

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 令和2年4月30日

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

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

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

【代理人の氏名又は名称】 弁護士 三 浦 健
弁護士 大 西 信 治

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

【事務連絡者氏名】 弁護士 三 浦 健
弁護士 大 西 信 治

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

【電話番号】 03 (6212) 8316

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

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

エマージング・マーケット・デッド

クラスF - a c c 投資証券：13億4,700万米ドル（約1,476億円）を上限とする。

クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券

1,036億1,000万円を上限とする。

U S マルチ・クレジット

クラスF - a c c 投資証券：15億3,440万米ドル（約1,681億円）を上限とする。

クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券

1,031億7,000万円を上限とする。

ハイ・イールド

クラスF - a c c 投資証券：12億8,260万米ドル（約1,405億円）を上限とする。

クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券

1,028億8,000万円を上限とする。

(注1) 上限見込額は、便宜上、各サブ・ファンドの投資証券の2019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134.70米ドル（約14,758円）、エマージング・マーケット・デッドのクラスF - a c c 円ヘッジ投資証券については10,361円、U S マルチ・クレジットのクラスF - a c c 投資証券については153.44米ドル（約16,811円）、U S マルチ・クレジットのクラスF - a c c 円ヘッジ投資証券については10,317円、ハイ・イールドのクラスF - a c c 投資証券については128.26米ドル（約14,052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10,288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、2019年11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＝109.56円）による。

【縦覧に供する場所】

該当事項なし

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出しましたので、令和2年1月16日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報により訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

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

2【訂正箇所および訂正事項】

半期報告書に係る訂正

半期報告書を提出したことによる原届出書の訂正内容は、以下のとおりです。

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

原届出書		半期報告書		訂正の方法
第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 1 外国投資法人の概況	(1) 主要な経営指標等の推移	1 外国投資法人の概況	(1) 主要な経営指標等の推移	追加 または 更新
	(5) 外国投資法人の出資総額		(2) 外国投資法人の出資総額	追加
	(6) 主要な投資主の状況		(3) 主要な投資主の状況	更新
3 投資リスク		2 外国投資法人の運用状況	(3) 投資リスク	追加 または 更新
5 運用状況	(1) 投資状況	2 外国投資法人の運用状況	(1) 投資状況	更新
	(3) 運用実績		(2) 運用実績	追加 または 更新
第2 財務ハイライト情報		4 外国投資法人の経理状況	(1) 資産及び負債の状況 「純資産計算書」 「運用計算書」 「重要な会計方針の要約」の注記	追加
第三部 外国投資法人の詳細情報 第1 外国投資法人の追加情報 2 役員の状況		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・クレジットおよびハイ・イールド (以下、マルチ・マネージャー・アクセス を「本投資法人」、エマージング・マーケット・デッド、U S マルチ・クレジットおよび/またはハイ・イールドを個別にまたは総称して「ファンド」または「サブ・ファンド」ということがある。) の概況は以下のとおりである。

(1) 主要な経営指標等の推移

(エマージング・マーケット・デッド)

(別段の記載がない限り金額は米ドル表示)

	2018年1月末日 に終了する 中間会計年度末	2018年7月末日 に終了する 会計年度末	2019年1月末日 に終了する 中間会計年度末	2019年7月末日 に終了する 会計年度末	2020年1月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ^(1)	247,749,693.78	- 230,820,085.68	- 1,772,841.39	262,426,023.02	205,152,492.83
(b) 経常利益金額 または経常損失金額	247,749,693.78	- 230,820,085.68	- 1,772,841.39	262,426,023.02	205,152,492.83
(c) 当期純利益金額 または当期純損失金額	247,749,693.78	- 230,820,085.68	- 1,772,841.39	262,426,023.02	205,152,492.83
(d) 出資総額 ^(2)	4,325,634,831.02	4,860,620,178.24	4,815,514,601.02	6,089,637,256.08	6,485,463,790.78
(e) 発行済投資口総数 (クラスF - a c c 投資証券) (クラスF - a c c 円ヘッジ 投資証券)	10,982,002.6930口 -	13,018,469.5970口 -	12,457,206.6330口 -	14,193,122.2020口 77,455口	15,882,703.0560口 127,510口
(f) 純資産額	4,325,634,831.02	4,860,620,178.24	4,815,514,601.02	6,089,637,256.08	6,485,463,790.78
(g) 資産総額	4,573,283,096.09	4,899,019,238.50	5,643,466,678.05	6,156,363,434.31	6,664,804,223.36
(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)	126.40 -	122.25 -	124.82 -	134.28 10,399円	138.80 10,611円
(i) 1口当たり当期 純利益金額または 当期純損失金額 (クラスF - a c c 投資証券) (クラスF - a c c 円ヘッジ 投資証券)	4.41 -	- 1.05 -	3.00 -	11.18 4.21	4.60 2.34
(j) 分配総額	5,994,441.30	5,994,441.30	9,576,575.17	9,576,575.17	12,736,384.92
(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	94.58%	99.22%	85.33%	98.92%	97.31%
(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)	8.95% -	0.29% -	- 1.25% -	9.84% 3.99%	11.20% 6.11%

(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 ）

（別段の記載がない限り金額は米ドル表示）

	2018年１月末日 に終了する 中間会計年度末	2018年７月末日 に終了する 会計年度末	2019年１月末日 に終了する 中間会計年度末	2019年７月末日 に終了する 会計年度末	2020年１月末日 に終了する 中間会計年度末
（ a ）営業収益 ^{（ 1 ）}	88,656,694.35	- 149,044,227.76	39,382,289.75	212,113,520.97	202,052,254.46
（ b ）経常利益金額 または経常損失金額	88,656,694.35	- 149,044,227.76	39,382,289.75	212,113,520.97	202,052,254.46
（ c ）当期純利益金額 または当期純損失金額	88,656,694.35	- 149,044,227.76	39,382,289.75	212,113,520.97	202,052,254.46
（ d ）出資総額 ^{（ 2 ）}	4,738,767,059.74	4,684,064,365.96	4,554,018,506.46	5,219,858,520.58	5,671,072,733.01
（ e ）発行済投資口総数 （クラスＦ - a c c 投資証券） （クラスＦ - a c c 円ヘッジ 投資証券）	14,967,666.2130口 -	14,919,985.7850口 -	14,133,543.7510口 -	14,765,747.6220口 278,717口	15,327,746.8270口 327,767口
（ f ）純資産額	4,738,767,059.74	4,684,064,365.96	4,554,018,506.46	5,219,858,520.58	5,671,072,733.01
（ g ）資産総額	4,916,284,774.89	4,710,062,577.57	4,564,362,055.62	5,246,548,649.35	5,731,345,460.24
（ 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）	140.26 -	139.19 -	142.56 -	150.44 10,183円	156.50 10,461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）	- 0.08 -	- 1.16 -	3.35 -	10.91 2.35	5.97 2.56
（ j ）分配総額	3,881,773.83	3,881,773.83	6,219,391.52	6,219,391.52	7,699,227.71
（ k ）１口当たり分配金額	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
（ l ）自己資本比率	96.39%	99.45%	99.77%	99.49%	98.95%
（ 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）	2.75% -	- 0.79% -	1.64% -	8.08% 1.83%	9.78% 4.61%

(ハイ・イールド)

(別段の記載がない限り金額は米ドル表示)

	2018年1月末日 に終了する 中間会計年度末	2018年7月末日 に終了する 会計年度末	2019年1月末日 に終了する 中間会計年度末	2019年7月末日 に終了する 会計年度末	2020年1月末日 に終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	156,161,105.16	- 21,517,501.04	- 61,547,460.22	108,749,340.73	145,821,659.70
(b) 経常利益金額 または経常損失金額	156,161,105.16	- 21,517,501.04	- 61,547,460.22	108,749,340.73	145,821,659.70
(c) 当期純利益金額 または当期純損失金額	156,161,105.16	- 21,517,501.04	- 61,547,460.22	108,749,340.73	145,821,659.70
(d) 出資総額 ⁽²⁾	3,496,170,503.17	3,391,096,914.21	4,192,199,174.56	4,507,826,074.78	4,460,382,133.69
(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)	9,266,454.6250口 -	9,338,538.8570口 -	11,349,743.1350口 -	11,444,078.7390口 77,644口	11,932,941.4770口 101,356口
(f) 純資産額	3,496,170,503.17	3,391,096,914.21	4,192,199,174.56	4,507,826,074.78	4,460,382,133.69
(g) 資産総額	3,676,148,206.18	3,414,008,751.29	4,233,420,506.64	4,598,888,147.24	4,536,686,484.21
(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)	118.04 -	118.11 -	119.17 -	126.70 10,229円	131.17 10,460円
(i) 1口当たり当期 純利益金額または 当期純損失金額 (クラスF - a c c 投資証券) (クラスF - a c c 円ヘッジ 投資証券)	2.57 -	2.64 -	0.75 -	8.22 2.75	4.34 2.07
(j) 分配総額	7,276,818.73	7,276,818.73	6,428,148.63	6,428,148.63	8,555,219.29
(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	95.10%	99.33%	98.69%	98.02%	98.32%
(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)	7.61% -	2.37% -	0.96% -	7.27% 2.29%	10.07% 4.60%

(2) 外国投資法人の出資総額

2020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		
2020年2月末日現在	6,181,847,696.15	676,480	クラスF - a c c 投資証券	15,717,637.0410
			クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券	130,350

(U S マルチ・クレジット)

	出資総額		発行済投資証券総数 (口)	
	米ドル	百万円		
2020年2月末日現在	5,737,356,394.27	627,839	クラスF - a c c 投資証券	15,465,116.8610
			クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券	336,407

(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		
2020年2月末日現在	4,252,889,667.07	465,394	クラスF - a c c 投資証券	11,797,053.6670
			クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券	103,636

(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) 役員の状況

(2020年 2 月末日現在)

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

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

(5) その他

a . 定款の変更

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

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

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

b . 事業譲渡または事業譲受

投資法人、サブ・ファンドおよび投資証券クラスの解散および合併

本投資法人、サブ・ファンドおよび投資証券クラスの解散

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

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

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

場合、取締役会は、一もしくは複数のサブ・ファンドの投資証券クラスの清算を要求することができる。

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

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

サブ・ファンド同士またはサブ・ファンドとその他のUCIの合併

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

合併の決定は、ルクセンブルグの日刊紙に公告するか書留郵便により、投資主に通知される。かかる決定の公告から30日以内に投資主は保有する投資証券の一部または全部を、「有価証券報告書 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)

(2020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	436,644,769.18	6.94
	ケイマン諸島	317,867,831.24	5.05
	オランダ	250,156,073.08	3.98
	コロンビア	223,920,714.22	3.56
	インドネシア	223,705,913.33	3.56
	トルコ	219,479,621.32	3.49
	中国	193,755,703.59	3.08
	ウクライナ	181,392,325.09	2.88
	ドミニカ共和国	167,577,933.48	2.66
	ブラジル	163,042,756.34	2.59
	香港	152,417,932.20	2.42
	アルゼンチン	128,706,820.44	2.05
	アラブ首長国連邦	127,309,980.53	2.02
	英領ヴァージン諸島	124,620,114.53	1.98
	エジプト	123,951,378.19	1.97
	ペルー	122,606,694.31	1.95
	チリ	119,450,499.52	1.90
	ロシア連邦	118,578,346.77	1.88
	カタール	98,546,936.52	1.57
	インド	98,332,306.86	1.56
	スリランカ	96,902,654.42	1.54
	南アフリカ	88,907,258.71	1.41
	ナイジェリア	87,371,034.96	1.39
	エクアドル	83,184,338.77	1.32
	サウジアラビア	82,859,306.37	1.32
	米国	78,734,997.52	1.25
	ルクセンブルグ	76,708,325.09	1.22
	パラグアイ	74,700,112.16	1.19
	アンゴラ	72,149,787.81	1.15
	マレーシア	65,896,060.70	1.05
	アゼルバイジャン	65,884,402.50	1.05
	パナマ	64,039,083.81	1.02
	カザフスタン	60,145,146.18	0.96
	チュニジア	57,863,952.99	0.92
	イギリス	55,831,545.92	0.89

アイルランド	54,406,717.12	0.86
コートジボワール	54,248,089.08	0.86
ガーナ	50,702,507.18	0.81
オマーン	48,498,097.18	0.77
グアテマラ	46,706,597.51	0.74
エクアドル	44,270,733.74	0.70
シンガポール	42,983,998.59	0.68
ケニヤ	41,903,064.38	0.67
フィリピン	41,555,915.81	0.66
モーリシャス	40,830,730.82	0.65
モンゴル	38,388,293.29	0.61
バーレーン	37,758,950.94	0.60
コスタリカ	33,384,328.34	0.53
モロッコ	32,126,695.26	0.51
ウルグアイ	31,659,487.60	0.50
韓国	29,987,641.21	0.48
ルーマニア	29,635,730.82	0.47
レバノン	28,268,003.24	0.45
オーストリア	26,700,272.70	0.42
セルビア	25,879,798.13	0.41
イスラエル	25,582,802.99	0.41
クロアチア	24,614,527.30	0.39
マカオ	23,465,750.02	0.37
バミューダ	23,336,363.44	0.37
ジャマイカ	23,118,318.58	0.37
ベネズエラ	20,271,629.24	0.32
スペイン	19,920,691.50	0.32
ホンデュラス	19,500,283.76	0.31
パキスタン	19,472,470.31	0.31
ハンガリー	17,271,713.08	0.27
タイ	16,853,171.92	0.27
カナダ	15,841,571.95	0.25
トリニダード・アンド・トバゴ	15,146,573.12	0.24
ガボン	15,013,615.17	0.24
マケドニア（旧ユーゴスラビア）	14,472,285.38	0.23
バハマ	14,439,680.62	0.23
クウェート	14,153,051.57	0.22
ザンビア	13,685,705.01	0.22
ウズベキスタン	11,058,094.37	0.18
マン島	9,911,725.00	0.16
グルジア	9,582,801.57	0.15
ノルウェー	9,490,875.00	0.15

セネガル	8,690,142.39	0.14
ナミビア	8,251,278.75	0.13
ベラルーシ	8,044,133.13	0.13
トーゴ	6,369,015.21	0.10
エチオピア	5,865,475.00	0.09
アルメニア	5,824,728.00	0.09
ベトナム	5,497,698.75	0.09
ボリビア	5,481,013.75	0.09
ブルンジ	4,398,628.80	0.07
ポーランド	3,768,810.62	0.06
マーシャル諸島	3,549,304.68	0.06
ヨルダン	3,208,455.00	0.05
イラク	2,556,987.49	0.04
ジャージー	2,213,852.00	0.04
国際機関	2,128,134.80	0.03
パプアニューギニア	1,967,362.19	0.03
スリナム	1,690,500.00	0.03
ベリーズ	1,583,029.79	0.03
タジキスタン	986,090.62	0.02
ポートフォリオ合計	5,941,416,653.46	94.42
現金・その他資産(負債控除後)	351,054,544.83	5.58
資産総額	6,292,471,198.29	100.00
負債総額	110,623,502.14	1.76
合計 (純資産総額)	6,181,847,696.15 (約676,480百万円)	98.24

(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)

(2020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	4,388,284,564.62	75.23
	イギリス	247,279,122.70	4.24
	カナダ	147,555,920.48	2.53
	オランダ	91,862,894.84	1.57
	日本	86,072,576.56	1.48
	フランス	75,850,572.83	1.30
	アイルランド	68,352,810.27	1.17
	ルクセンブルグ	39,610,138.64	0.68
	中国	39,038,341.64	0.67
	オーストラリア	38,227,125.39	0.66
	スイス	30,441,644.91	0.52
	ケイマン諸島	27,273,280.22	0.47
	バミューダ	23,260,784.28	0.40
	スペイン	22,728,144.25	0.39
	メキシコ	16,278,371.26	0.28
	ガーンジー	13,547,620.38	0.23
	ニュージーランド	11,630,393.27	0.20
	ノルウェー	10,539,318.20	0.18
	チリ	9,563,318.37	0.16
	韓国	9,553,895.74	0.16
	イタリア	8,533,446.13	0.15
	デンマーク	7,320,034.54	0.13
	スウェーデン	4,938,865.42	0.08
	カタール	4,780,236.26	0.08
	アラブ首長国連邦	4,758,202.50	0.08
	フィンランド	4,107,338.04	0.07
	キュラソー	3,506,440.00	0.06
	ジャージー	2,275,510.30	0.04
	インド	2,238,687.51	0.04
	サウジアラビア	1,726,920.00	0.03
	マカオ	1,321,998.48	0.02
	ペルー	1,070,490.63	0.02
	コロンビア	845,720.94	0.01
	小計	5,444,374,729.60	93.34
モーゲージ 担保証券 / 資産担保証券 / その他割引債	米国	46,978,980.01	0.81
	ケイマン諸島	36,875,611.17	0.63
	小計	83,854,591.18	1.44

短期金融商品	米国	19,125,697.39	0.33
ポートフォリオ合計		5,547,355,018.17	95.10
現金・その他資産(負債控除後)		285,622,705.84	4.90
資産総額		5,832,977,724.01	100.00
負債総額		95,621,329.74	1.64
合計 (純資産総額)		5,737,356,394.27 (約627,839百万円)	98.36

(ハイ・イールド)

(2020年2月末日現在)

資産の種類	国・地域名	時価合計 (米ドル)	投資比率 (%)
債券	米国	2,284,352,966.12	52.85
	オランダ	333,332,555.27	7.71
	フランス	268,663,566.89	6.22
	ルクセンブルグ	177,138,643.58	4.10
	カナダ	176,079,504.65	4.07
	ドイツ	154,277,899.49	3.57
	イギリス	150,589,316.58	3.48
	イタリア	108,191,970.29	2.50
	スペイン	77,199,133.52	1.79
	スウェーデン	63,303,127.53	1.46
	アイルランド	61,008,435.74	1.41
	デンマーク	24,790,006.00	0.57
	日本	21,369,777.14	0.49
	フィンランド	20,994,240.77	0.49
	オーストラリア	18,599,282.96	0.43
	ケイマン諸島	17,659,367.98	0.41
	ベルギー	11,876,046.07	0.27
	オーストリア	9,986,352.18	0.23
	ジャージー	9,038,783.43	0.21
	ポルトガル	8,317,427.36	0.19
	メキシコ	6,729,676.71	0.16
	スイス	5,619,170.41	0.13
	バミューダ	5,342,624.76	0.12
	スロベニア	4,741,186.24	0.11
	ルーマニア	4,578,888.84	0.11
	アラブ首長国連邦	3,882,200.00	0.09
	ハンガリー	3,669,255.75	0.08
	マン島	3,536,246.95	0.08
	チェコ共和国	2,735,003.19	0.06
	ジャマイカ	2,066,462.50	0.05
	英領ヴァージン諸島	1,817,330.60	0.04
	バハマ	1,809,427.50	0.04
	シンガポール	846,969.72	0.02
	ノルウェー	836,000.00	0.02
	ガーンジー	544,765.30	0.01
	マルタ	466,040.40	0.01

	エジプト	432,488.15	0.01
	ドミニカ共和国	397,687.50	0.01
	ナイジェリア	352,929.69	0.01
	トルコ	351,679.69	0.01
	キュラソー	245,000.00	0.01
	ウクライナ	197,226.70	0.00
	ギリシャ	106,030.74	0.00
	小計	4,048,072,694.89	93.66
モーゲージ 担保証券 / 資産担保証券 / その他割引債	ルクセンブルグ	2,625,350.42	0.06
短期金融商品	米国	1,793,290.50	0.04
株式	米国	265,972.00	0.01
ワラント	米国	77.86	0.00
ポートフォリオ合計		4,052,757,385.67	93.77
現金・その他資産(負債控除後)		269,451,257.18	6.23
資産総額		4,322,208,642.85	100.00
負債総額		69,318,975.78	1.60
合計 (純資産総額)		4,252,889,667.07 (約465,394百万円)	98.40

(2) 運用実績

純資産等の推移

2020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
2019年3月末日	5,167,692	565,501	5,095,569	557,608	127.76	13,981	-
4月末日	5,117,836	560,045	5,088,208	556,803	128.24	14,033	-
5月末日	5,249,149	574,414	5,151,113	563,686	128.67	14,080	10,012
6月末日	5,502,400	602,128	5,403,460	591,301	132.65	14,516	10,297
7月末日	6,156,363	673,691	6,089,637	666,389	134.28	14,694	10,399
8月末日	6,139,886	671,888	6,089,086	666,329	133.98	14,661	10,349
9月末日	6,122,223	669,955	6,053,557	662,441	134.16	14,681	10,339
10月末日	6,236,681	682,480	6,125,048	670,264	134.70	14,740	10,361
11月末日	6,110,688	668,693	6,047,190	661,744	134.15	14,680	10,303
12月末日	7,064,867	773,108	7,038,624	770,237	136.81	14,971	10,479
2020年1月末日	6,664,804	729,330	6,485,464	709,704	138.80	15,189	10,611
2月末日	6,292,471	688,585	6,181,848	676,480	137.39	15,035	10,495

(注) 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。

（ Ｕ Ｓ マルチ・クレジット ）

	資産総額		純資産総額		1口当たり純資産価格		
					(クラス F - a c c 投資証券)		(クラス F - a c c 円ヘッジ 投資証券)
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円	円
2019年3月末日	4,906,565	536,925	4,808,599	526,205	145.51	15,923	-
4月末日	4,903,772	536,620	4,864,719	532,346	146.26	16,005	-
5月末日	5,061,999	553,935	5,007,479	547,968	147.65	16,157	10,043
6月末日	5,315,277	581,651	5,212,254	570,377	150.03	16,418	10,181
7月末日	5,246,549	574,130	5,219,859	571,209	150.44	16,463	10,183
8月末日	5,353,417	585,824	5,303,436	580,355	152.98	16,741	10,330
9月末日	5,308,881	580,951	5,280,148	577,807	152.51	16,689	10,276
10月末日	5,417,023	592,785	5,353,861	585,873	153.44	16,791	10,317
11月末日	5,390,431	589,875	5,319,615	582,125	153.48	16,795	10,307
12月末日	5,475,474	599,181	5,462,743	597,788	154.20	16,874	10,325
2020年1月末日	5,731,345	627,181	5,671,073	620,586	156.50	17,126	10,461
2月末日	5,832,978	638,303	5,737,356	627,839	157.84	17,272	10,533

（ 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
2019年3月末日	4,373,794	478,624	4,290,111	469,467	122.35	13,389	-
4月末日	4,395,994	481,054	4,330,956	473,937	124.14	13,585	-
5月末日	4,408,969	482,473	4,318,724	472,598	122.83	13,441	9,962
6月末日	4,886,669	534,748	4,521,998	494,842	125.70	13,755	10,173
7月末日	4,598,888	503,256	4,507,826	493,291	126.70	13,865	10,229
8月末日	4,563,864	499,424	4,509,748	493,502	127.49	13,951	10,268
9月末日	4,532,006	495,937	4,475,459	489,749	127.91	13,997	10,281
10月末日	4,569,919	500,086	4,503,483	492,816	128.26	14,035	10,288
11月末日	4,531,121	495,841	4,466,409	488,759	128.99	14,115	10,333
12月末日	4,761,381	521,038	4,729,641	517,565	131.09	14,345	10,470
2020年1月末日	4,536,686	496,450	4,460,382	488,100	131.17	14,354	10,460
2月末日	4,322,209	472,979	4,252,890	465,394	129.04	14,121	10,282

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)

(U S マルチ・クレジット)

(ハイ・イールド)

クラスF - a c c 投資証券

クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券

該当事項なし。

自己資本利益率(収益率)の推移

2020年2月末日までの1年間における自己資本利益率(収益率)は次のとおりである。

(エマージング・マーケット・デッド)

収益率(%) (注)	
(クラスF - a c c 投資証券)	(クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券)
8.92	4.95

(U S マルチ・クレジット)

収益率(%) (注)	
(クラスF - a c c 投資証券)	(クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券)
10.28	5.33

(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)
6.56	2.82

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

a = 2020年2月末日の1口当たり純資産価格(当該期間の分配金の合計金額を加えた金額)

b = 2019年2月末日の1口当たり純資産価格(分配落の額)。ただし、クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券については10,000円(当初発行価格)。

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

(3) 投資リスク

当中間計算期間において、2020年1月16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

2020年2月末日現在の株主資本総額は、13,000,000ユーロ(約16億円)

(注)ユーロの円貨換算は、便宜上、2020年2月28日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1ユーロ=120.32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

2020年2月末日現在の株主資本総額は、10,000,000スイスフラン(約11億円)

(注)スイスフランの円貨換算は、便宜上、2020年2月28日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1スイスフラン=113.04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

(2020年2月末日現在)

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

ユービーエス・スイス・エイ・ジー

(2020年2月末日現在)

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

(3) 役員の状況

U B S ファンド・マネジメント(ルクセンブルグ) エス・エイ

(2020年 2 月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有株式
アンドレ・ミュラー・ウェグナー (André Müller-Wegner)	チェアマン	U B S アセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー、 チューリッヒ、 マネージング・ディレクター	該当なし
ギルバート・シントゲン (Gilbert Schintgen)	ディレクター / ボード・メンバー	ルクセンブルグ大公国、 ルクセンブルグ、 インディペンデント・ディレクター	該当なし
パスカル・キストラー (Pascal Kistler)	ディレクター / ボード・メンバー	U B S ビジネス・ ソリューションズ・エイ・ジー、 チューリッヒ、 マネージング・ディレクター	該当なし
フランチェスカ・ジリ・プリム (Francesca Gigli Prym)	ディレクター / ボード・メンバー	U B S ファンド・マネジメント (ルクセンブルグ) エス・エイ、 チーフ・エグゼクティブ・ オフィサー	該当なし

ユービーエス・スイス・エイ・ジー

(2020年 2 月末日現在)

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

(4) 事業の内容及び営業の概況

UBSファンド・マネジメント(ルクセンブルグ)エス・エイ

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

2020年2月末日現在、管理会社は以下のとおり、397本の投資信託/投資法人の管理・運用を行っている。

国別(設立国)	種類別(基本的性格)	本数	純資産額の合計(通貨別)
ルクセンブルグ	オープン・エンド型 投資信託/投資法人	362	536,589,800.73オーストラリア・ドル
			2,828,968,780.13カナダ・ドル
			11,791,710,281.51スイス・フラン
			3,468,874,954.83中国元
			976,616,258.37デンマーク・クローネ
			44,601,016,597.49ユーロ
			2,142,900,206.67英ポンド
			376,874,077.99香港ドル
			324,382,216,983.82日本円
			54,441,955.43シンガポール・ドル
			112,721,386,963.11米ドル
アイルランド	オープン・エンド型 投資信託/投資法人	35	428,919,144.87オーストラリア・ドル
			550,689,803.39スイス・フラン
			2,897,539,974.21ユーロ
			1,997,516,850.11英ポンド
			14,832,814,760.29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。

2019年12月末日現在、ユービーエス・スイス・エイ・ジーは以下の90本のファンドを運用している。

国別(設立国)	種類別(基本的性格)	本数	純資産額の合計(通貨別)
スイス (ポートフォリオ・マネジャー)	オープン・エンド型 ファンド	4	22.7億スイスフラン
スイス (共同ポートフォリオ・マネ ジャー)	オープン・エンド型 ファンド	9	41.2億スイスフラン
ケイマン諸島 (ポートフォリオ・マネジャー)	ヘッジ・ファンド	5	85.4億スイスフラン
ルクセンブルグ (ポートフォリオ・マネジャー)	オープン・エンド型 ファンド	39	314.8億スイスフラン
ルクセンブルグ (共同ポートフォリオ・マネ ジャー)	オープン・エンド型 ファンド	31	125.1億スイスフラン
アイルランド (ポートフォリオ・マネージャー)	ヘッジ・ファンド	2	0.9億スイスフラン

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

[次へ](#)

4 外国投資法人の経理状況

a. ファンドの日本語の中間財務書類は、ルクセンブルグにおける法令に準拠して作成された原文の中間財務書類を翻訳したものである。これは「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76

条第4項ただし書の規定の適用によるものである。

b. ファンドの原文の中間財務書類は、マルチ・マネージャー・アクセス および全てのサブ・ファンドにつき一括して作成されている。日本語の作成にあたっては、関係するサブ・ファンドに関連する部分のみを翻訳している。なお、各サブ・ファンドには下記のクラス投資証券以外のクラス投資証券も存在するが、本書においては下記のクラス投資証券に関する部分を抜粋して日本語に記載している。

- エマージング・マーケット・デッド

クラスF - a c c 投資証券

クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券

- U S マルチ・クレジット

クラスF - a c c 投資証券

クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券

- ハイ・イールド

クラスF - a c c 投資証券

クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券

c. ファンドの原文の中間財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。）の監査を受けていない。

d. 原文の中間財務書類は、米ドルで表示されている。日本語の中間財務書類には、主要な金額について円貨換算が併記されている。日本円による金額は、2020年2月28日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝109.43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・デット
純資産計算書

	2020年1月31日現在	
	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	6,203,493,942.54	678,848,342
投資有価証券、未実現評価(損)益	141,226,200.19	15,454,383
投資有価証券合計(注1)	6,344,720,142.73	694,302,725
現金預金、要求払預金および預託金勘定	135,728,331.68 *	14,852,751
その他の流動資産(委託証拠金)	4,823,582.11	527,845
投資有価証券売却未収金(注1)	73,764,688.01	8,072,070
発行未収金	9,919,454.53	1,085,486
有価証券に係る未収利息	81,495,205.88	8,918,020
金融先物に係る未実現(損)益(注1)	2,442,317.67	267,263
先渡為替契約に係る未実現(損)益(注1)	2,301,613.76	251,866
スワップに係る未実現(損)益(注1)	9,608,886.99	1,051,501
資産合計	6,664,804,223.36	729,329,526
負 債		
当座借越	(3,676,464.65)	(402,316)
投資有価証券購入未払金(注1)	(77,204,338.87)	(8,448,471)
買戻未払金	(93,850,964.46)	(10,270,111)
報酬引当金(注2)	(4,450,464.54)	(487,014)
年次税引当金(注3)	(55,233.36)	(6,044)
その他の手数料および報酬に係る引当金(注2)	(102,966.70)	(11,268)
引当金合計	(4,608,664.60)	(504,326)
負債合計	(179,340,432.58)	(19,625,224)
期末現在純資産	6,485,463,790.78	709,704,303

* 2020年1月31日現在、ユービーエス・ヨーロッパ・エス・イーに対する87,447.53米ドルの現金が、取引相手方に対する担保となっている。

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - U S マルチ・クレジット

純資産計算書

2020年1月31日現在

	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	5,239,450,377.75	573,353,055
投資有価証券、未実現評価(損)益	245,246,605.08	26,837,336
投資有価証券合計(注1)	5,484,696,982.83	600,190,391
現金預金、要求払預金および預託金勘定	178,134,097.95	19,493,214
その他の流動資産(委託証拠金)	2,472,394.80	270,554
投資有価証券売却未収金(注1)	9,892,342.64	1,082,519
発行未収金	6,409,258.81	701,365
有価証券に係る未収利息	46,371,057.40	5,074,385
金融先物に係る未実現(損)益(注1)	47,521.91	5,200
先渡為替契約に係る未実現(損)益(注1)	3,321,803.90	363,505
資産合計	5,731,345,460.24	627,181,134
負 債		
当座借越	(331,714.81)	(36,300)
当座借越に係る未払利息	(9,361.22)	(1,024)
投資有価証券購入未払金(注1)	(53,103,228.56)	(5,811,086)
買戻未払金	(3,977,972.81)	(435,310)
報酬引当金(注2)	(2,703,118.04)	(295,802)
年次税引当金(注3)	(48,297.61)	(5,285)
その他の手数料および報酬に係る引当金(注2)	(99,034.18)	(10,837)
引当金合計	(2,850,449.83)	(311,925)
負債合計	(60,272,727.23)	(6,595,645)
期末現在純資産	5,671,072,733.01	620,585,489

添付の注記は当財務書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

2020年1月31日現在

	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	4,260,213,873.45	466,195,204
投資有価証券、未実現評価（損）益	55,990,652.80	6,127,057
投資有価証券合計（注１）	4,316,204,526.25	472,322,261
現金預金、要求払預金および預託金勘定	118,615,024.38 *	12,980,042
その他の流動資産（委託証拠金）	4,209,945.08	460,694
投資有価証券売却未収金（注１）	21,421,950.90	2,344,204
発行未収金	8,080,116.84	884,207
有価証券に係る未収利息	63,401,556.77	6,938,032
その他の未収金	1.35	0
金融先物に係る未実現（損）益（注１）	661,792.08	72,420
先渡為替契約に係る未実現（損）益（注１）	4,092,604.60	447,854
スワップに係る未実現（損）益（注１）	(1,034.04)	(113)
資産合計	4,536,686,484.21	496,449,602
負 債		
当座借越	(1,765,185.75)	(193,164)
当座借越に係る未払利息	(1,469.09)	(161)
投資有価証券購入未払金（注１）	(53,692,051.38)	(5,875,521)
買戻未払金	(18,133,766.49)	(1,984,378)
報酬引当金（注２）	(2,519,933.45)	(275,756)
年次税引当金（注３）	(37,986.78)	(4,157)
その他の手数料および報酬に係る引当金（注２）	(153,957.58)	(16,848)
引当金合計	(2,711,877.81)	(296,761)
負債合計	(76,304,350.52)	(8,349,985)
期末現在純資産	4,460,382,133.69	488,099,617

* 2020年1月31日現在、バンク・オブ・アメリカに対する50,000.00米ドルの現金が、取引相手方に対する担保となっている。

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

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

自2019年8月1日 至2020年1月31日

	（米ドル）	（千円）
収 益		
流動資産に係る利息	1,406,917.22	153,959
有価証券に係る利息	167,502,389.77	18,329,787
スワップに係る受取利息（注１）	585,960.21	64,122
分配金	27,657.98	3,027
その他の収益（注４）	6,375,601.38	697,682
収益合計	<u>175,898,526.56</u>	<u>19,248,576</u>
費 用		
スワップに係る支払利息（注１）	(564,785.14)	(61,804)
定率報酬（注２）	(24,088,002.91)	(2,635,950)
年次税（注３）	(330,190.56)	(36,133)
当座借越に係る利息	(169,428.87)	(18,541)
その他の手数料および報酬（注２）	(127,605.86)	(13,964)
費用合計	<u>(25,280,013.34)</u>	<u>(2,766,392)</u>
投資純（損）益	<u>150,618,513.22</u>	<u>16,482,184</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	56,474,498.37	6,180,004
オプションに係る実現（損）益	(241,877.90)	(26,469)
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	16,087.81	1,760
金融先物に係る実現（損）益	6,482,745.04	709,407
先渡為替契約に係る実現（損）益	(32,276,986.95)	(3,532,071)
スワップに係る実現（損）益	(6,642,840.69)	(726,926)
外国為替に係る実現（損）益	3,498,242.69	382,813
実現（損）益合計	<u>27,309,868.37</u>	<u>2,988,519</u>
当期実現純（損）益	<u>177,928,381.59</u>	<u>19,470,703</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	2,969,475.48	324,950
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	85,767.62	9,386
金融先物に係る未実現評価（損）益	3,042,179.58	332,906
先渡為替契約に係る未実現評価（損）益	15,510,965.66	1,697,365
スワップに係る未実現評価（損）益	5,615,722.90	614,529
未実現評価（損）益の変動合計	<u>27,224,111.24</u>	<u>2,979,134</u>
運用の結果による純資産の純増（減）	<u><u>205,152,492.83</u></u>	<u><u>22,449,837</u></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

運用計算書

自2019年8月1日 至2020年1月31日

	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	411,128.13	44,990
有価証券に係る利息	91,137,819.91	9,973,212
収益合計	91,548,948.04	10,018,201
費 用		
定率報酬(注2)	(13,862,740.03)	(1,517,000)
年次税(注3)	(272,188.24)	(29,786)
当座借越に係る利息	(54,634.45)	(5,979)
その他の手数料および報酬(注2)	(100,860.67)	(11,037)
費用合計	(14,290,423.39)	(1,563,801)
投資純(損)益	77,258,524.65	8,454,400
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	19,186,451.79	2,099,573
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	42,060.28	4,603
金融先物に係る実現(損)益	(227,808.72)	(24,929)
先渡為替契約に係る実現(損)益	(26,842,078.76)	(2,937,329)
外国為替に係る実現(損)益	954,120.77	104,409
実現(損)益合計	(6,887,254.64)	(753,672)
当期実現純(損)益	70,371,270.01	7,700,728
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	117,347,032.92	12,841,286
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	35,710.30	3,908
金融先物に係る未実現評価(損)益	(462,073.92)	(50,565)
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	14,760,315.15	1,615,221
未実現評価(損)益の変動合計	131,680,984.45	14,409,850
運用の結果による純資産の純増(減)	202,052,254.46	22,110,578

添付の注記は当財務書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2019年8月1日 至2020年1月31日

	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	793,801.36	86,866
有価証券に係る利息	117,096,197.41	12,813,837
スワップに係る受取利息(注1)	40,104.10	4,389
その他の収益(注4)	938,975.72	102,752
収益合計	118,869,078.59	13,007,843
費 用		
スワップに係る支払利息(注1)	(61,628.28)	(6,744)
定率報酬(注2)	(14,814,795.96)	(1,621,183)
年次税(注3)	(229,508.85)	(25,115)
当座借越に係る利息	(195,710.80)	(21,417)
その他の手数料および報酬(注2)	(110,309.71)	(12,071)
費用合計	(15,411,953.60)	(1,686,530)
投資純(損)益	103,457,124.99	11,321,313
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	(5,111,646.15)	(559,367)
オプションに係る実現(損)益	685.52	75
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	88,218.29	9,654
金融先物に係る実現(損)益	13,327,744.34	1,458,455
先渡為替契約に係る実現(損)益	2,796,587.34	306,031
スワップに係る実現(損)益	(118,594.09)	(12,978)
外国為替に係る実現(損)益	(3,957,823.68)	(433,105)
実現(損)益合計	7,025,171.57	768,765
当期実現純(損)益	110,482,296.56	12,090,078
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	40,429,752.96	4,424,228
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	741,090.18	81,097
金融先物に係る未実現評価(損)益	(11,504,770.15)	(1,258,967)
先渡為替契約に係る未実現評価(損)益	5,345,529.39	584,961
スワップに係る未実現評価(損)益	327,760.76	35,867
未実現評価(損)益の変動合計	35,339,363.14	3,867,187
運用の結果による純資産の純増(減)	145,821,659.70	15,957,264

添付の注記は当財務書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・デット

純資産変動計算書

	自2019年8月1日 至2020年1月31日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	6,089,637,256.08	666,389,005
発行額	1,492,994,657.05	163,378,405
買戻額	(1,289,584,230.26)	(141,119,202)
純発行(買戻)合計	203,410,426.79	22,259,203
支払分配金	(12,736,384.92)	(1,393,743)
投資純(損)益	150,618,513.22	16,482,184
実現(損)益合計	27,309,868.37	2,988,519
未実現評価(損)益の変動合計	27,224,111.24	2,979,134
運用の結果による純資産の純増(減)	205,152,492.83	22,449,837
期末現在純資産	6,485,463,790.78	709,704,303

発行済投資証券数の変動表

	自2019年8月1日 至2020年1月31日
クラスF - a c c	(口)
期首現在発行済投資証券数	14,193,122.2020
期中発行投資証券数	3,624,862.3570
期中買戻投資証券数	(1,935,281.5030)
期末現在発行済投資証券数	15,882,703.0560
クラスF - a c c (円ヘッジ)	(口)
期首現在発行済投資証券数	77,455.0000
期中発行投資証券数	54,952.0000
期中買戻投資証券数	(4,897.0000)
期末現在発行済投資証券数	127,510.0000

最重要数値

日付	ISIN	2020年1月31日	2019年7月31日	2018年7月31日
純資産額(米ドル)		6,485,463,790.78	6,089,637,256.08	4,860,620,178.24
クラスF - a c c	LU0985399996			
発行済投資証券数(口)		15,882,703.0560	14,193,122.2020	13,018,469.5970
1口当たり純資産価格(米ドル)		138.80	134.28	122.25
1口当たり発行・買戻価格(米ドル) ¹		138.80	134.28	122.25
クラスF - a c c (円ヘッジ) ²	LU1749433899			
発行済投資証券数(口)		127,510.0000	77,455.0000	-
1口当たり純資産価格(日本円)		10,611	10,399	-
1口当たり発行・買戻価格(日本円) ¹		10,611	10,399	-

¹ 注記1を参照² 初回純資産価格計算日: 2019年5月24日

添付の注記は当財務書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	6.95	バハマ	0.22
ケイマン諸島	4.98	クウェート	0.22
オランダ	4.06	セネガル	0.21
トルコ	4.01	ベラルーシ	0.18
コロンビア	3.59	ウズベキスタン	0.17
インドネシア	3.51	マン島	0.17
中国	3.33	スペイン	0.15
ウクライナ	2.70	ジョージア	0.15
ドミニカ共和国	2.63	ノルウェー	0.15
ブラジル	2.60	トーゴ	0.10
香港	2.30	エチオピア	0.10
エジプト	2.29	アルメニア	0.09
アルゼンチン	2.17	ボリビア	0.08
ロシア連邦 (CIS)	2.14	ブルンジ	0.07
アラブ首長国連邦	2.06	ポーランド	0.06
ペルー	2.02	マーシャル諸島	0.05
チリ	1.83	ヨルダン	0.05
英国領バージン諸島	1.74	イラク	0.04
エクアドル	1.72	ベトナム	0.04
スリランカ	1.69	国際機関	0.03
カタール	1.62	パプアニューギニア	0.03
ナイジェリア	1.56	スリナム	0.02
南アフリカ	1.46	ナミビア	0.02
ルクセンブルグ	1.45	ベリーズ	0.02
アンゴラ	1.42	タジキスタン	0.02
サウジアラビア	1.30	合計	97.83
アメリカ合衆国	1.28		
インド	1.27	業種別分類	純資産割合%
マレーシア	1.18	国債および中央政府債	42.10
パナマ	1.16	金融および持株会社	13.46
パラグアイ	1.15	銀行および金融機関	9.78
アゼルバイジャン	1.11	石油	8.83
カザフスタン	1.02	エネルギー・水道	3.44
イギリス	0.96	通信	2.23
コートジボワール	0.91	不動産	2.01
チュニジア	0.89	交通・運輸	1.94
アイルランド	0.87	化学	1.72
オマーン	0.87	鉱業・石炭・鋼鉄	1.42
グアテマラ	0.81	モーゲージおよび貸付機関	1.31
シンガポール	0.76	建築業・資材	1.06
ガーナ	0.76	食品・清涼飲料	1.01
モンゴル	0.71	非鉄金属	0.73
エルサルバドル	0.70	各種サービス	0.66
フィリピン	0.70	貴金属および宝石	0.60
レバノン	0.66	国際機関	0.60
コスタリカ	0.65	宿泊・仕出し・レジャー	0.52
韓国	0.62	電気装置・部品	0.47
バーレーン	0.62	医薬品・化粧品・医療品	0.45
モリシャス	0.60	非分類会社	0.39
ルーマニア	0.58	たばこ・アルコール	0.35
ハンガリー	0.54	林業・紙・パルプ製品	0.34
モロッコ	0.50	インターネット、ソフトウェア・ITサービス	0.31
ウルグアイ	0.50	グラフィックデザイン・出版・メディア	0.30
クロアチア	0.48	保険	0.30
イスラエル	0.44	州、連邦州	0.30
セルビア	0.42	投資信託	0.23
ケニア	0.41	機械工学・産業機器	0.23
ジャマイカ	0.40	小売り・百貨店	0.17
ガボン	0.38	ヘルスケア、社会事業	0.10
マカオ	0.37	航空宇宙産業	0.09
オーストリア	0.37	その他消費財	0.07
パキスタン	0.36	農業・漁業	0.06
マケドニア共和国	0.33	公的、非営利機関	0.06
バミューダ	0.32	繊維・衣服・革製品	0.06
ベネズエラ	0.31	各種貿易会社	0.05
ホンジュラス	0.30	包装業	0.03
トリニダード・トバゴ共和国	0.27	電子工学・半導体	0.02
タイ	0.25	写真および光学	0.02
カナダ	0.25	バイオテクノロジー	0.01
ザンビア	0.22	合計	97.83

マルチ・マネージャー・アクセス - U S マルチ・クレジット

純資産変動計算書

	自2019年8月1日 至2020年1月31日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	5,219,858,520.58	571,209,118
発行額	854,190,812.21	93,474,101
買戻額	(597,329,626.53)	(65,365,781)
純発行(買戻)合計	256,861,185.68	28,108,320
支払分配金	(7,699,227.71)	(842,526)
投資純(損)益	77,258,524.65	8,454,400
実現(損)益合計	(6,887,254.64)	(753,672)
未実現評価(損)益の変動合計	131,680,984.45	14,409,850
運用の結果による純資産の純増(減)	202,052,254.46	22,110,578
期末現在純資産	5,671,072,733.01	620,585,489

発行済投資証券数の変動表

	自2019年8月1日 至2020年1月31日	
	(口)	
クラスF - a c c		
期首現在発行済投資証券数	14,765,747.6220	
期中発行投資証券数	1,958,977.4180	
期中買戻投資証券数	(1,396,978.2130)	
期末現在発行済投資証券数	15,327,746.8270	
クラスF - a c c (円ヘッジ)		
期首現在発行済投資証券数	278,717.0000	
期中発行投資証券数	64,343.0000	
期中買戻投資証券数	(15,293.0000)	
期末現在発行済投資証券数	327,767.0000	

最重要数値

日付	ISIN	2020年1月31日	2019年7月31日	2018年7月31日
純資産額(米ドル)		5,671,072,733.01	5,219,858,520.58	4,684,064,365.96
クラスF - a c c	LU0313364738			
発行済投資証券数(口)		15,327,746.8270	14,765,747.6220	14,919,985.7850
1口当たり純資産価格(米ドル)		156.50	150.44	139.19
1口当たり発行・買戻価格(米ドル) ¹		156.50	150.44	139.19
クラスF - a c c (円ヘッジ) ²	LU1749433972			
発行済投資証券数(口)		327,767.0000	278,717.0000	-
1口当たり純資産価格(日本円)		10,461	10,183	-
1口当たり発行・買戻価格(日本円) ¹		10,461	10,183	-

¹ 注記1を参照² 初回純資産価格計算日: 2019年5月24日

添付の注記は当財務書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

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	77.66	銀行および金融機関	21.84
イギリス	4.29	金融および持株会社	20.36
カナダ	2.56	エネルギー・水道	6.06
オランダ	1.61	医薬品・化粧品・医療品	5.25
日本	1.49	石油	4.57
フランス	1.35	不動産	4.28
アイルランド	1.19	通信	3.41
ケイマン諸島	1.12	保険	3.38
ルクセンブルグ	0.69	国債および中央政府債	3.19
中国	0.68	ヘルスケア、社会事業	2.14
オーストラリア	0.67	食品・清涼飲料	2.09
スイス	0.54	小売り・百貨店	1.68
バミューダ	0.41	インターネット、ソフトウェア・ITサービス	1.64
スペイン	0.40	交通・運輸	1.61
メキシコ	0.29	コンピュータ・ハードウェア、ネットワーク装置	1.58
ガーンジー	0.24	モーゲージおよび貸付機関	1.56
ニュージーランド	0.20	グラフィックデザイン・出版・メディア	1.49
チリ	0.17	電気装置・部品	1.03
韓国	0.17	たばこ・アルコール	1.01
ノルウェー	0.16	宿泊・仕出し・レジャー	0.81
イタリア	0.15	電子工学・半導体	0.71
デンマーク	0.13	自動車	0.64
スウェーデン	0.09	バイオテクノロジー	0.62
カタール	0.08	公的、非営利機関	0.61
アラブ首長国連邦	0.08	各種サービス	0.60
フィンランド	0.07	航空宇宙産業	0.56
キュラソー島	0.06	建築業・資材	0.55
ジャージー	0.04	化学	0.53
インド	0.04	その他消費財	0.42
サウジアラビア	0.03	農業・漁業	0.31
マカオ	0.02	投資信託	0.30
ペルー	0.02	機械工学・産業機器	0.26
コロンビア	0.01	林業、紙・パルプ製品	0.25
合計	96.71	環境サービスおよびリサイクル	0.24
		非分類会社	0.23
		州、連邦州	0.20
		各種貿易会社	0.19
		鉱業・石炭・鋼鉄	0.19
		貴金属および宝石	0.14
		包装業	0.06
		市および地方自治体	0.05
		各種資本財	0.05
		繊維・衣服・革製品	0.02
		合計	96.71

