関を指名しない場合、保管受託銀行は、当該状況についてCSSFに通知することができる。

保管受託銀行は、本投資法人の業務事項、組織または運営と直接的または間接的な関係を持たず、英文目論見書の内容に対して責任を有していないことから、英文目論見書に含まれる情報の正確性または本投資法人の仕組みおよび投資対象の有効性に対して責任を負わない。保管受託銀行は、意思決定における裁量を有さず本投資法人の投資対象に関する助言義務も負わず、本投資法人の投資対象の運用に干渉することを禁止されている。保管受託銀行は本投資法人に関して投資の意思決定上の役割を果たしていない。

保管受託銀行が投資者のデータを受領する場合、当該データが保管受託銀行によりアクセス可能となる可能性、ならびに/または保管受託銀行に代わり業務提供者としての権限において現在もしくは将来的にUBSグループ・エイ・ジーが支配権を有する別の事業体および第三者としての業務提供者に対して移転される可能性がある。UBSのパートナーズは、EUまたはEU外の地域の国を所在地としているものの(欧州委員会の充分性の認定を基準とする)適切な水準のデータ保護を提供している国(スイス等)を本拠地としている。ポーランド、英国、スイス、モナコおよびドイツに拠点を置くUBSの法人ならびに(オーストリア、フランス、イタリア、スペイン、デンマーク、スウェーデン、スイスおよびポーランドにある)UBSヨーロッパSEの他の支店が、ファイナンス、オペレーション、バックオフィス、クレジット、リスクもしくはその他のサポートまたはコントロール機能にリンクする一連のプロセスを統一および/または一元化するために一定のインフラストラクチャー(テレコミュニケーション、ソフトウェア等)および/または他の業務をアウトソースすることを目的として、データを利用することがある。保管受託銀行によるアウトソースおよび個人データな取扱いに関するさらに詳しい情報は<https://www.ubs.com/lux-europe-se> から入手することができる。

ノーザン・トラスト・グローバル・サービスS E

(後略)

<訂正後>

UBSヨーロッパSE ルクセンブルグ支店

(中略)

終了

本投資法人および保管受託銀行は、3か月前に書留郵便にて通知を行うことにより、いつでも保管受託契約を終了することができる。保管受託契約は、例えば一方の当事者によるその義務の重大な違反が生じた場合等の一定の状況において、これより短い期間による通知をもって終了することもできる。通知期間の満了時より前に新しい受託会社が任命されない場合、保管受託銀行は本投資法人の投資主の権利の適切な保護を確保するために必要なあらゆる措置(ファンドの清算終了時までにはファンドの異なる資産を安全に保全するために必要なすべての口座を維持および開設する義務を含む。)を講ずるものとする。

保管受託銀行は、本投資法人の業務事項、組織または運営と直接的または間接的な関係を持たず、英文目論見書の内容に対して責任を有していないことから、英文目論見書に含まれる情報の正確性または本投資法人の仕組みおよび投資対象の有効性に対して責任を負わない。保管受託銀行は、意思決定における裁量を有さず本投資法人の投資対象に関する助言義務も負わず、本投資法人の投資対象の運用に干渉することを禁止されている。保管受託銀行は本投資法人に関して投資の意思決定上の役割を果たしていない。

アウトソーシングおよびデータ保護

保管受託銀行による投資家のデータのアウトソーシングおよび見込まれるプロセッシングに関する情報は以下のサイトから入手できる。

<https://www.ubs.com/lu/en/wealth-management/about-us/europe-se.html>.

ノーザン・トラスト・グローバル・サービスS E

(後略)