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2019年8月1日 至2020年1月31日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	4,507,826,074.78	493,291,407
発行額	596,994,213.58	65,329,077
買戻額	(781,704,595.08)	(85,541,934)
純発行(買戻)合計	(184,710,381.50)	(20,212,857)
支払分配金	(8,555,219.29)	(936,198)
投資純(損)益	103,457,124.99	11,321,313
実現(損)益合計	7,025,171.57	768,765
未実現評価(損)益の変動合計	35,339,363.14	3,867,187
運用の結果による純資産の純増(減)	145,821,659.70	15,957,264
期末現在純資産	4,460,382,133.69	488,099,617

発行済投資証券数の変動表

	自2019年8月1日 至2020年1月31日	
	(口)	
クラスF - a c c		
期首現在発行済投資証券数	11,444,078.7390	
期中発行投資証券数	1,571,126.8690	
期中買戻投資証券数	(1,082,264.1310)	
期末現在発行済投資証券数	11,932,941.4770	
クラスF - a c c (円ヘッジ)		
期首現在発行済投資証券数	77,644.0000	
期中発行投資証券数	28,370.0000	
期中買戻投資証券数	(4,658.0000)	
期末現在発行済投資証券数	101,356.0000	

最重要数値

日付	ISIN	2020年1月31日	2019年7月31日	2018年7月31日
純資産額(米ドル)		4,460,382,133.69	4,507,826,074.78	3,391,096,914.21
クラスF - a c c	LU1344275315			
発行済投資証券数(口)		11,932,941.4770	11,444,078.7390	9,338,538.8570
1口当たり純資産価格(米ドル)		131.17	126.70	118.11
1口当たり発行・買戻価格(米ドル) ¹		131.17	126.70	118.11
クラスF - a c c (円ヘッジ) ²	LU1749434194			
発行済投資証券数(口)		101,356.0000	77,644.0000	-
1口当たり純資産価格(日本円)		10,460	10,229	-
1口当たり発行・買戻価格(日本円) ¹		10,460	10,229	-

¹ 注記1を参照² 初回純資産価格計算日: 2019年5月24日

添付の注記は当財務書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	54.00	金融および持株会社	32.97
オランダ	7.94	通信	9.25
フランス	6.94	銀行および金融機関	5.43
ルクセンブルグ	4.19	ヘルスケア、社会事業	3.90
カナダ	4.14	石油	3.82
ドイツ	3.71	インターネット、ソフトウェア・ITサービス	3.40
イギリス	3.50	不動産	2.83
イタリア	2.58	建築業・資材	2.65
スペイン	1.89	エネルギー・水道	2.61
スウェーデン	1.47	医薬品・化粧品・医療品	2.61
アイルランド	1.37	各種サービス	2.41
ケイマン諸島	0.60	宿泊・仕出し・レジャー	2.37
デンマーク	0.57	化学	2.33
日本	0.51	包装業	1.66
フィンランド	0.45	機械工学・産業機器	1.61
オーストラリア	0.40	交通・運輸	1.54
チェコ共和国	0.30	その他消費財	1.35
ベルギー	0.30	鉱業・石炭・鋼鉄	1.33
オーストリア	0.26	自動車	1.32
ポルトガル	0.26	電気装置・部品	1.31
ジャージー	0.21	食品・清涼飲料	1.20
メキシコ	0.17	保険	1.10
スイス	0.13	小売り・百貨店	1.02
バミューダ	0.12	グラフィックデザイン・出版・メディア	0.94
スロベニア	0.11	電子工学・半導体	0.75
マン島	0.09	林業、紙・パルプ製品	0.70
アラブ首長国連邦	0.09	航空宇宙産業	0.63
ハンガリー	0.08	繊維・衣服・革製品	0.50
ルーマニア	0.07	コンピュータ・ハードウェア、ネットワーク装置	0.47
ノルウェー	0.07	バイオテクノロジー	0.46
ジャマイカ	0.06	たばこ・アルコール	0.39
パハマ	0.04	モーゲージおよび貸付機関	0.36
英国領バージン諸島	0.04	農業・漁業	0.36
ガーンジー	0.03	環境サービスおよびリサイクル	0.33
シンガポール	0.02	貴金属および宝石	0.21
エジプト	0.01	非分類会社	0.17
マルタ共和国	0.01	非鉄金属	0.16
ドミニカ共和国	0.01	各種資本財	0.11
トルコ	0.01	国債および中央政府債	0.08
ナイジェリア	0.01	ゴム・タイヤ	0.07
キュラソー島	0.01	各種貿易会社	0.03
合計	96.77	投資信託	0.03
		合計	96.77

マルチ・マネージャー・アクセス

財務書類に対する注記

2020年1月31日現在

注1 - 重要な会計方針の要約

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

a) 純資産額の計算

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

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

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

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

b) 評価原則

- 証券取引所に上場されている証券、派生商品およびその他の投資対象は、その最終市場価格で評価される。同一の証券、派生商品もしくはその他の投資対象が複数の証券取引所に上場されている場合には、当該投資対象の主要市場である証券取引所における入手可能な最新の見積りが適用される。
証券取引所における取引がごく僅かな証券、派生商品およびその他の投資対象で、証券トレーダー間に市場と一致する値付が行われる流通市場が存在する場合、本投資法人は証券、派生商品およびその他の投資対象をそれらの価格に基づき評価できる。証券取引所に上場されていないが、認知され、公開され、かつ秩序ある方法で運用されている他の規制ある市場で取引されている証券、派生商品およびその他の投資対象商品は、当該市場における入手可能な最終価格で評価される。
- 証券取引所に上場されておらずまたは他の規制ある市場でも取引されていない、適正価格を入手することができない証券、派生商品およびその他の投資対象は、本投資法人が誠実に選択するその他の原則に従って予想売買価格に基づき本投資法人が評価する。

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

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

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

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

c) 先渡為替契約の評価

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

d) 金融先物契約の評価

金融先物契約は、評価日に適用される直近の入手可能な公表価格に基づいて評価される。実現損益および未実現損益の変動は、運用計算書に記帳される。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)益のカテゴリーに基づき、それぞれ運用計算書および純資産変動計算書に開示される。

g) 外貨換算

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

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

h) 組入証券取引の会計処理

組入証券取引は、取引日の翌銀行営業日に会計処理される。

i) 結合財務書類

結合財務書類は、ユーロで表示される。本投資法人の2020年1月31日現在の結合純資産計算書および結合運用計算書の各種科目は、各サブ・ファンドの財務書類の対応する科目をユーロに換算した金額の合計に等しい。

以下の為替レートが、2020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 = 1.108200 米ドル

j) 有価証券売却未収金、有価証券購入未払金

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

外貨取引による未収金および未払金は相殺される。

k) 収益の認識

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

1) スワップ

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

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

未実現(損)益は、未払または未収の経過利息を含む。

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

注2 - 定率報酬

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

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

マルチ・マネージャー・アクセス	実効定率報酬(年率)
	Fクラス
- エマージング・マーケット・デッド	0.76%
- ハイ・イールド	0.67%
- US マルチ・クレジット	0.48%

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

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

本投資法人の運用費用および管理事務費用

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

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

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

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

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

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

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

注3 - 年次税

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

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

注4 - その他の収益

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

注5 - 分配

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

取締役会は、中間分配金を支払い、また分配金支払を停止する権限を有している。

注6 - ソフト・ダラー・アレンジメント

2019年8月1日から2020年1月31日までの期間中、いかなる「ソフト・ダラー・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・ダラー」の金額もなかった。

注7 - 金融先物およびスワップ契約

2020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	債券に係る金融先物
	(購入)	(売却)
- エマージング・マーケット・デッド	330 942 187.99 米ドル	277 934 594.02 米ドル
- ハイ・イールド	35 563 419.33 米ドル	137 517 648.42 米ドル
- US マルチ・クレジット	407 672 009.04 米ドル	254 361 664.88 米ドル

マルチ・マネージャー・アクセス	通貨に係る金融先物	
	(購入)	(売却)
- ハイ・イールド	- 米ドル	479 778 656.25 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)	(売却)
- エマージング・マーケット・デッド	87 511 941.22 米ドル	15 380 732.40 米ドル
- ハイ・イールド	2 808 038.82 米ドル	- 米ドル

マルチ・マネージャー・アクセス	指数に係るスワップおよび フォワード・スワップ	
	(購入)	(売却)
- ハイ・イールド	- 米ドル	4 472 537.04 米ドル

注8 - 総費用比率（TER）

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

過去12か月におけるTER

マルチ・マネージャー・アクセス	総経費率（TER）
- エマージング・マーケット・デッド F - a c c	0.75%
- エマージング・マーケット・デッド F - a c c 円ヘッジ	0.78%
- ハイ・イールド F - a c c	0.65%
- ハイ・イールド F - a c c 円ヘッジ	0.67%
- U S マルチ・クレジット F - a c c	0.51%
- U S マルチ・クレジット F - a c c 円ヘッジ	0.54%

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

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

注9 - その他のUCITSまたはUCIsへの投資

2020年1月31日現在、マルチ・マネージャー・アクセスは、その他のUCITSおよび/またはUCIs（以下「対象ファンド」という。）への投資を有している。報酬はサブ・ファンドおよび対象ファンドの両段階で生じる可能性がある。対象ファンドに課せられる管理報酬の割合の最大値は、以下のとおりである。

投資ファンド	管理報酬
BMO ILI SDG EGE -SHS -XP ACC USD PORTFOLIO HDG-CAPITAL	0.50%
FOCUSED SICAV - WORLD BANK BOND USD F-ACC	2.00%
FOCUSED SICAV - WORLD BANK LONG TERM BOND USD F-ACC	2.00%
FOCUSED SICAV-US CORPORATE BOND SUSTAIN USD F-ACC	2.00%
HERMES SDG ENGAGEMENT EQUITY FUND-SHS-X- HEDGED US-ACC	0.70%
HERMES SDG ENGAGEMENT HIGH YIELD CREDIT FUND-Y-ACC-USD	0.40%
HERMES-GLOBAL EQUITY ESG FUND-F-HEDGED USD-ACC	0.55%
ISHARES GREEN BOND INDEX FUND IE-D-HEDGED-USD-CAP	0.17%
MIROVA FDS GLOBAL SUSTAINABLE EQUITY SHS-H-SI/A(USD)NPF-CAP	0.75%
PICTET - GLOBAL ENVIRONMENTAL OPPORTUNITIES-HJ-USD-CAP	0.67%
UBS (LUX) EQUITY SICAV - LONG TERM THEMES (USD) F-ACC	0.67%
UBS ETF - MSCI SWITZERLAND 20/35 UCITS A-CAP	0.20%
UBS ETF - SUSTAINABLE DEVELOPMENT BANK BONDS UCITS-ETF-A-ACC	0.18%
UBS IRL ETF PLC-GLOBAL GENDER EQUALITY UCITS ETF-USD HDG-ACC	0.30%
UBS IRL ETF-MSCI ACWI ESG UNIVERSAL-A-HDG USD-ETF-ACC	0.48%
UBS IRL ETF-MSCI ACWI SOCIALLY RESPONSIBLE-A-HDG USD-ETF-ACC	0.48%
XTRACKERS MSCI USA UCITS ETF DR-1 C-USD CAP	0.01%

管理報酬は、不動産ファンドの保有高には適用されない。

注10 - 報告期間後の重大な事象

流行病の発生は、その規模によって短期的な市場のボラティリティーの増大を招き、世界経済および市場全般に悪影響を及ぼす可能性がある。広範囲に及ぶ感染病または伝染病のアウトブレイクにより、世界の経済状況が混乱し、本投資法人およびその潜在的なリターンに悪影響を及ぼす可能性がある。例えば、COVID-19（新型コロナウイルスまたはコロナウイルス感染症2019としても知られる）の継続的な拡大は、本投資法人の一部またはすべてのサブ・ファンドの価額、運用成績および財務状況に悪影響を及ぼす可能性がある。現在のCOVID-19のアウトブレイクの進展と結末については、依然として不透明である。

注11 - 適用法、業務地および公認言語

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

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

[次へ](#)

(2) 投資有価証券明細表等

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
ノート、固定利付債			
EUR			
EUR ARGENTINA, REPUBLIC OF STEP-UP 05-31.12.38	15 300 000.00	6 968 694.06	0.11
EUR ARGENTINA, REPUBLIC OF 7.82000% 05-31.12.33	14 740 000.00	11 948 712.93	0.18
EUR CENTRAL BANK OF TUNISIA-REG-S 6.75000% 18-31.10.23	2 210 000.00	2 534 075.93	0.04
EUR CENTRAL BANK OF TUNISIA-REG-S 6.37500% 19-15.07.26	11 105 000.00	12 145 037.38	0.19
EUR CROATIA, REPUBLIC OF-REG-S 1.12500% 19-19.06.29	12 143 000.00	14 007 763.33	0.22
EUR DIGI COMMUNICATIONS NV-REG-S 5.00000% 16-15.10.23	420 000.00	476 789.19	0.01
EUR INDONESIA, REPUBLIC OF 1.40000% 19-30.10.31	3 052 000.00	3 377 998.61	0.05
EUR INDONESIA, REPUBLIC OF 0.90000% 20-14.02.27	1 299 000.00	1 437 392.48	0.02
EUR IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 5.87500% 19-17.10.31	4 243 000.00	4 966 585.31	0.08
EUR MACEDONIA GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 5.62500% 16-26.07.23	6 330 000.00	8 159 212.55	0.12
EUR MACEDONIA GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 2.75000% 18-18.01.25	10 114 000.00	12 073 478.14	0.19
EUR MOROCCO, KINGDOM OF-REG-S 1.50000% 19-27.11.31	11 575 000.00	12 939 654.88	0.20
EUR PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 1.87500% 19-05.11.31	2 193 000.00	2 436 358.31	0.04
EUR PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 0.70000% 20-03.02.29	1 610 000.00	1 777 511.24	0.03
EUR SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 0.75000% 19-09.07.27	2 270 000.00	2 599 258.17	0.04
EUR SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 2.00000% 19-09.07.39	1 680 000.00	1 966 035.46	0.03
EUR SERBIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 1.50000% 19-26.06.29	17 895 000.00	20 327 019.98	0.31
EUR UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 4.37500% 20-27.01.30	9 163 000.00	10 063 046.67	0.15
EUR UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 6.75000% 19-20.06.26	4 682 000.00	6 023 955.78	0.09
ユーロ合計		136 228 580.40	2.10
USD			
USD ABENGOA TRANSMISION SUR SA-REG-S 6.87500% 14-30.04.43	3 165 000.00	3 945 209.53	0.06
USD ABU DHABI CRUDE OIL PIPELINE LLC-REG-S 3.65000% 17-02.11.29	6 049 000.00	6 593 410.00	0.10
USD ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO PJSC-REG-S 4.87500% 18-23.04.30	1 379 000.00	1 595 330.62	0.02
USD ABU DHABI, GOVERNMENT OF-REG-S 4.12500% 17-11.10.47	6 150 000.00	7 314 656.25	0.11
USD ABU DHABI, GOVERNMENT OF-REG-S 2.50000% 17-11.10.22	2 260 000.00	2 293 900.00	0.04
USD ADANI PORTS AND SPECIAL ECO ZONE-REG-S 4.37500% 19-03.07.29	1 760 000.00	1 858 450.00	0.03
USD ADANI TRANSMISSION LTD-REG-S 4.00000% 16-03.08.26	7 200 000.00	7 501 500.00	0.12
USD ADANI TRANSMISSION LTD-REG-S 4.25000% 19-21.05.36	500 000.00	507 030.45	0.01
USD AEROPUERTO INTERNACIONAL DE TOCU-REG-S 6.00000% 18-18.11.48	4 522 000.00	5 686 550.66	0.09
USD AEROPUERTOS ARGENTINA 2000 SA-REG-S 6.87500% 17-01.02.27	730 000.00	641 302.14	0.01
USD AEROPUERTOS DOMINICANOS-REG-S 6.75000% 17-30.03.29	6 760 000.00	7 468 177.60	0.12
USD AES EL SALVADOR TRUST II-REG-S 6.75000% 13-28.03.23	2 228 000.00	2 251 672.50	0.03
USD AFREN PLC-REG-S 6.62500% 13-09.12.20	993 000.00	387.60	0.00
USD AFRICA FINANCE CORP-REG-S 3.75000% 19-30.10.29	2 973 000.00	3 041 379.00	0.05
USD AGUA Y SANEAMIENTOS ARGENTINOS SA-REG-S 6.62500% 18-01.02.23	1 838 000.00	928 764.37	0.01
USD AI CANDELARIA SPAIN SLU-REG-S 7.50000% 18-15.12.28	4 844 000.00	5 526 059.41	0.09
USD AJECORP BV-REG-S 6.50000% 12-14.05.22	1 576 000.00	1 571 864.58	0.02
USD ALIBABA GROUP HOLDING LTD 4.00000% 17-06.12.37	1 720 000.00	1 938 526.00	0.03
USD ALIBABA GROUP HOLDING LTD 4.20000% 17-06.12.47	2 658 000.00	3 121 488.75	0.05
USD ALTICE FINCO SA-144A 8.12500% 13-15.01.24	6 217 000.00	6 391 853.12	0.10
USD AMBER CIRCLE FUNDING LTD-REG-S 3.25000% 12-04.12.22	1 639 000.00	1 685 609.06	0.03
USD AMERICA MOVIL SAB DE CV 4.37500% 19-22.04.49	4 857 000.00	5 872 416.57	0.09
USD AMERICA MOVIL SAB DE CV 3.62500% 19-22.04.29	2 700 000.00	2 948 062.50	0.05
USD ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT-144A 3.37500% 12-01.11.22	1 000 000.00	1 009 062.50	0.02
USD ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT-REG-S 3.37500% 12-01.11.22	10 125 000.00	10 219 921.87	0.16
USD ANGOLAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 9.37500% 18-08.05.48	26 051 000.00	28 224 630.31	0.44
USD ARCOR SAIC-REG-S 6.00000% 16-06.07.23	5 821 000.00	5 713 311.50	0.09
USD ARGENTINA, REPUBLIC OF 4.62500% 18-11.01.23	9 717 000.00	4 469 820.00	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

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD ARGENTINA, REPUBLIC OF 5.87500% 18-11.01.28	5 129 000.00	2 245 540.31	0.03
USD ARGENTINA, REPUBLIC OF 6.87500% 18-11.01.48	20 301 000.00	8 564 484.38	0.13
USD ARGENTINA, REPUBLIC OF 8.280% 10-31.12.33	352 000.00	269 429.64	0.00
USD ARMENIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 3.95000% 19-26.09.29	5 733 000.00	5 796 063.00	0.09
USD AZURE POWER ENERGY LTD-REG-S 5.50000% 17-03.11.22	2 184 000.00	2 239 965.00	0.03
USD BAHAMAS GOVERNMENT INTERNATIONAL-REG-S 6.00000% 17-21.11.28	8 636 000.00	9 761 378.75	0.15
USD BAHRAIN GVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.12500% 13-01.08.23	1 100 000.00	1 215 500.00	0.02
USD BAHRAIN GVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 7.00000% 15-26.01.26	2 500 000.00	2 930 468.75	0.05
USD BAHRAIN GVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.75000% 17-20.09.29	3 411 000.00	3 961 023.75	0.06
USD BANCO ABC BRASIL SA REG-S-SUB 7.87500% 10-08.04.20	2 310 000.00	2 344 650.00	0.04
USD BANCO BTG PACTUAL SA/CAYMAN-REG-S 4.50000% 19-10.01.25	1 505 000.00	1 550 150.00	0.02
USD BANCO DE BOGOTA SA-REG-S-SUB 5.37500% 13-19.02.23	2 340 000.00	2 513 306.24	0.04
USD BANCO DE BOGOTA SA-REG-S-SUB 6.25000% 16-12.05.26	20 965 000.00	23 766 580.20	0.37
USD BANCO DE BOGOTA SA-REG-S 4.37500% 17-03.08.27	637 000.00	685 770.31	0.01
USD BANCO DE CREDITO E INVERSIONES-REG-S 3.50000% 17-12.10.27	2 010 000.00	2 070 928.13	0.03
USD BANCO DEL ESTADO DE CHILE-REG-S 3.87500% 12-08.02.22	1 044 000.00	1 074 993.75	0.02
USD BANCO DEL ESTADO DE CHILE-REG-S 2.70400% 20-09.01.25	924 000.00	932 085.00	0.01
USD BANCO DO BRASIL SA-REG-S-SUB 5.87500% 11-26.01.22	2 162 000.00	2 285 774.50	0.04
USD BANCO INBURSA SA-REG-S 4.37500% 17-11.04.27	2 146 000.00	2 266 712.50	0.04
USD BANCO NACIONAL DE COM EXTER SNC-REG-S 4.37500% 15-14.10.25	850 000.00	913 750.00	0.01
USD BANCO NACIONAL DE COSTA RICA-REG-S 6.25000% 13-01.11.23	810 000.00	863 662.50	0.01
USD BANCOLOMBIA SA 3.00000% 20-29.01.25	1 020 000.00	1 027 165.50	0.02
USD BANQUE OUEST AFRICAINE DE DEV-REG-S 5.00000% 17-27.07.27	3 441 000.00	3 716 004.72	0.06
USD BANQUE OUEST AFRICAINE DE DEV-REG-S 4.70000% 19-22.10.31	2 469 000.00	2 586 573.78	0.04
USD BBVA BANCOMER SA/TEXAS-REG-S-SUB 6.50000% 11-10.03.21	6 270 000.00	6 522 759.37	0.10
USD BBVA BANCOMER SA/TEXAS-REG-S-SUB 6.75000% 12-30.09.22	1 711 000.00	1 877 822.50	0.03
USD BECLE SA DE CV-REG-S 3.75000% 15-13.05.25	6 318 000.00	6 543 078.74	0.10
USD BELARUS INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.87500% 17-28.02.23	4 396 000.00	4 740 811.25	0.07
USD BELARUS INTERNATIONAL BOND-REG-S 7.62500% 17-29.06.27	2 138 000.00	2 470 058.13	0.04
USD BERMUDA, GOVERNMENT OF-REG-S 3.71700% 16-25.01.27	2 307 000.00	2 459 838.75	0.04
USD BHARTI AIRTEL INTL NETHERLANDS BV-REG-S 5.12500% 13-11.03.23	460 000.00	485 300.00	0.01
USD BHARTI AIRTEL LTD-REG-S 4.37500% 15-10.06.25	2 295 000.00	2 382 305.02	0.04
USD BOLIVIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.95000% 13-22.08.23	582 000.00	618 011.25	0.01
USD BOLIVIA, REPUBLIC OF-REG-S 4.50000% 17-20.03.28	5 021 000.00	4 878 215.31	0.08
USD BRASKEM AMERICA FINANCE CO-REG-S 7.12500% 11-22.07.41	1 450 000.00	1 733 964.38	0.03
USD BRASKEM IDESA SAPI-REG-S 7.45000% 19-15.11.29	7 508 000.00	7 939 710.00	0.12
USD BRASKEM NETHERLANDS FINANCE BV-REG-S 4.50000% 19-31.01.30	6 693 000.00	6 724 457.10	0.10
USD BRASKEM NETHERLANDS FINANCE BV-REG-S 5.87500% 19-31.01.50	650 000.00	672 698.00	0.01
USD BRAZIL LOAN TRUST 1-REG-S 5.47700% 13-24.07.23	2 920 000.00	1 539 400.19	0.02
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 5.62500% 09-07.01.41	530 000.00	615 131.25	0.01
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 4.25000% 13-07.01.25	5 000 000.00	5 414 062.50	0.08
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 4.62500% 17-13.01.28	8 365 000.00	9 245 939.06	0.14
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 4.75000% 19-14.01.50	19 339 000.00	19 937 300.31	0.31
USD CABLE ONDA SA-REG-S 4.50000% 19-30.01.30	13 315 000.00	13 780 891.85	0.21
USD CANARA BANK/LONDON-REG-S 3.87500% 19-28.03.24	3 918 000.00	4 074 720.00	0.06
USD CELULOSA ARAUCO Y CONSTITUCION SA-REG-S 5.50000% 19-30.04.49	1 140 000.00	1 215 525.00	0.02
USD CEMEX SAB DE CV-REG-S 7.75000% 16-16.04.26	2 865 000.00	3 122 850.00	0.05
USD CEMIG GERACAO E TRANSMISSAO SA-REG-S 9.25000% 17-05.12.24	10 293 000.00	12 046 026.56	0.19
USD CENCOSUD SA-144A 6.62500% 15-12.02.45	400 000.00	440 125.00	0.01
USD CENCOSUD SA-REG-S 4.37500% 17-17.07.27	1 614 000.00	1 652 332.50	0.03
USD CENCOSUD SA-REG-S 6.62500% 15-12.02.45	1 800 000.00	1 980 562.50	0.03
USD CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA-REG-S 5.75000% 11-27.10.21	1 245 000.00	1 310 751.56	0.02
USD CENTRAL AMERICAN BOTTLING CORP-REG-S 5.75000% 17-31.01.27	9 180 000.00	9 699 243.75	0.15
USD CENTRAL CHINA REAL ESTATE-REG-S 8.75000% 15-23.01.21	1 998 000.00	2 033 504.46	0.03
USD CERRO DEL AGUILA SA-REG-S 4.12500% 17-16.08.27	1 586 000.00	1 645 475.00	0.03
USD CFLD CAYMAN INVESTMENT LTD-REG-S 8.60000% 19-08.04.24	2 036 000.00	2 037 908.75	0.03
USD CHILE, REPUBLIC OF 3.24000% 18-06.02.28	553 000.00	594 302.19	0.01
USD CHILE, REPUBLIC OF 3.50000% 19-25.01.50	10 506 000.00	11 415 425.63	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

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD CHINA EVERGRANDE GROUP-REG-S 9.50000% 19-11.04.22	3 963 000.00	3 819 341.25	0.06
USD CHINA EVERGRANDE GROUP-REG-S 10.00000% 19-11.04.23	2 110 000.00	1 975 487.50	0.03
USD CHINA EVERGRANDE GROUP-REG-S 11.50000% 20-22.01.23	12 432 000.00	12 152 280.00	0.19
USD CHINA EVERGRANDE GROUP-REG-S 12.00000% 20-22.01.24	12 814 000.00	12 381 527.50	0.19
USD CHINA HONGQIAO GROUP LTD-REG-S 7.12500% 19-22.07.22	760 000.00	723 900.00	0.01
USD CIA GENERAL DE COMBUSTIBLES SA-REG-S 9.50000% 16-07.11.21	2 584 000.00	2 336 097.50	0.04
USD CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD-REG-S 6.87500% 18-23.04.21	715 000.00	730 536.95	0.01
USD CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD-REG-S 6.00000% 20-16.07.25	3 910 000.00	3 807 362.50	0.06
USD CIMPOR FINANCIAL OPERATIONS BV-REG-S 5.75000% 14-17.07.24	730 000.00	628 028.13	0.01
USD CK HUTCHISON INTERNATIONAL 17 LTD-REG-S 2.87500% 17-05.04.22	1 660 000.00	1 687 493.75	0.03
USD CNAC HK FINBRIDGE CO LTD-REG-S 4.12500% 18-14.03.21	18 440 000.00	18 779 987.50	0.29
USD CNAC HK FINBRIDGE CO LTD-REG-S 5.12500% 18-14.03.28	3 870 000.00	4 445 662.50	0.07
USD CNAC HK FINBRIDGE CO LTD-REG-S 3.37500% 19-19.06.24	17 070 000.00	17 544 759.37	0.27
USD CNOOC FINANCE 2011 LTD-REG-S 5.75000% 11-26.01.41	800 000.00	1 116 750.00	0.02
USD COCA-COLA FEMSA SA 5.25000% 13-26.11.43	282 000.00	366 776.25	0.01
USD COCA-COLA ICECEK AS-REG-S 4.21500% 17-19.09.24	9 890 000.00	10 171 246.87	0.16
USD COLOMBIA TELECOMUNICACIONES SA-REG-S 12-27.09.22	760 000.00	768 075.00	0.01
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 3.87500% 17-25.04.27	13 135 000.00	14 132 439.05	0.22
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 4.50000% 18-15.03.29	8 314 000.00	9 368 838.75	0.14
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 5.20000% 19-15.05.49	6 345 000.00	7 972 889.06	0.12
USD COMETA ENERGIA SA DE CV-REG-S 6.37500% 18-24.04.35	7 963 000.00	8 775 911.95	0.14
USD COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD-REG-S 4.75000% 16-23.02.27	1 420 000.00	1 538 037.50	0.02
USD COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD-REG-S 4.87500% 13-15.01.24	983 000.00	1 068 398.12	0.02
USD CONSORCIO TRANSMANTARO-REG-S 4.70000% 19-16.04.34	6 030 000.00	6 761 137.50	0.10
USD CONTROLADORA MABE SA DE CV-REG-S 5.60000% 18-23.10.28	2 670 000.00	3 007 171.07	0.05
USD CORP FINANCIERA DE DESARROLLO SA-REG-S 4.75000% 12-08.02.22	2 674 000.00	2 800 179.38	0.04
USD CORP FINANCIERA DE DESARROLLO SA-REG-S 4.75000% 15-15.07.25	2 900 000.00	3 197 250.00	0.05
USD CORP LINDLEY SA-REG-S 6.75000% 11-23.11.21	691 000.00	720 367.50	0.01
USD CORP LINDLEY SA-REG-S 4.62500% 13-12.04.23	1 943 000.00	2 012 826.56	0.03
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 4.25000% 12-17.07.42	792 000.00	860 805.00	0.01
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 4.50000% 15-16.09.25	1 560 000.00	1 725 262.50	0.03
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 3.62500% 17-01.08.27	852 000.00	907 380.00	0.01
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 4.50000% 17-01.08.47	808 000.00	917 837.50	0.01
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 4.37500% 19-05.02.49	5 679 000.00	6 348 057.19	0.10
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 3.00000% 19-30.09.29	1 715 000.00	1 736 973.44	0.03
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 3.70000% 19-30.01.50	1 930 000.00	1 931 809.38	0.03
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 3.15000% 20-14.01.30	2 691 000.00	2 735 383.20	0.04
USD COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 4.25000% 12-26.01.23	4 010 000.00	4 053 859.37	0.06
USD COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 7.00000% 14-04.04.44	6 193 000.00	6 566 515.31	0.10
USD COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 7.15800% 15-12.03.45	15 303 000.00	16 426 814.08	0.25
USD COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 6.12500% 19-19.02.31	4 059 000.00	4 311 419.06	0.07
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 8.00000% 18-27.01.24	600 000.00	651 000.00	0.01
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 7.12500% 19-25.04.22	1 310 000.00	1 386 962.50	0.02
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 7.25000% 19-08.04.26	1 320 000.00	1 443 750.00	0.02
USD CREDIT BK MOSCOW/CBOM FIN-REG-S 4.70000% 20-29.01.25	5 338 000.00	5 330 847.08	0.08
USD CSN ISLANDS XII CORP-REG-S 7.00000% 10-PRP	305 000.00	285 175.00	0.00
USD CSN RESOURCES SA-REG-S 7.62500% 18-13.02.23	3 419 000.00	3 591 659.50	0.06
USD CSN RESOURCES SA-REG-S 7.62500% 19-17.04.26	2 580 000.00	2 710 425.45	0.04
USD DEBT AND ASSET TRADING CORP-REG-S 1.00000% 13-10.10.25	1 020 000.00	805 481.25	0.01
USD DELEK & AVNER TAMAR BOND LTD-144A 5.08200% 14-30.12.23	2 823 599.00	2 925 954.47	0.05
USD DELEK & AVNER TAMAR BOND LTD-144A 5.41200% 14-30.12.25	2 852 041.00	2 979 491.59	0.05
USD DEV BK OF THE REPUBLIC OF BELARUS-REG-S 6.75000% 19-02.05.24	1 510 000.00	1 610 037.50	0.02
USD DEVELOPMENT BANK OF KAZAKHSTAN-REG-S 4.12500% 12-10.12.22	1 885 000.00	1 968 057.82	0.03
USD DIGICEL LTD-REG-S 6.75000% 15-01.03.23	510 000.00	327 196.87	0.01
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 5.50000% 15-27.01.25	9 689 000.00	10 361 174.36	0.16
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 6.85000% 15-27.01.45	14 930 000.00	16 800 915.63	0.26
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 6.87500% 16-29.01.26	11 550 000.00	13 174 218.75	0.20
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 5.95000% 17-25.01.27	5 521 000.00	6 055 846.87	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

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 6.50000% 18-15.02.48	11 769 000.00	12 791 431.87	0.20
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 6.00000% 18-19.07.28	4 404 000.00	4 867 796.24	0.08
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 6.40000% 19-05.06.49	18 891 000.00	20 372 762.82	0.31
USD EASY TACTIC LTD-REG-S 5.75000% 17-13.01.22	900 000.00	876 375.00	0.01
USD EASY TACTIC LTD-REG-S 8.12500% 19-11.07.24	1 443 000.00	1 421 355.00	0.02
USD ECOPETROL SA 5.87500% 13-18.09.23	3 738 000.00	4 176 093.60	0.06
USD ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S 9.65000% 16-13.12.26	11 964 000.00	10 554 491.25	0.16
USD ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S 9.62500% 17-02.06.27	11 424 000.00	10 064 544.00	0.16
USD ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S 8.87500% 17-23.10.27	27 943 000.00	23 707 889.06	0.37
USD ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S 7.87500% 18-23.01.28	22 583 000.00	18 362 801.88	0.28
USD ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S 10.75000% 19-31.01.29	15 592 000.00	14 125 377.51	0.22
USD ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S 7.87500% 19-27.03.25	5 450 000.00	4 639 312.50	0.07
USD ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S 9.50000% 19-27.03.30	16 927 000.00	14 551 930.31	0.22
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 5.57700% 18-21.02.23	4 411 000.00	4 631 550.00	0.07
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 7.90300% 18-21.02.48	21 928 000.00	23 695 945.01	0.37
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 6.58800% 18-21.02.28	2 080 000.00	2 217 800.00	0.03
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 4.55000% 19-20.11.23	20 523 000.00	21 087 382.50	0.33
USD EL PUERTO DE LIVERPOOL SA DE CV-REG-S 3.87500% 16-06.10.26	1 352 000.00	1 397 630.00	0.02
USD EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 7.75000% 02-24.01.23	6 399 000.00	7 070 895.00	0.11
USD EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 7.62500% 11-01.02.41	1 201 000.00	1 398 789.68	0.02
USD EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 5.87500% 12-30.01.25	3 006 000.00	3 228 631.89	0.05
USD EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 6.37500% 14-18.01.27	3 639 000.00	3 980 156.25	0.06
USD EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 8.62500% 17-28.02.29	5 956 000.00	7 316 573.75	0.11
USD EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 7.12460% 19-20.01.50	14 840 000.00	16 268 350.00	0.25
USD EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 8.25000% 02-10.04.32	787 000.00	960 385.94	0.01
USD EMBRAER NETHERLANDS FINANCE BV 5.40000% 17-01.02.27	4 711 000.00	5 336 432.36	0.08
USD EMPRESA DE TRANSMISION ELECTRICA-REG-S 5.12500% 19-02.05.49	3 500 000.00	4 101 562.50	0.06
USD EMPRESA DE TRANSPORTE DE PASA MET-REG-S 4.75000% 14-04.02.24	2 000 000.00	2 152 500.00	0.03
USD EMPRESA ELECTRICA ANGAMOS SA-REG-S 4.87500% 14-25.05.29	2 095 000.00	1 817 166.55	0.03
USD EMPRESA NACIONAL DE TELECOM SA-REG-S 4.87500% 13-30.10.24	400 000.00	427 250.00	0.01
USD EMPRESA NACIONAL DEL PETROLEO-REG-S 3.75000% 16-05.08.26	3 257 000.00	3 392 979.75	0.05
USD EMPRESA NACIONAL DEL PETROLEO-REG-S 4.50000% 17-14.09.47	1 838 000.00	1 915 345.43	0.03
USD EMPRESA NACIONAL DEL PETROLEO-REG-S 5.25000% 18-06.11.29	8 138 000.00	9 220 405.27	0.14
USD ENEL CHILE SA 4.87500% 18-12.06.28	1 657 000.00	1 852 733.13	0.03
USD ESKOM HOLDINGS SOC LTD-REG-S 6.75000% 13-06.08.23	4 770 000.00	4 816 269.00	0.07
USD ESKOM HOLDINGS SOC LTD-REG-S 7.12500% 15-11.02.25	10 778 000.00	10 926 197.50	0.17
USD ETERNA CAPITAL PTE LTD (PIK) 8.00000% 17-11.12.22	627 806.00	349 509.19	0.01
USD EVRAZ PLC-REG-S 5.37500% 17-20.03.23	1 947 000.00	2 090 591.25	0.03
USD EXPORT CREDIT BANK OF TURKEY-REG-S 5.37500% 16-24.10.23	7 564 000.00	7 729 462.50	0.12
USD EXPORT CREDIT BANK OF TURKEY-REG-S 6.12500% 18-03.05.24	3 330 000.00	3 473 606.25	0.05
USD FENIX POWER PERU SA-REG-S 4.31700% 17-20.09.27	3 040 000.00	2 933 125.00	0.05
USD FINANSBANK AS-REG-S 6.87500% 19-07.09.24	4 447 000.00	4 855 568.12	0.08
USD FIRST QUANTUM MINERALS LTD-144A 7.25000% 17-01.04.23	910 000.00	907 916.10	0.01
USD FIRST QUANTUM MINERALS LTD-REG-S 7.25000% 14-15.05.22	511 000.00	508 153.73	0.01
USD FIRST QUANTUM MINERALS LTD-REG-S 7.25000% 17-01.04.23	3 781 000.00	3 772 341.51	0.06
USD FIRST QUANTUM MINERALS LTD-REG-S 7.50000% 20-01.04.25	1 770 000.00	1 754 308.95	0.03
USD FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV 4.37500% 13-10.05.43	1 000 000.00	1 161 250.00	0.02
USD FOMENTO ECONOMICO MEXIC SAB DE CV 3.50000% 20-16.01.50	10 146 000.00	10 389 909.84	0.16
USD FORTUNE STAR BVI LTD-REG-S 6.75000% 19-02.07.23	1 660 000.00	1 727 956.25	0.03
USD FRESNILLO PLC-144A 5.50000% 13-13.11.23	1 570 000.00	1 714 292.89	0.03
USD FRESNILLO PLC-REG-S 5.50000% 13-13.11.23	4 732 000.00	5 166 900.61	0.08
USD FUTURE RETAIL LTD-REG-S 5.60000% 20-22.01.25	3 119 000.00	3 126 797.50	0.05
USD FWD GROUP LTD-REG-S-SUB 5.75000% 19-09.07.24	1 720 000.00	1 784 785.17	0.03
USD GABON, REPUBLIC OF-REG-S 6.62500% 20-06.02.31	8 692 000.00	8 746 325.00	0.14
USD GEOPARK LTD-REG-S 5.50000% 20-17.01.27	1 690 000.00	1 683 662.50	0.03
USD GEOPARK LTD-REG-S 6.50000% 17-21.09.24	3 226 000.00	3 394 356.88	0.05
USD GERDAU TRADE INC-REG-S 4.87500% 17-24.10.27	5 665 000.00	6 236 810.94	0.10
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 7.87500% 13-07.08.23	3 540 000.00	3 957 056.25	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

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / 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 7.62500% 18-16.05.29	15 268 000.00	15 573 360.00	0.24
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 8.62700% 18-16.06.49	3 329 000.00	3 330 040.31	0.05
USD GLOBAL LIMAN ISLETMELERI-REG-S 8.12500% 14-14.11.21	5 950 000.00	5 860 750.00	0.09
USD GLOBO COMUNICACOES E PARTICIPACO-REG-S 4.87500% 20-22.01.30	1 540 000.00	1 571 600.80	0.02
USD GMR HYDERABAD INTNATL AIRPORT LTD-REG-S 5.37500% 19-10.04.24	2 570 000.00	2 671 193.75	0.04
USD GNL QUINTERO SA-REG-S 4.63400% 14-31.07.29	4 803 000.00	5 132 005.50	0.08
USD GOL FINANCE SA-REG-S 7.00000% 17-31.01.25	1 950 000.00	1 980 225.00	0.03
USD GOLD FIELDS OROGEN HLDING BVI LTD-REG-S 4.87500% 10-07.10.20	3 287 000.00	3 332 196.25	0.05
USD GOLD FIELDS OROGEN HOLDINGS BVI-REG-S 5.12500% 19-15.05.24	660 000.00	709 500.00	0.01
USD GOLD FIELDS OROGEN HOLDINGS-REG-S 6.12500% 19-15.05.29	3 998 000.00	4 575 211.25	0.07
USD GREENKO DUTCH BV-REG-S 4.87500% 17-24.07.22	2 120 000.00	2 136 562.50	0.03
USD GREENKO MAURITIUS LTD-REG-S 6.25000% 19-21.02.23	3 089 000.00	3 181 670.00	0.05
USD GROWTHPOINT PROPERTIES INT PTY-REG-S 5.87200% 18-02.05.23	840 000.00	905 887.50	0.01
USD GRUMA SA DE CV-REG-S 4.87500% 14-01.12.24	6 727 000.00	7 286 181.87	0.11
USD GRUPO AVAL LTD-REG-S 4.37500% 20-04.02.30	7 012 000.00	7 089 833.20	0.11
USD GRUPO BIMBO SA DE CV-REG-S 4.00000% 19-06.09.49	1 788 000.00	1 800 571.96	0.03
USD GRUPO CEMENTO DE CHIHUA SAB DE CV-REG-S 5.25000% 17-23.06.24	2 660 000.00	2 773 050.00	0.04
USD GTH FINANCE BV-REG-S 7.25000% 16-26.04.23	1 374 000.00	1 540 226.52	0.02
USD GTL TRADE FINANCE INC-REG-S 7.25000% 14-16.04.44	915 000.00	1 194 932.81	0.02
USD GTLK EUROPE CAPITAL DAC-REG-S 4.94900% 19-18.02.26	2 939 000.00	3 071 255.00	0.05
USD GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 5.75000% 12-06.06.22	7 940 000.00	8 443 693.75	0.13
USD GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 4.50000% 16-03.05.26	12 222 000.00	12 844 558.13	0.20
USD GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 4.90000% 19-01.06.30	7 840 000.00	8 432 900.00	0.13
USD GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 6.12500% 19-01.06.50	4 950 000.00	5 867 296.88	0.09
USD GUSAP III-REG-S 4.25000% 19-21.01.30	4 053 000.00	4 253 623.50	0.07
USD HAITONG INTERNATIONAL SECURITIES-REG-S 3.37500% 19-19.07.24	1 624 000.00	1 668 261.47	0.03
USD HAITONG INTERNATIONAL SECURITIES-REG-S 3.12500% 19-18.05.25	800 000.00	813 610.40	0.01
USD HARVEST OPERATIONS CORP-REG-S 3.00000% 17-21.09.22	200 000.00	205 312.50	0.00
USD HKT CAPITAL NO 4 LTD-REG-S 3.00000% 16-14.07.26	2 800 000.00	2 840 250.00	0.04
USD HONDURAS, REPUBLIC OF-REG-S 6.25000% 17-19.01.27	6 872 000.00	7 621 477.51	0.12
USD HONDURAS, REPUBLIC OF-REG-S 7.50000% 13-15.03.24	2 340 000.00	2 617 875.00	0.04
USD HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS LTD-REG-S 7.50000% 19-27.06.22	3 090 000.00	3 136 350.00	0.05
USD HPHT FINANCE 19 LTD-REG-S 2.87500% 19-05.11.24	1 683 000.00	1 703 768.22	0.03
USD HUARONG FINANCE 2017 CO-REG-S 3.75000% 17-27.04.22	7 420 000.00	7 607 818.75	0.12
USD HUNGARY, REPUBLIC OF 7.62500% 11-29.03.41	370 000.00	622 871.88	0.01
USD HUNGARY, REPUBLIC OF 5.37500% 13-21.02.23	3 078 000.00	3 397 342.49	0.05
USD HUNGARY, REPUBLIC OF 5.75000% 13-22.11.23	7 264 000.00	8 294 580.00	0.13
USD HUNGARY, REPUBLIC OF 5.37500% 14-25.03.24	11 786 000.00	13 421 307.50	0.21
USD HYUNDAI CAPITAL AMERICA-REG-S 2.75000% 16-27.09.26	1 300 000.00	1 302 538.77	0.02
USD HYUNDAI CAPITAL AMERICA-REG-S 3.50000% 19-02.11.26	404 000.00	421 692.25	0.01
USD IHS NETHERLANDS HOLDCO BV-REG-S 7.12500% 19-18.03.25	3 187 000.00	3 382 203.75	0.05
USD IHS NETHERLANDS HOLDCO BV-REG-S 8.00000% 19-18.09.27	5 009 000.00	5 384 675.00	0.08
USD INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM TBK PT-REG-S 5.23000% 18-15.11.21	8 570 000.00	8 977 075.00	0.14
USD INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM TBK PT-REG-S 5.71000% 18-15.11.23	11 022 000.00	12 193 087.50	0.19
USD INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM TBK PT-REG-S 6.53000% 18-15.11.28	2 189 000.00	2 681 525.00	0.04
USD INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM TBK PT-REG-S 6.75700% 18-15.11.48	6 294 000.00	8 095 657.50	0.12
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 3.50000% 17-11.01.28	2 300 000.00	2 429 375.00	0.04
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 4.35000% 17-11.01.48	2 500 000.00	2 820 312.50	0.04
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 4.75000% 18-11.02.29	991 000.00	1 144 605.00	0.02
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 2.85000% 20-14.02.30	9 785 000.00	9 895 081.25	0.15
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 7.75000% 08-17.01.38	2 444 000.00	3 766 815.00	0.06
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.25000% 12-17.01.42	14 039 000.00	17 368 875.32	0.27
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 4.35000% 16-08.01.27	1 600 000.00	1 767 500.00	0.03
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.25000% 16-08.01.47	1 171 000.00	1 468 873.12	0.02
USD INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA-REG-S 4.87500% 17-14.01.48	742 000.00	746 405.62	0.01
USD INKIA ENERGY LTD-REG-S 5.87500% 17-09.11.27	3 168 000.00	3 346 200.00	0.05
USD INSTITUTO COSTARRICENSE DE ELEC-REG-S 6.95000% 11-10.11.21	1 700 000.00	1 770 125.00	0.03
USD INSTITUTO COSTARRICENSE DE ELEC-REG-S 6.37500% 13-15.05.43	540 000.00	473 681.25	0.01

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD INTERCORP PERU LTD-REG-S 3.87500% 19-15.08.29	640 000.00	646 700.03	0.01
USD INTERNATIONAL AIRPORT FINANCE SA-REG-S 12.00000% 19-15.03.33	3 945 000.00	4 329 637.50	0.07
USD INVERSIONES CMPC SA-REG-S 4.37500% 17-04.04.27	3 946 000.00	4 201 700.80	0.06
USD IRSA PROPIEDADES COMERCIALES SA-REG-S 8.75000% 16-23.03.23	2 382 000.00	2 242 801.87	0.03
USD ISRAEL CHEMICALS LTD-144A-REG-S 6.37500% 18-31.05.38	945 000.00	1 142 564.06	0.02
USD ISRAEL ELECTRIC CORP LTD-144A-REG-S 5.00000% 14-12.11.24	5 518 000.00	6 114 633.76	0.09
USD ISRAEL ELECTRIC CORP LTD-REG-S 6.87500% 13-21.06.23	3 732 000.00	4 252 147.50	0.07
USD ITAU UNIBANCO HOLDING SA-REG-S-SUB 6.20000% 11-21.12.21	2 410 000.00	2 551 467.00	0.04
USD ITAU UNIBANCO HOLDING SA-REG-S-SUB 5.12500% 12-13.05.23	1 773 000.00	1 891 569.38	0.03
USD IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S STEP-UP 10-31.12.32	21 027 000.00	17 944 376.08	0.28
USD JAMAICA, GOVERNMENT OF 6.75000% 15-28.04.28	2 850 000.00	3 375 468.75	0.05
USD JAMAICA, GOVERNMENT OF 7.87500% 15-28.07.45	10 694 000.00	14 580 600.63	0.22
USD JBS INVESTMENTS II GMBH-REG-S 7.00000% 18-15.01.26	3 316 000.00	3 609 499.16	0.06
USD JBS INVESTMENTS II GMBH-REG-S 5.75000% 19-15.01.28	3 860 000.00	4 075 040.60	0.06
USD JD.COM INC 3.37500% 20-14.01.30	2 184 000.00	2 236 452.69	0.03
USD JD.COM INC 3.87500% 16-29.04.26	970 000.00	1 030 928.13	0.02
USD JORDAN, KINGDOM OF-REG-S 5.75000% 16-31.01.27	3 034 000.00	3 240 691.25	0.05
USD JSC GEORGIAN RAILWAY-REG-S 7.75000% 12-11.07.22	2 380 000.00	2 612 050.00	0.04
USD KAISA GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 11.95000% 19-22.10.22	7 977 000.00	8 438 170.31	0.13
USD KAISA GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 11.25000% 19-09.04.22	5 777 000.00	6 076 681.87	0.09
USD KAISA GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 11.50000% 19-30.01.23	2 955 000.00	3 021 487.50	0.05
USD KAISA GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 10.50000% 20-15.01.25	7 380 000.00	7 186 275.00	0.11
USD KALLPA GENERACION SA-REG-S 4.87500% 16-24.05.26	640 000.00	689 200.00	0.01
USD KAZMUNAYGAS NATIONAL CO-REG-S 3.87500% 17-19.04.22	3 900 000.00	4 030 650.00	0.06
USD KAZMUNAYGAS NATIONAL CO-REG-S 4.75000% 17-19.04.27	5 600 000.00	6 259 750.00	0.10
USD KAZMUNAYGAS NATIONAL CO-REG-S 5.75000% 17-19.04.47	11 247 000.00	13 777 575.00	0.21
USD KAZMUNAYGAS NATIONAL CO-REG-S 4.75000% 18-24.04.25	400 000.00	441 750.00	0.01
USD KAZMUNAYGAS NATIONAL CO-REG-S 6.37500% 18-24.10.48	10 504 000.00	14 080 612.00	0.22
USD KAZMUNAYGAS NATIONAL CO-REG-S 5.37500% 18-24.04.30	7 814 000.00	9 279 593.84	0.14
USD KENYA, REPUBLIC OF-REG-S 8.25000% 18-28.02.48	6 964 000.00	7 499 357.50	0.12
USD KENYA, REPUBLIC OF-REG-S 8.00000% 19-22.05.32	13 139 000.00	14 272 238.75	0.22
USD KENYA, REPUBLIC OF-REG-S 7.00000% 19-22.05.27	4 291 000.00	4 553 823.75	0.07
USD KOC HOLDING AS-REG-S 5.25000% 16-15.03.23	7 797 000.00	8 094 260.64	0.12
USD KOKS OAO FINANCE LTD-REG-S 7.50000% 17-04.05.22	805 000.00	838 206.25	0.01
USD KOSMOS ENERGY LTD-144A 7.12500% 19-04.04.26	910 000.00	921 659.38	0.01
USD KOSMOS ENERGY LTD-REG-S 7.12500% 19-04.04.26	8 083 000.00	8 186 563.44	0.13
USD KUWAIT INTERNATIONAL GOVT BOND-REG-S 3.50000% 17-20.03.27	9 110 000.00	9 878 656.25	0.15
USD KUWAIT PROJECTS CO SPC LTD-REG-S 4.22900% 19-29.10.26	4 560 000.00	4 725 300.00	0.07
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S 6.65000% 15-26.02.30	7 273 000.00	2 581 915.00	0.04
USD LIGHT SERVICOS DE ELETRICIDADE SA-REG-S 7.25000% 18-03.05.23	1 016 000.00	1 092 073.00	0.02
USD LIQUID TELECOMMUNICATIONS FIN-REG-S 8.50000% 17-13.07.22	7 805 000.00	8 007 442.18	0.12
USD LLPL CAPITAL PTE LTD-REG-S 6.87500% 19-04.02.39	5 760 000.00	6 659 677.43	0.10
USD LMIRT CAPITAL PTE LTD-REG-S 7.25000% 19-19.06.24	2 310 000.00	2 478 735.34	0.04
USD LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO LTD-REG-S 5.25000% 17-23.02.23	1 025 000.00	1 012 828.13	0.02
USD LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO LTD-REG-S 8.75000% 18-12.12.20	1 240 000.00	1 281 850.00	0.02
USD LUKOIL INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S 4.75000% 16-02.11.26	3 550 000.00	3 976 000.00	0.06
USD MARB BONDCO PLC-REG-S 7.00000% 17-15.03.24	1 720 000.00	1 780 200.00	0.03
USD MEDCO BELL PTE LTD-REG-S 6.37500% 20-30.01.27	909 000.00	877 185.00	0.01
USD MEDCO OAK TREE PTE LTD-REG-S 7.37500% 19-14.05.26	2 176 000.00	2 238 560.00	0.03
USD MEDCO PLATINUM ROAD PTE LTD-REG-S 6.75000% 18-30.01.25	1 161 000.00	1 191 839.06	0.02
USD MELCO RESORTS FINANCE LTD-REG-S 5.37500% 19-04.12.29	1 702 000.00	1 709 199.46	0.03
USD MERSIN ULUSLARARASI LIMAN-REG-S 5.37500% 19-15.11.24	11 332 000.00	11 926 930.00	0.18
USD METINVEST BV-REG-S 8.50000% 18-23.04.26	6 585 000.00	7 196 170.32	0.11
USD METROPOLITAN LIGHT CO LTD-REG-S 5.50000% 17-21.11.22	4 147 000.00	4 281 694.56	0.07
USD MEXICAN, UNITED STATES OF 4.60000% 15-23.01.46	2 500 000.00	2 825 000.00	0.04
USD MEXICHEM SAB DE CV-REG-S 4.87500% 12-19.09.22	1 470 000.00	1 559 118.75	0.02
USD MEXICHEM SAB DE CV-REG-S 5.87500% 14-17.09.44	4 523 000.00	5 132 050.46	0.08
USD MEXICHEM SAB DE CV-REG-S 5.50000% 17-15.01.48	1 420 000.00	1 540 256.25	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

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD MEXICO CITY AIRPORT TRUST-REG-S 4.25000% 16-31.10.26	3 950 000.00	4 253 162.50	0.07
USD MEXICO GEN DE ENERGIA S DE RL-REG-S 5.50000% 12-06.12.32	660 000.00	605 027.02	0.01
USD MEXICO, UNITED STATES OF 6.05000% 08-11.01.40	506 000.00	680 253.75	0.01
USD MEXICO, UNITED STATES OF 5.75000% 10-12.10.110	11 240 000.00	13 955 162.50	0.22
USD MEXICO, UNITED STATES OF 4.35000% 16-15.01.47	649 000.00	711 466.25	0.01
USD MEXICO, UNITED STATES OF 4.60000% 17-10.02.48	1 400 000.00	1 592 937.50	0.02
USD MEXICO, UNITED STATES OF 3.75000% 18-11.01.28	3 900 000.00	4 135 218.75	0.06
USD MEXICO, UNITED STATES OF 4.50000% 19-22.04.29	11 349 000.00	12 707 333.44	0.20
USD MEXICO, UNITED STATES OF 4.50000% 19-31.01.50	12 348 000.00	13 849 053.75	0.21
USD MGM CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 5.87500% 19-15.05.26	3 923 000.00	4 060 305.00	0.06
USD MHP LUX SA-REG-S 6.95000% 18-03.04.26	9 847 000.00	10 280 883.43	0.16
USD MHP SA-REG-S 7.75000% 17-10.05.24	8 675 000.00	9 339 179.68	0.14
USD MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-REG-S 5.12500% 17-15.01.28	2 110 000.00	2 218 137.50	0.03
USD MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-REG-S 6.25000% 19-25.03.29	3 282 000.00	3 620 087.02	0.06
USD MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-REG-S 6.00000% 15-15.03.25	2 714 000.00	2 801 356.88	0.04
USD MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-REG-S 6.62500% 18-15.10.26	2 280 000.00	2 513 700.00	0.04
USD MINERVA LUXEMBOURG SA-REG-S 6.50000% 16-20.09.26	800 000.00	850 250.00	0.01
USD MMC NORILSK NICKL VIA MMC FIN DAC-REG-S 3.37500% 19-28.10.24	2 700 000.00	2 747 250.00	0.04
USD MONG DUONG FINANCE HOLDINGS BV-REG-S 5.12500% 19-07.05.29	3 370 000.00	3 471 706.60	0.05
USD MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 5.12500% 12-05.12.22	8 025 000.00	8 142 867.19	0.13
USD MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 5.62500% 17-01.05.23	6 936 000.00	7 081 222.49	0.11
USD MONGOLIAN MIN CORP/ENRGY RES LLC-REG-S 9.25000% 19-15.04.24	540 000.00	495 281.25	0.01
USD MTN MAURITIUS INVESTMENTS LTD-REG-S 4.75500% 14-11.11.24	9 670 000.00	10 056 800.00	0.16
USD MTN MAURITIUS INVESTMENTS LTD-REG-S 6.50000% 16-13.10.26	6 564 000.00	7 437 832.50	0.11
USD MTN MAURITIUS INVESTMENTS LTD-REG-S 5.37300% 16-13.02.22	5 060 000.00	5 256 075.00	0.08
USD NAMIBIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.25000% 15-29.10.25	1 557 000.00	1 632 417.18	0.03
USD NBM US HOLDINGS INC-REG-S 7.00000% 19-14.05.26	4 437 000.00	4 755 909.38	0.07
USD NBM US HOLDINGS INC-REG-S 6.62500% 19-06.08.29	440 000.00	473 550.00	0.01
USD NEERG ENERGY LTD-REG-S 6.00000% 17-13.02.22	2 990 000.00	3 020 834.38	0.05
USD NEXEN INC 5.87500% 05-10.03.35	2 001 000.00	2 651 325.00	0.04
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 7.87500% 17-16.02.32	8 181 000.00	8 577 267.18	0.13
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 7.14300% 18-23.02.30	12 190 000.00	12 544 271.88	0.19
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 7.69600% 18-23.02.38	4 019 000.00	4 019 000.00	0.06
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 7.62500% 18-21.11.25	4 180 000.00	4 723 400.00	0.07
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 8.74700% 18-21.01.31	14 261 000.00	15 927 754.38	0.25
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 9.24800% 18-21.01.49	8 580 000.00	9 665 906.26	0.15
USD OCP SA-REG-S 4.50000% 15-22.10.25	1 455 000.00	1 572 227.60	0.02
USD OCP SA-REG-S 5.62500% 14-25.04.24	6 319 000.00	7 021 988.75	0.11
USD OCP SA-REG-S 6.87500% 14-25.04.44	5 085 000.00	6 693 131.25	0.10
USD OIL AND GAS HOLDING CO BSCC/THE-REG-S 7.62500% 18-07.11.24	3 390 000.00	3 974 775.00	0.06
USD OIL AND GAS HOLDING CO BSCC/THE-REG-S 8.37500% 18-07.11.28	4 720 000.00	5 821 825.00	0.09
USD OLEODUCTO CENTRAL SA-REG-S 4.00000% 14-07.05.21	859 000.00	876 448.44	0.01
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 4.75000% 16-15.06.26	6 963 000.00	7 050 037.50	0.11
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 3.62500% 16-15.06.21	1 300 000.00	1 306 093.75	0.02
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 5.37500% 17-08.03.27	8 868 000.00	9 178 380.00	0.14
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.50000% 17-08.03.47	4 699 000.00	4 624 109.69	0.07
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 5.62500% 18-17.01.28	1 890 000.00	1 953 787.50	0.03
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.75000% 18-17.01.48	23 345 000.00	23 279 342.20	0.36
USD ONGC VIDESH LTD-REG-S 3.75000% 13-07.05.23	700 000.00	720 562.50	0.01
USD ORAZUL ENERGY EGENOR S EN C POR A-REG-S 5.62500% 17-28.04.27	7 348 000.00	7 638 613.40	0.12
USD PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 8.25000% 14-15.04.24	4 854 000.00	5 442 547.50	0.08
USD PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 8.25000% 15-30.09.25	707 000.00	802 224.06	0.01
USD PAKISTAN, ISLAMIC REPUBLIC OF-REG-S 6.87500% 17-05.12.27	11 054 000.00	11 658 515.62	0.18
USD PAMPA ENERGIA SA-REG-S 7.50000% 17-24.01.27	3 310 000.00	2 868 321.88	0.04
USD PAMPA ENERGIA SA-REG-S 7.37500% 16-21.07.23	324 000.00	296 865.00	0.00
USD PANAMA, REPUBLIC OF 4.50000% 17-15.05.47	630 000.00	778 837.50	0.01
USD PANAMA, REPUBLIC OF 3.87000% 19-23.07.60	1 580 000.00	1 776 018.75	0.03
USD PANAMA, REPUBLIC OF-REG-S 3.75000% 19-17.04.26	8 338 000.00	8 898 730.50	0.14

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 比率 （%）
USD PAPUA NEW GUINEA GOVT INTL BOND-REG-S 8.37500% 18-04.10.28	1 819 000.00	1 959 972.50	0.03
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 4.70000% 17-27.03.27	5 366 000.00	5 947 875.63	0.09
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 5.40000% 19-30.03.50	11 125 000.00	13 016 250.00	0.20
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 5.40000% 20-30.03.50	7 927 000.00	9 274 590.00	0.14
USD PATRIMONIO EN FIDEICOMISO-REG-S 5.75000% 18-03.04.28	1 180 000.00	1 275 137.50	0.02
USD PERTAMINA PT-144A 4.30000% 13-20.05.23	1 190 000.00	1 258 053.12	0.02
USD PERTAMINA PT-REG-S 6.00000% 12-03.05.42	390 000.00	480 431.25	0.01
USD PERU LNG SRL-REG-S 5.37500% 18-22.03.30	386 000.00	377 604.50	0.01
USD PERU, REPUBLIC OF 2.84400% 19-20.06.30	4 160 000.00	4 405 700.00	0.07
USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 5.50000% 11-22.11.21	1 282 000.00	1 357 317.50	0.02
USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 4.87500% 19-17.07.49	2 220 000.00	2 418 412.50	0.04
USD PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 4.32500% 15-28.05.25	6 067 000.00	6 590 278.75	0.10
USD PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 4.55000% 16-29.03.26	17 720 000.00	19 597 212.50	0.30
USD PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 4.40000% 18-01.03.28	21 508 000.00	23 806 667.50	0.37
USD PETROAMAZONAS EP-REG-S 4.62500% 17-06.11.20	1 910 000.00	1 574 755.21	0.02
USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 6.87500% 09-20.01.40	2 646 000.00	3 266 983.12	0.05
USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 6.90000% 19-19.03.49	13 614 000.00	16 584 404.63	0.26
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 12.75000% 11-17.02.22	560 000.00	44 800.00	0.00
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 8.50000% 16-27.10.20	34 620 000.00	6 145 050.00	0.09
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 5.37500% 07-12.04.27	23 369 600.00	1 986 416.00	0.03
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 5.50000% 07-12.04.37	370 000.00	29 600.00	0.00
USD PETROLEOS DEL PERU SA-REG-S 4.75000% 17-19.06.32	11 338 000.00	12 602 895.63	0.19
USD PETROLEOS DEL PERU SA-REG-S 5.62500% 17-19.06.47	2 479 000.00	2 990 293.75	0.05
USD PETROLEOS MEXICANOS 4.87500% 12-24.01.22	4 835 000.00	5 033 839.37	0.08
USD PETROLEOS MEXICANOS 5.50000% 12-27.06.44	3 273 000.00	3 051 049.68	0.05
USD PETROLEOS MEXICANOS 3.50000% 13-30.01.23	1 300 000.00	1 324 781.25	0.02
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.50000% 18-13.03.27	910 000.00	984 604.08	0.02
USD PETROLEOS MEXICANOS 5.35000% 18-12.02.28	9 510 000.00	9 601 296.00	0.15
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.35000% 18-12.02.48	6 726 000.00	6 651 005.10	0.10
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.50000% 18-23.01.29	1 111 000.00	1 181 722.15	0.02
USD PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 6.49000% 19-23.01.27	320 000.00	347 200.00	0.01
USD PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 6.84000% 19-23.01.30	11 771 000.00	12 753 878.50	0.20
USD PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 7.69000% 19-23.01.50	43 412 000.00	47 692 423.20	0.74
USD PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 5.95000% 20-28.01.31	12 847 000.00	13 030 069.75	0.20
USD PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 6.95000% 20-28.01.60	25 875 000.00	26 224 312.50	0.40
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 9.50000% 05-02.02.30	1 670 000.00	2 722 621.87	0.04
USD PHOSAGRO BOND FUNDING LTD-REG-S LPN 3.95000% 17-03.11.21	2 516 000.00	2 582 044.24	0.04
USD PHOSAGRO BOND FUNDING LTD-REG-S 3.05000% 20-23.01.25	8 610 000.00	8 634 108.00	0.13
USD POLAND, REPUBLIC OF 3.00000% 12-17.03.23	3 733 000.00	3 870 654.37	0.06
USD POLYUS FINANCE PLC-REG-S 5.25000% 17-07.02.23	1 960 000.00	2 094 750.00	0.03
USD POLYUS FINANCE PLC-REG-S 4.70000% 18-29.01.24	1 650 000.00	1 753 125.00	0.03
USD POWER SECTOR ASST & LIAB MGT CORP-REG-S 7.39000% 09-02.12.24	1 747 000.00	2 156 453.12	0.03
USD PROMIGAS SA ESP/GASES DEL PACIFIC-REG-S 3.75000% 19-16.10.29	3 230 000.00	3 270 375.00	0.05
USD PROSUS NV-REG-S 3.68000% 20-21.01.30	16 078 000.00	16 399 524.63	0.25
USD PROSUS NV-REG-S 4.85000% 17-06.07.27	1 410 000.00	1 556 728.13	0.02
USD PROVINCE OF CORDOBA-REG-S 7.12500% 16-10.06.21	966 000.00	756 196.87	0.01
USD QATAR, STATE OF-144A 5.10300% 18-23.04.48	200 000.00	264 937.50	0.00
USD QATAR, STATE OF-REG-S 3.87500% 18-23.04.23	938 000.00	991 935.00	0.02
USD QATAR, STATE OF-REG-S 4.50000% 18-23.04.28	10 497 000.00	12 150 277.50	0.19
USD QATAR, STATE OF-REG-S 5.10300% 18-23.04.48	16 937 000.00	22 436 232.19	0.35
USD QATAR, STATE OF-REG-S 3.37500% 19-14.03.24	6 350 000.00	6 696 075.00	0.10
USD QATAR, STATE OF-REG-S 4.00000% 19-14.03.29	6 319 000.00	7 140 470.00	0.11
USD QATAR, STATE OF-REG-S 4.81700% 19-14.03.49	30 062 000.00	38 347 838.76	0.59
USD REC LTD-REG-S 3.50000% 19-12.12.24	5 989 000.00	6 078 108.53	0.09
USD REDE D'OR FINANCE SARL-REG-S 4.95000% 18-17.01.28	834 000.00	878 566.87	0.01
USD REDSUN PROPERTIES GROUP LTD-REG-S 9.70000% 20-16.04.23	1 350 000.00	1 319 625.00	0.02
USD RELIANCE HOLDINGS USA INC-REG-S 5.40000% 12-14.02.22	9 740 000.00	10 324 400.00	0.16
USD RELIANCE INDUSTRIES LTD-REG-S 3.66700% 17-30.11.27	3 908 000.00	4 135 152.50	0.06

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 比率 （%）
USD RELIANCE INDUSTRIES LTD-REG-S 4.12500% 15-28.01.25	4 700 000.00	5 024 593.75	0.08
USD RENEW POWER PVT LTD-REG-S 6.45000% 19-27.09.22	580 000.00	600 300.00	0.01
USD REPUBLIC OF AZERBAIJAN-REG-S 4.75000% 14-18.03.24	5 893 000.00	6 334 975.00	0.10
USD REPUBLIC OF TAJIKISTAN INTER BOND-REG-S 7.12500% 17-14.09.27	1 170 000.00	1 023 018.75	0.02
USD REPUBLIC OF TURKEY 7.25000% 18-23.12.23	3 535 000.00	3 930 478.13	0.06
USD RONESANS GAYRIMENKUL YATIRIM AS-REG-S 7.25000% 18-26.04.23	1 587 000.00	1 458 552.19	0.02
USD RSHB CAPITAL SA-REG-S LPN 8.50000% 13-16.10.23	1 838 000.00	2 116 571.88	0.03
USD RUMO LUXEMBOURG SARL-REG-S 7.37500% 17-09.02.24	4 268 000.00	4 585 912.65	0.07
USD RUMO LUXEMBOURG SARL-REG-S 5.87500% 18-18.01.25	1 415 000.00	1 519 798.44	0.02
USD RUSSIA, FEDERATION OF-REG-S 5.62500% 12-04.04.42	33 800 000.00	45 260 312.50	0.70
USD SACI FALABELLA-REG-S 4.37500% 14-27.01.25	322 000.00	339 710.00	0.01
USD SAKA ENERGI INDONESIA PT-REG-S 4.45000% 17-05.05.24	2 800 000.00	2 834 440.00	0.04
USD SAMBA FUNDING LTD-REG-S 2.75000% 19-02.10.24	6 739 000.00	6 757 835.50	0.10
USD SANDS CHINA LTD 5.40000% 19-08.08.28	11 721 000.00	13 302 045.69	0.21
USD SASOL FINANCING INTERNATIONAL PLC 4.50000% 12-14.11.22	260 000.00	266 296.89	0.00
USD SASOL FINANCING USA LLC 5.87500% 18-27.03.24	16 246 000.00	17 391 343.00	0.27
USD SASOL FINANCING USA LLC 6.50000% 18-27.09.28	4 547 000.00	5 085 251.12	0.08
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 4.37500% 19-16.04.29	6 040 000.00	6 902 587.50	0.11
USD SB CAPITAL SA FOR SBERBK-REG-S-SUB LPN 5.12500% 12-29.10.22	1 610 000.00	1 706 096.87	0.03
USD SCENERY JOURNEY LTD-REG-S 12.00000% 20-24.10.23	500 000.00	485 000.00	0.01
USD SENEGAL, REPUBLIC OF-REG-S 6.75000% 18-13.03.48	1 217 000.00	1 247 044.69	0.02
USD SERBIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 7.25000% 11-28.09.21	6 198 000.00	6 724 830.00	0.10
USD SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD-REG-S 6.12500% 19-21.02.24	602 000.00	634 921.88	0.01
USD SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD-REG-S 5.60000% 19-15.07.26	1 750 000.00	1 834 765.63	0.03
USD SIGMA ALIMENTOS-REG-S 4.12500% 16-02.05.26	2 439 000.00	2 555 614.69	0.04
USD SIGMA FINANCE NETHERLANDS BV-REG-S 4.87500% 18-27.03.28	1 528 000.00	1 669 196.83	0.03
USD SINO-OCEAN LAND TREASURE IV LTD-REG-S 4.75000% 19-05.08.29	900 000.00	910 406.25	0.01
USD SINOCHEN OVERSEAS CAPITAL-REG-S 4.50000% 10-12.11.20	1 386 000.00	1 408 895.47	0.02
USD SINOCHEN OVERSEAS CAPITAL CO LTD-REG-S 6.30000% 10-12.11.40	500 000.00	713 437.50	0.01
USD SINOPEC GROUP OVERSEAS DEV12 LTD-REG-S 4.87500% 12-17.05.42	807 000.00	1 021 107.19	0.02
USD SINOPEC GROUP OVERSEAS DEV 2013-REG-S 5.37500% 13-17.10.43	896 000.00	1 217 547.52	0.02
USD SINOPEC GROUP OVERSEA DEVELOPMENT-REG-S 2.00000% 16-29.09.21	1 301 000.00	1 301 813.13	0.02
USD SINOPEC GROUP OVERSEAS DEV LD-REG-S 4.60000% 18-12.09.48	450 000.00	565 312.50	0.01
USD SINOPEC GRP OVERSEAS DEV LTD-REG-S 2.50000% 19-08.08.24	4 705 000.00	4 747 132.81	0.07
USD SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHIL-REG-S 5.50000% 10-21.04.20	4 099 000.00	4 132 304.37	0.06
USD SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHIL-REG-S 4.37500% 14-28.01.25	4 650 000.00	4 911 562.50	0.08
USD SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.87500% 07-30.05.22	547 000.00	585 802.81	0.01
USD SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.37500% 14-24.07.44	500 000.00	484 218.75	0.01
USD SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 4.87500% 16-14.04.26	1 660 000.00	1 737 812.50	0.03
USD SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 4.85000% 17-27.09.27	810 000.00	847 462.50	0.01
USD SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.65000% 17-27.09.47	1 954 000.00	1 927 743.12	0.03
USD SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 4.85000% 19-30.09.29	5 610 000.00	5 660 490.00	0.09
USD SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.75000% 19-30.09.49	19 400 000.00	19 060 888.00	0.29
USD SOUTHERN COPPER CORP 6.75000% 10-16.04.40	2 500 000.00	3 424 218.75	0.05
USD SOUTHERN COPPER CORP 3.87500% 15-23.04.25	272 000.00	288 150.00	0.00
USD SOUTHERN COPPER CORP 5.87500% 15-23.04.45	2 070 000.00	2 641 837.50	0.04
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 6.25000% 10-04.10.20	2 561 000.00	2 587 410.32	0.04
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 6.25000% 11-27.07.21	1 200 000.00	1 227 000.00	0.02
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 5.87500% 12-25.07.22	4 872 000.00	4 946 602.49	0.08
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 6.12500% 15-03.06.25	8 820 000.00	8 654 625.00	0.13
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 6.82500% 16-18.07.26	8 284 000.00	8 273 645.00	0.13
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 5.75000% 16-18.01.22	1 200 000.00	1 216 125.00	0.02
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 6.20000% 17-11.05.27	9 784 000.00	9 307 030.00	0.14
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 5.75000% 18-18.04.23	4 750 000.00	4 761 875.00	0.07
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 6.75000% 18-18.04.28	24 240 000.00	23 439 837.60	0.36
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 6.85000% 19-14.03.24	12 445 000.00	12 740 568.75	0.20
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 7.85000% 19-14.03.29	13 964 000.00	14 225 825.00	0.22
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 6.35000% 19-28.06.24	6 900 000.00	6 943 125.00	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

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 比率 （%）
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 7.55000% 19-28.03.30	7 141 000.00	7 069 590.00	0.11
USD SRI REJEKI ISMAN TBK PT-REG-S 7.25000% 19-16.01.25	620 000.00	641 700.00	0.01
USD SSB #1 PLC-REG-S LPN STEP-UP 15-20.03.25	1 300 000.00	1 377 187.50	0.02
USD STATE BANK OF INDIA LONDON-REG-S 4.37500% 19-24.01.24	3 040 000.00	3 230 000.00	0.05
USD STATE OF ISRAEL 3.37500% 20-15.01.50	1 522 000.00	1 592 385.50	0.02
USD STUDIO CITY CO LTD-REG-S 7.25000% 16-30.11.21	3 272 000.00	3 324 777.36	0.05
USD STUDIO CITY FINANCE LTD-REG-S 7.25000% 19-11.02.24	3 970 000.00	4 102 240.70	0.06
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 7.35000% 18-19.07.21	560 000.00	570 343.20	0.01
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 8.35000% 18-19.04.23	4 227 000.00	4 418 535.94	0.07
USD SURA ASSET MANAGEMENT SA-REG-S 4.37500% 17-11.04.27	2 028 000.00	2 193 408.75	0.03
USD SUZANO AUSTRIA GMBH 6.00000% 19-15.01.29	1 267 000.00	1 430 443.00	0.02
USD SUZANO AUSTRIA GMBH 5.00000% 19-15.01.30	3 844 000.00	4 053 498.00	0.06
USD TAQA ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO-REG-S 3.62500% 12-12.01.23	912 000.00	941 640.00	0.01
USD TECPETROL SA-REG-S 4.87500% 17-12.12.22	5 624 000.00	5 506 247.50	0.09
USD TELECOM ARGENTINA SA-REG-S 6.50000% 16-15.06.21	5 884 000.00	5 795 740.00	0.09
USD TELECOM ARGENTINA SA-REG-S 8.00000% 19-18.07.26	2 565 000.00	2 502 478.13	0.04
USD TELEFONICA CELULAR DEL PARAGUAY-REG-S 5.87500% 19-15.04.27	5 150 000.00	5 511 684.50	0.09
USD TELEFONICA CELULAR DEL PARAGUAY-REG-S 5.87500% 20-15.04.27	8 449 000.00	9 042 373.27	0.14
USD TERMOCANDELARIA POWER LTD-REG-S 7.87500% 19-30.01.29	1 884 000.00	2 073 577.50	0.03
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 2.20000% 16-21.07.21	32 000.00	31 552.00	0.00
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 2.80000% 16-21.07.23	1 723 000.00	1 613 158.75	0.03
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 3.15000% 16-01.10.26	10 094 000.00	8 642 987.50	0.13
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 4.10000% 16-01.10.46	3 590 000.00	2 749 940.00	0.04
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 6.75000% 18-01.03.28	2 775 000.00	2 864 466.00	0.04
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL-REG-S 7.12500% 19-31.01.25	4 893 000.00	5 140 805.98	0.08
USD THIRD PAKISTAN INTERNATIONAL SUK-REG-S 5.62500% 17-05.12.22	4 698 000.00	4 844 953.44	0.07
USD TOWER BERSAMA INFRA TBK PT-REG-S 4.25000% 20-21.01.25	1 540 000.00	1 536 150.00	0.02
USD TRANSNET SOC LTD-REG-S 4.00000% 12-26.07.22	1 000 000.00	1 017 500.00	0.02
USD TRANSPORTADORA DE GAS DEL SUR SA-REG-S 6.75000% 18-02.05.25	580 000.00	536 256.40	0.01
USD TRINIDAD & TOBAGO, REPUBLIC OF-REG-S 4.37500% 13-16.01.24	6 526 000.00	6 921 638.75	0.11
USD TRINIDAD & TOBAGO, REPUBLIC OF-REG-S 4.50000% 16-04.08.26	1 806 000.00	1 946 529.38	0.03
USD TRINIDAD GENERATION UNLTD-REG-S 5.25000% 16-04.11.27	3 075 000.00	3 277 950.00	0.05
USD TRUST F/1401-REG-S 5.25000% 14-15.12.24	3 754 000.00	4 105 937.50	0.06
USD TRUST F/1401-REG-S 5.25000% 15-30.01.26	600 000.00	655 875.00	0.01
USD TULLOW OIL PLC-REG-S-SUB 6.25000% 14-15.04.22	10 311 000.00	9 315 988.50	0.14
USD TUPRAS TURKIYE PETROL-REG-S 4.50000% 17-18.10.24	2 989 000.00	2 995 545.91	0.05
USD TURK SISE VE CAM FABRIKA-REG-S 6.95000% 19-14.03.26	1 421 000.00	1 559 991.57	0.02
USD TURK TELEKOMUNIKASYON AS-REG-S 6.87500% 19-28.02.25	726 000.00	799 961.25	0.01
USD TURKCELL ILETISIM HIZMETLERI AS-REG-S 5.80000% 18-11.04.28	6 449 000.00	6 706 960.00	0.10
USD TURKEY, REPUBLIC OF 7.37500% 05-05.02.25	1 140 000.00	1 286 775.00	0.02
USD TURKEY, REPUBLIC OF 7.00000% 05-05.06.20	505 000.00	512 575.00	0.01
USD TURKEY, REPUBLIC OF 6.87500% 06-17.03.36	870 000.00	967 059.38	0.01
USD TURKEY, REPUBLIC OF 6.75000% 10-30.05.40	640 000.00	698 600.00	0.01
USD TURKEY, REPUBLIC OF 6.00000% 11-14.01.41	13 886 000.00	14 055 235.62	0.22
USD TURKEY, REPUBLIC OF 6.25000% 12-26.09.22	800 000.00	855 750.00	0.01
USD TURKEY, REPUBLIC OF 3.25000% 13-23.03.23	690 000.00	682 237.50	0.01
USD TURKEY, REPUBLIC OF 4.87500% 13-16.04.43	8 001 000.00	7 153 394.06	0.11
USD TURKEY, REPUBLIC OF 4.87500% 16-09.10.26	3 000 000.00	3 008 437.50	0.05
USD TURKEY, REPUBLIC OF 6.00000% 17-25.03.27	2 963 000.00	3 132 446.57	0.05
USD TURKEY, REPUBLIC OF 5.75000% 17-11.05.47	4 416 000.00	4 268 340.00	0.07
USD TURKEY, REPUBLIC OF 7.62500% 19-26.04.29	481 000.00	559 162.50	0.01
USD TURKEY, REPUBLIC OF 6.35000% 19-10.08.24	7 810 000.00	8 451 884.37	0.13
USD TURKEY, REPUBLIC OF 5.60000% 19-14.11.24	29 782 000.00	31 300 882.00	0.48
USD TURKIYE GARANTI BANKASI AS-REG-S 5.25000% 12-13.09.22	2 863 000.00	2 962 310.32	0.05
USD TURKIYE GARANTI BANKASI AS-REG-S 5.87500% 17-16.03.23	1 980 000.00	2 083 950.00	0.03
USD TURKIYE IS BANKASI-REG-S 6.12500% 17-25.04.24	5 527 000.00	5 741 171.25	0.09
USD TURKIYE SINAI KALKINMA BANKASI AS-REG-S 6.00000% 20-23.01.25	1 577 000.00	1 600 650.58	0.02
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.75000% 15-01.09.21	3 200 000.00	3 406 400.00	0.05

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.75000% 15-01.09.22	10 013 000.00	10 904 157.00	0.17
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.75000% 15-01.09.23	15 095 000.00	16 695 070.00	0.26
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.75000% 15-01.09.24	15 592 000.00	17 385 080.00	0.27
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.75000% 15-01.09.25	21 613 000.00	24 325 431.50	0.38
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.75000% 15-01.09.26	17 440 000.00	19 794 400.00	0.31
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.75000% 15-01.09.27	5 520 000.00	6 256 920.00	0.10
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 7.37500% 17-25.09.32	12 600 000.00	13 934 812.50	0.21
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 8.99400% 18-01.02.24	3 803 000.00	4 363 942.50	0.07
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 9.75000% 18-01.11.28	15 027 000.00	18 699 223.13	0.29
USD UNIFIN FINANCIERA SA DE CV-REG-S 7.37500% 18-12.02.26	842 000.00	885 784.00	0.01
USD UPL CORP LTD-REG-S 4.50000% 18-08.03.28	1 520 000.00	1 549 228.54	0.02
USD URUGUAY, REPUBLIC OF 4.12500% 12-20.11.45	910 000.00	1 023 750.00	0.02
USD VALE OVERSEAS LTD 6.87500% 06-21.11.36	2 409 000.00	3 164 823.75	0.05
USD VALE OVERSEAS LTD 6.25000% 16-10.08.26	3 526 000.00	4 159 137.38	0.06
USD VEB FINANCE PLC-REG-S LPN 5.94200% 13-21.11.23	2 800 000.00	3 109 750.00	0.05
USD VEDANTA RESOURCES PLC-REG-S 6.37500% 17-30.07.22	6 832 000.00	6 661 200.00	0.10
USD VENEZUELA, REP. OF REG-S *DEFAULTED* 8.25000% 09-13.10.24	16 419 700.00	2 011 413.25	0.03
USD VENEZUELA, REP. OF REG-S *DEFAULTED* 7.75000% 09-13.10.19	4 923 700.00	603 153.25	0.01
USD VOLCAN CIA MINERA SAA-REG-S 5.37500% 12-02.02.22	1 000 000.00	1 040 000.00	0.02
USD VOTORANTIM CIMENTOS INTL SA-REG-S 7.25000% 11-05.04.41	2 685 000.00	3 489 660.94	0.05
USD WYNN MACAU LTD-REG-S 4.87500% 17-01.10.24	1 450 000.00	1 460 875.00	0.02
USD WYNN MACAU LTD-REG-S 5.50000% 17-01.10.27	200 000.00	202 687.50	0.00
USD YANGO JUSTICE INTERNATIONAL LTD-REG-S 10.25000% 19-18.03.22	2 960 000.00	2 997 000.00	0.05
USD YAPI VE KREDI BANKASI AS-REG-S-SUB 5.50000% 12-06.12.22	450 000.00	455 625.00	0.01
USD YPF ENERGIA ELECTRICA SA-REG-S 10.00000% 19-25.07.26	1 046 000.00	963 627.50	0.01
USD YPF SA-REG-S 6.95000% 17-21.07.27	7 690 000.00	6 567 740.62	0.10
USD YPF SA-REG-S 7.00000% 17-15.12.47	1 507 000.00	1 183 465.94	0.02
USD YPF SA-REG-S 8.50000% 15-28.07.25	3 975 000.00	3 641 472.85	0.06
USD YPF SA-REG-S 8.50000% 19-27.06.29	2 389 000.00	2 115 384.96	0.03
USD YUZHOU PROPERTIES CO LTD-REG-S 6.00000% 16-25.10.23	1 838 000.00	1 773 095.62	0.03
USD YUZHOU PROPERTIES CO LTD-REG-S 6.37500% 18-06.03.21	565 000.00	568 237.45	0.01
USD YUZHOU PROPERTIES CO LTD-REG-S 8.37500% 19-30.10.24	765 000.00	784 125.00	0.01
USD YUZHOU PROPERTIES CO LTD-REG-S 7.37500% 20-13.01.26	2 601 000.00	2 483 955.00	0.04
USD ZAMBIA, REPUBLIC OF-REG-S 8.50000% 14-14.04.24	3 230 000.00	2 209 521.88	0.03
USD ZAMBIA, REPUBLIC OF-REG-S 8.97000% 15-30.07.27	9 217 000.00	6 296 363.14	0.10
米ドル合計		2 996 435 319.58	46.20
ノート、固定利付債合計		3 132 663 899.98	48.30
ノート、ゼロ・クーポン			
EUR			
EUR PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 0.00000% 20-03.02.23	10 240 000.00	11 308 250.11	0.17
ユーロ合計		11 308 250.11	0.17
ノート、ゼロ・クーポン合計		11 308 250.11	0.17
ノート、変動利付債			
USD			
USD AES GENER SA-REG-S-SUB 7.125%/VAR 19-26.03.79	2 790 000.00	2 994 890.63	0.05
USD AKBANK TAS-REG-S-SUB 6.797%/VAR 18-27.04.28	2 612 000.00	2 616 897.50	0.04
USD ALFA BD ISS OJSC ALFA BK-REG-S-SUB 5.950%/VAR 19-15.04.30	5 439 000.00	5 614 067.81	0.09
USD ALFA BD ISS OJSC ALFA BK-REG-S-SUB 5.950%/VAR 19-15.04.30	2 770 000.00	2 859 159.37	0.04
USD BANCO DE CREDITO DEL PERU/P-REG-S-SUB 6.125%/VAR 12-24.04.27	2 939 000.00	3 160 343.44	0.05
USD BANCO DO BRASIL CAYMAN-REG-S-SUB 6.250%/VAR 13-PRP	12 191 000.00	12 575 016.50	0.19
USD BANCO DO BRASIL CAYMAN-REG-S-SUB 9.000%/VAR 14-PRP	22 207 000.00	25 843 396.25	0.40
USD BANCO INTL PERU-REG-S 6.625%/3M LIBOR+576BP 14-19.03.29	1 625 000.00	1 827 617.19	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

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD BANCO MER DEL NORTE SA/GRAND CY-REG-S-SUB 7.625%/VAR 17-PRP	5 298 000.00	5 939 058.00	0.09
USD BANCO MERCANTIL DEL NORTE-REG-S-SUB 5.750%/VAR 16-04.10.31	4 100 000.00	4 382 054.58	0.07
USD BANCO NACIONAL DE COM EXT-REG-S-SUB 3.800%/VAR 16-11.08.26	1 960 000.00	1 986 337.50	0.03
USD BANCO SANTANDER SA-REG-S-SUB 5.950%/VAR 18-01.10.28	3 500 000.00	3 772 378.75	0.06
USD BANK LEUMI ISRAEL BM-144A-REG-S-SUB 3.275%/VAR 20-29.01.31	8 768 000.00	8 763 616.00	0.14
USD BBVA BANCOMER SA/TEXAS-REG-S-SUB 5.875%/VAR 19-13.09.34	8 729 000.00	9 678 278.75	0.15
USD CHINA HUADIAN OVERSEAS DEVP MANG-REG-S 4.000%/VAR 19-PRP	222 000.00	227 758.12	0.00
USD CK HUTCHISON CAPITAL SEC 17 LTD-REG-S-SUB 4.000%/VAR 17-PRP	5 045 000.00	5 109 639.06	0.08
USD COLOMBIA TELECOMUNICACIONES SA-REG-S-SUB 8.500%/VAR 15-PRP	3 511 000.00	3 531 737.02	0.06
USD CORP FINANCIERA DE DESARROL-REG-S-SUB 5.250%/VAR 14-15.07.29	880 000.00	944 350.00	0.02
USD CREDIT BK MOSCOW/CBOM FIN-REG-S-SUB 7.500%/VAR 17-05.10.27	11 170 000.00	11 236 321.88	0.17
USD HANWHA LIFE INSURANCE CO-REG-S-SUB 4.700%/VAR 18-23.04.48	2 783 000.00	2 856 923.44	0.04
USD MONGOLIAN MINING CORP (PIK) VAR 17-PRP	1 235 901.00	702 146.26	0.01
USD NANYANG COMMERCIAL BANK LTD-REG-S-SUB 3.800%/VAR 19-20.11.29	1 200 000.00	1 223 364.00	0.02
USD PETROLEOS MEXICANOS 3M LIBOR+365BP 18-11.03.22	1 461 000.00	1 532 713.19	0.02
USD TURKIYE GARANTI BANK AS-REG-S-SUB 6.125%/VAR 17-24.05.27	200 000.00	199 312.50	0.00
USD TURKIYE IS BANKASI AS-REG-S-SUB 7.750%/VAR 20-22.01.30	2 099 000.00	2 128 595.90	0.03
米ドル合計		121 705 973.64	1.88

ノート、変動利付債合計	121 705 973.64	1.88
-------------	----------------	------

中期債券、固定利付債

EUR			
EUR EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 5.62500% 18-16.04.30	7 966 000.00	9 266 558.54	0.14
EUR EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 4.75000% 18-16.04.26	5 252 000.00	6 231 322.70	0.10
EUR EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 4.75000% 19-11.04.25	5 852 000.00	6 993 868.20	0.11
EUR EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 6.37500% 19-11.04.31	8 647 000.00	10 421 083.37	0.16
EUR KAZAKHSTAN, REPUBLIC OF-REG-S 2.37500% 18-09.11.28	1 046 000.00	1 322 548.75	0.02
EUR KAZAKHSTAN, REPUBLIC OF-REG-S 1.55000% 18-09.11.23	5 130 000.00	5 946 579.04	0.09
EUR KAZAKHSTAN, REPUBLIC OF-REG-S 0.60000% 19-30.09.26	3 530 000.00	3 915 857.95	0.06
EUR NE PROPERTY BV-REG-S 2.62500% 19-22.05.23	3 340 000.00	3 909 797.25	0.06
EUR NE PROPERTY BV-REG-S 1.87500% 19-09.10.26	3 060 000.00	3 425 002.92	0.05
EUR NE PROPERTY COOPERATIEF UA-REG-S 1.75000% 17-23.11.24	2 040 000.00	2 325 122.12	0.04
EUR PETROLEOS MEXICANOS-REG-S 5.12500% 16-15.03.23	3 520 000.00	4 384 814.94	0.07
EUR PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 0.87500% 19-17.05.27	6 710 000.00	7 582 418.68	0.12
EUR ROMANIA-REG-S 2.00000% 20-28.01.32	1 838 000.00	2 090 339.48	0.03
EUR ROMANIA-REG-S 2.87500% 18-11.03.29	1 970 000.00	2 488 113.32	0.04
EUR ROMANIA-REG-S 3.37500% 20-28.01.50	4 297 000.00	5 040 365.77	0.08
EUR ROMANIA-REG-S 3.50000% 19-03.04.34	4 786 000.00	6 139 200.82	0.09
EUR ROMANIA-REG-S 4.12500% 18-11.03.39	3 090 000.00	4 127 397.40	0.06
EUR ROMANIA-REG-S 4.62500% 19-03.04.49	9 339 000.00	13 266 739.42	0.20
EUR TURKEY, REPUBLIC OF 3.25000% 17-14.06.25	570 000.00	649 834.62	0.01
ユーロ合計		99 526 965.29	1.53

USD			
USD ABQ FINANCE LTD-REG-S 3.62500% 16-13.04.21	3 374 000.00	3 410 903.12	0.05
USD ABQ FINANCE LTD-REG-S 3.50000% 17-22.02.22	2 950 000.00	2 995 171.87	0.05
USD ABQ FINANCE LTD-REG-S 3.12500% 19-24.09.24	2 667 000.00	2 703 671.25	0.04
USD ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO PJSC-REG-S 4.37500% 16-22.06.26	650 000.00	711 140.62	0.01
USD ACCESS BANK PLC-REG-S 10.50000% 16-19.10.21	9 307 000.00	10 324 953.12	0.16
USD AFRICA FINANCE CORP-REG-S 4.37500% 19-17.04.26	8 474 000.00	9 091 449.54	0.14
USD AFRICAN EXPORT-IMPORT BANK-REG-S 4.12500% 17-20.06.24	2 024 000.00	2 132 891.20	0.03
USD AFRICAN EXPORT-IMPORT BANK-REG-S 5.25000% 18-11.10.23	4 856 000.00	5 271 673.60	0.08
USD AFRICAN EXPORT-IMPORT BANK/THE-REG-S 3.99400% 19-21.09.29	1 062 000.00	1 107 634.14	0.02
USD ALDAR SUKUK NO 2 LTD-REG-S 3.87500% 19-22.10.29	6 102 000.00	6 344 173.12	0.10
USD ANGOLAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 8.00000% 19-26.11.29	15 512 000.00	16 365 160.00	0.25
USD ANGOLAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 9.12500% 19-26.11.49	22 558 000.00	23 629 505.00	0.36

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 比率 （%）
USD ARAB PETROLEUM INVESTMENTS CORP-REG-S 4.12500% 18-18.09.23	3 265 000.00	3 489 330.31	0.05
USD ARGENTINA, REPUBLIC OF 6.87500% 17-22.04.21	56 637 000.00	30 194 600.62	0.47
USD ARGENTINA, REPUBLIC OF 7.50000% 17-22.04.26	2 593 000.00	1 185 487.18	0.02
USD ARGENTINA, REPUBLIC OF 7.62500% 17-22.04.46	9 635 000.00	4 100 896.87	0.06
USD ARGENTINA, REPUBLIC OF 6.62500% 17-06.07.28	1 034 000.00	461 745.63	0.01
USD ARGENTINA, REPUBLIC OF 7.12500% 17-06.07.36	1 887 000.00	815 537.82	0.01
USD ARGENTINA, REPUBLIC OF 5.62500% 17-26.01.22	5 179 000.00	2 550 657.50	0.04
USD ARGENTINA, REPUBLIC OF 6.87500% 17-26.01.27	3 792 000.00	1 708 770.00	0.03
USD AXIATA SPV2 BHD-REG-S 3.46600% 15-19.11.20	15 130 000.00	15 255 427.70	0.24
USD AZURE ORBIT IV INTL FIN LTD-REG-S 3.75000% 18-25.01.23	2 688 000.00	2 776 435.20	0.04
USD AZURE POWER SOLAR ENERGY PVT LTD-REG-S 5.65000% 19-24.12.24	1 200 000.00	1 239 750.00	0.02
USD BANCO BRADESCO SA GRAND CY BR-REG-S 3.20000% 20-27.01.25	5 343 000.00	5 370 249.30	0.08
USD BANCO DO BRASIL CAYMAN-REG-S 4.87500% 18-19.04.23	813 000.00	862 288.12	0.01
USD BANCO DO BRASIL SA/CAYMAN-REG-S 4.75000% 19-20.03.24	1 150 000.00	1 222 593.75	0.02
USD BANCO DO BRASIL SA/CAYMAN-REG-S 4.62500% 17-15.01.25	2 416 000.00	2 567 302.00	0.04
USD BANK MANDIRI PERSERO TBK PT-REG-S 3.75000% 19-11.04.24	1 899 000.00	1 964 278.13	0.03
USD BANK OF CHINA LTD-REG-S-SUB 5.00000% 14-13.11.24	6 585 000.00	7 274 367.19	0.11
USD BANK OF CHINA/HONG KONG-REG-S 3.62500% 19-17.04.29	1 060 000.00	1 139 500.00	0.02
USD BANK OF EAST ASIA LTD/THE-SUB 6.12500% 10-16.07.20	560 000.00	568 881.60	0.01
USD BATELCO INTERNATIONAL FINANCE-REG-S 4.25000% 13-01.05.20	4 183 000.00	4 188 228.75	0.06
USD BHARAT PETROLEUM CORP LTD-REG-S 4.37500% 19-24.01.22	2 559 000.00	2 633 748.39	0.04
USD BLUESTAR FINANCE HOLDINGS LTD-REG-S 4.37500% 15-11.06.20	2 400 000.00	2 415 528.00	0.04
USD CBQ FINANCE LTD-REG-S 5.00000% 18-24.05.23	1 700 000.00	1 828 031.25	0.03
USD CCBL CAYMAN 1 CORP LTD-REG-S 3.50000% 19-16.05.24	1 820 000.00	1 894 470.58	0.03
USD CDBL FUNDING 1-REG-S 3.00000% 17-24.04.23	3 014 000.00	3 042 256.25	0.05
USD CDBL FUNDING 2-REG-S 3.00000% 17-01.08.22	1 699 000.00	1 720 768.43	0.03
USD CHARMING LIGHT INVESTMENTS LTD-REG-S 4.37500% 17-21.12.27	3 000 000.00	3 295 312.50	0.05
USD CHINA RESOURCES LAND LTD-REG-S 4.12500% 19-26.02.29	429 000.00	469 755.00	0.01
USD DP WORLD CRESCENT LTD-REG-S 4.84800% 18-26.09.28	3 957 000.00	4 374 958.13	0.07
USD DP WORLD CRESCENT LTD-REG-S 3.87500% 19-18.07.29	4 006 000.00	4 166 240.00	0.06
USD DP WORLD CRESCENT LTD-REG-S 3.75000% 19-30.01.30	2 326 000.00	2 393 599.37	0.04
USD DP WORLD PLC-REG-S 4.70000% 19-30.09.49	675 000.00	702 000.00	0.01
USD DP WORLD PLC-REG-S 5.62500% 18-25.09.48	5 554 000.00	6 574 547.50	0.10
USD DP WORLD PLC-REG-S 6.85000% 07-02.07.37	1 550 000.00	2 071 187.50	0.03
USD EASTERN AND SOUTHERN AFRICAN TRAD-REG-S 4.87500% 19-23.05.24	4 352 000.00	4 590 419.96	0.07
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 5.87500% 15-11.06.25	4 352 000.00	4 702 880.00	0.07
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 8.50000% 17-31.01.47	13 461 000.00	15 391 812.19	0.24
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 7.50000% 17-31.01.27	5 097 000.00	5 831 286.56	0.09
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 7.60030% 19-01.03.29	3 100 000.00	3 469 093.75	0.05
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 8.70020% 19-01.03.49	5 827 000.00	6 713 796.56	0.10
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 7.05290% 19-15.01.32	10 440 000.00	11 121 862.50	0.17
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 8.15000% 19-20.11.59	9 408 000.00	10 301 760.00	0.16
USD EMAAR SUKUK LTD-REG-S 3.87500% 19-17.09.29	998 000.00	1 002 678.13	0.02
USD EMIRATES DEVELOPMENT BANK PJSC-REG-S 3.51600% 19-06.03.24	1 990 000.00	2 064 625.00	0.03
USD EQUATE PETROCHEMICAL BV-REG-S 4.25000% 16-03.11.26	4 909 000.00	5 303 254.06	0.08
USD ESKOM HOLDINGS SOC LTD-REG-S 8.45000% 18-10.08.28	935 000.00	1 005 125.00	0.02
USD ESKOM HOLDINGS SOC LTD-REG-S 6.35000% 18-10.08.28	5 285 000.00	5 659 277.36	0.09
USD EXIMCH/ AVI FUNDING CO LTD-REG-S 3.80000% 15-16.09.25	1 000 000.00	1 067 362.90	0.02
USD EXPORT CREDIT BANK OF TURKEY-REG-S 5.37500% 16-08.02.21	1 220 000.00	1 247 831.25	0.02
USD EXPORT-IMPORT BANK OF INDIA-REG-S 4.00000% 13-14.01.23	1 051 000.00	1 095 010.63	0.02
USD FINANSBANK AS-REG-S 4.87500% 17-19.05.22	1 700 000.00	1 741 968.75	0.03
USD FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 3.00000% 17-30.03.22	505 000.00	512 953.75	0.01
USD FIRSTSTRAND BANK LTD-REG-S 4.25000% 15-30.04.20	1 110 000.00	1 112 775.00	0.02
USD GLP CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 4.97400% 19-26.02.24	2 947 000.00	3 143 159.68	0.05
USD GREENLAND GLOBAL INVESTMENT LTD-REG-S 5.25000% 18-12.02.21	487 000.00	482 037.47	0.01
USD GREENLAND GLOBAL INVESTMENT LTD-REG-S 6.75000% 19-25.06.22	1 160 000.00	1 161 450.00	0.02
USD HLP FINANCE LTD-REG-S 4.75000% 12-25.06.22	840 000.00	879 186.00	0.01
USD HUARONG FINANCE 2017 CO-REG-S 4.25000% 17-07.11.27	2 540 000.00	2 685 256.26	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

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD HUARONG FINANCE II CO LTD-REG-S 5.50000% 15-16.01.25	3 330 000.00	3 716 071.87	0.06
USD HUARONG FINANCE II CO LTD-REG-S 4.87500% 16-22.11.26	950 000.00	1 048 562.50	0.02
USD INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD-REG-S 6.37500% 19-28.05.22	3 361 000.00	2 851 598.44	0.04
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 4.12500% 15-15.01.25	5 599 000.00	6 053 918.75	0.09
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.87500% 14-15.01.24	720 000.00	819 000.00	0.01
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 6.75000% 14-15.01.44	3 071 000.00	4 483 660.00	0.07
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.12500% 15-15.01.45	6 733 000.00	8 228 988.44	0.13
USD INDONESIA, REPUBLIC OF 5.95000% 15-08.01.46	775 000.00	1 049 640.63	0.02
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 4.75000% 17-18.07.47	733 000.00	864 940.00	0.01
USD ISRAEL ELECTRIC CORP LTD-144A-REG-S 4.25000% 18-14.08.28	860 000.00	944 387.50	0.01
USD KAZAKHSTAN, REPUBLIC OF-REG-S 6.50000% 15-21.07.45	2 210 000.00	3 292 209.38	0.05
USD KSA SUKUK LTD-REG-S 4.30300% 18-19.01.29	8 250 000.00	9 347 250.00	0.14
USD KSA SUKUK LTD-REG-S 2.96900% 19-29.10.29	13 598 000.00	13 944 749.00	0.21
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S 8.25000% 06-12.04.21	5 341 000.00	2 483 565.00	0.04
USD LEBANON, REPUBLIC OF 6.37500% 10-09.03.20	5 821 000.00	4 773 220.00	0.07
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S 6.10000% 10-04.10.22	6 955 000.00	2 738 531.25	0.04
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S 6.60000% 11-27.11.26	8 292 000.00	3 047 310.00	0.05
USD LEBANON, REPUBLIC OF 6.15000% 13-19.06.20	9 821 000.00	7 362 680.94	0.11
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S 5.80000% 14-14.04.20	3 136 000.00	2 430 400.00	0.04
USD LI & FUNG LTD-REG-S 4.37500% 19-04.10.24	1 500 000.00	1 561 875.00	0.02
USD MANAPPURAM FINANCE LTD-REG-S 5.90000% 20-13.01.23	3 470 000.00	3 496 025.00	0.05
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 3.75000% 17-19.04.29	2 600 000.00	2 838 062.50	0.04
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 4.50000% 18-07.11.28	1 297 000.00	1 488 307.50	0.02
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 2.87500% 19-07.11.29	6 010 000.00	6 109 540.62	0.09
USD MDGH - GMTN BV-REG-S 3.70000% 19-07.11.49	11 293 000.00	11 801 185.00	0.18
USD MEXICO, UNITED STATES OF 3.62500% 12-15.03.22	1 214 000.00	1 264 077.50	0.02
USD MEXICO, UNITED STATES OF 4.75000% 12-08.03.44	3 302 000.00	3 802 459.38	0.06
USD MEXICO, UNITED STATES OF 5.55000% 14-21.01.45	2 033 000.00	2 607 957.81	0.04
USD MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 10.87500% 16-06.04.21	9 965 000.00	10 746 629.69	0.17
USD MONGOLIA, GOVERNMENT OF-REG-S 8.75000% 17-09.03.24	9 004 000.00	10 180 147.50	0.16
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 6.50000% 17-28.11.27	7 902 000.00	8 121 774.37	0.13
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 7.62500% 17-28.11.47	6 264 000.00	6 097 612.49	0.09
USD NTPC LTD-REG-S 3.75000% 19-03.04.24	1 864 000.00	1 930 405.00	0.03
USD NTPC LTD-REG-S 4.50000% 18-19.03.28	2 040 000.00	2 218 500.00	0.03
USD NWD MTN LTD-REG-S 5.25000% 14-26.02.21	900 000.00	923 310.00	0.01
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 4.87500% 19-01.02.25	4 322 000.00	4 457 062.50	0.07
USD OMAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.00000% 19-01.08.29	4 090 000.00	4 284 275.00	0.07
USD OVERSEA-CHINESE BANKING CORP-REG-S-SUB 4.25000% 14-19.06.24	2 900 000.00	3 117 500.00	0.05
USD PANAMA, REPUBLIC OF 9.37500% 99-01.04.29	5 376 000.00	8 294 160.00	0.13
USD PERTAMINA PERSERO PT-REG-S 3.65000% 19-30.07.29	1 593 000.00	1 653 040.17	0.03
USD PERTAMINA PERSERO PT-REG-S 4.70000% 19-30.07.49	8 967 000.00	9 605 898.75	0.15
USD PERTAMINA PERSERO PT-REG-S 4.17500% 20-21.01.50	713 000.00	713 000.00	0.01
USD PERTAMINA PT-144A 6.45000% 14-30.05.44	2 040 000.00	2 640 525.00	0.04
USD PERTAMINA PT-REG-S 6.45000% 14-30.05.44	1 922 000.00	2 492 593.75	0.04
USD PERTAMINA PT-REG-S 6.50000% 18-07.11.48	2 006 000.00	2 662 965.00	0.04
USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 4.12500% 17-15.05.27	2 500 000.00	2 656 250.00	0.04
USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 5.25000% 17-15.05.47	1 783 000.00	2 029 276.88	0.03
USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 5.45000% 18-21.05.28	1 253 000.00	1 455 829.37	0.02
USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 6.15000% 18-21.05.48	4 000 000.00	5 070 000.00	0.08
USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 4.37500% 19-05.02.50	823 000.00	843 575.00	0.01
USD PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 4.45000% 19-20.02.29	5 245 000.00	5 856 370.31	0.09
USD PETROLEOS MEXICANOS 5.62500% 16-23.01.46	4 688 000.00	4 377 420.00	0.07
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.87500% 17-04.08.26	8 130 000.00	9 150 315.00	0.14
USD PETRONAS CAPITAL LTD-REG-S 4.50000% 15-18.03.45	3 600 000.00	4 519 125.00	0.07
USD PHILIPPINE NATIONAL BANK-REG-S 3.28000% 19-27.09.24	3 889 000.00	3 966 780.00	0.06
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 10.62500% 00-16.03.25	740 000.00	1 049 875.00	0.02
USD POWER FINANCE CORP LTD-REG-S 6.15000% 18-06.12.28	1 474 000.00	1 721 466.18	0.03
USD POWER FINANCE CORP LTD-REG-S 3.95000% 20-23.04.30	892 000.00	892 272.50	0.01

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD PROVEN GLORY CAPITAL LTD-REG-S 3.25000% 17-21.02.22	1 800 000.00	1 811 812.50	0.03
USD PSA TREASURY PTE LTD-REG-S 2.12500% 19-05.09.29	1 445 000.00	1 431 532.22	0.02
USD PTTEP TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 3.90300% 19-06.12.59	5 854 000.00	6 218 045.62	0.10
USD PTTEP TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 2.99300% 20-15.01.30	4 310 000.00	4 426 761.78	0.07
USD QNB FINANCE LTD-REG-S 2.12500% 16-07.09.21	5 077 000.00	5 057 961.25	0.08
USD QNB FINANCE LTD-REG-S 3.50000% 19-28.03.24	4 354 000.00	4 522 717.50	0.07
USD RAKFUNDING CAYMAN LTD-REG-S 4.12500% 19-09.04.24	918 000.00	958 449.38	0.01
USD REC LTD-REG-S 3.37500% 19-25.07.24	3 668 000.00	3 704 680.00	0.06
USD REC LTD-REG-S 5.25000% 18-13.11.23	1 000 000.00	1 072 487.70	0.02
USD REPUBLIC OF UZBEKISTAN BOND-REG-S 5.37500% 19-20.02.29	4 355 000.00	4 853 103.13	0.07
USD REPUBLIC OF UZBEKISTAN BOND-REG-S 4.75000% 19-20.02.24	5 852 000.00	6 221 407.50	0.10
USD RHB BANK BHD-REG-S 3.76600% 19-19.02.24	2 762 000.00	2 924 267.50	0.04
USD RIZAL COMMERCIAL BANKING CORP-REG-S 4.12500% 18-16.03.23	3 165 000.00	3 280 839.00	0.05
USD RIZAL COMMERCIAL BANKING CORP-REG-S 3.00000% 19-11.09.24	1 930 000.00	1 930 000.00	0.03
USD ROMANIA-REG-S 4.87500% 14-22.01.24	10 000.00	11 056.25	0.00
USD ROMANIA-REG-S 6.12500% 14-22.01.44	302 000.00	402 131.87	0.01
USD ROMANIA-REG-S 6.75000% 12-07.02.22	3 960 000.00	4 318 875.00	0.07
USD RURAL ELECTRIFICATION CORP LTD-REG-S 3.87500% 17-07.07.27	900 000.00	912 937.50	0.01
USD SAUDI ARABIAN OIL CO-REG-S 3.50000% 19-16.04.29	6 300 000.00	6 671 700.00	0.10
USD SAUDI ARABIAN OIL CO-REG-S 4.25000% 19-16.04.39	8 483 000.00	9 377 108.20	0.14
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 4.50000% 16-26.10.46	1 780 000.00	2 033 650.00	0.03
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 3.62500% 17-04.03.28	2 470 000.00	2 657 565.63	0.04
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 4.00000% 18-17.04.25	2 950 000.00	3 209 600.00	0.05
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 5.00000% 18-17.04.49	2 723 000.00	3 363 755.93	0.05
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 2.50000% 20-03.02.27	5 180 000.00	5 196 213.40	0.08
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 3.75000% 20-21.01.55	15 750 000.00	16 009 898.62	0.25
USD SHARJAH SUKUK PROGRAM LTD-REG-S 4.22600% 18-14.03.28	2 570 000.00	2 821 378.13	0.04
USD SHARJAH SUKUK PROGRAM LTD-REG-S 3.85400% 19-03.04.26	2 830 000.00	3 013 950.00	0.05
USD SHINHAN BANK CO LTD-REG-S-SUB 4.00000% 19-23.04.29	1 100 000.00	1 193 840.12	0.02
USD SHINHAN BANK-REG-S-SUB 4.50000% 18-26.03.28	2 507 000.00	2 792 171.25	0.04
USD SIAM COMMERCIAL BK CAYMAN ISLAND-REG-S 3.90000% 19-11.02.24	2 249 000.00	2 387 601.60	0.04
USD SIAM COMMERCIAL BK CAYMAN ISLAND-REG-S 4.40000% 19-11.02.29	400 000.00	454 000.00	0.01
USD STATE OIL OF THE AZERBAIJAN REP-REG-S 4.75000% 13-13.03.23	7 917 000.00	8 330 168.45	0.13
USD SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD-REG-S 3.75000% 19-25.02.29	3 029 000.00	3 294 984.07	0.05
USD TBC BANK JSC-REG-S 5.75000% 19-19.06.24	5 969 000.00	6 284 237.82	0.10
USD TC ZIRAAT BANKASI AS-REG-S 4.75000% 16-29.04.21	3 314 000.00	3 367 852.50	0.05
USD TC ZIRAAT BANKASI AS-REG-S 5.12500% 17-03.05.22	850 000.00	869 390.63	0.01
USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.59500% 18-19.01.28	5 845 000.00	6 218 320.15	0.10
USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.97500% 19-11.04.29	12 178 000.00	13 452 884.37	0.21
USD THAIOIL TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 4.62500% 18-20.11.28	2 620 000.00	3 013 132.83	0.05
USD THAIOIL TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 5.37500% 18-20.11.48	1 157 000.00	1 533 748.12	0.02
USD THAIOIL TREASURY CENTER CO LTD-REG-S 3.50000% 19-17.10.49	1 210 000.00	1 202 909.65	0.02
USD TURKIYE BANKASI AS-REG-S 5.37500% 16-06.10.21	7 576 000.00	7 800 912.49	0.12
USD TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO-REG-S 5.50000% 16-27.10.21	295 000.00	302 743.75	0.00
USD TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO-REG-S 5.75000% 18-30.01.23	2 272 000.00	2 342 290.00	0.04
USD VANKE REAL ESTAT HONG KONG CO LTD-REG-S 3.97500% 17-09.11.27	1 760 000.00	1 848 000.00	0.03
USD YAPI VE KREDI BANKASI AS-REG-S 5.85000% 17-21.06.24	280 000.00	289 712.50	0.00
USD YAPI VE KREDI BANKASI AS-REG-S 6.10000% 18-16.03.23	3 810 000.00	3 970 734.37	0.06
USD YAPI VE KREDI BANKASI AS-REG-S 8.25000% 19-15.10.24	12 474 000.00	13 964 643.00	0.22
USD ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD-REG-S 8.65000% 19-21.01.23	550 000.00	554 812.50	0.01
米ドル合計		734 955 024.16	11.34
中期債券、固定利付債合計		834 481 989.45	12.87
中期債券、変動利付債			
EUR			
EUR OTP BANK NYRT-REG-S-SUB 2.875%/VAR 19-15.07.29	7 960 000.00	9 083 528.42	0.14
ユーロ合計		9 083 528.42	0.14

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD			
USD BANGKOK BANK PCL/HONG KONG-REG-S-SUB 3.733%/VAR 19-25.09.34	3 843 000.00	3 967 595.82	0.06
USD BANK OF CHINA/HONG KONG-REG-S 3M LIBOR+85BP 18-08.03.23	2 610 000.00	2 625 425.10	0.04
USD CITIC BANK INTERNATIONAL LTD-REG-S-SUB 4.625%/VAR 19-28.02.29	4 213 000.00	4 455 835.21	0.07
USD DBS GROUP HOLDINGS LTD-REG-S-SUB 4.520%/VAR 18-11.12.28	3 548 000.00	3 808 352.24	0.06
USD DIANJI HAIYU LTD-REG-S 4.300%/VAR 19-PRP	217 000.00	222 425.00	0.00
USD HUARONG FINANCE 2017 CO-REG-S 4.000%/VAR 17-PRP	7 147 000.00	7 236 337.50	0.11
USD ICBCIL FINANCE CO LTD-REG-S 3M LIBOR+95BP 18-15.05.21	2 265 000.00	2 264 524.35	0.04
USD ICBCIL FINANCE CO LTD-REG-S 3M LIBOR+110BP 18-15.05.23	231 000.00	231 907.16	0.00
USD KASIKORN BANK PCL/HONG KONG-REG-S-SUB 3.343%/VAR 19-02.10.31	10 280 000.00	10 472 750.00	0.16
USD KOOKMIN BANK-REG-S-SUB 4.350%/VAR 19-PRP	709 000.00	731 156.25	0.01
USD LEADER GOAL INTERNATIONAL LTD-REG-S 4.250%/VAR 18-PRP	500 000.00	512 031.25	0.01
USD OLAM INTERNATIONAL LTD-REG-S-SUB 5.350%/VAR 16-PRP	1 855 000.00	1 874 663.00	0.03
USD PARKWAY PANTAI LTD-REG-S 4.250%/VAR 17-PRP	4 100 000.00	4 114 093.74	0.06
USD QIB SUKUK LTD-REG-S 3M LIBOR+135BP 20-07.02.25	1 230 000.00	1 234 612.50	0.02
USD QNB FINANCE LTD-REG-S 3M LIBOR+135BP 18-31.05.21	2 715 000.00	2 734 656.60	0.04
USD SHINHAN BANK-REG-S-SUB 3.875%/VAR 16-07.12.26	1 838 000.00	1 883 375.63	0.03
USD SHINHAN FIN GROUP CO LTD-REG-S-SUB 3.340%/VAR 19-05.02.30	4 577 000.00	4 667 212.67	0.07
USD UNITED OVERSEAS BANK LTD-REG-S-SUB 3.750%/VAR 19-15.04.29	845 000.00	887 317.60	0.01
USD UNITED OVERSEAS BANK LTD-REG-S-SUB 2.880%/VAR 16-08.03.27	882 000.00	888 941.34	0.02
USD WING LUNG BANK LTD-REG-S-SUB 3.750%/H15T5Y+175BP 17-22.11.27	1 647 000.00	1 673 398.61	0.03
USD WOORI BANK-REG-S-SUB 4.250%/VAR 19-PRP	4 585 000.00	4 607 925.00	0.07
米ドル合計		61 094 536.57	0.94
中期債券、変動利付債合計		70 178 064.99	1.08
債券、固定利付債			
EUR			
EUR ARGENTINA, REPUBLIC OF-REG-S 3.87500% 16-15.01.22	6 745 000.00	3 478 122.06	0.05
EUR ARGENTINA, REPUBLIC OF-REG-S 5.00000% 16-15.01.27	100 000.00	46 475.14	0.00
EUR ARGENTINA, REPUBLIC OF 3.37500% 17-15.01.23	3 536 000.00	1 748 673.11	0.03
EUR ARGENTINA, REPUBLIC OF 5.25000% 17-15.01.28	4 730 000.00	2 194 997.89	0.03
EUR CENTRAL BANK OF TUNISIA-REG-S 5.62500% 17-17.02.24	14 202 000.00	15 635 371.47	0.24
EUR CROATIA, REPUBLIC OF-REG-S 3.00000% 17-20.03.27	2 000 000.00	2 602 192.13	0.04
EUR CROATIA, REPUBLIC OF-REG-S 2.75000% 17-27.01.30	4 717 000.00	6 277 755.95	0.10
EUR GAZ CAPITAL SA/GAZPROM-REG-S LPN 2.94900% 18-24.01.24	1 294 000.00	1 561 274.38	0.02
EUR IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 5.12500% 17-15.06.25	3 500 000.00	4 312 629.56	0.06
EUR IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 5.25000% 18-22.03.30	1 530 000.00	1 759 658.83	0.03
EUR IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 6.62500% 18-22.03.48	5 808 000.00	6 551 074.43	0.10
EUR IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 6.87500% 19-17.10.40	13 487 000.00	16 011 216.80	0.25
EUR MACEDONIA GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 3.97500% 14-24.07.21	1 129 000.00	1 318 407.54	0.02
EUR NAK NAFTOGAZ UKRAINE VIA KONDOR-REG-S 3.12500% 19-19.07.24	1 343 000.00	1 628 772.10	0.02
EUR REPUBLIC OF TURKEY 5.20000% 18-16.02.26	2 450 000.00	3 048 537.00	0.05
EUR RUSSIA, FEDERATION OF-REG-S 2.87500% 18-04.12.25	12 200 000.00	15 379 045.50	0.24
EUR SENEGAL, REPUBLIC OF-REG-S 4.75000% 18-13.03.28	4 250 000.00	5 013 046.59	0.08
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV-REG-S 1.25000% 15-31.03.23	1 270 000.00	1 326 927.52	0.02
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV-REG-S 1.12500% 16-15.10.24	1 110 000.00	1 094 790.78	0.02
ユーロ合計		90 988 968.78	1.40
USD			
USD 21VIANET GROUP INC-REG-S 7.00000% 17-17.08.20	390 000.00	387 562.50	0.01
USD 21VIANET GROUP INC-REG-S 7.87500% 19-15.10.21	2 160 000.00	2 164 334.47	0.03
USD ABJA INVESTMENT CO PTE LTD-REG-S 5.95000% 14-31.07.24	2 500 000.00	2 635 156.25	0.04
USD ABU DHABI CRUDE OIL PIPELINE LLC-REG-S 4.60000% 17-02.11.47	10 752 000.00	12 673 920.00	0.20
USD ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO PJSC-REG-S 4.00000% 19-03.10.49	1 000 000.00	1 054 375.00	0.02
USD ABU DHABI, GOVERNMENT OF-REG-S 3.12500% 19-30.09.49	8 897 000.00	8 902 560.62	0.14
USD ACWA POWER MGMT & INVEST ONE LTD-REG-S 5.95000% 17-15.12.39	2 530 000.00	2 734 930.00	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

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD ADANI GREEN ENERGY UP LTD-REG-S 6.25000% 19-10.12.24	700 000.00	756 656.25	0.01
USD ADCB FINANCE CAYMAN LTD-REG-S 4.00000% 18-29.03.23	3 695 000.00	3 869 357.81	0.06
USD AHB SUKUK CO LTD-REG-S 4.37500% 18-19.09.23	2 800 000.00	2 977 625.00	0.05
USD AKBANK TAS-REG-S 5.12500% 15-31.03.25	4 976 000.00	5 078 630.00	0.08
USD AKCB FINANCE LTD-REG-S 4.75000% 18-09.10.23	2 959 000.00	3 172 602.81	0.05
USD ALTICE FINANCING SA-144A 7.50000% 16-15.05.26	1 570 000.00	1 677 859.00	0.03
USD ALTICE FINANCING SA-REG-S 7.50000% 16-15.05.26	8 052 000.00	8 625 302.40	0.13
USD ANGOLAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 9.50000% 15-12.11.25	9 750 000.00	11 343 515.63	0.18
USD ANGOLAN GOVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 8.25000% 18-09.05.28	11 355 000.00	12 238 560.94	0.19
USD ANTON OILFIELD SERVICES GROUP-REG-S 9.75000% 17-05.12.20	2 230 000.00	2 246 725.00	0.03
USD ARGENTINA, REPUBLIC OF STEP-UP 05-31.12.38	14 613 000.00	6 137 460.00	0.09
USD ARGENTINA, REPUBLIC OF (PIK) 8.28000% 05-31.12.33	6 198 431.00	4 820 476.11	0.07
USD AYC FINANCE LTD-REG-S 4.85000% 19-PRP	1 086 000.00	1 072 425.00	0.02
USD BAHRAIN GVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.00000% 14-19.09.44	4 177 000.00	4 346 690.62	0.07
USD BAHRAIN GVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 7.00000% 16-12.10.28	4 501 000.00	5 309 773.44	0.08
USD BAHRAIN GVT INTERNATIONAL BOND-REG-S 7.50000% 17-20.09.47	2 690 000.00	3 282 640.63	0.05
USD BAHRAIN, KINGDOM OF-REG-S 5.62500% 19-30.09.31	1 720 000.00	1 827 500.00	0.03
USD BANK OF BAHRAIN & KUWAIT-REG-S 5.50000% 19-09.07.24	2 933 000.00	3 059 485.62	0.05
USD BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO-REG-S-SUB 4.20000% 20-23.01.25	3 252 000.00	3 272 325.00	0.05
USD BELARUS INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.20000% 18-28.02.30	2 394 000.00	2 604 971.25	0.04
USD BELIZE, GOVERNMENT OF-REG-S STEP-DOWN 13-20.02.34	2 573 000.00	1 568 937.53	0.02
USD BHARAT PETROLEUM CORP LT-REG-S 4.62500% 12-25.10.22	2 030 000.00	2 123 253.12	0.03
USD BHARTI AIRTEL INTL NETHERLANDS BV-REG-S 5.35000% 14-20.05.24	11 469 000.00	12 354 263.44	0.19
USD BIZ FINANCE PLC FOR UKREXIMBANK-REG-S 9.75000% 15-22.01.25	921 000.00	997 903.50	0.02
USD BIZ FINANCE PLC FOR UKREXIMBANK-REG-S 9.62500% 15-27.04.22	5 081 000.00	2 249 399.98	0.03
USD BLUESTAR FINANCE HOLDINGS LTD-REG-S 3.37500% 19-16.07.24	800 000.00	819 572.00	0.01
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 8.25000% 04-20.01.34	2 109 000.00	2 994 120.93	0.05
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 7.12500% 06-20.01.37	920 000.00	1 215 262.50	0.02
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 5.00000% 14-27.01.45	2 558 000.00	2 767 436.25	0.04
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 6.00000% 16-07.04.26	898 000.00	1 064 971.88	0.02
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 5.62500% 16-21.02.47	860 000.00	1 009 693.75	0.02
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 4.50000% 19-30.05.29	19 620 000.00	21 318 356.25	0.33
USD CDBL FUNDING 1-REG-S 4.25000% 14-02.12.24	766 000.00	822 731.88	0.01
USD CENTRAL BANK OF TUNISIA-REG-S 5.75000% 15-30.01.25	29 728 000.00	27 554 140.00	0.42
USD CHINA CONSTRUCTION BANK CORP-REG-S-SUB 4.25000% 19-27.02.29	4 897 000.00	5 190 820.00	0.08
USD CHINA EVERGRANDE GROUP-REG-S 7.00000% 17-23.03.20	2 883 000.00	2 869 485.94	0.04
USD CHINA EVERGRANDE GROUP-REG-S 8.25000% 17-23.03.22	4 786 000.00	4 540 717.50	0.07
USD CHINA EVERGRANDE GROUP-REG-S 6.25000% 17-28.06.21	870 000.00	837 918.75	0.01
USD CHINA EVERGRANDE GROUP-REG-S 7.50000% 17-28.06.23	1 531 000.00	1 335 319.06	0.02
USD CHINA EVERGRANDE GROUP-REG-S 8.75000% 17-28.06.25	2 775 000.00	2 333 601.58	0.04
USD CHINA OVERSEAS FIN CAYMAN VII LTD-REG-S 4.75000% 18-26.04.28	700 000.00	796 031.25	0.01
USD CHINA OVERSEAS FINANCE CAYMAN-REG-S 5.95000% 14-08.05.24	200 000.00	226 250.00	0.00
USD CHINA OVERSEAS FINANCE CAYMAN-REG-S 6.45000% 14-11.06.34	550 000.00	757 109.38	0.01
USD CHINA REINSURANCE FINANCE CORP-REG-S 3.37500% 17-09.03.22	4 567 000.00	4 609 815.63	0.07
USD CHINA SCE PROPERTY HOLDINGS LTD-REG-S 5.87500% 17-10.03.22	890 000.00	882 621.90	0.01
USD CHINA SCE PROPERTY HOLDINGS LTD-REG-S 7.45000% 18-17.04.21	545 000.00	554 744.60	0.01
USD CHINA SCE PROPERTY HOLDINGS LTD-REG-S 8.75000% 19-15.01.21	4 163 000.00	4 282 686.25	0.07
USD CHINA SCE PROPERTY HOLDINGS LTD-REG-S 7.37500% 19-09.04.24	865 000.00	872 028.12	0.01
USD CHINALCO CAPITAL HOLDINGS LTD-REG-S 4.00000% 16-25.08.21	3 029 000.00	3 066 862.50	0.05
USD CHINALCO CAPITAL HOLDINGS LTD-REG-S 4.25000% 17-21.04.22	3 802 000.00	3 866 443.89	0.06
USD CHOUZHOU INTERNATIONAL INVESTMENT-REG-S 4.00000% 17-05.12.20	3 682 000.00	3 701 560.63	0.06
USD CK HUTCHISON INTERNATIONAL LTD-REG-S 3.62500% 19-11.04.29	2 170 000.00	2 346 008.70	0.04
USD CNAC HK FINBRIDGE CO LTD-REG-S 3.50000% 17-19.07.22	260 000.00	265 850.00	0.00
USD CNAC HK FINBRIDGE CO LTD-REG-S 4.12500% 17-19.07.27	2 400 000.00	2 592 000.00	0.04
USD CNAC HK FINBRIDGE CO LTD-REG-S 4.62500% 18-14.03.23	7 342 000.00	7 766 459.38	0.12
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 10.37500% 03-28.01.33	660 000.00	1 079 306.25	0.02
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 8.12500% 04-21.05.24	2 000 000.00	2 477 500.00	0.04
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 7.37500% 06-18.09.37	1 073 000.00	1 579 657.19	0.02
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 6.12500% 09-18.01.41	1 666 000.00	2 250 661.87	0.03

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 4.00000% 13-26.02.24	32 550 000.00	34 553 859.38	0.53
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 5.62500% 14-26.02.44	2 526 000.00	3 279 063.75	0.05
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 5.00000% 15-15.06.45	15 395 000.00	18 652 004.69	0.29
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 2.62500% 13-15.03.23	8 320 000.00	8 424 000.00	0.13
USD COMCEL TRUST VIA COMUNICACIONES-REG-S 6.87500% 14-06.02.24	9 695 000.00	9 914 955.31	0.15
USD COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD-REG-S 5.75000% 12-14.02.42	1 300 000.00	1 515 312.50	0.02
USD COMPETITION TEAM TECHNOLOGIES LTD-REG-S 3.75000% 19-12.03.24	4 355 000.00	4 556 418.75	0.07
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 5.62500% 13-18.10.43	1 367 000.00	1 777 527.19	0.03
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-REG-S 4.87500% 14-04.11.44	1 818 000.00	2 162 851.88	0.03
USD COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 9.99500% 00-01.08.20	2 891 000.00	2 983 150.63	0.05
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 4.75000% 18-17.01.23	565 000.00	570 473.44	0.01
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 6.15000% 19-17.09.25	776 000.00	817 710.00	0.01
USD COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD-REG-S 5.12500% 20-14.01.27	987 000.00	988 233.75	0.02
USD CROATIA, REPUBLIC OF-REG-S 6.00000% 13-26.01.24	7 340 000.00	8 452 468.76	0.13
USD CSN RESOURCES SA-REG-S 6.50000% 10-21.07.20	250 000.00	254 609.38	0.00
USD DAR AL-ARKAN SUKUK CO LTD-REG-S 6.87500% 18-21.03.23	1 120 000.00	1 148 350.00	0.02
USD DEVELOPMENT BANK OF MONGOLIA LLC-REG-S 7.25000% 18-23.10.23	3 618 000.00	3 847 516.87	0.06
USD DIB SUKUK LTD-REG-S 2.95000% 19-20.02.25	3 155 000.00	3 181 817.50	0.05
USD DNO ASA-144A-REG-S 8.75000% 18-31.05.23	4 800 000.00	4 920 000.00	0.08
USD DNO ASA-144A-REG-S 8.37500% 19-29.05.24	4 550 000.00	4 641 000.00	0.07
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 7.50000% 10-06.05.21	33 221 000.00	22 911 416.34	0.35
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 5.87500% 13-18.04.24	9 629 000.00	10 327 102.50	0.16
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 6.60000% 13-28.01.24	1 090 000.00	1 211 603.12	0.02
USD EA PARTNERS I BV-REG-S *DEFAULTED* 6.87500% 15-28.09.20	4 113 000.00	1 852 384.56	0.03
USD EA PARTNERS II BV-REG-S *DEFAULTED* 6.75000% 16-01.06.21	1 710 000.00	845 167.50	0.01
USD EASY TACTIC LTD-REG-S 8.12500% 19-27.02.23	1 970 000.00	1 965 075.00	0.03
USD ECOPETROL SA 4.12500% 14-16.01.25	2 700 000.00	2 867 214.51	0.04
USD ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S 7.95000% 14-20.06.24	7 549 000.00	6 661 992.50	0.10
USD ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S 10.50000% 15-24.03.20	648 000.00	650 835.00	0.01
USD ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S 10.75000% 16-28.03.22	4 632 000.00	4 571 205.00	0.07
USD ECUADOR, REPUBLIC OF-REG-S 8.75000% 17-02.06.23	2 049 000.00	1 911 973.12	0.03
USD EL FONDO MIVIVIENDA-REG-S 3.50000% 13-31.01.23	1 950 000.00	2 003 625.00	0.03
USD EL SALVADOR, REPUBLIC OF-REG-S 7.65000% 05-15.06.35	4 527 000.00	5 262 637.50	0.08
USD ELDORADO INTL. FINANCE GMBH-REG-S 8.62500% 16-16.06.21	7 485 000.00	7 817 146.88	0.12
USD EMG SUKUK LTD-REG-S 4.56400% 14-18.06.24	588 000.00	619 421.25	0.01
USD EMIRATES REIT SUKUK LTD-REG-S 5.12500% 17-12.12.22	1 382 000.00	1 365 588.75	0.02
USD ENN CLEAN ENERGY INTL INVEST LTD-REG-S 7.50000% 19-27.02.21	1 690 000.00	1 736 475.00	0.03
USD ESKOM HOLDINGS SOC LTD-REG-S 5.75000% 11-26.01.21	6 411 000.00	6 426 546.67	0.10
USD ETHIOPIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 6.62500% 14-11.12.24	5 840 000.00	6 301 725.00	0.10
USD EXPORT CREDIT BANK OF TURKEY-REG-S 8.25000% 19-24.01.24	2 365 000.00	2 642 887.50	0.04
USD EXPORT-IMPORT BANK OF INDIA-REG-S 3.37500% 16-05.08.26	380 000.00	392 825.00	0.01
USD FORMOSA GROUP CAYMAN LTD-REG-S 3.37500% 15-22.04.25	1 803 000.00	1 879 627.50	0.03
USD FUFENG GROUP LTD-REG-S 5.87500% 18-28.08.21	600 000.00	623 432.88	0.01
USD GABON, REPUBLIC OF-REG-S 6.37500% 13-12.12.24	12 906 519.00	13 866 441.35	0.21
USD GABON, REPUBLIC OF-REG-S 6.95000% 15-16.06.25	1 867 000.00	2 018 693.75	0.03
USD GAZ CAPITAL SA/GAZPROM-REG-S LPN 5.15000% 19-11.02.26	3 827 000.00	4 282 652.19	0.07
USD GCL NEW ENERGY HOLDINGS LTD-REG-S 7.10000% 18-30.01.21	4 514 000.00	2 935 815.32	0.05
USD GEORGIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.87500% 11-12.04.21	700 000.00	738 062.50	0.01
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 8.12500% 14-18.01.26	540 000.00	600 750.00	0.01
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 10.75000% 15-14.10.30	7 941 000.00	10 144 596.53	0.16
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 7.87500% 19-26.03.27	2 108 000.00	2 247 655.00	0.03
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 8.12500% 19-26.03.32	5 640 000.00	5 777 475.00	0.09
USD GHANA GOVT INTNL BOND-REG-S 8.95000% 19-26.03.51	7 259 000.00	7 410 985.31	0.11
USD GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD-REG-S 3.87500% 15-04.06.25	5 559 000.00	5 732 718.75	0.09
USD GOHL CAPITAL LTD-REG-S 4.25000% 17-24.01.27	9 890 000.00	10 464 856.25	0.16
USD GREENKO INVESTMENT CO-REG-S 4.87500% 16-16.08.23	3 436 000.00	3 445 663.75	0.05
USD GREENKO SOLAR MAURITIUS LTD-REG-S 5.55000% 19-29.01.25	2 940 000.00	3 006 150.00	0.05
USD GREENKO SOLAR MAURITIUS LTD-REG-S 5.95000% 19-29.07.26	640 000.00	654 400.00	0.01
USD GTL TRADE FIN/ GERDAU HOLDINGS-REG-S 5.89300% 14-29.04.24	5 333 000.00	5 935 795.92	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

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD GTLK EUROPE LTD-REG-S 5.95000% 16-19.07.21	1 270 000.00	1 324 371.88	0.02
USD HAITIAN BVI INTL INVT DEV-REG-S 3.87500% 17-12.12.20	2 739 000.00	2 743 108.50	0.04
USD HALYK SAVINGS BANK OF KAZAKHSTAN-REG-S 5.50000% 12-21.12.22	2 250 977.00	1 664 582.02	0.03
USD HK RED STAR MAC UNIV HOME FURN-REG-S 3.37500% 17-21.09.22	3 080 000.00	2 791 250.00	0.04
USD HKT CAPITAL NO 5 LTD-REG-S 3.25000% 19-30.09.29	4 650 000.00	4 761 412.60	0.07
USD HONGKONG INTERNATIONAL QINGDAO-REG-S 4.25000% 17-04.12.22	3 194 000.00	3 202 983.12	0.05
USD HTA GROUP LTD/MAURITIUS-REG-S 9.12500% 17-08.03.22	6 146 000.00	6 301 570.63	0.10
USD HUARONG FINANCE II CO LTD-REG-S 4.62500% 16-03.06.26	1 300 000.00	1 411 312.50	0.02
USD HUBI SCI TECH INV GRP HNG KNG LTD-REG-S 4.37500% 18-05.03.21	1 868 000.00	1 882 593.75	0.03
USD ICD SUKUK CO LTD-REG-S 3.50800% 14-21.05.20	2 000 000.00	1 999 999.80	0.03
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 8.50000% 05-12.10.35	3 513 000.00	5 629 582.50	0.09
USD INDONESIA, REPUBLIC OF-REG-S 6.62500% 07-17.02.37	2 493 000.00	3 469 165.32	0.05
USD IRAQ INTERNATIONAL BOND-REG-S 5.80000% 06-15.01.28	2 696 000.00	2 593 215.01	0.04
USD IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 6.37500% 15-03.03.28	3 220 000.00	3 473 575.00	0.05
USD IVORY COAST, REPUBLIC OF-REG-S 6.12500% 17-15.06.33	3 631 000.00	3 731 987.19	0.06
USD JAMAICA, GOVERNMENT OF 9.25000% 05-17.10.25	496 000.00	633 485.00	0.01
USD JAMAICA, GOVERNMENT OF 8.00000% 07-15.03.39	430 000.00	591 115.63	0.01
USD JSW STEEL LTD-REG-S 5.95000% 19-18.04.24	1 105 000.00	1 141 603.12	0.02
USD KAISA GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 8.50000% 17-30.06.22	12 502 000.00	12 364 790.54	0.19
USD KAZAKHSTAN TEMIR ZHOLY FINANCE BV-REG-S 6.95000% 12-10.07.42	3 587 000.00	5 062 153.75	0.08
USD KING POWER CAPITAL LTD-REG-S 5.62500% 14-03.11.24	2 300 000.00	2 602 105.00	0.04
USD KOREA EXCHANGE BANK-REG-S-SUB 4.25000% 14-14.10.24	3 492 000.00	3 750 626.25	0.06
USD KOREA HOUSING FINANCE CORP-REG-S 3.00000% 17-31.10.22	3 680 000.00	3 778 040.35	0.06
USD KUNMING RAIL TRANSIT GROUP CO LTD-REG-S 3.50000% 19-12.12.22	1 918 000.00	1 925 978.88	0.03
USD KUWAIT PROJECTS CO SPC LTD-REG-S 5.00000% 16-15.03.23	300 000.00	318 093.75	0.01
USD KUWAIT PROJECTS CO SPC LTD-REG-S 4.50000% 17-23.02.27	2 382 000.00	2 483 979.38	0.04
USD KWG GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 5.87500% 17-10.11.24	1 310 000.00	1 238 359.37	0.02
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S 6.75000% 12-29.11.27	665 000.00	244 387.50	0.00
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S 6.00000% 12-27.01.23	1 419 000.00	546 315.00	0.01
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S 6.20000% 15-26.02.25	4 600 000.00	1 656 000.00	0.03
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S 7.05000% 15-02.11.35	6 509 000.00	2 326 967.50	0.04
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S 6.65000% 15-03.11.28	7 214 000.00	2 597 040.00	0.04
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S 6.65000% 16-22.04.24	9 237 000.00	3 452 328.75	0.05
USD LEBANON, REPUBLIC OF 6.85000% 16-25.05.29	581 000.00	210 067.81	0.00
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S 6.85000% 17-23.03.27	7 976 000.00	2 931 180.00	0.05
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S 7.25000% 17-23.03.37	7 795 000.00	2 786 712.50	0.04
USD LEBANON, REPUBLIC OF-REG-S 7.00000% 17-23.03.32	1 558 000.00	556 985.00	0.01
USD LONGFOR PROPERTIES CO LTD-REG-S 3.90000% 18-16.04.23	1 060 000.00	1 092 236.19	0.02
USD LONGFOR PROPERTIES CO LTD-REG-S 4.50000% 18-16.01.28	1 907 000.00	2 036 318.44	0.03
USD MAF GLOBAL SECURITIES LTD-REG-S 4.75000% 14-07.05.24	8 058 000.00	8 664 868.12	0.13
USD MARBLE II PTE LTD-REG-S 5.30000% 17-20.06.22	886 000.00	899 290.00	0.01
USD MASHREQBANK PSC-REG-S 4.25000% 19-26.02.24	4 621 000.00	4 833 277.18	0.07
USD MELCO RESORTS FINANCE LTD-REG-S 5.25000% 19-26.04.26	2 456 000.00	2 467 260.51	0.04
USD METINVEST BV-REG-S 7.75000% 18-23.04.23	3 447 000.00	3 666 746.25	0.06
USD METINVEST BV-REG-S 7.75000% 19-17.10.29	2 390 000.00	2 497 550.00	0.04
USD MEXICO CITY AIRPORT TRUST-144A 5.50000% 16-31.10.46	1 500 000.00	1 646 250.00	0.03
USD MEXICO CITY AIRPORT TRUST-144A 3.87500% 17-30.04.28	4 080 000.00	4 248 300.00	0.07
USD MEXICO CITY AIRPORT TRUST-144A 5.50000% 17-31.07.47	3 060 000.00	3 348 309.53	0.05
USD MEXICO CITY AIRPORT TRUST-REG-S 5.50000% 16-31.10.46	261 000.00	286 447.50	0.00
USD MEXICO CITY AIRPORT TRUST-REG-S 3.87500% 17-30.04.28	630 000.00	655 987.50	0.01
USD MEXICO CITY AIRPORT TRUST-REG-S 5.50000% 17-31.07.47	17 155 000.00	18 771 323.52	0.29
USD MINEJESA CAPITAL BV-REG-S 4.62500% 17-10.08.30	8 685 000.00	9 035 114.06	0.14
USD MINEJESA CAPITAL BV-REG-S 5.62500% 17-10.08.37	6 247 000.00	6 824 847.50	0.11
USD MINERA Y METALURGICA DEL BOLEO-REG-S 3.25000% 19-17.04.24	357 000.00	370 275.94	0.01
USD MINMETALS BOUNTEOUS FIN BVI LTD-REG-S 4.20000% 16-27.07.26	2 500 000.00	2 696 875.00	0.04
USD MOROCCO, KINGDOM OF THE-REG-S 5.50000% 12-11.12.42	2 133 000.00	2 684 913.75	0.04
USD MOROCCO, KINGDOM OF-REG-S 4.25000% 12-11.12.22	1 702 000.00	1 791 355.00	0.03
USD MUMTALAKAT SUKUK HOLDING CO-REG-S 4.10000% 20-21.01.27	2 040 000.00	2 052 746.74	0.03
USD NAKILAT INC-REG-S 6.06700% 06-31.12.33	2 925 000.00	3 572 156.25	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

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD NEW METRO GLOBAL LTD-REG-S 6.50000% 18-23.04.21	2 330 000.00	2 332 399.90	0.04
USD NWD FINANCE BVI LTD-REG-S 5.75000% 16-PRP	1 229 000.00	1 244 989.29	0.02
USD NWD MTN LTD-REG-S 4.12500% 19-18.07.29	3 774 000.00	3 848 649.72	0.06
USD OIL INDIA INTERNATIONAL PTE LTD-REG-S 4.00000% 17-21.04.27	1 000 000.00	1 051 875.00	0.02
USD OIL INDIA LTD-REG-S 5.12500% 19-04.02.29	2 652 000.00	3 012 506.25	0.05
USD OILFLOW SPV 1 DAC-REG-S 12.00000% 17-13.01.22	5 120 000.00	5 286 370.30	0.08
USD OSCHADBANK VIA SSB #1 PLC-REG-S LPN STEP UP/DOWN 15-10.03.23	5 778 000.00	2 147 429.81	0.03
USD OVPH LTD-REG-S-SUB 5.87500% 16-PRP	1 105 000.00	1 132 970.31	0.02
USD OZTEL HOLDINGS SPC-REG-S 6.62500% 18-24.04.28	6 299 000.00	6 810 793.75	0.11
USD PANAMA, REPUBLIC OF 8.87500% 97-30.09.27	655 000.00	943 814.06	0.01
USD PANAMA, REPUBLIC OF 7.12500% 05-29.01.26	371 000.00	469 778.75	0.01
USD PANAMA, REPUBLIC OF 6.70000% 06-26.01.36	1 747 000.00	2 514 588.13	0.04
USD PANAMA, REPUBLIC OF 4.30000% 13-29.04.53	1 330 000.00	1 612 209.38	0.02
USD PANAMA, REPUBLIC OF 4.00000% 14-22.09.24	420 000.00	454 256.25	0.01
USD PANAMA, REPUBLIC OF 3.75000% 15-16.03.25	7 510 000.00	8 054 475.00	0.12
USD PANAMA, REPUBLIC OF 3.87500% 16-17.03.28	4 200 000.00	4 646 250.00	0.07
USD PANAMA, REPUBLIC OF 4.50000% 18-16.04.50	1 868 000.00	2 299 975.00	0.04
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 4.62500% 13-25.01.23	8 370 000.00	8 872 200.00	0.14
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 5.00000% 16-15.04.26	6 962 000.00	7 736 522.50	0.12
USD PELABUHAN INDONESIA II PT-REG-S 4.25000% 15-05.05.25	2 400 000.00	2 550 750.00	0.04
USD PERU, REPUBLIC OF 4.12500% 15-25.08.27	3 107 000.00	3 552 660.31	0.05
USD PERU, REPUBLIC OF 7.35000% 05-21.07.25	6 572 000.00	8 395 730.00	0.13
USD PERU, REPUBLIC OF 8.75000% 03-21.11.33	2 691 000.00	4 552 835.63	0.07
USD PERUSAHAAN GAS NEGARA PT-REG-S 5.12500% 14-16.05.24	1 810 000.00	1 971 203.13	0.03
USD PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT-REG-S 3.87500% 19-17.07.29	6 934 000.00	7 259 031.25	0.11
USD PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 3.40000% 17-29.03.22	560 000.00	574 000.00	0.01
USD PETROAMAZONAS EP-REG-S 4.62500% 17-16.02.20	2 100 000.00	174 562.49	0.00
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 9.75000% 12-17.05.35	1 493 000.00	119 440.00	0.00
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 6.00000% 14-16.05.24	33 023 021.00	2 972 071.89	0.05
USD PETRONAS CAPITAL LTD-REG-S 7.87500% 02-22.05.22	2 963 000.00	3 349 115.93	0.05
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 7.75000% 06-14.01.31	3 515 000.00	5 290 075.00	0.08
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 6.37500% 09-23.10.34	1 050 000.00	1 520 203.12	0.02
USD POWER FINANCE CORP LTD-REG-S 3.75000% 19-18.06.24	282 000.00	289 243.23	0.00
USD POWER FINANCE CORP LTD-REG-S 4.50000% 19-18.06.29	2 280 000.00	2 385 450.00	0.04
USD POWER FINANCE CORP LTD-REG-S 3.25000% 19-16.09.24	2 718 000.00	2 733 444.50	0.04
USD PROSUS NV-REG-S 5.50000% 15-21.07.25	2 055 000.00	2 291 325.00	0.04
USD PROVEN HONOUR CAPITAL LTD-REG-S 4.12500% 15-19.05.25	500 000.00	528 750.00	0.01
USD PT ADARO INDONESIA-REG-S 4.25000% 19-31.10.24	1 175 000.00	1 151 500.00	0.02
USD PTTEP CANADA INTERNATIONAL FIN-REG-S 6.35000% 12-12.06.42	1 020 000.00	1 468 162.50	0.02
USD QATAR, STATE OF-REG-S 3.25000% 16-02.06.26	6 915 000.00	7 347 187.50	0.11
USD QIB SUKUK LTD-REG-S 3.25100% 17-23.05.22	6 120 000.00	6 188 850.00	0.10
USD RAS LAFFAN LIQUIFIED NATURAL GAS-REG-S 5.29800% 05-30.09.20	10 000 000.00	1 132 209.78	0.02
USD RENEW POWER SYNTHETIC-REG-S 6.67000% 19-12.03.24	1 550 000.00	1 626 046.87	0.03
USD REPUBLIC OF AZERBAIJAN-REG-S 3.50000% 17-01.09.32	13 141 000.00	13 264 196.87	0.20
USD RONGXINGDA DEVELOPMENT BVI LTD-REG-S 8.00000% 19-24.04.22	3 032 000.00	2 899 350.00	0.04
USD RUSSIA, FEDERATION OF-REG-S 4.75000% 16-27.05.26	8 400 000.00	9 492 000.00	0.15
USD RUSSIA, FEDERATION OF-REG-S 12.75000% 98-24.06.28	2 400 000.00	4 164 000.00	0.06
USD RUSSIA, FEDERATION OF-REG-S STEP-UP 00-31.03.30	70.00	26.63	0.00
USD RUSSIA, FEDERATION OF-REG-S 4.87500% 13-16.09.23	14 200 000.00	15 549 000.00	0.24
USD RUSSIA, FEDERATION OF-REG-S 5.87500% 13-16.09.43	23 400 000.00	32 335 875.00	0.50
USD SABIC CAPITAL II BV-REG-S 4.00000% 18-10.10.23	745 000.00	785 230.00	0.01
USD SAMARCO MINERACAO SA-REG-S 4.12500% 12-01.11.22	17 538 000.00	11 366 816.25	0.18
USD SAMBA FUNDING LTD-REG-S 2.90000% 20-29.01.27	1 363 000.00	1 361 637.00	0.02
USD SANDS CHINA LTD 5.12500% 19-08.08.25	4 761 000.00	5 263 285.50	0.08
USD SAUDI ELECTRICITY GLOBAL SUKIK CO REG-S 5.50000% 14-08.04.44	2 993 000.00	3 681 390.00	0.06
USD SAUDI ELECTRICITY GLOBAL SUKUK CO-REG-S 4.22200% 18-27.01.24	824 000.00	877 848.40	0.01
USD SAUDI ELECTRICITY GLOBAL SUKUK CO-REG-S 4.72300% 18-27.09.28	1 433 000.00	1 627 673.05	0.03
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-REG-S 5.25000% 19-16.01.50	6 072 000.00	7 787 340.00	0.12
USD SCENERY JOURNEY LTD-REG-S 11.00000% 18-06.11.20	1 150 000.00	1 167 250.00	0.02

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD SCENERY JOURNEY LTD-REG-S 13.00000% 18-06.11.22	3 990 000.00	4 037 381.25	0.06
USD SENEGAL, REPUBLIC OF-REG-S 6.25000% 14-30.07.24	3 650 000.00	4 053 781.25	0.06
USD SENEGAL, REPUBLIC OF-REG-S 6.25000% 17-23.05.33	2 850 000.00	3 036 140.62	0.05
USD SFC CAPITAL LTD-REG-S 5.37500% 16-16.06.23	4 703 000.00	5 068 952.18	0.08
USD SHARJAH SUKUK PROGRAM LTD-REG-S 3.23400% 19-23.10.29	6 868 000.00	7 056 870.00	0.11
USD SK HYNIX INC-REG-S 3.00000% 19-17.09.24	1 403 000.00	1 431 162.56	0.02
USD SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.87500% 13-16.09.25	3 063 000.00	3 383 657.82	0.05
USD SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 4.30000% 16-12.10.28	12 764 000.00	12 582 113.00	0.19
USD SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.00000% 16-12.10.46	2 966 000.00	2 781 551.88	0.04
USD SOUTH AFRICA, REPUBLIC OF 5.87500% 18-22.06.30	6 666 000.00	7 256 940.90	0.11
USD SOUTHERN GAS CORRIDOR CJSC-REG-S 6.87500% 16-24.03.26	22 498 000.00	26 871 048.75	0.41
USD SOVCOMBANK CAP DAC-REG-S-SUB 8.00000% 19-07.04.30	2 260 000.00	2 437 975.00	0.04
USD SRI LANKA, DEMOCRATIC REP OF-REG-S 6.85000% 15-03.11.25	3 925 000.00	3 970 382.81	0.06
USD SSMS PLANTATION HOLDINGS PTE LTD-REG-S 7.75000% 18-23.01.23	1 652 000.00	1 355 466.00	0.02
USD STATE OIL OF THE AZERBAIJAN REP-REG-S 6.95000% 15-18.03.30	13 887 000.00	17 128 746.57	0.26
USD STILLWATER MINING CO-REG-S 6.12500% 17-27.06.22	2 681 000.00	2 741 322.50	0.04
USD STILLWATER MINING CO-REG-S 7.12500% 17-27.06.25	5 774 000.00	6 142 092.50	0.09
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 7.87500% 19-15.02.22	938 000.00	966 140.00	0.01
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 7.95000% 19-11.10.23	1 310 000.00	1 351 346.88	0.02
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 7.50000% 19-01.02.24	3 887 000.00	3 914 209.00	0.06
USD SUNAC CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 6.50000% 20-10.01.25	3 630 000.00	3 489 337.50	0.05
USD SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP-REG-S 3.75000% 18-23.01.23	1 200 000.00	1 238 250.00	0.02
USD TABREED SUKUK SPC LTD-REG-S 5.50000% 18-31.10.25	3 982 000.00	4 474 772.50	0.07
USD THETA CAPITAL PTE LTD-REG-S 7.00000% 14-11.04.22	3 010 000.00	3 032 575.00	0.05
USD THETA CAPITAL PTE LTD-REG-S 8.12500% 20-22.01.25	590 000.00	590 000.00	0.01
USD THIRD PAKISTAN INTERNATIONAL SUK-REG-S 5.50000% 16-13.10.21	806 000.00	825 142.50	0.01
USD THREE GORGES FIN I CAYMAN ISLANDS-REG-S 3.15000% 16-02.06.26	2 000 000.00	2 088 750.00	0.03
USD TIMES CHINA HOLDINGS LTD-REG-S 6.25000% 18-17.01.21	2 339 000.00	2 355 583.51	0.04
USD TNB GLOBAL VENTURES CAPITAL-REG-S 4.85100% 18-01.11.28	4 077 000.00	4 698 498.69	0.07
USD TRADE & DEVELOPMENT BANK MONGOLIA-REG-S 9.37500% 15-19.05.20	5 008 000.00	5 075 608.00	0.08
USD TURKEY, REPUBLIC OF 5.62500% 10-30.03.21	390 000.00	402 675.00	0.01
USD TURKEY, REPUBLIC OF 5.75000% 14-22.03.24	8 520 000.00	9 036 525.00	0.14
USD TURKEY, REPUBLIC OF 6.62500% 14-17.02.45	1 500 000.00	1 607 812.50	0.02
USD TURKEY, REPUBLIC OF 4.25000% 15-14.04.26	3 040 000.00	2 969 700.00	0.05
USD TURKEY, REPUBLIC OF 6.12500% 18-24.10.28	2 042 000.00	2 168 348.75	0.03
USD TURKIYE BANKASI AS-REG-S 5.00000% 14-30.04.20	2 009 000.00	2 022 560.75	0.03
USD TURKIYE IS BANKASI AS-REG-S-SUB 6.00000% 12-24.10.22	879 000.00	897 129.38	0.01
USD TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO-REG-S 8.12500% 19-28.03.24	4 100 000.00	4 556 125.00	0.07
USD UKRAINE RAILWAY VIA SHORTLINE-REG-S LPN 9.87500% 16-15.09.21	492 000.00	205 410.00	0.00
USD UNITED BANK FOR AFRICA PLC-REG-S 7.75000% 17-08.06.22	8 438 000.00	8 989 106.88	0.14
USD URUGUAY, REPUBLIC OF 7.62500% 06-21.03.36	1 059 715.00	1 628 318.33	0.03
USD URUGUAY, REPUBLIC OF 5.10000% 14-18.06.50	3 791 500.00	4 773 735.47	0.07
USD URUGUAY, REPUBLIC OF 4.97500% 18-20.04.55	10 804 921.00	13 418 361.26	0.21
USD URUGUAY, REPUBLIC OF 4.37500% 19-23.01.31	988 000.00	1 133 730.00	0.02
USD VALE OVERSEAS LTD 6.87500% 09-10.11.39	1 500 000.00	1 995 000.00	0.03
USD VEDANTA RESOURCES FINANCE II PLC-REG-S 9.25000% 19-23.04.26	1 531 000.00	1 475 501.25	0.02
USD VENEZUELA, REP. OF REG-S *DEFAULTED* 11.75000% 11-21.10.26	4 098 600.00	502 078.50	0.01
USD VENEZUELA, REP. OF REG-S *DEFAULTED* 9.00000% 08-07.05.23	378 000.00	46 305.00	0.00
USD VENEZUELA, REP. OF REG-S *DEFAULTED* 9.25000% 08-07.05.28	2 977 000.00	364 682.50	0.01
USD VENEZUELA, REP. OF REG-S *DEFAULTED* 12.75000% 10-23.08.22	2 305 600.00	282 436.00	0.00
USD VENEZUELA, REP. OF REG-S *DEFAULTED* 11.95000% 11-05.08.31	6 682 000.00	818 545.00	0.01
USD VENEZUELA, REPUBLIC OF *DEFAULTED* 9.25000% 97-15.09.27	1 002 000.00	122 745.00	0.00
USD VIETNAM, SOCIALIST REPUBLIC-REG-S 4.80000% 14-19.11.24	1 500 000.00	1 646 850.00	0.03
USD VTB BK OJSC VIA VTB CPTL-REG-S-SUB LPN 6.95000% 12-17.10.22	1 595 000.00	1 736 556.25	0.03
USD WAKALA GLOBAL SUKUK BHD-REG-S 4.64600% 11-06.07.21	791 000.00	822 640.00	0.01
USD WOORI BANK-REG-S-SUB 4.75000% 14-30.04.24	3 741 000.00	4 061 323.12	0.06
USD XINGSHENG BVI CO LTD-REG-S 4.50000% 18-20.09.21	2 168 000.00	2 226 884.83	0.03
USD XINGSHENG BVI CO LTD-REG-S 3.37500% 19-25.07.22	1 745 000.00	1 770 808.55	0.03
USD YAPI VE KREDI BANKASI AS-REG-S 5.75000% 17-24.02.22	2 331 000.00	2 415 498.75	0.04

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD YUZHOU PROPERTIES CO LTD-REG-S 8.50000% 19-04.02.23	550 000.00	575 437.50	0.01
USD YUZHOU PROPERTIES CO LTD-REG-S 8.30000% 19-27.05.25	3 761 000.00	3 775 103.75	0.06
USD ZAMBIA, REPUBLIC OF-REG-S 5.37500% 12-20.09.22	8 588 000.00	5 928 403.76	0.09
米ドル合計		1 206 619 299.57	18.61
債券、固定利付債合計		1 297 608 268.35	20.01
債券、ゼロ・クーポン債			
USD			
USD ECUADOR SOCIAL BOND SARL-REG-S 0.00000% 20-30.01.35	7 910 000.00	5 141 500.00	0.08
米ドル合計		5 141 500.00	0.08
債券、ゼロ・クーポン債合計		5 141 500.00	0.08
債券、変動利付債			
USD			
USD ABSA GROUP LIMITED-REG-S-SUB 6.250%/VAR 18-25.04.28	2 060 000.00	2 193 256.25	0.03
USD AGILE GROUP HOLDINGS LTD-REG-S 7.875%/VAR 19-PRP	2 935 000.00	3 017 546.88	0.05
USD AL AHLI BANK OF KUWAIT KSCP 7.250%/VAR 18-PRP	3 005 000.00	3 239 765.62	0.05
USD BANK OF EAST ASIA LTD/THE-REG-S-SUB 4.000%/VAR 16-03.11.26	4 463 000.00	4 528 716.78	0.07
USD BANK OF EAST ASIA LTD/THE-REG-S-SUB 5.625%/VAR 17-PRP	720 000.00	737 325.00	0.01
USD BURGAN BANK SAK-REG-S-SUB 5.749%/VAR 19-PRP	900 000.00	922 781.25	0.01
USD CELESTIAL MILES LTD-REG-S 5.750%/VAR 19-PRP	2 000 000.00	2 119 033.60	0.03
USD CHALCO HONG KONG INVESTMENT CO-REG-S 4.250%/VAR 16-PRP	2 655 000.00	2 689 846.88	0.04
USD CHAMPION SINCERITY HOLDINGS LTD-REG-S 8.125%/VAR 19-PRP	1 500 000.00	1 578 281.25	0.02
USD CHINA CONSTRUCTION BANK-REG-S-SUB 3.875%/VAR 15-13.05.25	8 195 000.00	8 228 292.19	0.13
USD CHINA MINMETALS CORP-REG-S 3.750%/VAR 17-PRP	11 616 000.00	11 743 050.00	0.18
USD CHINA MINMETALS CORP-REG-S 4.450%/VAR 18-PRP	11 410 000.00	11 589 707.50	0.18
USD CHINALCO CAPITAL HOLDINGS LTD-REG-S 4.100%/VAR 19-PRP	558 000.00	568 288.13	0.01
USD CLP POWER HK FINANCE LTD-REG-S-SUB 3.550%/VAR 19-PRP	400 000.00	404 441.56	0.01
USD DIANJIANG INTERNATIONAL FINANCE LTD-REG-S 4.600%/VAR 18-PRP	7 157 000.00	7 411 968.12	0.11
USD DIB TIER 1 SUKUK 2 LTD-REG-S-SUB 6.750%/VAR 15-PRP	5 675 000.00	5 818 648.44	0.09
USD DIB TIER 1 SUKUK 3 LTD-REG-S-SUB 6.250%/VAR 19-PRP	1 352 000.00	1 450 442.50	0.02
USD EMIRATES NBD PJSC-REG-S-SUB 6.125%/VAR 19-PRP	9 715 000.00	10 255 396.88	0.16
USD FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S-SUB 5.250%/VAR 15-PRP	3 950 000.00	3 969 750.00	0.06
USD FIRSTSTRAND BANK LTD-REG-S-SUB 6.250%/VAR 18-23.04.28	700 000.00	746 593.75	0.01
USD FRANSION BRILLIANT LTD-REG-S 4.000%/VAR 17-PRP	1 426 000.00	1 438 031.88	0.02
USD HEUNGKUK LIFE INSURANCE CO-REG-S-SUB 4.475%/VAR 17-09.11.47	5 430 000.00	5 453 756.25	0.08
USD HUARONG FINANCE 2017 CO-REG-S 4.500%/VAR 17-PRP	2 932 000.00	2 992 472.50	0.05
USD JOLLIBEE WORLDWIDE PTE LTD-REG-S 3.900%/VAR 20-PRP	4 000 000.00	3 970 000.00	0.06
USD KING TALENT MANAGEMENT LTD-REG-S-SUB 5.600%/VAR 17-PRP	360 000.00	329 220.00	0.01
USD KYOBO LIFE INSURANCE CO LTD-REG-S-SUB 3.950%/VAR 17-24.07.47	1 032 000.00	1 045 867.50	0.02
USD MAF GLOBAL SECURITIES LTD-REG-S-SUB 6.375%/VAR 18-PRP	2 280 000.00	2 422 500.00	0.04
USD NBK TIER 1 FINANCING LTD-REG-S-SUB 5.750%/VAR 15-PRP	6 115 000.00	6 277 429.70	0.10
USD NBK TIER 1 FINANCING 2 LTD-REG-S-SUB 4.500%/VAR 19-PRP	10 093 000.00	10 121 386.56	0.16
USD NETWORK I2I LTD-REG-S-SUB 5.650%/VAR 19-PRP	2 320 000.00	2 303 325.00	0.04
USD NOOR TIER 1 SUKUK LTD-REG-S-SUB 6.250%/VAR 16-PRP	2 926 000.00	2 999 150.00	0.05
USD QATAR REINSURANCE CO LTD-REG-S-SUB 4.950%/VAR 17-PRP	5 521 000.00	5 657 299.68	0.09
USD SHENZHEN INTERNATIONAL HLDS-REG-S 3.950%/VAR 17-PRP	2 120 000.00	2 143 850.00	0.03
USD SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD-REG-S-SUB 5.875%/VAR 18-PRP	1 938 000.00	2 093 645.62	0.03
USD SMC GLOBAL POWER HOLDINGS CORP-REG-S 5.700%/VAR 20-PRP	1 630 000.00	1 636 112.50	0.03
USD STANDARD BANK GROUP LTD-REG-S-SUB 5.950%/VAR 19-31.05.29	3 338 000.00	3 539 323.12	0.05
USD SUNNY EXPRESS ENTERPRISES CORP-REG-S 3.350%/VAR 19-PRP	840 000.00	848 400.00	0.01
USD UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S VAR 15-31.05.40	14 272 000.00	14 106 980.01	0.22
USD URUGUAY, REPUBLIC OF (PIK) 7.87500% 03-15.01.33	6 976 423.00	10 697 908.64	0.16
米ドル合計		163 289 791.54	2.52
債券、変動利付債合計		163 289 791.54	2.52

添付の注記は当財務書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

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
転換社債型新株予約権付社債、固定利付債			
USD			
USD DP WORLD PLC-REG-S 1.75000% 14-19.06.24	7 600 000.00	7 527 800.00	0.12
USD INNOVATE CAPITAL PTE LTD (PIK) 6.00000% 17-11.12.24	950 000.00	366 700.37	0.00
米ドル合計		7 894 500.37	0.12
転換社債型新株予約権付社債、固定利付債合計		7 894 500.37	0.12
転換社債型新株予約権付社債、変動利付債			
USD			
USD BANCO MER DEL NORTE SA/GRAN-REG-S-SUB 7.500%/VAR 19-PRP	9 233 000.00	10 448 062.80	0.16
USD BANCO MERCANTIL DEL NOR-REG-S-SUB 6.750%/VAR 19-PRP	8 450 000.00	9 171 292.00	0.14
USD YAPI VE KREDI BANKASI AS-REG-S-SUB 13.875%/VAR 19-PRP	8 590 000.00	10 198 219.80	0.16
米ドル合計		29 817 574.60	0.46
転換社債型新株予約権付社債、変動利付債合計		29 817 574.60	0.46
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
合計		5 674 089 813.03	87.49
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 1MDB ENERGY LTD-REG-S 5.99000% 12-11.05.22	31 400 000.00	33 009 250.00	0.51
USD ALFA SAB DE CV-REG-S 6.87500% 14-25.03.44	5 356 000.00	6 728 475.00	0.10
USD ALIBABA GROUP HOLDING LTD 3.60000% 15-28.11.24	2 491 000.00	2 647 634.08	0.04
USD ALPEK SA DE CV-REG-S 4.25000% 19-18.09.29	5 070 000.00	5 263 293.75	0.08
USD AMERICA MOVIL SAB DE CV 6.12500% 10-30.03.40	950 000.00	1 349 940.50	0.02
USD BANCO DEL CREDITO DEL PERU-REG-S 2.70000% 19-11.01.25	20 766 000.00	20 817 915.00	0.32
USD BANCO GENERAL SA-REG-S 4.12500% 17-07.08.27	2 480 000.00	2 628 800.00	0.04
USD BANCO INTL PERU-REG-S 3.25000% 19-04.10.26	3 669 000.00	3 710 276.25	0.06
USD BANCO SANTANDER CHILE-REG-S 2.70000% 20-10.01.25	968 000.00	977 486.40	0.02
USD BANCO SANTANDER SA-REG-S 4.12500% 12-09.11.22	2 802 000.00	2 911 803.37	0.05
USD BANGKOK BANK PUBLIC CO LTD HK-REG-S-SUB 9.02500% 97-15.03.29	790 000.00	1 148 956.25	0.02
USD BANISTMO SA-REG-S 3.65000% 17-19.09.22	6 084 000.00	6 217 087.51	0.10
USD BRAZIL MINAS SPE-REG-S 5.33300% 13-15.02.28	12 166 000.00	11 818 508.63	0.18
USD BRF SA-REG-S 4.87500% 19-24.01.30	3 131 000.00	3 203 698.06	0.05
USD C&W SENIOR FIN DESIGNATD ACT V CO-REG-S 6.87500% 17-15.09.27	5 538 000.00	5 946 427.50	0.09
USD C&W SENIOR FIN DESIGNATD ACT V CO-REG-S 7.50000% 18-15.10.26	2 471 000.00	2 666 209.00	0.04
USD CELULOSA ARAUCO Y CONSTITUCION SA-REG-S 4.20000% 19-29.01.30	4 674 000.00	4 755 853.43	0.07
USD CELULOSA ARAUCO Y CONSTITUCION SA-REG-S 5.15000% 19-29.01.50	3 279 000.00	3 357 900.94	0.05
USD CEMEX SAB DE CV-REG-S 5.45000% 19-19.11.29	10 366 000.00	11 010 765.20	0.17
USD CENCOSUD SA-REG-S 5.15000% 15-12.02.25	1 163 000.00	1 232 780.00	0.02
USD CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA-REG-S 4.62500% 20-04.02.30	2 510 000.00	2 547 650.00	0.04
USD COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 4.37500% 13-30.04.25	2 600 000.00	2 623 562.50	0.04
USD COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 5.62500% 13-30.04.43	2 262 000.00	2 098 005.00	0.03
USD DIGICEL GROUP ONE LTD-144A 8.25000% 18-30.12.22	3 545 000.00	2 303 142.19	0.04
USD DIGICEL GROUP ONE LTD-REG-S 8.25000% 19-30.12.22	4 432 715.00	2 879 879.53	0.04
USD DIGICEL GROUP ONE LTD-REG-S 8.25000% 19-30.09.22	1 831 000.00	476 060.00	0.01
USD DIGICEL GROUP TWO LTD-REG-S (PIK) STEP-UP 19-01.04.24	7 984 593.00	1 374 847.11	0.02
USD DIGICEL LTD-REG-S 6.00000% 13-15.04.21	12 733 000.00	10 055 886.75	0.16
USD DOLPHIN ENERGY LTD-REG-S 5.500000% 12-15.12.21	2 365 000.00	2 495 075.00	0.04
USD DTEK FINANCE PLC (PIK) 10.75000% 16-31.12.24	4 023 000.00	4 161 919.42	0.06
USD ECOPETROL SA 5.37500% 15-26.06.26	2 932 000.00	3 320 032.02	0.05
USD ECOPETROL SA 5.87500% 14-28.05.45	10 095 000.00	12 117 218.30	0.19
USD ECOPETROL SA 7.37500% 13-18.09.43	5 075 000.00	6 995 570.31	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

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD ELEMENTIA SAB DE CV-REG-S 5.50000% 14-15.01.25	3 684 000.00	3 738 108.75	0.06
USD EMBOTELLADORA ANDINA SA-REG-S 5.00000% 13-01.10.23	1 980 000.00	2 124 168.75	0.03
USD EMBRAER NETHERLANDS FINANCE BV 5.05000% 15-15.06.25	1 091 000.00	1 201 634.27	0.02
USD EMBRAER OVERSEAS LTD-REG-S 5.69600% 13-16.09.23	1 707 000.00	1 881 967.50	0.03
USD EMPRESA DE TRANSPORTE DE PASA MET-REG-S 5.00000% 17-25.01.47	200 000.00	231 937.50	0.00
USD EMPRESA ELECTRICA COCHRANE SPA-REG-S 5.50000% 19-14.05.27	1 840 000.00	1 914 428.00	0.03
USD EMPRESAS PUBLICAS DE MEDELLIN ESP-REG-S 4.25000% 19-18.07.29	13 671 000.00	14 229 289.46	0.22
USD ENERGUATE TRUST-REG-S 5.87500% 17-03.05.27	4 800 000.00	5 034 000.00	0.08
USD ENERSIS AMERICAS SA 4.00000% 16-25.10.26	2 770 000.00	2 937 931.25	0.05
USD FIRST QUANTUM MINERALS LTD-REG-S 7.50000% 17-01.04.25	760 000.00	753 262.60	0.01
USD GEMS MENASA CAYMAN LTD/GEDL-REG-S 7.12500% 19-31.07.26	6 020 000.00	6 281 493.75	0.10
USD GENNEIA SA-REG-S 8.75000% 17-20.01.22	1 000 000.00	831 562.50	0.01
USD GRUPO AVAL LTD-REG-S 4.75000% 12-26.09.22	3 610 000.00	3 758 574.24	0.06
USD GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 4.87500% 13-13.02.28	1 910 000.00	2 059 815.63	0.03
USD HIDROVIAS INTERNATIONAL FIN SARL-REG-S 5.95000% 18-24.01.25	894 000.00	927 525.00	0.01
USD HONDURAS, REPUBLIC OF-REG-S 8.75000% 13-16.12.20	8 822 000.00	9 249 315.62	0.14
USD HUNT OIL CO OF PERU LLC SUCUAL DL-REG-S 6.37500% 18-01.06.28	5 026 000.00	5 451 702.20	0.08
USD INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CN/NY 3.53800% 17-08.11.27	1 676 000.00	1 788 082.50	0.03
USD INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV-REG-S 4.15000% 19-12.09.29	1 423 000.00	1 482 143.44	0.02
USD INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV-REG-S 5.65000% 19-12.09.49	6 031 000.00	6 644 466.09	0.10
USD INVERSIONES CMPC SA-REG-S 4.75000% 14-15.09.24	2 530 000.00	2 707 100.00	0.04
USD INVERSIONES CMPC SA-REG-S 3.85000% 20-13.01.30	3 040 000.00	3 123 600.00	0.05
USD JSL EUROPE SA-REG-S 7.75000% 17-26.07.24	1 021 000.00	1 104 275.32	0.02
USD KENBOURNE INVEST SA-REG-S 6.87500% 19-26.11.24	5 100 000.00	5 281 687.50	0.08
USD KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV-144A 3.80000% 14-08.04.24	140 000.00	143 193.75	0.00
USD KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV-144A 3.25000% 15-12.03.25	307 000.00	307 287.81	0.00
USD LCPR SENIOR SECURED FINANCING DAC-REG-S 6.75000% 19-15.10.27	1 250 000.00	1 321 925.00	0.02
USD LUKOIL INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S 4.56300% 13-24.04.23	6 672 000.00	7 070 235.00	0.11
USD MEXICO, UNITED STATES OF 4.00000% 13-02.10.23	15 480 000.00	16 524 900.00	0.25
USD MGM CHINA HOLDINGS-REG-S 5.37500% 19-15.05.24	1 830 000.00	1 864 312.50	0.03
USD MINERA MEXICO SA DE CV-REG-S 4.50000% 19-26.01.50	1 948 000.00	2 015 607.87	0.03
USD MV24 CAPITAL BV-REG-S 6.74800% 19-01.06.34	17 283 000.00	18 388 932.33	0.28
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 6.10000% 14-11.08.44	8 774 000.00	10 964 758.12	0.17
USD PERU, REPUBLIC OF 5.62500% 10-18.11.50	6 595 000.00	10 040 887.50	0.15
USD PETRA DIAMONS US TREASURY PLC-REG-S 7.25000% 17-01.05.22	1 340 000.00	812 375.00	0.01
USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 7.25000% 14-17.03.44	1 532 000.00	1 933 671.25	0.03
USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 6.85000% 15-05.06.115	9 356 000.00	11 166 386.00	0.17
USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV-REG-S 5.09300% 19-15.01.30	9 780 000.00	10 720 347.00	0.17
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 6.00000% 13-15.11.26	22 988 469.00	1 839 077.52	0.03
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 6.00000% 14-28.10.22	31 450 000.00	1 729 750.00	0.03
USD RAIZEN FUELS FINANCE SA-REG-S 5.30000% 17-20.01.27	1 120 000.00	1 247 750.00	0.02
USD REDE D'OR FINANCE SARL-REG-S 4.50000% 20-22.01.30	7 001 000.00	7 044 756.25	0.11
USD RIO ENERGY SA/UGEN SA/UENSA SA-REG-S 6.87500% 18-01.02.25	2 231 000.00	1 327 445.00	0.02
USD SACI FALABELLA-REG-S 3.75000% 17-30.10.27	1 018 000.00	1 047 903.75	0.02
USD SAMARCO MINERACAO SA-REG-S *DEFAULT* 5.75000% 13-24.10.23	2 950 000.00	1 980 187.50	0.03
USD SAMARCO MINERACAO SA-REG-S 5.37500% 14-26.09.24	1 280 000.00	848 000.00	0.01
USD ST MARYS CEMENT INC CANADA-REG-S 5.75000% 16-28.01.27	3 558 000.00	4 091 700.00	0.06
USD SURINAME, REPUBLIC OF-REG-S 9.25000% 16-26.10.26	1 932 000.00	1 636 693.80	0.03
USD TRANSPORTADORA DE GAS INTER-REG-S 5.55000% 18-01.11.28	11 919 000.00	13 837 214.06	0.21
USD TRANSPORTADORA DE GAS DEL PERU SA-REG-S 4.25000% 13-30.04.28	1 173 000.00	1 263 907.50	0.02
USD TRINIDAD PETROLEUM HOLDINGS LTD-REG-S 9.75000% 19-15.06.26	4 450 000.00	5 072 026.78	0.08
USD TRUST F/1401-REG-S 6.39000% 19-15.01.50	2 976 000.00	3 422 400.00	0.05
USD TRUST F/1401-REG-S 6.95000% 14-30.01.44	2 636 000.00	3 213 448.75	0.05
USD TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO-144A 5.25000% 20-05.02.25	970 000.00	965 147.58	0.02
USD ULTRAPAR INTERNATIONAL SA-REG-S 5.25000% 19-06.06.29	1 389 000.00	1 490 570.62	0.02
USD VEON HOLDINGS BV-REG-S 4.00000% 19-09.04.25	7 037 000.00	7 323 990.68	0.11
USD VM HOLDING SA-REG-S 5.37500% 17-04.05.27	4 586 000.00	4 935 682.50	0.08
USD VTR FINANCE B V-REG-S 6.87500% 14-15.01.24	9 418 000.00	9 629 905.00	0.15
USD YINGDE GASES INVESTMENT LTD-REG-S 6.25000% 18-19.01.23	5 388 000.00	5 553 007.50	0.09
米ドル合計		442 365 364.79	6.82
ノート、固定利付債合計		442 365 364.79	6.82

添付の注記は当財務書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

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
ノート、ゼロ・クーポン			
USD			
USD BIOCEANICO SOVEREIGN CERTIFICATE-REG-S 0.00000% 19-05.06.34	8 900 000.00	6 265 600.00	0.10
USD RUTAS 2 AND 7 FINANCE LTD-REG-S 0.00000% 19-30.09.36	8 543 000.00	5 685 366.50	0.09
米ドル合計		11 950 966.50	0.19
ノート、ゼロ・クーポン合計		11 950 966.50	0.19
ノート、変動利付債			
USD			
USD AES GENER SA-REG-S-SUB 6.350%/VAR 19-07.10.79	1 239 000.00	1 293 206.25	0.02
USD BANCOLOMBIA SA-SUB 4.875%/VAR 17-18.10.27	2 860 000.00	2 952 056.25	0.05
USD BBVA BANCOMER SA/TEXAS-REG-S-SUB 5.125%/VAR 18-18.01.33	13 388 000.00	14 203 831.24	0.22
USD ITAU UNIBANCO HOLDING SA-REG-S-SUB 4.500%/VAR 19-21.11.29	5 808 000.00	5 963 364.00	0.09
米ドル合計		24 412 457.74	0.38
ノート、変動利付債合計		24 412 457.74	0.38
中期債券、固定利付債			
USD			
USD BANCO VOTORANTIM SA-REG-S 4.00000% 19-24.09.22	3 693 000.00	3 789 018.00	0.06
USD BANCO VOTORANTIM SA-REG-S 4.50000% 19-24.09.24	2 069 000.00	2 171 480.26	0.03
USD ICD SUKUK CO LTD-REG-S 5.00000% 17-01.02.27	6 595 000.00	7 058 710.94	0.11
USD PETROLEOS MEXICANOS 4.50000% 16-23.01.26	4 500 000.00	4 594 500.00	0.07
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.75000% 17-21.09.47	8 971 000.00	9 050 382.58	0.14
米ドル合計		26 664 091.78	0.41
中期債券、固定利付債合計		26 664 091.78	0.41
中期債券、変動利付債			
USD			
USD FAR EAST HORIZON LTD-REG-S 4.350%/VAR 17-PRP	2 100 000.00	2 080 312.50	0.03
米ドル合計		2 080 312.50	0.03
中期債券、変動利付債合計		2 080 312.50	0.03
債券、固定利付債			
USD			
USD 1MDB GLOBAL INV-REG-S 4.40000% 13-09.03.23	12 000 000.00	11 887 500.00	0.18
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 7.45000% 14-30.04.44	3 696 000.00	4 419 030.00	0.07
USD INVERSIONES CMPC SA-REG-S 4.37500% 13-15.05.23	2 395 000.00	2 499 032.81	0.04
USD LIMA METRO LINE 2 FINANCE LTD-REG-S 4.35000% 19-05.04.36	14 880 000.00	16 014 600.00	0.25
USD PETROLEOS DE VENEZUE-REG-S *DEFAULTED* 9.00000% 11-17.11.21	2 611 961.00	208 956.88	0.00
USD SURA ASSET MANAGEMENT SA-REG-S 4.87500% 14-17.04.24	465 000.00	501 473.44	0.01
USD TENGIZCHEVROIL FINANCE CO INT-REG-S 4.00000% 16-15.08.26	630 000.00	662 697.00	0.01
USD TULLOW OIL PLC-REG-S 7.00000% 18-01.03.25	1 687 000.00	1 358 035.00	0.02
米ドル合計		37 551 325.13	0.58
債券、固定利付債合計		37 551 325.13	0.58

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - エマージング・マーケット・デッド

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / 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 BANCOLOMBIA SA-SUB 4.625%/VAR 19-18.12.29	7 655 000.00	7 875 081.25	0.12
米ドル合計		7 875 081.25	0.12
債券、変動利付債合計		7 875 081.25	0.12
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		552 899 599.69	8.53
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 AXTEL SAB DE CV-REG-S 6.37500% 17-14.11.24	5 385 000.00	5 682 857.81	0.09
USD CAMPOSOL SA-REG-S 6.00000% 20-03.02.27	750 000.00	759 750.00	0.01
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 3.00000% 20-30.01.30	19 747 000.00	19 564 340.25	0.30
USD CSN ISLANDS XI CORP-REG-S 6.75000% 20-28.01.28	3 891 000.00	3 855 981.00	0.06
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 4.50000% 20-30.01.30	24 384 000.00	24 329 136.00	0.38
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 5.87500% 20-30.01.60	15 308 000.00	15 292 692.00	0.24
USD GREENKO DUTCH BV-REG-S 5.25000% 17-24.07.24	7 456 000.00	7 572 500.00	0.12
USD INRETAIL PHARMA SA-REG-S 5.37500% 18-02.05.23	4 260 000.00	4 488 975.00	0.07
USD INTERCORP FINANCIAL SERVICES INC-REG-S 4.12500% 17-19.10.27	1 010 000.00	1 049 768.75	0.02
USD ITAU UNIBANCO HOLDING SA-REG-S 3.25000% 20-24.01.25	4 560 000.00	4 601 724.00	0.07
USD MELCO RESORTS FINANCE LTD-REG-S 5.62500% 19-17.07.27	3 500 000.00	3 570 000.00	0.05
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 5.60000% 18-13.03.48	3 290 000.00	3 924 353.13	0.06
USD PRUMO PARTICIPACOES E INVESTIMENT-REG-S 7.50000% 19-31.12.31	3 840 000.00	4 101 350.16	0.06
USD SABLE INTERNATIONAL FINANCE LTD-REG-S 5.75000% 20-07.09.27	2 000 000.00	2 113 820.80	0.03
USD SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHIL-REG-S 4.25000% 20-22.01.50	675 000.00	675 877.50	0.01
USD SUZANO AUSTRIA GMBH-REG-S 7.00000% 17-16.03.47	7 039 000.00	8 418 995.95	0.13
米ドル合計		110 002 122.35	1.70
ノート、固定利付債合計		110 002 122.35	1.70
債券、固定利付債			
USD			
USD ARABIAN CENTRES SUKUK LTD-REG-S 5.37500% 19-26.11.24	4 781 000.00	4 948 335.00	0.07
米ドル合計		4 948 335.00	0.07
債券、固定利付債合計		4 948 335.00	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			
		114 950 457.35	1.77
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 LCPR SENIOR SECURED FINANCING DAC-144A 6.75000% 19-15.10.27	2 629 000.00	2 780 272.66	0.04
米ドル合計		2 780 272.66	0.04
ノート、固定利付債合計		2 780 272.66	0.04
最近発行された譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		2 780 272.66	0.04
投資有価証券合計		6 344 720 142.73	97.83

添付の注記は当財務書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

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
派生商品			
公認の証券取引所に上場されている派生商品			
債券に係る金融先物			
EUR EURO-BUND FUTURE 06.03.20	-582.00	-1 655 318.34	-0.03
EUR EURO-BOBL FUTURE 06.03.20	-650.00	-689 732.60	-0.01
EUR EURO-SCHATZ FUTURE 06.03.20	-182.00	-31 262.32	0.00
EUR EURO-BUXL FUTURE 06.03.20	-112.00	-1 013 426.74	-0.02
USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 20.03.20	120.00	155 859.81	0.00
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.20	968.00	824 904.25	0.02
USD US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 20.03.20	406.00	3 225 950.85	0.05
USD US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.20	-88.00	-45 374.21	0.00
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 20.03.20	699.00	1 127 495.78	0.02
USD US LONG BOND FUTURE 20.03.20	161.00	543 221.19	0.01
債券に係る金融先物合計		2 442 317.67	0.04
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		2 442 317.67	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派生商品			
クレジット・デフォルト・スワップ*			
USD BARCLAYS/BRAZIL CREDIT DEFAULT SWAP RECEIVER 1.00000% 19-20.12.24	20 710 000.00	-14 820.22	0.00
USD CITIGROUP/MEX CREDIT DEFAULT SWAP RECEIVER 1.00000% 19-20.12.24	15 830 000.00	-156 806.70	0.00
USD BARCLAYS/ESKOM HOLDINGS SOC CREDIT DEFAULT SWAP RECEIVER 1.00000% 19-20.12.20	4 039 000.00	67 662.47	0.00
USD BARCLAYS/ESKOM HOLDINGS SOC CREDIT DEFAULT SWAP RECEIVER 1.00000% 19-20.12.20	4 039 000.00	67 662.47	0.00
USD BARCLAYS/ESKOM HOLDINGS SOC CREDIT DEFAULT SWAP RECEIVER 1.00000% 19-20.12.20	4 847 000.00	81 198.32	0.00
USD BARCLAYS/BRAZIL CREDIT DEFAULT SWAP RECEIVER 1.00000% 19-20.12.24	5 650 000.00	-4 043.18	0.00
USD BARCLAYS/MEX CREDIT DEFAULT SWAP RECEIVER 1.00000% 19-20.12.24	1 900 000.00	-18 820.77	0.00
USD BARCLAYS/ARGENT CREDIT DEFAULT SWAP RECEIVER 5.00000% 19-20.12.24	3 857 000.00	2 272 538.10	0.03
USD JPMORGAN/ARGENT CREDIT DEFAULT SWAP RECEIVER 5.00000% 19-20.12.24	4 172 000.00	2 458 135.58	0.04
USD BNP/ARGENT CREDIT DEFAULT SWAP RECEIVER 5.00000% 19-20.12.24	1 238 000.00	729 427.57	0.01
USD CITI/ARGENT CREDIT DEFAULT SWAP RECEIVER 5.00000% 19-20.12.24	1 445 000.00	851 391.64	0.01
USD BARCLAYS/ARGENT CREDIT DEFAULT SWAP RECEIVER 5.00000% 19-20.12.24	2 008 000.00	1 183 110.32	0.02
USD BARCLAYS/TURKEY CREDIT DEFAULT SWAP RECEIVER 1.00000% 19-20.12.24	27 160 000.00	1 694 018.99	0.03
USD CITI GROUP/PERU CREDIT DEFAULT SWAP PAYER 1.00000% 19-20.12.24	-13 000 000.00	345 134.75	0.01
USD BARCLAYS/PERU CREDIT DEFAULT SWAP PAYER 1.00000% 19-20.12.24	-2 000 000.00	53 097.65	0.00
クレジット・デフォルト・スワップ合計		9 608 886.99	0.15
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		9 608 886.99	0.15
派生商品合計		12 051 204.66	0.19

* 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

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 比率 （%）
先渡為替契約			
先渡為替契約（購入 / 売却）			
USD 46 915 914.60	EUR 42 128 000.00	2020年2月20日 178 290.21	0.00
USD 1 109 134.00	EUR 1 000 000.00	2020年2月20日 -285.49	0.00
USD 7 973 690.81	EUR 7 193 543.79	2020年2月20日 -6 966.89	0.00
USD 109 981 889.15	EUR 99 280 449.50	2020年2月20日 -161 776.78	0.00
USD 85 301 802.38	EUR 76 970 000.00	2020年3月4日 -158 492.95	0.00
EUR 1 917 000.00	USD 2 121 864.04	2020年2月20日 4 893.13	0.00
USD 2 512 898.17	EUR 2 247 073.83	2020年2月20日 19 950.66	0.00
USD 11 209 342.15	EUR 10 025 079.51	2020年2月20日 87 323.52	0.00
USD 4 795 098.01	EUR 4 285 573.34	2020年2月20日 40 599.41	0.00
USD 8 601 729.61	EUR 7 641 526.02	2020年3月24日 107 890.45	0.00
USD 6 175 425.85	EUR 5 500 000.00	2020年2月20日 73 618.64	0.00
USD 12 653 518.88	EUR 11 263 716.00	2020年3月4日 147 341.20	0.00
USD 15 491 468.99	EUR 13 849 301.87	2020年2月20日 126 783.53	0.00
USD 1 232 407.27	EUR 1 100 945.56	2020年2月20日 10 996.81	0.00
EUR 2 851 987.04	USD 3 191 168.15	2020年3月24日 -21 078.94	0.00
USD 2 617 105.84	EUR 2 342 000.00	2020年3月4日 16 767.89	0.00
USD 3 881 192.03	EUR 3 460 000.00	2020年2月20日 42 600.58	0.00
USD 2 237 618.05	EUR 1 988 000.00	2020年3月4日 30 328.62	0.00
USD 3 704 423.00	EUR 3 314 000.00	2020年3月4日 24 867.09	0.00
CHF 1 839 758 583.04	USD 1 894 867 000.00	2020年2月14日 14 282 215.15	0.22
EUR 2 254 413 117.52	USD 2 511 946 000.00	2020年2月14日 -11 778 062.23	-0.18
GBP 102 481 816.76	USD 133 166 000.00	2020年2月14日 1 968 518.06	0.03
JPY 1 251 854 996.00	USD 11 410 000.00	2020年2月14日 147 861.26	0.00
SGD 20 150 896.41	USD 14 962 000.00	2020年2月14日 -198 706.02	0.00
USD 1 914 729.96	EUR 1 716 000.00	2020年2月20日 10 966.11	0.00
USD 19 000 000.00	CHF 18 299 850.00	2020年2月14日 9 930.01	0.00
EUR 12 000 000.00	USD 13 395 727.20	2020年2月20日 -82 693.29	0.00
USD 10 000 000.00	CHF 9 674 870.00	2020年2月14日 -39 779.48	0.00
EUR 41 443 196.24	USD 46 000 000.00	2020年2月14日 -39 058.03	0.00
USD 52 321 679.97	EUR 47 125 737.53	2020年2月28日 13 750.56	0.00
USD 4 293 363.24	EUR 3 864 028.00	2020年3月4日 3 107.63	0.00
EUR 3 125 717.96	USD 3 478 924.09	2020年3月24日 -4 572.82	0.00
USD 17 000 000.00	CHF 16 492 329.00	2020年2月14日 -114 374.28	0.00
USD 4 416 490.00	EUR 4 000 000.00	2020年2月20日 -21 187.97	0.00
USD 5 269 746.92	EUR 4 772 485.00	2020年3月4日 -29 174.45	0.00
USD 206 000 000.00	CHF 199 582 894.00	2020年2月14日 -1 110 611.66	-0.02
EUR 2 453 000.00	USD 2 703 007.31	2020年2月20日 18 398.71	0.00
USD 95 000 000.00	CHF 92 204 815.00	2020年2月14日 -682 526.94	-0.01
USD 105 000 000.00	EUR 95 334 683.76	2020年2月14日 -727 170.34	-0.01
USD 3 000 000.00	SGD 4 077 381.00	2020年2月14日 12 759.48	0.00
EUR 8 870 614.93	USD 9 781 529.51	2020年2月20日 59 703.61	0.00
USD 34 000 000.00	EUR 30 887 497.74	2020年2月14日 -254 560.94	0.00
EUR 30 907 124.09	USD 34 000 000.00	2020年2月3日 251 274.92	0.01
EUR 8 239 001.83	USD 9 076 413.98	2020年2月20日 64 095.25	0.00
EUR 902 129.98	USD 995 292.94	2020年2月28日 6 039.96	0.00
EUR 1 062 458.32	USD 1 173 984.57	2020年3月24日 6 977.20	0.00
EUR 4 097 526.00	USD 4 524 108.37	2020年3月4日 25 401.60	0.00
CHF 13 583 262.00	USD 14 000 000.00	2020年2月4日 83 946.29	0.00
USD 14 000 000.00	CHF 13 574 442.00	2020年2月14日 -86 432.61	0.00
USD 13 035 299.13	EUR 11 802 001.75	2020年2月20日 -58 071.67	0.00
先渡為替契約（購入 / 売却）合計		2 301 613.76	0.04
現金預金、要求払預金および預託金勘定その他の流動資産		140 551 913.79*	2.17
当座借越およびその他の短期負債		-3 676 464.65	-0.06
その他の資産および負債		-10 484 619.51	-0.17
純資産総額		6 485 463 790.78	100.00

* 2020年1月31日現在、ユービーエス・ヨーロッパ・エス・イーに対する87,447.53米ドルの現金が、取引相手方に対する担保となっている。

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - U S マルチ・クレジット

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
アセット・バック証券、変動利付債			
USD			
USD MIDOCEAN CREDIT CLO III -144A 3M LIBOR+112BP 18-21.04.31	3 000 000.00	2 984 872.80	0.05
USD OCP CLO LTD-144A 3M LIBOR+126BP 17-15.07.30	2 000 000.00	2 000 615.00	0.04
USD SLM STUDENT LOAN TRUST-SUB 3M LIBOR+75BP 05-25.10.40	2 500 000.00	2 448 510.00	0.04
USD SLM STUDENT LOAN TRUST 2006-2-SUB 3M LIBOR+17BP 06-25.01.41	1 500 000.00	1 216 439.16	0.02
USD ZAIS CLO 6 LTD-144A 3M LIBOR+137BP 17-15.07.29	3 000 000.00	2 983 420.80	0.05
米ドル合計		11 633 857.76	0.20
アセット・バック証券、変動利付債合計		11 633 857.76	0.20
ノート、固定利付債			
EUR			
EUR FIDELITY NATIONAL INFO SERVICES 0.75000% 19-21.05.23	400 000.00	453 542.81	0.01
EUR MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 1.62500% 19-07.03.31	100 000.00	124 279.32	0.00
ユーロ合計		577 822.13	0.01
USD			
USD ABBOTT LABORATORIES 3.40000% 16-30.11.23	716 000.00	760 977.98	0.01
USD ABBOTT LABORATORIES 3.75000% 16-30.11.26	641 000.00	711 606.02	0.01
USD ABBVIE INC 2.30000% 16-14.05.21	2 100 000.00	2 113 762.14	0.04
USD ABBVIE INC 2.50000% 15-14.05.20	4 300 000.00	4 305 265.78	0.08
USD ABBVIE INC 3.20000% 16-14.05.26	4 882 000.00	5 115 296.13	0.09
USD ABBVIE INC 3.60000% 15-14.05.25	7 260 000.00	7 759 391.44	0.14
USD ABBVIE INC 3.75000% 18-14.11.23	2 030 000.00	2 160 539.76	0.04
USD ABBVIE INC 4.25000% 18-14.11.28	2 480 000.00	2 783 492.23	0.05
USD ABBVIE INC 4.50000% 15-14.05.35	1 500 000.00	1 723 397.70	0.03
USD ABN AMRO BANK NV-144A-SUB 4.75000% 15-28.07.25	1 954 000.00	2 160 016.08	0.04
USD ABN AMRO BANK NV-REG-S-SUB 4.75000% 15-28.07.25	4 300 000.00	4 753 361.90	0.08
USD ACTIVISION BLIZZARD INC 3.40000% 17-15.06.27	650 000.00	695 235.38	0.01
USD ADANI PORTS&SPECIAL ECO ZONE LTD-REG-S 4.00000% 17-30.07.27	1 075 000.00	1 112 960.94	0.02
USD ADANI TRANSMISSION LTD-REG-S 4.00000% 16-03.08.26	1 075 000.00	1 120 015.62	0.02
USD AERCAP IRE CAP LTD/GLB AVIA TRUST 5.00000% 15-01.10.21	3 550 000.00	3 725 055.83	0.07
USD AERCAP IRE CAP LTD/GLB AVIA TRUST 3.95000% 16-01.02.22	8 724 000.00	9 029 339.13	0.16
USD AERCAP IRE CAP LTD/GLB AVIA TRUST 4.45000% 18-01.10.25	2 000 000.00	2 191 699.00	0.04
USD AERCAP IRE CAP LTD/GLB AVIA TRUST 4.87500% 19-16.01.24	1 000 000.00	1 095 769.10	0.02
USD AERCAP IRE CAP LTD/GLB AVIA TRUST 2.87500% 19-14.08.24	605 000.00	618 144.53	0.01
USD AES CORP 4.00000% 18-15.03.21	1 976 000.00	1 999 218.00	0.04
USD AETNA INC 2.80000% 16-15.06.23	600 000.00	616 229.34	0.01
USD AETNA INC 3.50000% 14-15.11.24	1 000 000.00	1 062 984.70	0.02
USD AIG GLOBAL FUNDING-REG-S 2.30000% 19-01.07.22	2 900 000.00	2 936 063.53	0.05
USD AIR LEASE CORP 3.00000% 16-15.09.23	750 000.00	772 859.25	0.01
USD AIR LEASE CORP 3.25000% 18-01.03.25	2 600 000.00	2 713 005.88	0.05
USD AIR LEASE CORP 3.62500% 17-01.12.27	804 000.00	852 500.17	0.01
USD ALABAMA POWER CO 2.45000% 17-30.03.22	2 000 000.00	2 032 674.00	0.04
USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC 4.30000% 15-15.01.26	1 700 000.00	1 893 408.32	0.03
USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC 3.45000% 17-30.04.25	1 015 000.00	1 082 672.18	0.02
USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC 3.80000% 19-15.04.26	5 470 000.00	5 980 525.49	0.11
USD ALIBABA GROUP HOLDING LTD 2.80000% 17-06.06.23	5 071 000.00	5 179 417.98	0.09
USD ALIBABA GROUP HOLDING LTD 3.40000% 17-06.12.27	6 475 000.00	6 895 875.00	0.12
USD ALLERGAN FUNDING SCS 3.45000% 15-15.03.22	2 570 000.00	2 645 538.72	0.05
USD ALLERGAN FUNDING SCS 3.80000% 15-15.03.25	1 100 000.00	1 181 107.95	0.02
USD ALLY FINANCIAL INC 3.87500% 19-21.05.24	4 860 000.00	5 125 258.80	0.09
USD ALTRIA GROUP INC 3.80000% 19-14.02.24	1 250 000.00	1 330 192.63	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 - U S マルチ・クレジット

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD ALTRIA GROUP INC 4.80000% 19-14.02.29	3 019 000.00	3 421 689.92	0.06
USD AMAZON.COM INC 3.80000% 14-05.12.24	3 275 000.00	3 589 328.93	0.06
USD AMEREN CORP 2.50000% 19-15.09.24	4 815 000.00	4 906 980.46	0.09
USD AMEREN CORP 2.70000% 15-15.11.20	2 000 000.00	2 011 597.20	0.04
USD AMERICAN CAMPUS COMMUN OPER PARTN 4.12500% 14-01.07.24	585 000.00	634 353.58	0.01
USD AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC 3.65000% 18-01.12.21	380 000.00	393 421.25	0.01
USD AMERICAN EXPRESS CO 3.40000% 18-27.02.23	1 750 000.00	1 832 276.77	0.03
USD AMERICAN EXPRESS CO 4.20000% 18-06.11.25	2 410 000.00	2 702 214.91	0.05
USD AMERICAN EXPRESS CO 3.12500% 19-20.05.26	11 485 000.00	12 231 612.28	0.22
USD AMERICAN EXPRESS CO 2.50000% 19-30.07.24	1 750 000.00	1 795 826.03	0.03
USD AMERICAN HOMES 4 RENT LP 4.25000% 18-15.02.28	2 415 000.00	2 643 373.27	0.05
USD AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC 4.12500% 13-15.02.24	4 035 000.00	4 372 867.50	0.08
USD AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC-SUB 3.75000% 15-10.07.25	1 100 000.00	1 192 302.32	0.02
USD AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC 3.90000% 16-01.04.26	3 510 000.00	3 821 595.69	0.07
USD AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC 4.20000% 18-01.04.28	2 980 000.00	3 354 951.94	0.06
USD AMERICAN TOWER CORP 3.50000% 13-31.01.23	1 260 000.00	1 315 623.83	0.02
USD AMERICAN TOWER CORP 3.37500% 16-15.10.26	3 740 000.00	3 972 984.79	0.07
USD AMERICAN TOWER CORP 3.95000% 19-15.03.29	1 615 000.00	1 769 423.71	0.03
USD AMERICAN TOWER CORP 3.80000% 19-15.08.29	3 208 000.00	3 491 062.37	0.06
USD AMERICAN TOWER CORP 2.90000% 20-15.01.30	2 615 000.00	2 653 275.75	0.05
USD AMERICAN WATER CAPITAL CORP 3.45000% 19-01.06.29	1 559 000.00	1 686 771.74	0.03
USD AMERISOURCEBERGEN CORP 3.45000% 17-15.12.27	1 195 000.00	1 271 643.59	0.02
USD AMGEN INC 2.12500% 15-01.05.20	2 200 000.00	2 201 374.78	0.04
USD AMGEN INC 2.25000% 16-19.08.23	1 995 000.00	2 025 359.91	0.04
USD AMGEN INC 2.60000% 16-19.08.26	2 650 000.00	2 737 921.97	0.05
USD AMGEN INC 2.65000% 17-11.05.22	4 975 000.00	5 063 628.13	0.09
USD AMGEN INC 2.70000% 15-01.05.22	7 507 000.00	7 650 492.56	0.13
USD AMGEN INC 3.87500% 11-15.11.21	1 900 000.00	1 963 277.98	0.03
USD ANALOG DEVICES INC 2.85000% 18-12.03.20	1 535 000.00	1 536 396.39	0.03
USD ANALOG DEVICES INC 3.90000% 15-15.12.25	2 668 000.00	2 920 732.97	0.05
USD ANALOG DEVICES INC 3.12500% 16-05.12.23	2 585 000.00	2 705 660.31	0.05
USD ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC-144A 4.87500% 15-14.05.25	1 800 000.00	2 012 203.44	0.04
USD ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC-144A 3.75000% 17-10.04.22	200 000.00	206 547.98	0.00
USD ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC-REG-S 4.50000% 18-15.03.28	2 800 000.00	3 078 237.12	0.05
USD ANHEUSER-BUSCH COS 3.65000% 19-01.02.26	3 025 000.00	3 285 322.12	0.06
USD ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 4.15000% 19-23.01.25	1 450 000.00	1 599 269.82	0.03
USD ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 4.00000% 18-13.04.28	3 840 000.00	4 302 645.89	0.08
USD ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 4.75000% 19-23.01.29	10 134 000.00	11 991 667.59	0.21
USD ANTERO RESOURCES CORP 5.00000% 17-01.03.25	1 266 000.00	835 306.80	0.01
USD ANTHEM INC 2.37500% 19-15.01.25	2 840 000.00	2 877 800.40	0.05
USD ANTHEM INC 2.87500% 19-15.09.29	5 635 000.00	5 685 037.11	0.10
USD ANTHEM INC 3.65000% 17-01.12.27	3 100 000.00	3 346 599.73	0.06
USD ANTHEM INC 3.70000% 11-15.08.21	1 500 000.00	1 539 137.85	0.03
USD ANTHEM INC 4.10100% 18-01.03.28	2 250 000.00	2 487 397.72	0.04
USD AON CORP 3.75000% 19-02.05.29	1 620 000.00	1 784 762.10	0.03
USD APACHE CORP 4.25000% 19-15.01.30	1 145 000.00	1 204 332.52	0.02
USD APPALACHIAN POWER CO 4.60000% 11-30.03.21	660 000.00	677 329.36	0.01
USD APPALACHIAN POWER CO 3.40000% 15-01.06.25	5 300 000.00	5 667 481.86	0.10
USD APPALACHIAN POWER CO 3.30000% 17-01.06.27	2 490 000.00	2 642 576.99	0.05
USD APPLE INC 2.50000% 17-09.02.22	4 500 000.00	4 581 031.50	0.08
USD APPLE INC 2.75000% 17-13.01.25	3 700 000.00	3 873 036.05	0.07
USD APPLE INC 2.85000% 16-23.02.23	3 850 000.00	3 988 381.71	0.07
USD APPLE INC 2.85000% 17-11.05.24	3 675 000.00	3 845 787.17	0.07
USD APPLE INC 3.00000% 17-20.06.27	1 085 000.00	1 159 458.67	0.02
USD APPLE INC 3.00000% 17-13.11.27	8 630 000.00	9 228 271.30	0.16
USD APPLE INC 3.20000% 15-13.05.25	4 320 000.00	4 629 380.26	0.08
USD APPLE INC 3.25000% 16-23.02.26	5 525 000.00	5 944 266.83	0.10
USD ARCHER-DANIELS MIDLAND CO 3.37500% 18-15.03.22	3 885 000.00	4 014 662.65	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 - U S マルチ・クレジット

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD ASTRAZENECA PLC 3.37500% 15-16.11.25	1 686 000.00	1 814 702.49	0.03
USD ASTRAZENECA PLC 3.50000% 18-17.08.23	3 870 000.00	4 090 165.85	0.07
USD AT&T INC 3.00000% 15-30.06.22	5 780 000.00	5 924 094.24	0.10
USD AT&T INC 3.40000% 15-15.05.25	13 215 000.00	14 021 774.43	0.25
USD AT&T INC 3.95000% 16-15.01.25	1 000 000.00	1 086 260.60	0.02
USD AT&T INC 4.10000% 18-15.02.28	2 475 000.00	2 739 940.09	0.05
USD AT&T INC 4.25000% 17-01.03.27	3 687 000.00	4 109 158.55	0.07
USD AT&T INC 4.30000% 18-15.02.30	1 875 000.00	2 120 783.82	0.04
USD AT&T INC 4.35000% 19-01.03.29	13 320 000.00	15 024 202.09	0.26
USD AT&T INC 6.40000% 08-15.05.38	1 700 000.00	2 283 507.15	0.04
USD AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK-REG-S-SUB-4.40000% 16-19.05.26	6 800 000.00	7 446 408.00	0.13
USD AUTODESK INC 4.37500% 15-15.06.25	3 400 000.00	3 769 998.88	0.07
USD AUTOZONE INC 3.12500% 19-18.04.24	2 675 000.00	2 817 886.20	0.05
USD AVALON BAY COMMUNITIES INC 3.30000% 19-01.06.29	2 450 000.00	2 658 601.09	0.05
USD AVANGRID INC 3.15000% 17-01.12.24	2 190 000.00	2 291 990.71	0.04
USD BAIDU INC 2.87500% 17-06.07.22	929 000.00	941 810.91	0.02
USD BAIDU INC 4.37500% 18-14.05.24	1 655 000.00	1 788 674.35	0.03
USD BALL CORP 4.00000% 13-15.11.23	250 000.00	264 325.00	0.00
USD BALTIMORE GAS & ELECTRIC CO 2.40000% 16-15.08.26	2 755 000.00	2 809 258.90	0.05
USD BANCO SANTANDER SA 2.70600% 19-27.06.24	4 400 000.00	4 521 998.36	0.08
USD BANCO SANTANDER SA 3.12500% 17-23.02.23	400 000.00	412 869.56	0.01
USD BANCO SANTANDER SA 3.84800% 18-12.04.23	1 200 000.00	1 264 094.40	0.02
USD BANCO SANTANDER SA 3.30600% 19-27.06.29	2 200 000.00	2 345 263.36	0.04
USD BANCO SANTANDER SA 4.25000% 17-11.04.27	800 000.00	886 109.36	0.02
USD BANCO SANTANDER SA-SUB 5.17900% 15-19.11.25	6 600 000.00	7 509 971.70	0.13
USD BANK OF AMERICA CORP 4.00000% 14-01.04.24	4 221 000.00	4 574 769.61	0.08
USD BANK OF IRELAND GROUP PLC-144A 4.50000% 18-25.11.23	2 447 000.00	2 631 966.77	0.05
USD BANK OF NOVA SCOTIA 3.40000% 19-11.02.24	4 500 000.00	4 764 186.45	0.08
USD BARCLAYS BANK PLC 2.65000% 18-11.01.21	2 540 000.00	2 558 886.94	0.04
USD BARCLAYS PLC 3.65000% 15-16.03.25	3 185 000.00	3 376 301.93	0.06
USD BARCLAYS PLC 3.68400% 17-10.01.23	2 230 000.00	2 294 907.50	0.04
USD BARCLAYS PLC 4.33700% 17-10.01.28	900 000.00	993 701.34	0.02
USD BARCLAYS PLC 4.37500% 16-12.01.26	2 040 000.00	2 246 843.76	0.04
USD BARCLAYS PLC-SUB 4.37500% 14-11.09.24	8 920 000.00	9 551 422.71	0.17
USD BAT CAPITAL CORP 2.76400% 18-15.08.22	6 765 000.00	6 900 430.57	0.12
USD BAT CAPITAL CORP 3.22200% 18-15.08.24	8 580 000.00	8 919 775.72	0.16
USD BAT CAPITAL CORP 3.21500% 19-06.09.26	1 382 000.00	1 426 247.08	0.03
USD BAT CAPITAL CORP 3.46200% 19-06.09.29	1 250 000.00	1 292 873.50	0.02
USD BAT CAPITAL CORP 3.55700% 18-15.08.27	1 730 000.00	1 809 253.72	0.03
USD BAXALTA INC 3.60000% 16-23.06.22	279 000.00	288 124.44	0.00
USD BAXALTA INC 4.00000% 16-23.06.25	1 340 000.00	1 460 512.77	0.03
USD BAYER US FINANCE II LLC-144A 2.20000% 18-15.07.22	1 250 000.00	1 240 798.33	0.02
USD BBVA BANCOMER SA/TEXAS-144A-SUB 6.50000% 11-10.03.21	955 000.00	993 498.44	0.02
USD BECTON DICKINSON AND CO 2.89400% 17-06.06.22	3 730 000.00	3 815 969.42	0.07
USD BECTON DICKINSON AND CO 3.70000% 17-06.06.27	1 728 000.00	1 874 806.73	0.03
USD BERKSHIRE HATHAWAY INC 2.75000% 16-15.03.23	3 950 000.00	4 084 709.22	0.07
USD BIOGEN INC 3.62500% 15-15.09.22	3 000 000.00	3 138 428.10	0.06
USD BLACK HILLS CORP 3.95000% 16-15.01.26	575 000.00	623 388.21	0.01
USD BLOCK FINANCIAL LLC 4.12500% 15-01.10.20	895 000.00	905 350.94	0.02
USD BNZ INTERNATIONAL FUND LTD/LONDON-144A 3.37500% 18-01.03.23	7 030 000.00	7 303 396.70	0.13
USD BOARDWALK PIPELINES LP 5.95000% 16-01.06.26	2 260 000.00	2 597 018.65	0.05
USD BOARDWALK PIPELINES LP 4.80000% 19-03.05.29	1 574 000.00	1 664 429.44	0.03
USD BOEING CO 1.87500% 16-15.06.23	2 075 000.00	2 068 254.49	0.04
USD BOEING CO 2.80000% 19-01.03.24	635 000.00	651 223.24	0.01
USD BOEING CO 2.95000% 19-01.02.30	3 820 000.00	3 933 481.50	0.07
USD BOSTON PROPERTIES LP 2.75000% 16-01.10.26	1 974 000.00	2 039 600.96	0.04
USD BOSTON PROPERTIES LP 3.20000% 17-15.01.25	2 015 000.00	2 127 629.23	0.04
USD BOSTON PROPERTIES LP 2.90000% 19-15.03.30	8 400 000.00	8 659 271.88	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 - U S マルチ・クレジット

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD BOSTON SCIENTIFIC CORP 3.45000% 19-01.03.24	1 000 000.00	1 057 372.40	0.02
USD BP CAPITAL MARKETS AMERICA INC 3.79000% 18-06.02.24	2 585 000.00	2 771 123.88	0.05
USD BP CAPITAL MARKETS AMERICA INC 3.41000% 19-11.02.26	5 450 000.00	5 849 698.64	0.10
USD BP CAPITAL MARKETS PLC 3.27900% 17-19.09.27	2 925 000.00	3 109 482.96	0.05
USD BP CAPITAL MARKETS PLC 3.79600% 18-21.09.25	2 690 000.00	2 944 917.58	0.05
USD BP CAPITAL MARKETS PLC 2.75000% 18-10.05.23	3 125 000.00	3 218 005.94	0.06
USD BP CAPITAL MARKETS PLC 3.21600% 18-28.11.23	3 765 000.00	3 945 813.00	0.07
USD BP CAPITAL MARKETS PLC 2.52000% 18-19.09.22	2 250 000.00	2 291 058.00	0.04
USD BRISTOL-MYERS SQUIBB CO-REG-S 2.90000% 19-26.07.24	6 170 000.00	6 441 429.40	0.11
USD BRITISH AIRW CL AA PASS THR TRUST-144A 3.80000% 18-20.09.31	1 500 000.00	1 531 452.13	0.03
USD BRITISH TELECOMMUNICATIONS PLC-144A 3.25000% 19-08.11.29	9 340 000.00	9 531 419.55	0.17
USD BROADCOM INC-REG-S 3.62500% 19-15.10.24	1 335 000.00	1 404 955.60	0.02
USD BROOKFIELD FINANCE INC 4.85000% 19-29.03.29	5 000 000.00	5 951 614.50	0.10
USD BUCKEYE PARTNERS LP 4.12500% 17-01.12.27	2 055 000.00	2 026 861.02	0.04
USD BURLINGTON NORTHERN SANTA FE LLC 3.65000% 15-01.09.25	2 300 000.00	2 515 862.36	0.04
USD CA INC 3.60000% 17-15.08.22	1 640 000.00	1 677 536.65	0.03
USD CAMDEN PROPERTY TRUST 3.50000% 14-15.09.24	1 250 000.00	1 330 276.37	0.02
USD CAMPBELL SOUP CO 3.95000% 18-15.03.25	1 500 000.00	1 623 715.95	0.03
USD CANADIAN IMPERIAL BK OF COM 3.10000% 19-02.04.24	5 500 000.00	5 756 765.30	0.10
USD CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO 2.75000% 16-01.03.26	1 675 000.00	1 755 431.99	0.03
USD CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD 3.80000% 14-15.04.24	1 000 000.00	1 064 673.90	0.02
USD CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD 2.95000% 17-15.01.23	2 430 000.00	2 497 151.59	0.04
USD CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD 3.85000% 17-01.06.27	310 000.00	330 960.40	0.01
USD CANADIAN PACIFIC RAILWAY CO 4.50000% 11-15.01.22	1 800 000.00	1 888 428.24	0.03
USD CAPITAL ONE FINANCIAL CORP 3.7500 14-24.04.24	2 200 000.00	2 350 562.06	0.04
USD CAPITAL ONE FINANCIAL CORP-SUB 3.75000% 16-28.07.26	2 165 000.00	2 305 300.23	0.04
USD CAPITAL ONE FINANCIAL CORP 3.30000% 17-30.10.24	2 800 000.00	2 953 666.24	0.05
USD CAPITAL ONE NA 2.95000% 14-23.07.21	3 800 000.00	3 862 540.02	0.07
USD CARDINAL HEALTH INC 3.20000% 13-15.03.23	5 659 000.00	5 855 215.64	0.10
USD CARDINAL HEALTH INC 3.07900% 17-15.06.24	1 920 000.00	1 991 416.13	0.03
USD CBS CORP 2.90000% 16-15.01.27	1 000 000.00	1 021 297.00	0.02
USD CBS CORP 3.37500% 17-15.02.28	2 693 000.00	2 822 889.59	0.05
USD CBS CORP 3.70000% 14-15.08.24	3 000 000.00	3 209 380.50	0.06
USD CCO LLC/CAPITAL 3.57900% 16-23.07.20	1 500 000.00	1 508 851.05	0.03
USD CCO LLC/CAPITAL 4.50000% 18-01.02.24	1 770 000.00	1 923 348.20	0.03
USD CCO LLC/CAPITAL 5.05000% 19-30.03.29	2 342 000.00	2 695 888.61	0.05
USD CELGENE CORP 3.25000% 18-20.02.23	0.00	2 655.00	0.00
USD CELGENE CORP 3.45000% 17-15.11.27	0.00	150.00	0.00
USD CELGENE CORP 3.87500% 15-15.08.25	0.00	1 120.50	0.00
USD CENOVUS ENERGY INC 4.25000% 17-15.04.27	4 395 000.00	4 690 515.84	0.08
USD CENTERPOINT ENERGY INC 3.60000% 18-01.11.21	1 550 000.00	1 595 019.44	0.03
USD CENTERPOINT ENERGY INC 3.85000% 18-01.02.24	6 255 000.00	6 681 734.24	0.12
USD CENTERPOINT ENERGY INC 4.25000% 18-01.11.28	1 066 000.00	1 197 980.93	0.02
USD CENTERPOINT ENERGY RESOURCES CORP 3.55000% 18-01.04.23	1 510 000.00	1 576 618.94	0.03
USD CERRO DEL AGUILA SA-144A 4.12500% 17-16.08.27	1 018 000.00	1 056 175.00	0.02
USD CHUBB INA HOLDINGS INC 2.87500% 15-03.11.22	4 815 000.00	4 958 500.48	0.09
USD CHURCH & DWIGHT CO INC 3.15000% 17-01.08.27	2 610 000.00	2 788 724.19	0.05
USD CIGNA CORP 3.40000% 19-17.09.21	5 690 000.00	5 838 951.68	0.10
USD CIGNA CORP 3.75000% 19-15.07.23	5 359 000.00	5 666 454.94	0.10
USD CIGNA CORP 4.12500% 19-15.11.25	7 527 000.00	8 286 816.02	0.15
USD CIGNA CORP 4.37500% 19-15.10.28	16 532 000.00	18 639 385.30	0.33
USD CISCO SYSTEMS INC 2.20000% 16-28.02.21	2 800 000.00	2 815 965.04	0.05
USD CIT GROUP INC 4.12500% 18-09.03.21	979 000.00	994 664.00	0.02
USD CIT GROUP INC 5.25000% 18-07.03.25	674 000.00	739 715.00	0.01
USD CITIGROUP INC 2.75000% 17-25.04.22	2 000 000.00	2 036 505.80	0.04
USD CITIGROUP INC 2.90000% 16-08.12.21	9 750 000.00	9 930 136.12	0.17
USD CITIGROUP INC 3.20000% 16-21.10.26	3 160 000.00	3 346 066.80	0.06
USD CITIGROUP INC 3.40000% 16-01.05.26	1 800 000.00	1 929 749.94	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 - U S マルチ・クレジット

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD CITIGROUP INC 3.70000% 16-12.01.26	4 315 000.00	4 682 685.90	0.08
USD CITIGROUP INC 4.50000% 11-14.01.22	1 800 000.00	1 891 755.90	0.03
USD CITIGROUP INC-SUB 3.87500% 15-26.03.25	3 288 000.00	3 536 449.50	0.06
USD CITIGROUP INC-SUB 4.40000% 15-10.06.25	8 772 000.00	9 670 519.47	0.17
USD CITIGROUP INC-SUB 4.45000% 15-29.09.27	15 320 000.00	17 197 977.69	0.30
USD CITIZENS FINANCIAL GROUP INC-SUB 4.30000% 15-03.12.25	3 960 000.00	4 353 292.94	0.08
USD CK HUTCHISON INTNL 17 II LTD-REG-S 2.75000% 17-29.03.23	1 950 000.00	1 985 953.12	0.03
USD CMS ENERGY CORP 2.95000% 16-15.02.27	1 650 000.00	1 699 756.08	0.03
USD CMS ENERGY CORP 3.00000% 16-15.05.26	1 700 000.00	1 786 562.81	0.03
USD CMS ENERGY CORP 3.87500% 14-01.03.24	1 500 000.00	1 601 513.55	0.03
USD CNA FINANCIAL CORP 3.95000% 14-15.05.24	3 560 000.00	3 829 102.18	0.07
USD CNA FINANCIAL CORP 3.90000% 19-01.05.29	2 760 000.00	3 064 262.40	0.05
USD CNH INDUSTRIAL CAPITAL LLC 3.87500% 16-15.10.21	8 655 000.00	8 906 426.01	0.16
USD CNH INDUSTRIAL CAPITAL LLC 4.37500% 17-05.04.22	822 000.00	859 787.34	0.02
USD COCA-COLA FEMSA SA 2.75000% 20-22.01.30	2 125 000.00	2 186 731.25	0.04
USD COLORADO INTERSTATE GAS/ ISSUING-REG-S 4.15000% 16-15.08.26	5 030 000.00	5 377 169.59	0.09
USD COMCAST CORP 2.65000% 19-01.02.30	1 945 000.00	2 005 719.79	0.04
USD COMCAST CORP 3.00000% 17-01.02.24	3 095 000.00	3 245 007.53	0.06
USD COMCAST CORP 3.55000% 18-01.05.28	2 926 000.00	3 214 587.87	0.06
USD COMCAST CORP 3.60000% 14-01.03.24	1 500 000.00	1 610 918.40	0.03
USD COMCAST CORP 3.70000% 18-15.04.24	2 385 000.00	2 565 987.87	0.05
USD COMCAST CORP 3.95000% 18-15.10.25	9 896 000.00	10 940 930.52	0.19
USD COMCAST CORP 4.15000% 18-15.10.28	2 800 000.00	3 212 044.64	0.06
USD COMCAST CORP 4.25000% 18-15.10.30	3 775 000.00	4 419 871.93	0.08
USD CONAGRA BRANDS INC 4.30000% 18-01.05.24	2 110 000.00	2 300 922.08	0.04
USD CONAGRA BRANDS INC 4.85000% 18-01.11.28	2 720 000.00	3 185 280.75	0.06
USD CONAGRA INC 4.60000% 18-01.11.25	6 395 000.00	7 204 064.70	0.13
USD CONCHO RESOURCES INC 4.30000% 18-15.08.28	4 800 000.00	5 258 482.56	0.09
USD CONOCOPHILLIPS CO 4.95000% 16-15.03.26	735 000.00	857 383.01	0.02
USD CONSTELLATION BRANDS INC 4.25000% 13-01.05.23	1 250 000.00	1 340 022.38	0.02
USD CONSTELLATION BRANDS INC 2.70000% 17-09.05.22	1 965 000.00	1 998 840.64	0.04
USD CONSTELLATION BRANDS INC 4.40000% 18-15.11.25	3 415 000.00	3 813 476.20	0.07
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-144A 3.62500% 17-01.08.27	579 000.00	616 635.00	0.01
USD CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE-144A 3.00000% 19-30.09.29	2 941 000.00	2 978 681.56	0.05
USD CORPORATE OFFICE PROPERTIES LP 3.70000% 14-15.06.21	875 000.00	889 741.47	0.02
USD CRANE CO 4.45000% 13-15.12.23	1 760 000.00	1 904 022.73	0.03
USD CREDIT SUISSE AG/NEW YORK NY 2.10000% 19-12.11.21	2 400 000.00	2 415 974.16	0.04
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-144A 3.57400% 17-09.01.23	1 900 000.00	1 956 426.96	0.03
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-144A 4.28200% 17-09.01.28	4 530 000.00	5 012 849.53	0.09
USD CREDIT SUISSE GRP FDNG GUERNSEY 3.75000% 16-26.03.25	3 975 000.00	4 260 807.67	0.08
USD CREDIT SUISSE GRP FDNG GUERNSEY 3.80000% 16-09.06.23	3 000 000.00	3 168 410.40	0.06
USD CREDIT SUISSE-REG-S-SUB 6.50000% 13-08.08.23	2 400 000.00	2 685 000.00	0.05
USD CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP 4.87500% 14-15.04.22	3 545 000.00	3 769 563.34	0.07
USD CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP 3.40000% 16-15.02.21	3 500 000.00	3 549 399.70	0.06
USD CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP 3.70000% 16-15.05.26	2 250 000.00	2 429 777.03	0.04
USD CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP 3.15000% 18-15.07.23	2 317 000.00	2 402 053.13	0.04
USD CSX CORP 3.25000% 17-01.06.27	3 145 000.00	3 376 463.82	0.06
USD CUBESMART LP 4.37500% 19-15.02.29	6 265 000.00	7 097 241.97	0.13
USD CUBESMART LP 4.80000% 12-15.07.22	1 000 000.00	1 058 199.60	0.02
USD CVS HEALTH CORP 2.62500% 19-15.08.24	3 000 000.00	3 073 317.30	0.05
USD CVS HEALTH CORP 3.70000% 18-09.03.23	20 188 000.00	21 185 652.61	0.37
USD CVS HEALTH CORP 3.87500% 15-20.07.25	10 239 000.00	11 071 207.49	0.20
USD CVS HEALTH CORP 4.10000% 18-25.03.25	2 495 000.00	2 713 126.62	0.05
USD CVS HEALTH CORP 4.30000% 18-25.03.28	15 015 000.00	16 637 923.30	0.29
USD CVS HEALTH CORP 4.75000% 16-01.12.22	3 000 000.00	3 206 358.30	0.06
USD CVS HEALTH CORP 5.00000% 16-01.12.24	1 830 000.00	2 042 938.98	0.04
USD CVS HEALTH CORP 5.05000% 18-25.03.48	3 830 000.00	4 642 505.01	0.08
USD DANSKE BANK AS-144A 3.87500% 18-12.09.23	2 960 000.00	3 113 459.72	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 - U S マルチ・クレジット

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD DANSKE BANK AS-144A 5.37500% 19-12.01.24	2 355 000.00	2 619 791.49	0.05
USD DDR CORP 3.62500% 15-01.02.25	1 550 000.00	1 623 427.69	0.03
USD DDR CORP 4.70000% 17-01.06.27	4 333 000.00	4 791 678.81	0.08
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP-REG-S 5.45000% 16-15.06.23	11 325 000.00	12 407 072.04	0.22
USD DELTA AIR LINES INC 2.87500% 17-13.03.20	2 600 000.00	2 603 415.88	0.05
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 3.15000% 18-22.01.21	5 020 000.00	5 062 778.43	0.09
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 3.95000% 18-27.02.23	435 000.00	451 456.23	0.01
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 4.25000% 18-04.02.21	2 115 000.00	2 154 758.40	0.04
USD DIGITAL REALTY TRUST LP 2.75000% 17-01.02.23	1 500 000.00	1 531 226.40	0.03
USD DISCOVER BANK 4.20000% 13-08.08.23	750 000.00	803 412.90	0.01
USD DISCOVER BANK 4.65000% 18-13.09.28	3 250 000.00	3 740 886.83	0.07
USD DISCOVERY COMMUNICATIONS LLC 3.45000% 15-15.03.25	1 035 000.00	1 088 537.65	0.02
USD DISCOVERY COMMUNICATIONS LLC 2.95000% 17-20.03.23	1 350 000.00	1 388 603.79	0.02
USD DISCOVERY COMMUNICATIONS LLC 3.95000% 17-20.03.28	1 265 000.00	1 365 930.93	0.02
USD DISCOVERY COMMUNICATIONS LLC 4.12500% 19-15.05.29	1 665 000.00	1 819 298.38	0.03
USD DOLLAR GENERAL CORP 3.25000% 13-15.04.23	1 600 000.00	1 664 152.96	0.03
USD DOLLAR TREE INC 3.70000% 18-15.05.23	9 563 000.00	10 084 916.03	0.18
USD DOLLAR TREE INC 4.00000% 18-15.05.25	2 590 000.00	2 804 629.42	0.05
USD DOLLAR TREE INC 4.20000% 18-15.05.28	3 000 000.00	3 293 268.30	0.06
USD DOMINION ENERGY INC 2.85000% 16-15.08.26	5 550 000.00	5 748 233.24	0.10
USD DOMINION ENERGY INC-SUB 2.00000% 19-15.08.24	2 700 000.00	2 802 476.61	0.05
USD DOMINION GAS HOLDINGS LLC 2.50000% 19-15.11.24	6 300 000.00	6 399 298.08	0.11
USD DOW CHEMICAL CO 3.00000% 12-15.11.22	9 165 000.00	9 423 012.16	0.17
USD DOW CHEMICAL CO 4.55000% 19-30.11.25	3 275 000.00	3 683 983.96	0.06
USD DR HORTON INC 2.50000% 19-15.10.24	3 660 000.00	3 727 709.27	0.07
USD DR HORTON INC 2.55000% 17-01.12.20	6 100 000.00	6 134 988.99	0.11
USD DR HORTON INC 4.00000% 15-15.02.20	1 130 000.00	1 130 542.06	0.02
USD DTE ENERGY CO 2.85000% 16-01.10.26	1 900 000.00	1 963 554.24	0.03
USD DTE ENERGY CO 2.95000% 19-01.03.30	580 000.00	589 475.69	0.01
USD DTE ENERGY CO 3.40000% 19-15.06.29	1 105 000.00	1 170 434.45	0.02
USD DTE ENERGY CO 3.70000% 18-01.08.23	6 760 000.00	7 140 769.84	0.13
USD DUKE ENERGY CORP 2.65000% 16-01.09.26	5 850 000.00	6 017 229.86	0.11
USD DUKE ENERGY CORP 3.15000% 17-15.08.27	1 415 000.00	1 492 962.67	0.03
USD DUKE ENERGY CORP 3.40000% 19-15.06.29	2 680 000.00	2 882 289.62	0.05
USD DUKE ENERGY CORP 3.75000% 14-15.04.24	1 700 000.00	1 820 224.00	0.03
USD DUKE ENERGY CORP 3.95000% 13-15.10.23	3 000 000.00	3 202 524.00	0.06
USD DUKE REALTY LP 3.37500% 17-15.12.27	3 525 000.00	3 785 737.20	0.07
USD DUKE REALTY LP 3.62500% 13-15.04.23	2 250 000.00	2 358 446.40	0.04
USD DUPONT DE NEMOURS INC 4.20500% 18-15.11.23	5 000 000.00	5 412 589.50	0.10
USD DUPONT DE NEMOURS INC 4.49300% 18-15.11.25	3 328 000.00	3 717 390.31	0.07
USD EBAY INC 3.60000% 17-05.06.27	4 755 000.00	5 053 537.44	0.09
USD EDISON INTERNATIONAL 2.40000% 17-15.09.22	1 325 000.00	1 328 994.08	0.02
USD EDISON INTERNATIONAL 4.12500% 18-15.03.28	944 000.00	1 003 570.08	0.02
USD EDISON INTERNATIONAL 3.55000% 19-15.11.24	1 540 000.00	1 620 736.66	0.03
USD EDP FINANCE BV-REG-S 3.62500% 17-15.07.24	2 200 000.00	2 315 333.68	0.04
USD EL PASO ELECTRIC CO 3.30000% 12-15.12.22	2 595 000.00	2 647 502.56	0.05
USD ELANCO ANIMAL HEALTH INC 4.90000% 19-28.08.28	1 700 000.00	1 953 727.21	0.03
USD ELI LILLY & CO 2.75000% 15-01.06.25	1 344 000.00	1 401 173.49	0.02
USD ELI LILLY & CO 3.37500% 19-15.03.29	2 565 000.00	2 816 353.33	0.05
USD EMPRESA NACIONAL DE ELECTRICIDAD SA/CHI 4.25000% 14-15.04.24	348 000.00	366 596.25	0.01
USD EMPRESA NACIONAL DEL PETROLEO-REG-S 3.75000% 16-05.08.26	213 000.00	221 892.75	0.00
USD ENBRIDGE ENERGY PARTNERS LP 5.87500% 15-15.10.25	1 650 000.00	1 959 590.82	0.03
USD ENBRIDGE INC 3.12500% 19-15.11.29	4 775 000.00	4 908 000.94	0.09
USD ENCOMPASS HEALTH CORP 4.75000% 19-01.02.30	427 000.00	444 080.00	0.01
USD ENEL CHILE SA 4.87500% 18-12.06.28	676 000.00	755 852.50	0.01
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-REG-S 3.62500% 17-25.05.27	1 850 000.00	1 975 021.33	0.03
USD ENERGY TRANSFER LP/REGENCY FIN CORP 5.00000% 14-01.10.22	5 045 000.00	5 353 766.11	0.09
USD ENERGY TRANSFER OPERATING LP 5.25000% 19-15.04.29	1 885 000.00	2 135 101.99	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 - U S マルチ・クレジット

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD ENERGY TRANSFER OPERATING LP 4.50000% 19-15.04.24	1 555 000.00	1 672 137.99	0.03
USD ENERGY TRANSFER OPERATING LP 2.90000% 20-15.05.25	8 225 000.00	8 317 198.13	0.15
USD ENERGY TRANSFER PARTNERS LP 4.75000% 15-15.01.26	2 155 000.00	2 360 455.76	0.04
USD ENERGY TRANSFER PARTNERS LP 4.95000% 18-15.06.28	1 500 000.00	1 667 223.30	0.03
USD ENI SPA-144A 4.00000% 18-12.09.23	1 485 000.00	1 581 996.78	0.03
USD ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LLC 2.85000% 16-15.04.21	1 500 000.00	1 515 628.35	0.03
USD ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LLC 3.12500% 19-31.07.29	7 045 000.00	7 300 188.92	0.13
USD ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LP 2.80000% 20-31.01.30	3 550 000.00	3 590 238.18	0.06
USD EOG RESOURCES INC 2.62500% 12-15.03.23	1 431 000.00	1 467 105.13	0.03
USD EOG RESOURCES INC 4.15000% 16-15.01.26	800 000.00	886 936.16	0.02
USD EPR PROPERTIES 4.50000% 17-01.06.27	700 000.00	769 211.38	0.01
USD EPR PROPERTIES 4.75000% 16-15.12.26	1 780 000.00	1 980 583.93	0.03
USD EPR PROPERTIES 5.25000% 13-15.07.23	1 000 000.00	1 085 705.30	0.02
USD EQT CORP 3.00000% 17-01.10.22	4 055 000.00	3 905 786.06	0.07
USD EQT CORP 3.90000% 17-01.10.27	2 660 000.00	2 126 405.57	0.04
USD EQT CORP 7.00000% 20-01.02.30	2 117 000.00	1 863 613.38	0.03
USD EQT MIDSTREAM PARTNERS LP 5.50000% 18-15.07.28	645 000.00	596 832.04	0.01
USD EQT MIDSTREAM PARTNERS LP 4.75000% 18-15.07.23	3 380 000.00	3 335 208.91	0.06
USD EQUIFAX INC 2.30000% 16-01.06.21	180 000.00	181 135.53	0.00
USD EQUIFAX INC 2.60000% 19-01.12.24	5 395 000.00	5 541 725.66	0.10
USD EQUINIX INC 2.62500% 19-18.11.24	2 815 000.00	2 845 092.35	0.05
USD EQUINOR ASA 2.45000% 12-17.01.23	1 800 000.00	1 841 435.28	0.03
USD ERAC USA FINANCE LLC-REG-S 2.70000% 16-01.11.23	3 500 000.00	3 583 200.95	0.06
USD ESSEX PORTFOLIO LP 3.25000% 13-01.05.23	1 990 000.00	2 066 471.12	0.04
USD ESSEX PORTFOLIO LP 3.00000% 19-15.01.30	3 025 000.00	3 148 804.48	0.06
USD ESTEE LAUDER COS INC 2.00000% 19-01.12.24	930 000.00	942 164.21	0.02
USD EVERGY INC 2.45000% 19-15.09.24	1 250 000.00	1 271 543.13	0.02
USD EVERGY INC 4.85000% 11-01.06.21	2 000 000.00	2 065 491.60	0.04
USD EVERGY INC- 2.90000% 19-15.09.29	5 895 000.00	6 044 681.71	0.11
USD EVERSOURCE ENERGY 2.90000% 17-01.10.24	4 410 000.00	4 570 324.67	0.08
USD EVERSOURCE ENERGY 4.25000% 18-01.04.29	2 065 000.00	2 359 145.62	0.04
USD EXELON CORP 3.40000% 16-15.04.26	2 790 000.00	2 984 732.51	0.05
USD EXELON CORP 3.95000% 16-15.06.25	6 807 000.00	7 414 731.00	0.13
USD EXELON CORP-SUB STEP-UP 17-01.06.22	1 280 000.00	1 319 042.56	0.02
USD FEDEX CORP 3.25000% 16-01.04.26	2 000 000.00	2 126 301.00	0.04
USD FIDELITY NATIONAL INFO SERVICES 3.87500% 14-05.06.24	183 000.00	196 984.55	0.00
USD FIDELITY NATIONAL INFO SERVICES 3.75000% 19-21.05.29	760 000.00	849 388.61	0.01
USD FIRSTENERGY CORP 2.85000% 17-15.07.22	1 585 000.00	1 619 370.72	0.03
USD FIRSTENERGY CORP 3.90000% 17-15.07.27	1 205 000.00	1 318 763.81	0.02
USD FISERV INC 3.50000% 19-01.07.29	2 195 000.00	2 365 263.30	0.04
USD FMC CORP 3.45000% 19-01.10.29	1 300 000.00	1 383 056.87	0.02
USD FORD MOTOR CO 5.29100% 16-08.12.46	465 000.00	459 437.87	0.01
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 5.75000% 11-01.02.21	2 035 000.00	2 103 665.17	0.04
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 5.87500% 11-02.08.21	3 248 000.00	3 408 978.35	0.06
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.25000% 12-20.09.22	3 735 000.00	3 877 524.97	0.07
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.20000% 15-15.01.21	615 000.00	620 100.68	0.01
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.09600% 16-04.05.23	6 200 000.00	6 244 149.58	0.11
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.81000% 17-09.01.24	2 605 000.00	2 657 845.29	0.05
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.33900% 17-28.03.22	3 495 000.00	3 544 077.49	0.06
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.97900% 17-03.08.22	3 850 000.00	3 873 884.63	0.07
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.81300% 18-12.10.21	1 400 000.00	1 428 689.22	0.03
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.35000% 19-01.11.22	1 500 000.00	1 522 064.85	0.03
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.06300% 19-01.11.24	2 815 000.00	2 905 157.70	0.05
USD FRESENIUS MED CARE US FIN II INC-144A 4.12500% 14-15.10.20	2 000 000.00	2 018 009.20	0.04
USD FRESENIUS MEDICAL CARE US FINANCE-144A 5.75000% 11-15.02.21	750 000.00	777 010.72	0.01
USD FRESENIUS US FINANCE II INC-144A 4.25000% 14-01.02.21	1 600 000.00	1 633 160.16	0.03
USD FS KKR CAPITAL CORP 4.75000% 15-15.05.22	6 000 000.00	6 246 649.20	0.11
USD GATX CORP 4.35000% 18-15.02.24	5 425 000.00	5 838 677.41	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 - U S マルチ・クレジット

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD GE CAPITAL INTL FUNDING CO 3.37300% 16-15.11.25	6 622 000.00	7 024 701.04	0.12
USD GE CAPITAL INTL FUNDING CO 2.34200% 16-15.11.20	1 730 000.00	1 735 840.31	0.03
USD GE CAPITAL INTL FUNDING CO 4.41800% 16-15.11.35	1 095 000.00	1 233 354.57	0.02
USD GENERAL ELECTRIC CO 3.37500% 14-11.03.24	3 500 000.00	3 679 344.55	0.06
USD GENERAL MILLS INC 4.00000% 18-17.04.25	4 255 000.00	4 653 695.20	0.08
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 4.37500% 14-25.09.21	735 000.00	762 832.24	0.01
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 4.00000% 15-15.01.25	1 870 000.00	1 982 502.57	0.03
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 3.20000% 16-06.07.21	575 000.00	584 019.39	0.01
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 3.15000% 17-30.06.22	1 155 000.00	1 181 822.21	0.02
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 3.50000% 17-07.11.24	6 175 000.00	6 392 357.53	0.11
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO 3.85000% 18-05.01.28	665 000.00	689 805.30	0.01
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 5.10000% 19-17.01.24	2 130 000.00	2 336 497.54	0.04
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 2.90000% 20-26.02.25	818 000.00	826 718.24	0.01
USD GENESIS ENERGY LP 7.75000% 20-01.02.28	1 760 000.00	1 774 572.80	0.03
USD GENPACT LUXEMBOURG SARL 3.37500% 19-01.12.24	1 905 000.00	1 963 479.31	0.03
USD GILEAD SCIENCES INC 3.50000% 14-01.02.25	530 000.00	568 078.54	0.01
USD GILEAD SCIENCES INC 3.65000% 15-01.03.26	4 314 000.00	4 695 122.06	0.08
USD GILEAD SCIENCES INC 1.95000% 16-01.03.22	2 600 000.00	2 617 811.04	0.05
USD GILEAD SCIENCES INC 2.50000% 16-01.09.23	1 205 000.00	1 233 374.62	0.02
USD GILEAD SCIENCES INC 2.95000% 16-01.03.27	1 245 000.00	1 318 922.49	0.02
USD GLAXOSMITHKLINE CAPITAL INC 3.37500% 18-15.05.23	2 675 000.00	2 815 754.75	0.05
USD GLAXOSMITHKLINE CAPITAL INC 3.62500% 18-15.05.25	2 500 000.00	2 724 348.25	0.05
USD GLOBAL PAYMENTS INC 2.65000% 19-15.02.25	415 000.00	425 182.69	0.01
USD GLOBAL PAYMENTS INC 3.20000% 19-15.08.29	4 921 000.00	5 146 086.54	0.09
USD GLOBAL PAYMENTS INC 3.80000% 16-01.04.21	2 515 000.00	2 566 050.98	0.05
USD GLOBAL PAYMENTS INC 4.00000% 18-01.06.23	2 085 000.00	2 217 125.83	0.04
USD GLP CAPITAL LP / GLP FINANC II INC 5.25000% 18-01.06.25	1 585 000.00	1 774 920.88	0.03
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 5.75000% 12-24.01.22	1 600 000.00	1 720 747.04	0.03
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC-SUB 4.25000% 15-21.10.25	9 200 000.00	10 165 022.04	0.18
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 3.00000% 17-26.04.22	4 390 000.00	4 455 275.78	0.08
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 3.20000% 18-23.02.23	9 875 000.00	10 244 368.45	0.18
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.62500% 19-20.02.24	5 200 000.00	5 530 519.28	0.10
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 2.87500% 16-25.02.21	1 265 000.00	1 278 404.70	0.02
USD GRAPHIC PACKAGING INTERNATIONAL INC 4.12500% 16-15.08.24	416 000.00	435 760.00	0.01
USD HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP 2.80000% 19-19.08.29	3 000 000.00	3 102 454.80	0.05
USD HCA INC 4.12500% 19-15.06.29	7 685 000.00	8 316 667.81	0.15
USD HCA INC 4.75000% 12-01.05.23	2 500 000.00	2 704 378.00	0.05
USD HCA INC 5.25000% 14-15.04.25	500 000.00	567 967.65	0.01
USD HCA INC 5.25000% 16-15.06.26	700 000.00	799 935.50	0.01
USD HCA INC 5.37500% 18-01.09.26	1 469 000.00	1 652 698.45	0.03
USD HCA INC 5.87500% 19-01.02.29	1 214 000.00	1 432 641.40	0.03
USD HCP INC 3.25000% 19-15.07.26	1 978 000.00	2 095 717.30	0.04
USD HCP INC 3.40000% 15-01.02.25	6 000 000.00	6 354 769.80	0.11
USD HCP INC 3.87500% 14-15.08.24	2 690 000.00	2 897 329.06	0.05
USD HEALTHCARE REALTY TRUST 3.87500% 15-01.05.25	2 000 000.00	2 143 101.20	0.04
USD HEALTHCARE REALTY TRUST 3.62500% 17-15.01.28	1 836 000.00	1 950 718.60	0.03
USD HEALTHCARE TRUST OF AMERICA HOLDINGS LP 3.50000% 16-01.08.26	715 000.00	764 735.33	0.01
USD HEALTHCARE TRUST OF AMERICA HOLDINGS LP 3.75000% 17-01.07.27	2 070 000.00	2 238 811.40	0.04
USD HEALTHPEAK PROPERTIES INC 3.00000% 19-15.01.30	1 275 000.00	1 310 618.91	0.02
USD HESS CORP 3.50000% 14-15.07.24	1 035 000.00	1 079 196.36	0.02
USD HESS CORP 4.30000% 16-01.04.27	2 185 000.00	2 332 704.26	0.04
USD HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO STEP-UP/DOWN 16-15.10.25	490 000.00	553 534.72	0.01
USD HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO 3.50000% 18-05.10.21	2 365 000.00	2 428 999.03	0.04
USD HEWLETT-PACKARD CO 3.75000% 10-01.12.20	69 000.00	70 053.71	0.00
USD HIGHWOODS REALTY LP 3.20000% 14-15.06.21	2 000 000.00	2 028 355.80	0.04
USD HILLENBRAND INC 4.50000% 19-15.09.26	1 370 000.00	1 474 159.05	0.03
USD HOME DEPOT INC/THE 1.80000% 17-05.06.20	2 125 000.00	2 125 627.09	0.04
USD HOME DEPOT INC/THE 2.62500% 15-01.06.22	2 300 000.00	2 355 363.30	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 - U S マルチ・クレジット

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD HOME DEPOT INC/THE 2.00000% 16-01.04.21	2 075 000.00	2 086 063.70	0.04
USD HOME DEPOT INC/THE 3.25000% 18-01.03.22	745 000.00	771 594.19	0.01
USD HOME DEPOT INC/THE 3.90000% 18-06.12.28	1 160 000.00	1 322 568.31	0.02
USD HSBC HOLDINGS PLC 2.95000% 16-25.05.21	7 000 000.00	7 107 578.80	0.13
USD HSBC HOLDINGS PLC-SUB 4.25000% 14-14.03.24	6 617 000.00	7 107 579.75	0.13
USD HUDSON PACIFIC PROPERTIES LP 3.95000% 17-01.11.27	1 200 000.00	1 295 678.40	0.02
USD HUDSON PACIFIC PROPERTIES LP 4.65000% 19-01.04.29	850 000.00	966 979.38	0.02
USD HUMANA INC 2.90000% 17-15.12.22	3 750 000.00	3 846 063.00	0.07
USD HUMANA INC 3.12500% 19-15.08.29	3 270 000.00	3 389 281.10	0.06
USD HUNTINGTON BANCSHARES INC/OH 2.62500% 19-06.08.24	2 500 000.00	2 567 582.25	0.05
USD HUSKY ENERGY INC 3.95000% 12-15.04.22	6 375 000.00	6 598 898.92	0.12
USD IHS MARKIT LTD 3.62500% 19-01.05.24	703 000.00	738 606.95	0.01
USD IHS MARKIT LTD 4.12500% 18-01.08.23	4 158 000.00	4 423 114.08	0.08
USD IMPERIAL BRANDS FINANCE PLC-144A 2.95000% 15-21.07.20	685 000.00	688 169.97	0.01
USD INDIANA MICHIGAN POWER CO 3.20000% 13-15.03.23	862 000.00	897 415.53	0.02
USD ING GROEP NV 3.55000% 19-09.04.24	1 950 000.00	2 066 151.36	0.04
USD ING GROEP NV 3.95000% 17-29.03.27	1 710 000.00	1 890 378.15	0.03
USD ING GROEP NV 4.05000% 19-09.04.29	1 761 000.00	1 988 133.08	0.03
USD INGERSOLL-RAND LUXEMBOURG FINANCE SA 2.62500% 14-01.05.20	1 375 000.00	1 376 522.26	0.02
USD INGERSOLL-RAND LUXEMBOURG FINANCE SA 3.50000% 19-21.03.26	2 725 000.00	2 921 804.95	0.05
USD INTEL CORP 2.87500% 17-11.05.24	1 600 000.00	1 677 941.12	0.03
USD INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 3.37500% 13-01.08.23	2 471 000.00	2 610 638.43	0.05
USD INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 3.00000% 19-15.05.24	1 660 000.00	1 742 835.66	0.03
USD INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 3.30000% 19-15.05.26	1 650 000.00	1 775 746.50	0.03
USD INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 3.50000% 19-15.05.29	3 095 000.00	3 404 329.47	0.06
USD INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC 4.45000% 18-26.09.28	1 955 000.00	2 196 670.45	0.04
USD INTERNATIONAL LEASE FINANCE CORP 4.62500% 13-15.04.21	2 500 000.00	2 577 693.00	0.05
USD INTERNATIONAL PAPER CO 3.00000% 16-15.02.27	495 000.00	519 751.88	0.01
USD INTERPUBLIC GROUP OF COS INC 3.75000% 18-01.10.21	1 614 000.00	1 664 322.58	0.03
USD ITC HOLDINGS CORP 3.65000% 14-15.06.24	2 833 000.00	3 010 578.67	0.05
USD ITC HOLDINGS CORP 3.25000% 16-30.06.26	1 350 000.00	1 427 273.33	0.03
USD ITC HOLDINGS CORP 4.05000% 13-01.07.23	675 000.00	713 265.00	0.01
USD JABIL INC 3.60000% 20-15.01.30	2 615 000.00	2 686 048.77	0.05
USD JD.COM INC 3.37500% 20-14.01.30	5 220 000.00	5 345 367.70	0.09
USD JM SMUCKER CO/THE 3.00000% 15-15.03.22	950 000.00	971 623.99	0.02
USD JOHN DEERE CAPITAL CORP 3.65000% 18-12.10.23	2 845 000.00	3 043 971.05	0.05
USD JOHNSON & JOHNSON 2.90000% 17-15.01.28	2 055 000.00	2 189 702.58	0.04
USD JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC STEP-UP 16-02.07.24	1 182 000.00	1 249 721.04	0.02
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.30000% 16-01.04.26	1 750 000.00	1 871 763.25	0.03
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.20000% 16-15.06.26	7 930 000.00	8 437 382.81	0.15
USD JPMORGAN CHASE & CO 2.95000% 16-01.10.26	1 800 000.00	1 892 254.68	0.03
USD JPMORGAN CHASE & CO-SUB 3.87500% 14-10.09.24	18 223 000.00	19 695 908.60	0.35
USD JUNIPER NETWORKS INC 4.50000% 14-15.03.24	448 000.00	490 471.03	0.01
USD JUNIPER NETWORKS INC 4.35000% 15-15.06.25	510 000.00	560 531.26	0.01
USD KAISER FOUNDATION HOSPITALS 3.15000% 17-01.05.27	3 890 000.00	4 175 265.76	0.07
USD KEURIG DR PEPPER INC 3.20000% 11-15.11.21	3 545 000.00	3 615 722.05	0.06
USD KILROY REALTY LP 3.45000% 17-15.12.24	1 756 000.00	1 858 652.42	0.03
USD KILROY REALTY LP 4.37500% 15-01.10.25	1 500 000.00	1 656 292.50	0.03
USD KIMCO REALTY CORP 3.40000% 15-01.11.22	2 000 000.00	2 079 639.20	0.04
USD KINDER MORGAN ENERGY PARTNERS LP 3.45000% 12-15.02.23	1 840 000.00	1 913 849.14	0.03
USD KINDER MORGAN ENERGY PARTNERS LP 4.25000% 14-01.09.24	3 000 000.00	3 262 127.40	0.06
USD KINDER MORGAN INC 3.15000% 17-15.01.23	7 475 000.00	7 725 021.56	0.14
USD KLA-TENCOR CORP 4.10000% 19-15.03.29	3 252 000.00	3 650 852.59	0.06
USD KLA-TENCOR CORP 4.12500% 14-01.11.21	1 646 000.00	1 705 006.96	0.03
USD KOREA HYDRO&NUCLEAR POWER CO LTD-144A 3.75000% 18-25.07.23	6 450 000.00	6 817 069.49	0.12
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 3.95000% 16-15.07.25	1 675 000.00	1 798 321.87	0.03
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 4.00000% 18-15.06.23	6 211 000.00	6 588 347.45	0.12
USD KROGER CO 4.50000% 19-15.01.29	730 000.00	840 038.89	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 - U S マルチ・クレジット

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD LABORATORY CORP AMERICA HOLDINGS 2.95000% 19-01.12.29	1 780 000.00	1 817 311.65	0.03
USD LAM RESEARCH CORP 3.75000% 19-15.03.26	1 133 000.00	1 238 966.21	0.02
USD LAS VEGAS SANDS CORP 3.50000% 19-18.08.26	2 350 000.00	2 453 850.03	0.04
USD LAS VEGAS SANDS CORP 3.90000% 19-08.08.29	3 000 000.00	3 152 104.50	0.06
USD LAS VEGAS SANDS CORP 3.20000% 19-08.08.24	4 954 000.00	5 114 171.24	0.09
USD LEGGETT & PLATT INC 4.40000% 19-15.03.29	2 451 000.00	2 736 786.84	0.05
USD LENNAR CORP 4.75000% 15-30.05.25	1 205 000.00	1 315 787.70	0.02
USD LENNAR CORP 4.87500% 15-15.12.23	2 265 000.00	2 429 212.50	0.04
USD LEVEL 3 FINANCING INC 5.37500% 16-01.05.25	171 000.00	176 557.50	0.00
USD LEVEL 3 FINANCING INC 5.37500% 16-15.01.24	150 000.00	151 812.00	0.00
USD LG&E AND KU ENERGY LLC 4.37500% 12-01.10.21	2 000 000.00	2 064 461.60	0.04
USD LIBERTY PROPERTY LP 4.37500% 19-01.02.29	1 125 000.00	1 319 733.22	0.02
USD LIFE STORAGE LP 3.50000% 16-01.07.26	2 636 000.00	2 766 001.46	0.05
USD LIFE STORAGE LP 3.87500% 17-15.12.27	535 000.00	581 566.62	0.01
USD LIFE STORAGE LP 4.00000% 19-15.06.29	625 000.00	687 077.19	0.01
USD LINCOLN NATIONAL CORP 4.20000% 12-15.03.22	2 700 000.00	2 829 775.23	0.05
USD LINCOLN NATIONAL CORP 3.80000% 18-01.03.28	8 898 000.00	9 729 096.33	0.17
USD LINCOLN NATIONAL CORP 3.05000% 19-15.01.30	1 115 000.00	1 160 076.78	0.02
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.05000% 18-16.08.23	3 112 000.00	3 316 024.59	0.06
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC-SUB 4.50000% 14-04.11.24	1 520 000.00	1 655 232.88	0.03
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.45000% 18-08.05.25	1 534 000.00	1 698 073.88	0.03
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 3.90000% 19-12.03.24	5 955 000.00	6 366 413.68	0.11
USD LOCKHEED MARTIN CORP 3.55000% 15-15.01.26	1 045 000.00	1 140 440.27	0.02
USD LOWE ' S COS INC 3.65000% 19-05.04.29	1 260 000.00	1 373 751.04	0.02
USD MARATHON OIL CORP 6.80000% 02-15.03.32	1 080 000.00	1 382 400.00	0.02
USD MARKEL CORP 3.35000% 19-17.09.29	1 420 000.00	1 501 815.29	0.03
USD MARKEL CORP 3.50000% 17-01.11.27	2 000 000.00	2 128 127.00	0.04
USD MARKEL CORP 4.90000% 12-01.07.22	1 765 000.00	1 888 272.19	0.03
USD MARRIOTT INTERNATIONAL INC/MD 3.60000% 19-15.04.24	2 455 000.00	2 613 626.88	0.05
USD MARRIOTT INTERNATIONAL INC/MD 3.12500% 14-15.10.21	1 900 000.00	1 936 135.34	0.03
USD MARRIOTT INTERNATIONAL INC/MD 3.12500% 16-15.06.26	1 400 000.00	1 472 268.70	0.03
USD MARRIOTT INTERNATIONAL INC/MD 4.65000% 18-01.12.28	2 040 000.00	2 351 388.86	0.04
USD MARS INC-REG-S 2.70000% 19-01.04.25	2 650 000.00	2 758 136.17	0.05
USD MARSH & MCLENNAN COS INC 3.30000% 16-14.03.23	2 550 000.00	2 659 578.34	0.05
USD MARSH & MCLENNAN COS INC 3.87500% 19-15.03.24	1 930 000.00	2 078 493.04	0.04
USD MARSH & MCLENNAN COS INC 4.37500% 19-15.03.29	6 785 000.00	7 826 828.61	0.14
USD MARTIN MARIETTA MATERIALS INC 3.50000% 17-15.12.27	1 205 000.00	1 293 765.48	0.02
USD MASTERCARD INC 2.95000% 19-01.06.29	2 775 000.00	2 965 846.19	0.05
USD MCDONALD ' S CORP 2.62500% 11-15.01.22	4 600 000.00	4 682 604.04	0.08
USD MCKESSON CORP 3.95000% 18-16.02.28	1 020 000.00	1 111 226.96	0.02
USD MEAD JOHNSON NUTRITION CO 4.12500% 15-15.11.25	1 583 000.00	1 765 615.04	0.03
USD MEDTRONIC INC 3.15000% 15-15.03.22	1 336 000.00	1 378 325.01	0.02
USD MERCK & CO INC 3.40000% 19-07.03.29	4 975 000.00	5 499 714.24	0.10
USD MERITAGE HOMES CORP 6.00000% 15-01.06.25	3 150 000.00	3 559 500.00	0.06
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 3.45000% 16-18.12.26	2 200 000.00	2 401 111.02	0.04
USD MEXICHEM SAB DE CV-144A 4.00000% 17-04.10.27	2 200 000.00	2 300 540.00	0.04
USD MICROSOFT CORP 2.37500% 15-12.02.22	4 300 000.00	4 371 787.21	0.08
USD MICROSOFT CORP 3.30000% 17-06.02.27	11 507 000.00	12 597 219.21	0.22
USD MID-AMERICA APARTMENTS LP 4.30000% 13-15.10.23	1 000 000.00	1 078 896.80	0.02
USD MID-AMERICA APARTMENTS LP 3.75000% 14-15.06.24	1 300 000.00	1 391 678.08	0.02
USD MINERVA LUXEMBOURG SA-144A 6.50000% 16-20.09.26	280 000.00	297 587.50	0.01
USD MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 2.99800% 17-22.02.22	400 000.00	408 696.00	0.01
USD MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 3.45500% 18-02.03.23	5 320 000.00	5 552 164.80	0.10
USD MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 3.76100% 18-26.07.23	1 070 000.00	1 132 445.20	0.02
USD MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 3.40700% 19-07.03.24	7 850 000.00	8 260 947.50	0.15
USD MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 3.74100% 19-07.03.29	2 550 000.00	2 811 400.50	0.05
USD MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 2.62300% 19-18.07.22	1 600 000.00	1 626 240.00	0.03
USD MOLINA HEALTHCARE INC 5.37500% 16-15.11.22	1 685 000.00	1 784 162.25	0.03

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - U S マルチ・クレジット

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD MOLSON COORS BREWING CO 3.00000% 16-15.07.26	1 695 000.00	1 743 060.88	0.03
USD MOODY ' S CORP 3.25000% 18-07.06.21	2 000 000.00	2 038 052.60	0.04
USD MOODY ' S CORP 4.50000% 12-01.09.22	3 110 000.00	3 297 998.88	0.06
USD MORGAN STANLEY 2.50000% 16-21.04.21	1 915 000.00	1 933 589.86	0.03
USD MORGAN STANLEY 2.62500% 16-17.11.21	5 405 000.00	5 489 689.32	0.10
USD MORGAN STANLEY 2.75000% 17-19.05.22	6 480 000.00	6 618 410.86	0.12
USD MORGAN STANLEY 3.62500% 17-20.01.27	2 200 000.00	2 386 880.10	0.04
USD MORGAN STANLEY-SUB 5.00000% 13-24.11.25	5 935 000.00	6 786 242.81	0.12
USD MOSAIC CO 3.25000% 17-15.11.22	4 525 000.00	4 664 071.80	0.08
USD MOTOROLA SOLUTIONS INC 4.00000% 14-01.09.24	3 000 000.00	3 224 970.00	0.06
USD MPLX LP 3.37500% 18-15.03.23	3 120 000.00	3 251 803.78	0.06
USD MPLX LP 4.12500% 17-01.03.27	3 390 000.00	3 591 399.90	0.06
USD MPLX LP 4.87500% 16-01.12.24	7 905 000.00	8 699 529.97	0.15
USD MYLAN INC 4.55000% 19-15.04.28	1 829 000.00	2 019 188.93	0.04
USD NATIONAL OILWELL VARCO INC 2.60000% 12-01.12.22	373 000.00	378 834.47	0.01
USD NATIONAL OILWELL VARCO INC 3.60000% 19-01.12.29	3 390 000.00	3 402 933.53	0.06
USD NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC 3.80000% 07-15.10.22	2 000 000.00	2 089 185.80	0.04
USD NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC 3.90000% 14-15.06.24	1 931 000.00	2 071 257.22	0.04
USD NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC 4.30000% 18-15.10.28	2 640 000.00	2 991 231.68	0.05
USD NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-144A-SUB 4.00000% 16-14.09.26	2 095 000.00	2 250 852.29	0.04
USD NATWEST MARKETS PLC-144A 3.62500% 19-29.09.22	1 940 000.00	2 019 884.55	0.04
USD NESTLE HOLDINGS INC-REG-S 3.35000% 18-24.09.23	2 670 000.00	2 816 193.18	0.05
USD NEVADA POWER CO 3.70000% 19-01.05.29	2 550 000.00	2 829 436.40	0.05
USD NEWELL BRANDS INC 3.85000% 16-01.04.23	4 115 000.00	4 283 617.47	0.08
USD NEWFIELD EXPLORATION CO 5.37500% 15-01.01.26	3 836 000.00	4 207 922.06	0.07
USD NEWMONT GOLDCORP CORP 2.80000% 19-01.10.29	4 250 000.00	4 371 669.85	0.08
USD NISOURCE INC 2.65000% 17-17.11.22	2 563 000.00	2 610 279.41	0.05
USD NISOURCE INC 3.49000% 17-15.05.27	4 220 000.00	4 538 798.21	0.08
USD NOBLE ENERGY INC 3.25000% 19-15.10.29	435 000.00	437 731.15	0.01
USD NOBLE ENERGY INC 3.90000% 14-15.11.24	2 755 000.00	2 936 445.41	0.05
USD NOMURA HOLDINGS INC 2.64800% 20-16.01.25	1 545 000.00	1 564 621.50	0.03
USD NORDEA BANK ABP-REG-S 3.75000% 18-30.08.23	2 774 000.00	2 935 953.61	0.05
USD NORFOLK SOUTHERN CORP 3.80000% 18-01.08.28	2 645 000.00	2 962 622.71	0.05
USD NORFOLK SOUTHERN CORP 3.65000% 18-01.08.25	1 730 000.00	1 876 496.05	0.03
USD NORTHROP GRUMMAN CORP 2.55000% 17-15.10.22	2 500 000.00	2 552 983.75	0.04
USD NUTRIEN LTD 4.20000% 19-01.04.29	1 245 000.00	1 400 320.60	0.02
USD O ' REILLY AUTOMOTIVE INC 3.55000% 16-15.03.26	825 000.00	891 303.68	0.02
USD O ' REILLY AUTOMOTIVE INC 3.60000% 17-01.09.27	2 250 000.00	2 452 538.25	0.04
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 2.70000% 19-15.08.22	5 800 000.00	5 889 913.34	0.10
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 3.50000% 19-15.08.29	1 793 000.00	1 849 742.88	0.03
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 2.90000% 19-15.08.24	14 515 000.00	14 826 814.13	0.26
USD OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC 4.50000% 15-15.01.25	1 550 000.00	1 677 827.73	0.03
USD OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC 5.25000% 16-15.01.26	2 606 000.00	2 950 751.39	0.05
USD ONCOR ELECTRIC DELIVERY CO 4.10000% 19-15.11.48	1 200 000.00	1 473 002.04	0.03
USD ONEOK INC 2.75000% 19-01.09.24	2 790 000.00	2 851 044.08	0.05
USD ONEOK INC 4.25000% 12-01.02.22	1 830 000.00	1 900 042.52	0.03
USD ONEOK INC 4.35000% 19-15.03.29	2 426 000.00	2 659 920.98	0.05
USD ONEOK INC 4.55000% 18-15.07.28	2 595 000.00	2 860 190.83	0.05
USD ONEOK PARTNERS LP 4.90000% 15-15.03.25	1 510 000.00	1 687 038.44	0.03
USD ORACLE CORP 1.90000% 16-15.09.21	2 100 000.00	2 108 780.94	0.04
USD ORACLE CORP 2.40000% 16-15.09.23	7 755 000.00	7 950 955.67	0.14
USD ORACLE CORP 2.95000% 17-15.11.24	3 410 000.00	3 589 389.87	0.06
USD OVINTIV INC 3.90000% 11-15.11.21	6 939 000.00	7 120 472.89	0.13
USD OWENS CORNING 3.40000% 16-15.08.26	1 600 000.00	1 673 743.04	0.03
USD OWENS CORNING 3.95000% 19-15.08.29	2 000 000.00	2 168 704.00	0.04
USD OWL ROCK CAPITAL CORP 3.75000% 20-22.07.25	6 850 000.00	6 906 970.76	0.12
USD PANASONIC CORP-144A 2.67900% 19-19.07.24	4 730 000.00	4 853 926.00	0.09
USD PAYPAL HOLDINGS INC 2.20000% 19-26.09.22	6 650 000.00	6 722 628.64	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 - U S マルチ・クレジット

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD PAYPAL HOLDINGS INC 2.40000% 19-01.10.24	2 375 000.00	2 421 156.22	0.04
USD PAYPAL HOLDINGS INC 2.85000% 19-01.10.29	1 845 000.00	1 897 124.76	0.03
USD PENTAIR FINANCE SARL 4.50000% 19-01.07.29	4 315 000.00	4 756 813.28	0.08
USD PEPSICO INC 2.00000% 17-15.04.21	2 620 000.00	2 632 748.92	0.05
USD PEPSICO INC 2.25000% 17-02.05.22	1 950 000.00	1 982 581.18	0.03
USD PEPSICO INC 3.00000% 17-15.10.27	4 300 000.00	4 636 405.77	0.08
USD PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD-144A 5.50000% 15-15.07.22	5 800 000.00	6 131 470.00	0.11
USD PETROLEOS MEXICANOS 6.50000% 18-23.01.29	3 990 000.00	4 243 988.63	0.07
USD PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC 2.12500% 16-10.05.23	2 000 000.00	2 014 535.80	0.04
USD PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC 2.87500% 19-01.05.24	2 725 000.00	2 842 913.47	0.05
USD PHILLIPS 66 PARTNERS LP 3.75000% 17-01.03.28	2 840 000.00	3 019 985.57	0.05
USD PIEDMONT NATURAL GAS CO INC 3.50000% 19-01.06.29	1 320 000.00	1 445 469.83	0.03
USD PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP 3.65000% 12-01.06.22	2 400 000.00	2 472 888.00	0.04
USD PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP 3.55000% 19-15.12.29	4 275 000.00	4 251 277.26	0.07
USD PNC BANK NATIONAL ASSOCIATION-SUB 3.80000% 13-25.07.23	7 755 000.00	8 258 127.34	0.15
USD PNC BANK NATIONAL ASSOCIATION-SUB 4.20000% 13-01.11.25	770 000.00	862 542.22	0.02
USD PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE 3.45000% 19-23.04.29	7 509 000.00	8 214 336.14	0.14
USD PNC FINANCIAL SERVICES GROUP 2.20000% 19-01.11.24	5 710 000.00	5 814 834.46	0.10
USD PPL CAPITAL FUNDING INC 3.95000% 14-15.03.24	4 330 000.00	4 612 554.15	0.08
USD PRINCIPAL FINANCIAL GROUP 3.40000% 15-15.05.25	2 747 000.00	2 921 746.83	0.05
USD PRINCIPAL FINANCIAL GROUP 3.10000% 16-15.11.26	3 750 000.00	3 963 170.25	0.07
USD PRINCIPAL FINANCIAL GROUP 3.70000% 19-15.05.29	435 000.00	482 952.84	0.01
USD PROGRESS ENERGY INC 4.40000% 11-15.01.21	5 000 000.00	5 087 963.00	0.09
USD PSEG POWER LLC 3.00000% 16-15.06.21	3 765 000.00	3 826 156.40	0.07
USD PUBLIC SERVICE CO OF NEW MEXICO 3.85000% 15-01.08.25	3 000 000.00	3 201 303.30	0.06
USD PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC 2.87500% 19-15.06.24	2 850 000.00	2 948 401.10	0.05
USD PUBLIC STORAGE 3.38500% 19-01.05.29	2 100 000.00	2 297 490.93	0.04
USD PULTEGROUP INC 5.00000% 16-15.01.27	445 000.00	491 725.00	0.01
USD QATAR, STATE OF-144A 3.87500% 18-23.04.23	1 819 000.00	1 923 592.50	0.03
USD QATAR, STATE OF-144A 4.00000% 19-14.03.29	882 000.00	996 660.00	0.02
USD QATAR, STATE OF-144A 4.81700% 19-14.03.49	1 450 000.00	1 849 656.25	0.03
USD QUALCOMM INC 2.60000% 17-30.01.23	3 015 000.00	3 089 227.49	0.05
USD QUALCOMM INC 3.45000% 15-20.05.25	2 000 000.00	2 147 626.40	0.04
USD QUEST DIAGNOSTICS INC 3.45000% 16-01.06.26	2 110 000.00	2 271 728.34	0.04
USD QUEST DIAGNOSTICS INC 2.95000% 19-30.06.30	715 000.00	731 417.62	0.01
USD QUESTAR MARKET RESOURCES INC 6.87500% 10-01.03.21	3 037 000.00	3 109 128.75	0.05
USD QWEST CORP 6.75000% 11-01.12.21	1 090 000.00	1 168 349.20	0.02
USD RABOBANK NEDERLAND NV-SUB 4.37500% 15-04.08.25	5 870 000.00	6 448 547.78	0.11
USD RABOBANK NEDERLAND NV-SUB 3.75000% 16-21.07.26	1 504 000.00	1 602 415.29	0.03
USD RABOBANK NEDERLAND-SUB 4.62500% 13-01.12.23	5 000 000.00	5 443 692.00	0.10
USD RAYMOND JAMES FINANCIAL INC 5.62500% 12-01.04.24	2 000 000.00	2 286 193.40	0.04
USD REALTY INCOME CORP 3.87500% 18-15.04.25	4 535 000.00	4 969 256.63	0.09
USD REALTY INCOME CORP 3.25000% 19-15.06.29	3 000 000.00	3 244 377.00	0.06
USD REALTY INCOME CORP 4.12500% 14-15.10.26	1 000 000.00	1 120 420.20	0.02
USD REGENCY CENTERS LP 3.75000% 14-15.06.24	1 110 000.00	1 181 364.12	0.02
USD REGENCY CENTERS LP 3.60000% 17-01.02.27	2 030 000.00	2 180 839.56	0.04
USD REGENCY CENTERS LP 4.12500% 18-15.03.28	1 600 000.00	1 780 830.56	0.03
USD REGIONS FINANCIAL CORP 3.80000% 18-14.08.23	4 735 000.00	5 047 706.97	0.09
USD RELX CAPITAL INC 4.00000% 19-18.03.29	2 940 000.00	3 307 355.94	0.06
USD REPUBLIC SERVICES INC 2.90000% 16-01.07.26	2 445 000.00	2 564 419.42	0.05
USD REPUBLIC SERVICES INC 2.50000% 19-15.08.24	2 500 000.00	2 561 799.00	0.05
USD REYNOLDS AMERICAN INC 5.70000% 15-15.08.35	1 700 000.00	2 033 511.61	0.04
USD REYNOLDS GROUP INC/LLC/LUX 5.75000% 12-15.10.20	960 000.00	932 483.20	0.02
USD RIO TINTO FINANCE USA LTD 3.75000% 15-15.06.25	2 585 000.00	2 806 069.20	0.05
USD ROGERS COMMUNICATIONS INC 3.62500% 15-15.12.25	1 520 000.00	1 647 098.44	0.03
USD ROGERS COMMUNICATIONS INC 2.90000% 16-15.11.26	2 000 000.00	2 085 623.40	0.04
USD ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC-SUB 6.10000% 13-10.06.23	3 145 000.00	3 493 545.89	0.06
USD ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC-SUB 6.00000% 13-19.12.23	1 610 000.00	1 811 469.77	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 - U S マルチ・クレジット

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC 3.87500% 16-12.09.23	4 075 000.00	4 311 698.82	0.08
USD ROYAL BANK OF SCOTLAND PLC-SUB 5.12500% 14-28.05.24	2 115 000.00	2 330 589.99	0.04
USD SALESFORCE.COM INC 3.25000% 18-11.04.23	5 382 000.00	5 645 962.34	0.10
USD SANDS CHINA LTD 4.60000% 19-08.08.23	800 000.00	846 712.00	0.01
USD SANTANDER HOLDINGS USA INC 4.40000% 18-13.07.27	3 861 000.00	4 227 230.52	0.07
USD SANTANDER HOLDINGS USA INC 3.40000% 18-18.01.23	577 000.00	596 906.96	0.01
USD SANTANDER HOLDINGS USA INC 3.50000% 19-07.06.24	2 346 000.00	2 447 532.06	0.04
USD SANTANDER UK GROUP HOLD PLC 2.87500% 15-16.10.20	2 500 000.00	2 515 090.00	0.04
USD SANTANDER UK GROUP HOLD PLC 3.57100% 17-10.01.23	6 370 000.00	6 546 255.99	0.12
USD SANTANDER UK PLC 3.40000% 18-01.06.21	2 820 000.00	2 882 442.41	0.05
USD SANTANDER UK PLC 3.75000% 18-15.11.21	2 695 000.00	2 788 181.24	0.05
USD SASOL FINANCING USA LLC 5.87500% 18-27.03.24	1 070 000.00	1 145 435.00	0.02
USD SEMPRA ENERGY 2.90000% 18-01.02.23	1 500 000.00	1 544 711.10	0.03
USD SEMPRA ENERGY 3.40000% 18-01.02.28	5 487 000.00	5 820 824.14	0.10
USD SENIOR HOUSING PROPERTIES TRUST 6.75000% 10-15.04.20	820 000.00	822 750.03	0.01
USD SENIOR HOUSING PROPERTIES TRUST 6.75000% 11-15.12.21	1 450 000.00	1 539 212.56	0.03
USD SERVICE PROPERTIES TRUST 4.65000% 14-15.03.24	1 769 000.00	1 863 826.01	0.03
USD SERVICE PROPERTIES TRUST 5.25000% 16-15.02.26	5 000 000.00	5 424 016.50	0.10
USD SERVICE PROPERTIES TRUST 4.35000% 19-01.10.24	1 135 000.00	1 195 442.83	0.02
USD SERVICE PROPERTIES TRUST 4.75000% 19-01.10.26	1 135 000.00	1 202 803.54	0.02
USD SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 3.50000% 18-13.11.23	2 600 000.00	2 765 349.34	0.05
USD SHERWIN-WILLIAMS CO 3.45000% 17-01.06.27	2 825 000.00	3 040 573.77	0.05
USD SHERWIN-WILLIAMS CO 2.95000% 19-15.08.29	2 225 000.00	2 300 534.08	0.04
USD SHIRE ACQUISITIONS INVT IRELAND DAC 2.40000% 16-23.09.21	3 450 000.00	3 480 519.73	0.06
USD SHIRE ACQUISITIONS INVT IRELAND DAC 2.87500% 16-23.09.23	6 955 000.00	7 153 998.54	0.13
USD SHIRE ACQUISITIONS INVT IRELAND DAC 3.20000% 16-23.09.26	4 765 000.00	5 013 853.08	0.09
USD SIMON PROPERTY GROUP LP 2.00000% 19-13.09.24	9 935 000.00	10 011 609.78	0.18
USD SK TELECOM CO LTD-144A 3.75000% 18-16.04.23	2 505 000.00	2 618 355.51	0.05
USD SOCIETE GENERALE SA-144A-SUB 4.25000% 15-14.04.25	2 165 000.00	2 318 318.59	0.04
USD SOCIETE GENERALE SA-144A-SUB 4.75000% 15-24.11.25	2 930 000.00	3 230 838.63	0.06
USD SOUTHERN CO 2.75000% 15-15.06.20	3 200 000.00	3 206 855.68	0.06
USD SOUTHERN CO 3.25000% 16-01.07.26	615 000.00	654 626.84	0.01
USD SOUTHERN CO GAS CAPITAL CORP 3.25000% 16-15.06.26	1 665 000.00	1 769 426.63	0.03
USD SOUTHWEST GAS CORP 3.70000% 18-01.04.28	1 250 000.00	1 355 937.50	0.02
USD SOUTHWESTERN ELECTRIC POWER 3.55000% 12-15.02.22	1 000 000.00	1 029 154.20	0.02
USD SPECTRA ENERGY PARTNERS LP 3.50000% 15-15.03.25	900 000.00	958 028.49	0.02
USD SPIRE INC 3.54300% 17-27.02.24	1 500 000.00	1 550 332.80	0.03
USD SPIRIT AEROSYSTEMS INC 4.60000% 18-15.06.28	1 975 000.00	2 029 566.88	0.04
USD SPIRIT REALTY LP 3.20000% 19-15.01.27	1 546 000.00	1 590 911.30	0.03
USD SPIRIT REALTY LP 3.40000% 19-15.01.30	2 660 000.00	2 778 542.90	0.05
USD SPIRIT REALTY LP 4.00000% 19-15.07.29	3 829 000.00	4 165 523.52	0.07
USD SPIRIT REALTY LP 4.45000% 17-15.09.26	2 710 000.00	2 997 280.60	0.05
USD STARBUCKS CORP 3.80000% 18-15.08.25	4 368 000.00	4 780 337.89	0.08
USD STATE STREET CORP-SUB 3.10000% 13-15.05.23	1 900 000.00	1 980 644.93	0.03
USD STEEL DYNAMICS INC 3.45000% 19-15.04.30	2 960 000.00	3 053 447.20	0.05
USD STORE CAPITAL CORP 4.62500% 19-15.03.29	892 000.00	1 019 027.22	0.02
USD STRYKER CORP 2.62500% 16-15.03.21	1 323 000.00	1 335 373.76	0.02
USD STRYKER CORP 3.50000% 16-15.03.26	1 000 000.00	1 084 124.20	0.02
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 2.78400% 17-12.07.22	5 150 000.00	5 252 742.50	0.09
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 3.10200% 18-17.01.23	5 510 000.00	5 692 876.90	0.10
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 3.74800% 18-19.07.23	2 740 000.00	2 908 152.98	0.05
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 2.69600% 19-16.07.24	2 925 000.00	2 997 598.50	0.05
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 2.44800% 19-27.09.24	7 535 000.00	7 639 962.55	0.13
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 2.34800% 20-15.01.25	2 915 000.00	2 940 331.35	0.05
USD SUNOCO LOGISTICS PARTNERS OPERATIONS LP 3.90000% 16-15.07.26	750 000.00	785 585.93	0.01
USD SUNOCO LOGISTICS PARTNERS OPERATIONS LP 4.00000% 17-01.10.27	1 000 000.00	1 048 185.00	0.02
USD SYNCHRONY BANK 3.00000% 17-15.06.22	5 000 000.00	5 120 637.00	0.09
USD SYNCHRONY FINANCIAL 4.25000% 14-15.08.24	544 000.00	583 595.26	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 - U S マルチ・クレジット

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD SYNCHRONY FINANCIAL 4.50000% 15-23.07.25	4 550 000.00	4 945 832.71	0.09
USD SYNCHRONY FINANCIAL 3.95000% 17-01.12.27	586 000.00	624 714.80	0.01
USD SYNCHRONY FINANCIAL 4.37500% 19-19.03.24	389 000.00	417 882.55	0.01
USD T-MOBILE USA INC 4.75000% 18-01.02.28	56 000.00	59 570.00	0.00
USD T-MOBILE USA INC 6.00000% 14-01.03.23	134 000.00	136 449.52	0.00
USD T-MOBILE USA INC 6.00000% 16-15.04.24	389 000.00	400 426.88	0.01
USD T-MOBILE USA INC 6.50000% 13-15.01.24	657 000.00	674 246.25	0.01
USD TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 4.40000% 19-26.11.23	2 853 000.00	3 088 486.62	0.05
USD TAQA ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO-144A 4.37500% 18-23.04.25	2 229 000.00	2 416 375.31	0.04
USD TARGET CORP 3.37500% 19-15.04.29	2 670 000.00	2 932 977.64	0.05
USD TC PIPELINES LP 4.37500% 15-13.03.25	500 000.00	538 692.25	0.01
USD TD AMERITRADE HOLDING COPR 3.75000% 18-01.04.24	5 000 000.00	5 375 807.00	0.09
USD TELEFLEX INC 4.62500% 17-15.11.27	172 000.00	181 030.00	0.00
USD TELEFONICA EMISIONES SAU 5.46200% 11-16.02.21	1 700 000.00	1 763 014.75	0.03
USD TELEFONICA EMISIONES SA 4.10300% 17-08.03.27	2 440 000.00	2 695 993.09	0.05
USD TENET HEALTHCARE CORP 4.62500% 17-15.07.24	225 000.00	230 625.00	0.00
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE CO BV 3.65000% 11-10.11.21	3 578 000.00	3 546 692.50	0.06
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 2.20000% 16-21.07.21	3 051 000.00	3 008 286.00	0.05
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 3.15000% 16-01.10.26	6 750 000.00	5 779 687.50	0.10
USD TEXAS INSTRUMENTS INC 2.90000% 17-03.11.27	2 019 000.00	2 156 577.08	0.04
USD THE HERSHEY CO 3.10000% 18-15.05.21	2 015 000.00	2 055 502.50	0.04
USD THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 3.00000% 16-15.04.23	2 000 000.00	2 070 826.60	0.04
USD TIME WARNER CABLE LLC 5.00000% 09-01.02.20	1 000 000.00	1 000 000.00	0.02
USD TOLL BROTHERS FINANCE CORP 4.87500% 15-15.11.25	965 000.00	1 055 468.75	0.02
USD TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 3.75000% 14-10.04.24	1 200 000.00	1 292 390.16	0.02
USD TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 3.45500% 19-19.02.29	1 040 000.00	1 145 476.38	0.02
USD TOTAL CAPITAL SA 3.88300% 18-11.10.28	4 405 000.00	5 001 877.06	0.09
USD TOYOTA INDUSTRIES CORP-144A 3.11000% 19-12.03.22	4 500 000.00	4 595 355.00	0.08
USD TOYOTA MOTOR CORP 2.15700% 19-02.07.22	2 250 000.00	2 279 116.13	0.04
USD TRANSOCEAN PHOENIX 2 LTD-144A 7.75000% 16-15.10.24	249 000.00	184 758.00	0.00
USD TRANSOCEAN PROTEUS LTD-144A 6.25000% 16-01.12.24	150 000.00	107 887.50	0.00
USD TRIMBLE INC 4.15000% 18-15.06.23	1 460 000.00	1 555 433.33	0.03
USD TRINITY ACQUISITION PLC 4.40000% 16-15.03.26	700 000.00	778 697.71	0.01
USD TRIVIUM PACKAGING FINANCE BV-144A 5.50000% 19-15.08.26	250 000.00	263 437.50	0.00
USD TRUIST BANK 2.80000% 19-17.05.22	2 220 000.00	2 270 161.35	0.04
USD TRUIST BANK 4.05000% 18-03.11.25	5 250 000.00	5 865 014.93	0.10
USD TUCSON ELECTRIC POWER CO 5.15000% 11-15.11.21	220 000.00	230 032.99	0.00
USD TYCO ELECTRONICS GROUP SA 3.45000% 14-01.08.24	690 000.00	732 414.44	0.01
USD TYSON FOODS INC 3.95000% 14-15.08.24	2 000 000.00	2 167 962.80	0.04
USD TYSON FOODS INC 4.00000% 19-01.03.26	6 548 000.00	7 215 873.74	0.13
USD UBS GROUP AG-144A 4.12500% 16-15.04.26	2 000 000.00	2 207 255.20	0.04
USD UBS GROUP AG-REG-S 3.00000% 16-15.04.21	2 500 000.00	2 538 469.25	0.04
USD UBS GROUP AG-REG-S 4.12500% 15-24.09.25	2 100 000.00	2 318 251.53	0.04
USD UNILEVER CAPITAL CORP 2.75000% 18-22.03.21	2 740 000.00	2 772 581.06	0.05
USD UNION ELECTRIC CO 2.95000% 17-15.06.27	1 555 000.00	1 639 147.73	0.03
USD UNION PACIFIC CORP 1.80000% 15-01.02.20	1 800 000.00	1 800 000.00	0.03
USD UNION PACIFIC CORP 3.95000% 18-10.09.28	1 135 000.00	1 282 065.12	0.02
USD UNION PACIFIC CORP 3.15000% 19-01.03.24	2 800 000.00	2 943 788.12	0.05
USD UNITED AIRLINES 2014-2 CLAS A PAS THR 3.75000% 14-03.09.26	4 500 000.00	3 745 081.08	0.07
USD UNITED PARCEL SERVICE INC 2.20000% 19-01.09.24	6 230 000.00	6 352 982.69	0.11
USD UNITED TECHNOLOGIES CORP 2.30000% 17-04.05.22	1 950 000.00	1 973 430.42	0.03
USD UNITED TECHNOLOGIES CORP 4.12500% 18-16.11.28	4 725 000.00	5 438 884.18	0.10
USD UNITED TECHNOLOGIES CORP 3.65000% 18-16.08.23	2 970 000.00	3 160 735.77	0.06
USD UNITED TECHNOLOGIES CORP 3.95000% 18-16.08.25	5 637 000.00	6 220 642.58	0.11
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 3.37500% 17-15.04.27	2 315 000.00	2 496 104.54	0.04
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 3.85000% 18-15.06.28	4 361 000.00	4 882 742.19	0.09
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 3.50000% 18-15.02.24	2 830 000.00	3 016 311.06	0.05
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 2.37500% 19-15.08.24	1 640 000.00	1 675 987.83	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 - U S マルチ・クレジット

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC-REG-S 4.75000% 16-01.08.22	2 000 000.00	2 013 788.00	0.04
USD UNUM GROUP 4.00000% 19-15.06.29	2 000 000.00	2 175 819.00	0.04
USD US BANCORP 2.40000% 19-30.07.24	2 915 000.00	2 993 780.79	0.05
USD VENTAS REALITY LP 3.75000% 14-01.05.24	535 000.00	568 856.94	0.01
USD VENTAS REALTY LP 3.12500% 16-15.06.23	2 805 000.00	2 900 049.95	0.05
USD VENTAS REALTY LP 3.85000% 17-01.04.27	850 000.00	919 504.42	0.02
USD VEREIT OPERATING PARTNERSHIP LP 4.62500% 18-01.11.25	1 985 000.00	2 214 270.48	0.04
USD VERISK ANALYTICS INC 4.00000% 15-15.06.25	1 491 000.00	1 633 489.50	0.03
USD VERISK ANALYTICS INC 4.12500% 19-15.03.29	4 734 000.00	5 323 658.52	0.09
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 4.27200% 15-15.01.36	1 500 000.00	1 757 484.15	0.03
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.62500% 16-15.08.26	5 245 000.00	5 433 758.64	0.10
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 4.12500% 17-16.03.27	2 600 000.00	2 933 221.46	0.05
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 4.50000% 17-10.08.33	5 305 000.00	6 383 140.98	0.11
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.37600% 18-15.02.25	3 008 000.00	3 213 313.45	0.06
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 4.32900% 18-21.09.28	2 429 000.00	2 809 638.15	0.05
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.87500% 19-08.02.29	1 275 000.00	1 436 558.18	0.03
USD VIACOMCBS INC 2.25000% 16-04.02.22	921 000.00	920 407.29	0.02
USD VIACOMCBS INC 3.87500% 14-01.04.24	1 400 000.00	1 504 042.40	0.03
USD VIRGIN MEDIA SECURED FINANCE PLC-144A 5.50000% 19-15.05.29	500 000.00	526 250.00	0.01
USD VISA INC 2.15000% 17-15.09.22	1 000 000.00	1 016 254.20	0.02
USD VISA INC 2.20000% 15-14.12.20	2 055 000.00	2 063 795.81	0.04
USD VMWARE INC 2.95000% 17-21.08.22	663 000.00	678 474.28	0.01
USD VODAFONE GROUP PLC 4.37500% 18-30.05.28	4 241 000.00	4 812 340.31	0.08
USD VORNADO REALTY LP 3.50000% 17-15.01.25	4 600 000.00	4 879 905.40	0.09
USD VOYA FINANCIAL INC 3.12500% 17-15.07.24	2 000 000.00	2 095 628.80	0.04
USD WABTEC CORP/DE 3.45000% 17-15.11.26	2 875 000.00	2 970 081.14	0.05
USD WALMART INC 2.65000% 17-15.12.24	5 950 000.00	6 208 755.98	0.11
USD WALMART INC 2.85000% 19-08.07.24	2 675 000.00	2 809 195.92	0.05
USD WALMART INC 3.05000% 19-08.07.26	4 720 000.00	5 050 429.74	0.09
USD WALMART INC 3.25000% 19-08.07.29	2 715 000.00	2 980 256.31	0.05
USD WALMART INC 3.40000% 18-26.06.23	2 840 000.00	3 010 186.43	0.05
USD WALT DISNEY CO 1.65000% 19-01.09.22	3 165 000.00	3 177 056.75	0.06
USD WALT DISNEY CO 1.75000% 19-30.08.24	7 700 000.00	7 725 847.36	0.14
USD WASTE MANAGEMENT INC 3.20000% 19-15.06.26	3 030 000.00	3 236 359.36	0.06
USD WEIBO CORP 3.50000% 19-05.07.24	3 269 000.00	3 386 479.68	0.06
USD WELLS FARGO & CO 3.00000% 16-22.04.26	2 000 000.00	2 090 331.20	0.04
USD WELLS FARGO & CO 3.00000% 16-23.10.26	6 065 000.00	6 344 894.30	0.11
USD WELLS FARGO & CO 3.06900% 17-24.01.23	4 330 000.00	4 426 700.16	0.08
USD WELLS FARGO & CO-SUB 4.12500% 13-15.08.23	6 520 000.00	6 990 337.15	0.12
USD WELLS FARGO CO 3.50000% 12-08.03.22	5 000 000.00	5 180 184.00	0.09
USD WELLTOWER INC 3.10000% 19-15.01.30	3 275 000.00	3 415 115.30	0.06
USD WELLTOWER INC 3.62500% 19-15.03.24	3 128 000.00	3 326 117.51	0.06
USD WELLTOWER INC 3.95000% 18-01.09.23	1 975 000.00	2 106 356.46	0.04
USD WELLTOWER INC 4.00000% 15-01.06.25	3 467 000.00	3 787 836.53	0.07
USD WESTERN GAS PARTNERS LP 4.65000% 16-01.07.26	3 995 000.00	4 184 967.04	0.07
USD WESTERN MIDSTREAM OPERATING LP 3.10000% 20-01.02.25	690 000.00	694 029.60	0.01
USD WESTERN MIDSTREAM OPERATING LP 4.05000% 20-01.02.30	9 540 000.00	9 509 251.14	0.17
USD WESTERN UNION CO 2.85000% 19-10.01.25	2 825 000.00	2 891 606.43	0.05
USD WEYERHAEUSER CO 3.25000% 12-15.03.23	2 400 000.00	2 475 830.40	0.04
USD WILLIAMS COS INC/THE LP 3.35000% 12-15.08.22	1 000 000.00	1 029 678.70	0.02
USD WILLIAMS COS INC/THE 4.50000% 13-15.11.23	3 300 000.00	3 569 538.72	0.06
USD WILLIAMS COS INC/THE 4.30000% 14-04.03.24	2 620 000.00	2 813 817.12	0.05
USD WILLIAMS COS INC/THE 3.90000% 14-15.01.25	1 000 000.00	1 066 438.90	0.02
USD WILLIS NORTH AMERICA INC 3.60000% 17-15.05.24	975 000.00	1 037 653.40	0.02
USD WILLIS TOWERS WATSON PLC 5.75000% 11-15.03.21	600 000.00	625 022.94	0.01
USD WISCONSIN ENERGY CORP 3.10000% 19-08.03.22	5 900 000.00	6 058 308.80	0.11
USD WOODSIDE FINANCE LTD-REG-S 3.70000% 17-15.03.28	2 175 000.00	2 304 108.00	0.04
USD WP CAREY INC 3.85000% 19-15.07.29	3 208 000.00	3 466 975.43	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 - U S マルチ・クレジット

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD WR BERKLEY CORP 4.62500% 12-15.03.22	2 220 000.00	2 347 377.39	0.04
USD XCEL ENERGY INC 2.60000% 19-01.12.29	3 270 000.00	3 313 077.02	0.06
USD ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC 3.15000% 15-01.04.22	3 780 000.00	3 874 475.43	0.07
USD ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC 3.70000% 18-19.03.23	1 000 000.00	1 050 250.60	0.02
米ドル合計		2 614 650 792.05	46.10
ノート、固定利付債合計		2 615 228 614.18	46.11
ノート、変動利付債			
USD			
USD AEGON NV-SUB 5.500%/VAR 18-11.04.48	1 182 000.00	1 307 894.82	0.02
USD ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 3M LIBOR+74BP 18-12.01.24	1 581 000.00	1 599 173.12	0.03
USD BANK OF AMERICA CORP 3.366%/VAR 18-23.01.26	12 185 000.00	12 945 526.78	0.23
USD BANK OF AMERICA CORP 3.550%/3M LIBOR+78BP 18-05.03.24	9 755 000.00	10 219 389.70	0.18
USD BARCLAYS PLC 3.932%/VAR 19-07.05.25	2 750 000.00	2 928 704.63	0.05
USD BARCLAYS PLC 4.610%/VAR 18-15.02.23	4 269 000.00	4 473 573.47	0.08
USD BARCLAYS PLC 5.088%/VAR 19-20.06.30	1 000 000.00	1 148 860.60	0.02
USD BBVA BANCOMER SA/TEXAS-144A-SUB 5.875%/VAR 19-13.09.34	1 590 000.00	1 762 912.50	0.03
USD BNP PARIBAS-144A-SUB 7.625%/VAR 16-PRP	946 000.00	995 665.00	0.02
USD CITIGROUP INC 2.876%/VAR 17-24.07.23	4 600 000.00	4 696 411.86	0.08
USD CITIGROUP INC 3.142%/3M LIBOR+72.2BP 18-24.01.23	6 240 000.00	6 382 437.98	0.11
USD CITIGROUP INC 3.352%/VAR 19-24.04.25	2 750 000.00	2 893 806.30	0.05
USD CITIGROUP INC 3.520%/VAR 17-27.10.28	5 010 000.00	5 388 792.08	0.09
USD CITIGROUP INC 3.980%/3M LIBOR+133.8BP 19-20.03.30	8 580 000.00	9 589 552.83	0.17
USD CITIGROUP INC-SUB 5.950%/VAR 15-PRP	3 100 000.00	3 154 250.00	0.06
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-144A 2.997%/VAR 17-14.12.23	515 000.00	527 914.45	0.01
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-144A 3.869%/VAR 18-12.01.29	1 300 000.00	1 414 282.48	0.02
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-144A-SUB 6.375%/VAR 19-PRP	1 403 000.00	1 555 576.25	0.03
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S 2.593%/VAR 19-11.09.25	2 375 000.00	2 413 930.76	0.04
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S-SUB 6.250%/VAR 14-PRP	1 600 000.00	1 763 910.40	0.03
USD DANSKE BANK AS-144A 3.244%/3M LIBOR+159.1BP 19-20.12.25	650 000.00	672 717.50	0.01
USD DISCOVER BANK-SUB 4.682%/VAR 18-09.08.28	2 158 000.00	2 283 811.40	0.04
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3M LIBOR+127BP 17-28.03.22	1 500 000.00	1 493 814.17	0.03
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 3M LIBOR+111BP 17-26.04.22	2 300 000.00	2 324 391.50	0.04
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 2.905%/VAR 17-24.07.23	12 510 000.00	12 774 418.87	0.23
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 2.876%/3M LIBOR+82.1BP 17-31.10.22	3 000 000.00	3 051 790.80	0.05
USD HSBC HOLDINGS PLC 2.633%/VAR 19-07.11.25	2 815 000.00	2 862 184.47	0.05
USD HSBC HOLDINGS PLC 3.950%/VAR 18-18.05.24	4 500 000.00	4 764 503.25	0.08
USD HSBC HOLDINGS PLC 3.803%/VAR 19-11.03.25	2 400 000.00	2 548 320.72	0.04
USD HSBC HOLDINGS PLC 3.973%/VAR 19-22.05.30	5 325 000.00	5 856 349.26	0.10
USD HSBC HOLDINGS PLC 4.583%/VAR 18-19.06.29	3 848 000.00	4 394 199.36	0.08
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.782%/VAR 17-01.02.28	6 635 000.00	7 271 693.94	0.13
USD JPMORGAN CHASE & CO 2.776%/VAR 17-25.04.23	4 485 000.00	4 576 184.54	0.08
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.540%/VAR 17-01.05.28	2 075 000.00	2 246 624.08	0.04
USD JPMORGAN CHASE & CO 4.452%/3M LIBOR+133BP 18-05.12.29	11 365 000.00	13 208 264.34	0.23
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.960%/3M LIBOR+124.5BP 19-29.01.27	3 874 000.00	4 256 616.00	0.08
USD JPMORGAN CHASE & CO 2.301%/VAR 19-15.10.25	5 175 000.00	5 256 913.00	0.09
USD LLOYDS BANKING GROUP 2.858%/VAR 19-17.03.23	1 250 000.00	1 269 942.00	0.02
USD MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 3.922%/VAR 18-11.09.24	14 385 000.00	15 247 236.90	0.27
USD MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 2.555%/VAR 19-13.09.25	2 840 000.00	2 874 648.00	0.05
USD MORGAN STANLEY 3.591%/VAR 17-22.07.28	360 000.00	389 731.03	0.01
USD MORGAN STANLEY 3.737%/VAR 18-24.04.24	9 765 000.00	10 309 543.27	0.18
USD MORGAN STANLEY 3M LIBOR+93BP 17-22.07.22	3 000 000.00	3 030 818.10	0.05
USD NATIONWIDE BUIL SOC-144A 3.766%/3M LIBOR+106.4BP 18-08.03.24	2 000 000.00	2 089 616.00	0.04
USD NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-144A 4.363%/VAR 18-01.08.24	2 512 000.00	2 686 880.92	0.05
USD PRINCIPAL FINANCIAL GROUP-SUB 4.700%/VAR 15-15.05.55	2 686 000.00	2 696 072.50	0.05
USD PRUDENTIAL FINANCIAL-SUB 5.200%/3M LIBOR+304BP 13-15.03.44	1 849 000.00	1 971 976.99	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 - U S マルチ・クレジット

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC-SUB 8.625%/VAR 16-PRP	2 900 000.00	3 132 000.00	0.06
USD ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC 4.269%/VAR 19-22.03.25	3 470 000.00	3 727 734.95	0.07
USD ROYAL BK OF SCOTLAND GP PLC 4.519%/VAR 18-25.06.24	510 000.00	547 445.02	0.01
USD ROYAL BK OF SCOTLAND GP PLC 4.445%/VAR 19-08.05.30	1 220 000.00	1 380 113.90	0.02
USD SANTANDER UK GRP HOLD PLC 4.796%/3M LIBOR+157BP 18-15.11.24	350 000.00	381 542.74	0.01
USD SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN-REG-S-SUB 5.625%/VAR 17-PRP	400 000.00	416 500.00	0.01
USD SL GREEN OPERATING PARTNERSHIP 3M LIBOR+98BP 18-16.08.21	620 000.00	620 154.88	0.01
USD STANDARD CHARTERED PLC-144A-SUB 6.409%/3M LIBOR+151BP 06-PRP	200 000.00	182 000.00	0.00
USD STANDARD CHARTERED PLC-144A 4.247%/VAR 18-20.01.23	970 000.00	1 006 305.74	0.02
USD STANDARD CHARTERED PLC-144A 3.785%/VAR 19-21.05.25	2 086 000.00	2 194 890.66	0.04
USD STANDARD CHARTERED PLC-144A 2.819%/VAR 20-30.01.26	6 500 000.00	6 581 929.90	0.12
USD SWISS RE FINANCE LUXEMBOURG-144A-SUB 5.000%/VAR 19-02.04.49	3 024 000.00	3 436 020.00	0.06
USD UBS GROUP AG-144A 2.859%/VAR 17-15.08.23	1 960 000.00	2 002 794.25	0.04
USD WABTEC CORP/DE STEP-UP/RATING LINKED 18-15.03.24	7 281 000.00	7 883 369.51	0.14
米ドル合計		233 064 630.47	4.11
ノート、変動利付債合計		233 064 630.47	4.11
中期債券、固定利付債			
USD 3M CO 3.25000% 18-14.02.24	2 560 000.00	2 709 259.77	0.05
USD AIR LEASE CORP 2.30000% 20-01.02.25	6 535 000.00	6 541 308.89	0.11
USD AMERICAN HONDA FINANCE CORP 3.55000% 19-12.01.24	4 330 000.00	4 616 502.24	0.08
USD AMERICAN HONDA FINANCE CORP 2.35000% 20-08.01.27	1 860 000.00	1 888 576.11	0.03
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 4.20000% 14-26.08.24	2 515 000.00	2 735 740.80	0.05
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 4.45000% 16-03.03.26	10 545 000.00	11 776 822.61	0.21
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 4.18300% 16-25.11.27	4 650 000.00	5 154 690.53	0.09
USD BANK OF NEW YORK MELLON CORP 2.80000% 16-04.05.26	2 000 000.00	2 106 588.40	0.04
USD BANK OF NEW YORK MELLON CORP 2.20000% 16-16.08.23	2 000 000.00	2 032 404.20	0.04
USD BANK OF NEW YORK MELLON CORP 3.25000% 14-11.09.24	365 000.00	388 555.39	0.01
USD BANK OF NEW YORK MELLON CORP 3.50000% 18-28.04.23	2 500 000.00	2 640 632.50	0.05
USD BANK OF NEW YORK MELLON CORP 3.45000% 18-11.08.23	5 930 000.00	6 284 063.70	0.11
USD BB&T CORP 2.50000% 19-01.08.24	2 950 000.00	3 026 159.56	0.05
USD CATERPILLAR FINANCIAL SERVICES CORP 3.15000% 18-07.09.21	1 650 000.00	1 690 361.81	0.03
USD CATERPILLAR FINANCIAL SERVICES CORP 3.65000% 18-07.12.23	2 115 000.00	2 258 909.67	0.04
USD CITIZENS BANK NA/PROVIDENCE RI 2.55000% 16-13.05.21	3 650 000.00	3 684 544.70	0.06
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 3.37500% 18-12.05.21	689 000.00	698 046.08	0.01
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.21900% 15-09.01.22	545 000.00	551 273.49	0.01
USD GENERAL ELECTRIC CO 6.75000% 02-15.03.32	265 000.00	353 514.72	0.01
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 4.00000% 14-03.03.24	3 600 000.00	3 886 006.32	0.07
USD JOHN DEERE CAPITAL CORP 3.12500% 18-10.09.21	991 000.00	1 014 038.96	0.02
USD JOHN DEERE CAPITAL CORP 3.20000% 19-10.01.22	1 570 000.00	1 618 500.44	0.03
USD JOHN DEERE CAPITAL CORP 2.80000% 19-18.07.29	2 900 000.00	3 045 997.31	0.05
USD MORGAN STANLEY 3.12500% 18-23.01.23	4 000 000.00	4 150 398.80	0.07
USD MORGAN STANLEY 3.12500% 16-27.07.26	2 200 000.00	2 329 270.46	0.04
USD MORGAN STANLEY 3.87500% 16-27.01.26	10 725 000.00	11 745 772.25	0.21
USD MORGAN STANLEY 4.00000% 15-23.07.25	3 260 000.00	3 581 884.57	0.06
USD MORGAN STANLEY-SUB 3.95000% 15-23.04.27	1 600 000.00	1 743 269.60	0.03
USD MORGAN STANLEY-SUB 4.35000% 14-08.09.26	7 435 000.00	8 279 766.19	0.15
USD MORGAN STANLEY-SUB 4.10000% 13-22.05.23	6 470 000.00	6 893 348.92	0.12
USD PNC BANK NATIONAL ASSOCIATION 2.15000% 16-29.04.21	3 000 000.00	3 018 864.90	0.05
USD PUBLIC SERVICE ELECTRIC & GAS CO 3.00000% 17-15.05.27	455 000.00	483 768.92	0.01
USD PUBLIC SERVICE ELECTRIC & GAS CO 3.70000% 18-01.05.28	835 000.00	934 002.11	0.02
USD PUBLIC SERVICE ELECTRIC & GAS CO 3.65000% 18-01.09.28	1 530 000.00	1 707 705.06	0.03
USD PUBLIC SERVICE ELECTRIC & GAS CO 3.20000% 19-15.05.29	820 000.00	888 922.72	0.02
USD ROYAL BANK OF CANADA 2.55000% 19-16.07.24	2 985 000.00	3 075 571.77	0.05
USD RYDER SYSTEM INC 3.65000% 19-18.03.24	6 165 000.00	6 561 309.63	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 - U S マルチ・クレジット

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BD-144A 3.25000% 16-26.10.26	1 640 000.00	1 724 460.00	0.03
USD TENCENT HOLDINGS LTD-144A 3.28000% 19-11.04.24	5 800 000.00	6 057 984.00	0.11
USD TENCENT HOLDINGS LTD-144A 3.97500% 19-11.04.29	8 860 000.00	9 754 083.87	0.17
USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.57500% 19-11.04.26	480 000.00	509 596.56	0.01
USD TENCENT HOLDINGS LTD-REG-S 3.97500% 19-11.04.29	1 845 000.00	2 038 148.44	0.04
USD TORONTO-DOMINION BANK 3.25000% 19-11.03.24	7 950 000.00	8 406 012.00	0.15
USD US BANCORP 2.35000% 16-29.01.21	2 850 000.00	2 866 932.71	0.05
USD US BANCORP 2.62500% 17-24.01.22	2 455 000.00	2 500 680.92	0.04
USD US BANCORP 3.95000% 18-17.11.25	2 700 000.00	3 010 357.98	0.05
USD WALT DISNEY CO/THE 1.80000% 17-05.06.20	2 000 000.00	2 000 469.00	0.03
USD WELLS FARGO & CO 2.62500% 17-22.07.22	3 215 000.00	3 278 566.34	0.06
USD WELLS FARGO & CO 3.30000% 14-09.09.24	1 400 000.00	1 484 933.24	0.03
USD WELLS FARGO & CO 3.75000% 19-24.01.24	4 795 000.00	5 121 071.51	0.09
USD WELLS FARGO & CO 4.15000% 19-24.01.29	4 242 000.00	4 822 031.99	0.08
米ドル合計		179 671 682.66	3.17

中期債券、固定利付債合計	179 671 682.66	3.17
--------------	----------------	------

中期債券、変動利付債

USD			
USD BANK OF AMERICA CORP 3.124%/VAR 17-20.01.23	541 000.00	553 935.96	0.01
USD BANK OF AMERICA CORP 3.824%/VAR 17-20.01.28	2 910 000.00	3 189 455.46	0.06
USD BANK OF AMERICA CORP 3.593%/VAR 17-21.07.28	22 980 000.00	24 931 029.57	0.44
USD BANK OF AMERICA CORP 3.970%/3M LIBOR+107BP 18-05.03.29	1 000 000.00	1 112 755.40	0.02
USD BANK OF AMERICA CORP 3.458%/3M LIBOR+97BP 19-15.03.25	7 270 000.00	7 694 782.46	0.13
USD BANK OF AMERICA CORP 3.559%/VAR 19-23.04.27	8 410 000.00	9 055 588.61	0.16
USD BANK OF AMERICA CORP 3.194%/VAR 19-23.07.30	11 110 000.00	11 791 386.31	0.21
USD BANK OF AMERICA CORP 2.884%/VAR 19-22.10.30	5 350 000.00	5 531 006.55	0.10
USD BANK OF NEW YORK MELLON CORP 2.661%/VAR 17-16.05.23	1 360 000.00	1 387 352.73	0.02
USD MORGAN STANLEY 2.720%/VAR 19-22.07.25	5 965 000.00	6 137 622.92	0.11
USD MORGAN STANLEY 4.431%/VAR 19-23.01.30	1 086 000.00	1 252 850.55	0.02
USD NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-144A 3.622%/VAR 19-26.04.23	3 105 000.00	3 209 287.33	0.06
USD ROYAL BANK OF SC PLC-SUB 7.64000%/3M LIBOR+232BP 07-PRP	700 000.00	698 439.00	0.01
USD SVENSKA HANDELSBANKEN AB-REG-S-SUB 6.250%/VAR 19-PRP	600 000.00	652 500.00	0.01
USD WELLS FARGO & CO 3.584%/VAR 17-22.05.28	4 350 000.00	4 702 993.36	0.08
米ドル合計		81 900 986.21	1.44

中期債券、変動利付債合計	81 900 986.21	1.44
--------------	---------------	------

債券、固定利付債

EUR			
EUR MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 2.25000% 19-07.03.39	200 000.00	262 721.42	0.01
EUR THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 0.50000% 19-01.03.28	1 100 000.00	1 228 031.00	0.02
ユーロ合計		1 490 752.42	0.03

USD			
USD ABU DHABI GOVERNMENT OF-144A 2.50000% 19-30.09.29	2 250 000.00	2 280 937.50	0.04
USD ACE CAPITAL TRUST II-SUB 9.70000% 00-01.04.30	779 000.00	1 191 870.00	0.02
USD ANDEAVR LOGIST LP/TESRO LOGIST FIN CORP 3.50000% 17-01.12.22	0.00	741.00	0.00
USD ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 2.50000% 12-15.07.22	826 000.00	843 874.64	0.01
USD BAIDU INC 3.87500% 18-29.09.23	3 000 000.00	3 165 937.50	0.06
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 8.05000% 97-15.06.27	281 000.00	370 290.14	0.01
USD BRANCH BANKING & TRUST CO-SUB 3.80000% 14-30.10.26	6 200 000.00	6 836 347.54	0.12
USD BURLINGTON NORTHERN SANTA FE CORP 3.00000% 15-01.04.25	2 000 000.00	2 115 231.80	0.04
USD CITIGROUP INC-SUB 4.30000% 14-20.11.26	2 965 000.00	3 287 006.11	0.06
USD CK HUTCHISON INTERNATIONAL LTD-REG-S 3.25000% 19-11.04.24	2 745 000.00	2 864 579.07	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 - U S マルチ・クレジット

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD COMCAST CORP 3.37500% 14-15.02.25	5 940 000.00	6 338 989.80	0.11
USD COMMONSPIRIT HEALTH 2.76000% 19-01.10.24	2 990 000.00	3 088 956.45	0.05
USD COMMONWEALTH EDISON CO 3.70000% 18-15.08.28	520 000.00	580 011.28	0.01
USD CONSOLIDATED EDISON CO OF NEW YORK INC 4.00000% 18-01.12.28	2 580 000.00	2 951 696.73	0.05
USD CVS CAREMARK CORP 6.25000% 07-01.06.27	1 100 000.00	1 334 554.87	0.02
USD DISCOVER BANK 4.25000% 14-13.03.26	500 000.00	549 250.45	0.01
USD DTE ENERGY CO 3.80000% 17-15.03.27	4 300 000.00	4 648 619.49	0.08
USD ENERGY TRANSFER LP/REGENCY FIN CORP 5.87500% 14-01.03.22	330 000.00	351 491.11	0.01
USD ENERGY TRANSFER OPERATING LP 5.50000% 19-01.06.27	3 460 000.00	3 973 450.85	0.07
USD ENERGY TRANSFER PARTNERS LP 4.20000% 17-15.04.27	790 000.00	842 481.91	0.01
USD ENTERGY ARKANSAS LLC 3.05000% 13-01.06.23	1 035 000.00	1 070 782.02	0.02
USD ENTERGY LOUISIANA LLC 3.25000% 16-01.04.28	2 875 000.00	3 100 192.43	0.05
USD ENTERGY LOUISIANA LLC 4.00000% 18-15.03.33	465 000.00	545 794.17	0.01
USD ENTERGY TEXAS INC 4.00000% 19-30.03.29	3 895 000.00	4 415 924.69	0.08
USD EQUIFAX INC 3.95000% 18-15.06.23	900 000.00	959 760.54	0.02
USD EVERSOURCE ENERGY 2.75000% 17-15.03.22	1 270 000.00	1 294 331.80	0.02
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 4.35000% 17-17.01.27	2 035 000.00	2 182 706.61	0.04
USD HEATHROW FUNDING LTD-144A 4.87500% 11-15.07.21	2 183 000.00	2 260 900.14	0.04
USD INTERSTATE POWER & LIGHT CO 3.25000% 14-01.12.24	2 225 000.00	2 352 975.55	0.04
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.87500% 14-01.02.24	2 055 000.00	2 212 212.02	0.04
USD JPMORGAN CHASE & CO-SUB 5.30000% 15-PRP	333 000.00	335 354.31	0.01
USD KONINKLIJKE KPN NV 8.37500% 00-01.10.30	515 000.00	734 967.01	0.01
USD KROGER CO 3.70000% 17-01.08.27	925 000.00	1 007 012.54	0.02
USD MICROSOFT CORP 2.00000% 16-08.08.23	2 275 000.00	2 310 422.66	0.04
USD MICROSOFT CORP 2.40000% 16-08.08.26	1 485 000.00	1 539 698.34	0.03
USD MIZUHO FINANCE GROUP CAYMAN 3-144A-SUB 4.60000% 14-27.03.24	7 657 000.00	8 303 273.77	0.15
USD NEVADA POWER CO 2.40000% 20-01.05.30	4 000 000.00	4 008 712.00	0.07
USD PNC BANK NATIONAL ASSOCIATION-SUB 2.70000% 12-01.11.22	2 135 000.00	2 188 914.51	0.04
USD REYNOLDS AMERICAN INC 4.00000% 15-12.06.22	1 230 000.00	1 287 260.56	0.02
USD REYNOLDS AMERICAN INC 4.45000% 15-12.06.25	4 230 000.00	4 630 099.20	0.08
USD SABIC CAPITAL II BV-REG-S 4.00000% 18-10.10.23	1 650 000.00	1 739 100.00	0.03
USD SOUTHERN CALIFORNIA EDISON 3.40000% 18-01.06.23	1 069 000.00	1 122 997.54	0.02
USD SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO 3.70000% 18-01.08.25	1 048 000.00	1 140 670.45	0.02
USD SOUTHWESTERN PUBLIC SERVICE CO 3.30000% 14-15.06.24	2 500 000.00	2 641 487.50	0.05
USD SUNCOR ENERGY INC 7.87500% 96-15.06.26	4 500 000.00	5 850 391.05	0.10
USD TOLEDO HOSPITAL 5.32500% 18-15.11.28	4 490 000.00	5 126 802.34	0.09
USD TOLEDO HOSPITAL 5.75000% 18-15.11.38	2 265 000.00	2 707 320.98	0.05
USD TOLEDO HOSPITAL 6.01500% 18-15.11.48	2 900 000.00	3 630 415.17	0.06
USD UBS GROUP AG-REG-S 2.95000% 15-24.09.20	1 200 000.00	1 208 723.04	0.02
USD UNITEDHEALTH GROUP INC 3.75000% 15-15.07.25	1 855 000.00	2 029 108.44	0.04
USD VIACOMCBS INC 5.85000% 13-01.09.43	1 000 000.00	1 301 760.30	0.02
USD VODAFONE GROUP PLC 3.75000% 18-16.01.24	3 635 000.00	3 876 478.50	0.07
USD VODAFONE GROUP PLC 4.12500% 18-30.05.25	750 000.00	825 262.28	0.01
USD WESTAR ENERGY INC 2.55000% 16-01.07.26	2 500 000.00	2 570 916.00	0.05
USD WILLIAMS COS INC/THE 3.60000% 15-15.03.22	5 806 000.00	5 978 326.15	0.11
米ドル合計		136 107 372.85	2.40

債券、固定利付債合計	137 598 125.27	2.43
------------	----------------	------

債券、変動利付債

USD			
USD AMERICAN EXPRESS CO-SUB 4.900%/VAR 15-PRP	1 036 000.00	1 035 440.56	0.02
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 6.25000%/VAR 14-PRP	2 005 000.00	2 233 068.75	0.04
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 6.500%/VAR 14-PRP	572 000.00	646 360.00	0.01
USD BANK OF NEW YORK MELLON CORP-SUB 4.950%/VAR 15-PRP	889 000.00	898 414.51	0.02
USD BARCLAYS BANK PLC-144A-SUB 6.860%/6M LIBOR+173BP 02-PRP	188 000.00	231 240.00	0.00
USD CITIGROUP INC-SUB 5.950%/3M LIBOR+406.8BP 12-PRP	2 225 000.00	2 375 187.50	0.04

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - U S マルチ・クレジット

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD CLOVERIE PLC VIA SWISS RE-REG-S-SUB 4.500%/VAR 14-11.09.44	1 200 000.00	1 259 683.20	0.02
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S-SUB 7.500%/VAR 18-PRP	891 000.00	981 748.35	0.02
USD DEMETER INVESTMENTS BV-REG-S-SUB 5.125%/VAR 18-01.06.48	3 030 000.00	3 374 783.70	0.06
USD DEUTSCHE TELEKOM INTL FIN 8.250%/RATING LINKED 00-15.06.30	4 450 000.00	6 710 903.04	0.12
USD DNB BANK ASA-REG-S-SUB 6.500%/VAR 16-PRP	2 545 000.00	2 707 243.75	0.05
USD DUKE ENERGY CORP-SUB 4.875%/VAR 19-PRP	956 000.00	1 014 707.96	0.02
USD ENERGY TRANSFER OPERATING LP-SUB 6.750%/VAR 20-PRP	1 205 000.00	1 206 205.00	0.02
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC-SUB 5.700%/VAR 14-PRP	33 000.00	33 041.25	0.00
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC-SUB 5.375%/3M LIBOR+392.2BP 15-PRP	810 000.00	816 034.50	0.01
USD JPMORGAN CHASE & CO-SUB 5.000%/VAR 14-PRP	121 000.00	121 895.40	0.00
USD LLOYDS BANKING GROUP-144A-SUB 6.657%/3M LIBOR+127BP 09-PRP	672 000.00	819 840.00	0.01
USD METLIFE INC-SUB 5.250%/3M LIBOR+357.5BP 15-PRP	2 330 000.00	2 347 591.50	0.04
USD MORGAN STANLEY-SUB 5.500%/3M LIBOR+3.81BP 15-PRP	868 000.00	880 369.00	0.02
USD QBE INSURANCE GROUP LTD-REG-S-SUB 6.750%/VAR 14-02.12.44	2 810 000.00	3 152 876.20	0.06
USD STANDARD CHARTERED PLC-144A-SUB 7.500%/VAR 16-PRP	1 690 000.00	1 806 187.50	0.03
USD SVENSKA HANDELSBANKEN AB-REG-S-SUB 5.250%/VAR 15-PRP	2 465 000.00	2 519 772.30	0.04
USD SWEDBANK AB-REG-S-SUB 5.500%/VAR 15-PRP	1 400 000.00	1 403 500.00	0.03
USD WESTPAC BANKING CORP-SUB 4.322%/VAR 16-23.11.31	4 600 000.00	4 978 718.00	0.09
米ドル合計		43 554 811.97	0.77
債券、変動利付債合計		43 554 811.97	0.77
財務省証券(T-note)、固定利付債			
USD			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.37500% 19-15.11.49	360 000.00	389 278.12	0.01
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.75000% 19-15.11.29	570 000.00	581 867.57	0.01
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.50000% 19-30.11.24	47 805 000.00	48 200 882.77	0.85
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.75000% 19-31.12.24	83 885 000.00	85 562 700.00	1.51
USD AMERICA, UNITED STATES OF 1.37500% 20-31.01.25	36 840 000.00	36 924 901.46	0.65
米ドル合計		171 659 629.92	3.03
財務省証券(T-note)、固定利付債合計		171 659 629.92	3.03
地方債、固定利付債			
USD			
USD OREGON, STATE OF 5.76200% 03-01.06.23	3 000 000.00	2 188 490.23	0.04
米ドル合計		2 188 490.23	0.04
地方債、固定利付債合計		2 188 490.23	0.04
転換社債型新株予約権付社債、変動利付債			
USD			
USD BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA-SUB COCO 6.500%/VAR 19-PRP	800 000.00	855 960.00	0.02
USD BARCLAYS PLC-REG-S-SUB 7.875%/VAR 16-PRP	542 000.00	586 080.86	0.01
米ドル合計		1 442 040.86	0.03
転換社債型新株予約権付社債、変動利付債合計		1 442 040.86	0.03
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		3 477 942 869.53	61.33

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 - U S マルチ・クレジット

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
財務省証券(T-bill)、ゼロ・クーポン			
USD			
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 24.12.19-18.02.20	3 000 000.00	2 998 178.13	0.05
米ドル合計		2 998 178.13	0.05
財務省証券(T-bill)、ゼロ・クーポン合計		2 998 178.13	0.05
割引手形、ゼロ・クーポン			
USD			
USD FEDERAL HOME LOAN BANK SYSTEM DN 0.00000% 11.02.19-10.02.20	2 500 000.00	2 499 246.53	0.04
USD FEDERAL HOME LOAN BANK SYSTEM DN 0.00000% 11.02.19-11.02.20	1 500 000.00	1 499 483.34	0.03
USD FEDERAL HOME LOAN BANK SYSTEM DN 0.00000% 12.02.19-12.02.20	6 000 000.00	5 997 675.00	0.11
米ドル合計		9 996 404.87	0.18
割引手形、ゼロ・クーポン合計		9 996 404.87	0.18
アセット・バック証券、変動利付債			
USD			
USD ALLEGRO CLO VII LTD-144A 3M LIBOR+110BP 18-13.06.31	3 500 000.00	3 498 218.50	0.06
USD CIFC FUNDING LTD-144A 3M LIBOR+105BP 18-24.04.30	1 500 000.00	1 499 695.95	0.03
USD OCEAN TRAILS CLO VI-144A 3M LIBOR+115BP 19-15.07.28	8 000 000.00	8 012 815.20	0.14
USD OCEAN TRAILS CLO-144A 3M LIBOR+140BP 19-17.04.30	3 250 000.00	3 256 064.17	0.06
USD PALMER SQUARE CLO LTD-144A 3M LIBOR+110BP 18-16.07.31	3 500 000.00	3 501 319.85	0.06
USD ROMARK CLO II-144A 3M LIBOR+117.5BP 18-25.07.31	5 500 000.00	5 485 130.20	0.10
USD SHACKLETON 2014-V-R CLO LTD-144A 3M LIBOR+110BP 18-07.05.31	3 750 000.00	3 733 074.75	0.06
米ドル合計		28 986 318.62	0.51
アセット・バック証券、変動利付債合計		28 986 318.62	0.51
モーゲージ・バック証券、固定利付債			
USD			
USD CD 2017-CD4 MORTGAGE TRUST-SUB 3.24820% 17-01.05.50	5 000 000.00	5 381 802.50	0.09
USD FANNIE MAE 2.95000% 16-01.05.31	900 000.00	903 250.28	0.02
USD FANNIE MAE 3.12000% 15-01.10.27	765 000.00	831 622.32	0.01
USD FANNIE MAE 3.34000% 15-01.08.30	765 000.00	783 511.15	0.01
USD FANNIE MAE 3.53000% 15-01.12.30	940 000.00	985 496.70	0.02
USD FANNIE MAE 3.63000% 16-01.02.31	860 000.00	904 324.85	0.02
USD JPMDB COMRCIAL MOTGE SECURTIES TRST-SUB 3.04770% 17-01.10.50	3 000 000.00	3 124 218.60	0.06
USD MORGAN STANLEY BANK OF AMERICA ML 2.84000% 16-01.11.49	2 500 000.00	2 619 790.00	0.05
USD MORGAN STANLEY BK OF AMERICA MERRI TRT 3.29500% 17-01.05.50	5 000 000.00	5 300 056.50	0.09
USD MORGAN STANLEY CAPITAL I TRUST 3.15300% 17-01.06.50	2 800 000.00	2 919 244.44	0.05
米ドル合計		23 753 317.34	0.42
モーゲージ・バック証券、固定利付債合計		23 753 317.34	0.42
モーゲージ・バック証券、変動利付債			
USD			
USD AMERICAN HOME MORTGAGE INVESTMENT 6M LIBOR+200BP 05-01.06.45	29 470 000.00	1 625 477.68	0.03
USD BANC OF AMERICA FUND TRUST 1M LIBOR+30BP 05-20.05.35	16 952 000.00	689 276.19	0.01
USD WAMU MORTGAGE PASS-TH TRUST 1M LIBOR+27BP 05-25.12.45	12 000 000.00	1 145 785.56	0.02
米ドル合計		3 460 539.43	0.06
モーゲージ・バック証券、変動利付債合計		3 460 539.43	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 - U S マルチ・クレジット

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
ノート、固定利付債			
USD			
USD ABBVIE INC-144A 2.30000% 19-21.11.22	4 415 000.00	4 458 838.30	0.08
USD ABBVIE INC-144A 2.60000% 19-21.11.24	1 525 000.00	1 557 867.56	0.03
USD ABBVIE INC-144A 2.95000% 19-21.11.26	5 851 000.00	6 043 314.19	0.11
USD ABBVIE INC-144A 3.20000% 19-21.11.29	7 675 000.00	7 970 371.60	0.14
USD ABBVIE INC-144A 4.05000% 19-21.11.39	1 730 000.00	1 882 382.90	0.03
USD ABBVIE INC-REG-S 2.95000% 19-21.11.26	7 100 000.00	7 333 367.06	0.13
USD ACTIVISION BLIZZARD INC 2.60000% 17-15.06.22	2 946 000.00	2 995 770.32	0.05
USD AEP TRANSMISSION CO LLC 3.10000% 17-01.12.26	150 000.00	160 333.08	0.00
USD AERCAP IRE CAP LTD/GLB AVIA TRUST 3.50000% 17-15.01.25	2 380 000.00	2 496 822.78	0.04
USD AETNA INC 2.75000% 12-15.11.22	2 300 000.00	2 346 892.86	0.04
USD AIRCASTLE LTD 5.50000% 15-15.02.22	6 795 000.00	7 239 195.94	0.13
USD AKER BP ASA-144A 3.00000% 20-15.01.25	2 165 000.00	2 182 904.55	0.04
USD AKER BP ASA-REG-S 3.75000% 20-15.01.30	1 000 000.00	1 007 880.00	0.02
USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC 3.90000% 13-15.06.23	1 680 000.00	1 782 983.66	0.03
USD ALLERGAN FINANCE LLC 3.25000% 12-01.10.22	979 000.00	1 010 156.78	0.02
USD ALLERGAN FUNDING SCS 3.85000% 14-15.06.24	2 939 000.00	3 133 640.56	0.06
USD ALLERGAN FUNDING SCS 4.55000% 15-15.03.35	2 000 000.00	2 300 040.60	0.04
USD ALLERGAN SALES LLC-144A 5.00000% 13-15.12.21	2 882 000.00	3 020 929.98	0.05
USD ALLIANT ENERGY FINANCE LLC-144A 3.75000% 18-15.06.23	3 900 000.00	4 104 085.05	0.07
USD ALPEK SA DE CV-144A 4.50000% 12-20.11.22	1 780 000.00	1 857 875.00	0.03
USD ALTRIA GROUP INC 2.85000% 12-09.08.22	2 555 000.00	2 614 578.26	0.05
USD AMAZON.COM INC 2.40000% 18-22.02.23	2 220 000.00	2 272 245.92	0.04
USD AMAZON.COM INC 3.15000% 18-22.08.27	1 810 000.00	1 954 856.65	0.03
USD ANCOR FINANCE USA INC-144A 3.62500% 19-28.04.26	2 550 000.00	2 703 671.67	0.05
USD AMERICAN EXPRESS CO 2.50000% 17-01.08.22	3 349 000.00	3 408 336.58	0.06
USD AMERICAN TOWER CORP 5.00000% 13-15.02.24	4 958 000.00	5 519 991.78	0.10
USD AMERICAN TOWER CORP 3.12500% 16-15.01.27	2 599 000.00	2 704 786.32	0.05
USD AMERICAN TOWER CORP 3.00000% 17-15.06.23	1 000 000.00	1 034 619.60	0.02
USD ANTERO RESOURCES FIN CORP 5.12500% 14-01.12.22	2 499 000.00	2 155 387.50	0.04
USD APACHE CORP 3.25000% 12-15.04.22	2 115 000.00	2 160 933.77	0.04
USD ARC PROPERTIES OPERATING PSHIP LP/CLARK 4.60000% 14-06.02.24	12 315 000.00	13 440 216.63	0.24
USD ARCH CAPITAL FINANCE LLC 4.01100% 16-15.12.26	1 300 000.00	1 469 995.28	0.03
USD ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-144A 4.25000% 17-15.09.22	840 000.00	850 500.00	0.01
USD ARES CAPITAL CORP 3.62500% 16-19.01.22	5 595 000.00	5 729 645.35	0.10
USD ASTRAZENECA PLC 3.12500% 17-12.06.27	1 200 000.00	1 279 614.60	0.02
USD AT&T INC 2.95000% 19-15.07.26	1 095 000.00	1 140 887.07	0.02
USD AT&T INC 3.80000% 19-15.02.27	2 100 000.00	2 289 384.93	0.04
USD AT&T INC 3.87500% 19-15.01.26	1 000 000.00	1 086 029.00	0.02
USD AT&T INC 4.00000% 19-15.01.22	1 395 000.00	1 454 443.18	0.03
USD AT&T INC 4.12500% 16-17.02.26	4 915 000.00	5 420 587.87	0.10
USD AT&T INC STEP-UP 19-15.12.23	1 800 000.00	1 946 384.46	0.03
USD ATHENE GLOBAL FUNDING-144A 2.95000% 19-12.11.26	7 500 000.00	7 720 581.00	0.14
USD ATMOS ENERGY CORP 3.00000% 17-15.06.27	1 500 000.00	1 591 838.70	0.03
USD AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK-144A-SUB 4.50000% 14-19.03.24	1 593 000.00	1 717 556.67	0.03
USD AUTODESK INC 3.50000% 17-15.06.27	3 482 000.00	3 732 794.53	0.07
USD AVIATION CAPITAL GROUP-144A 2.87500% 17-20.01.22	4 350 000.00	4 402 573.23	0.08
USD AVIATION CAPITAL GROUP-144A 3.87500% 18-01.05.23	2 515 000.00	2 618 259.36	0.05
USD BACARDI LTD-144A 4.45000% 18-15.05.25	1 700 000.00	1 858 083.00	0.03
USD BAKER HUGHES A GE CO/ CO-OBLIGATOR 2.77300% 18-15.12.22	2 700 000.00	2 771 468.73	0.05
USD BAKER HUGHES A GE CO/ CO-OBLIGATOR 3.33700% 18-15.12.27	2 755 000.00	2 904 224.02	0.05
USD BAKER HUGHES A GE CO/ CO-OBLIGATOR 3.13800% 19-07.11.29	2 825 000.00	2 937 067.75	0.05
USD BANK OF NEW ZEALAND-144A 3.50000% 19-20.02.24	4 900 000.00	5 190 722.39	0.09
USD BAUSCH HEALTH COS INC-144A 5.75000% 19-15.08.27	37 000.00	39 586.30	0.00
USD BAYER US FINANCE II LLC-144A 3.87500% 18-15.12.23	3 275 000.00	3 497 789.73	0.06
USD BAYER US FINANCE II LLC-144A 4.37500% 18-15.12.28	1 530 000.00	1 721 879.44	0.03

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - U S マルチ・クレジット

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD BAYER US FINANCE LLC-144A 3.37500% 14-08.10.24	1 000 000.00	1 054 237.80	0.02
USD BECTON DICKINSON AND CO 3.73400% 14-15.12.24	3 767 000.00	4 043 633.79	0.07
USD BECTON DICKINSON AND CO 3.36300% 17-06.06.24	5 066 000.00	5 336 083.15	0.09
USD BERKSHIRE HATHAWAY ENERGY CO 3.25000% 18-15.04.28	2 485 000.00	2 672 923.90	0.05
USD BERRY GLOBAL ESCROW CORP-144A 4.87500% 19-15.07.26	158 000.00	165 086.62	0.00
USD BMW US CAPITAL LLC-144A 3.40000% 18-13.08.21	2 750 000.00	2 818 357.58	0.05
USD BNP PARIBAS SA-144A 2.95000% 17-23.05.22	1 065 000.00	1 090 169.57	0.02
USD BNP PARIBAS SA-144A 3.37500% 18-09.01.25	1 720 000.00	1 815 060.62	0.03
USD BNP PARIBAS-144A 4.40000% 18-14.08.28	695 000.00	788 574.38	0.01
USD BNP PARIBAS-REG-S 3.37500% 18-09.01.25	1 185 000.00	1 250 492.34	0.02
USD BNP PARIBAS-REG-S 4.40000% 18-14.08.28	2 700 000.00	3 063 526.38	0.05
USD BOSTON PROPERTIES LP 3.80000% 13-01.02.24	282 000.00	301 380.45	0.01
USD BP CAPITAL MARKETS PLC 3.56100% 11-01.11.21	2 600 000.00	2 685 317.96	0.05
USD BPCE SA-144A 2.37500% 20-14.01.25	7 650 000.00	7 711 626.87	0.14
USD BPCE SA-144A 4.00000% 18-12.09.23	490 000.00	522 380.09	0.01
USD BPCE SA-144A-SUB 5.15000% 14-21.07.24	2 425 000.00	2 694 917.05	0.05
USD BPCE SA-144A-SUB 5.70000% 13-22.10.23	1 996 000.00	2 224 108.27	0.04
USD BRISTOL MYERS SQUIBB CO-144A 3.25000% 19-20.02.23	3 000 000.00	3 128 787.60	0.06
USD BRISTOL-MYERS SQUIBB CO-144A 3.20000% 19-15.06.26	3 465 000.00	3 685 763.12	0.06
USD BRIXMOR OPERATING PARTNERSHIP LP 3.85000% 15-01.02.25	2 000 000.00	2 140 691.20	0.04
USD BROADCOM CORP/CAYMAN FIN LTD 3.00000% 18-15.01.22	3 500 000.00	3 562 383.30	0.06
USD BROADCOM CORP/CAYMAN FIN LTD 3.62500% 18-15.01.24	5 737 000.00	6 001 995.46	0.11
USD BROADCOM CORP/CAYMAN FIN LTD 3.87500% 18-15.01.27	3 010 000.00	3 176 318.15	0.06
USD BROADCOM CORP/CAYMAN FIN LTD 3.12500% 18-15.01.25	2 300 000.00	2 366 605.24	0.04
USD BROADCOM INC-144A 3.12500% 19-15.04.21	1 400 000.00	1 420 150.76	0.02
USD BROADCOM INC-144A 3.12500% 19-15.10.22	4 195 000.00	4 301 396.94	0.08
USD BROADCOM INC-144A 3.62500% 19-15.10.24	850 000.00	894 541.02	0.02
USD BROADCOM INC-144A 4.25000% 19-15.04.26	18 284 000.00	19 739 141.29	0.35
USD BUNGE LTD FINANCE CORP 3.50000% 15-24.11.20	954 000.00	966 348.19	0.02
USD BUNGE LTD FINANCE CORP 3.00000% 17-25.09.22	1 300 000.00	1 330 304.17	0.02
USD CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD 3.45000% 11-15.11.21	750 000.00	768 473.70	0.01
USD CAPITAL ONE NA 2.65000% 17-08.08.22	1 825 000.00	1 860 756.86	0.03
USD CARLYLE HOLDINGS FINANCE LLC-REG-S 3.87500% 13-01.02.23	777 000.00	810 866.01	0.01
USD CATALENT PHARMA SOLUTIONS INC-144A 4.87500% 17-15.01.26	304 000.00	312 360.00	0.01
USD CBS CORP 2.90000% 18-01.06.23	1 400 000.00	1 444 059.40	0.03
USD CBS CORP 3.37500% 12-01.03.22	1 000 000.00	1 027 678.00	0.02
USD CBS CORP 3.50000% 15-15.01.25	900 000.00	956 998.71	0.02
USD CBS CORP 3.70000% 18-01.06.28	4 140 000.00	4 445 755.97	0.08
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 4.00000% 17-01.03.23	788 000.00	799 820.00	0.01
USD CCO LLC/CAPITAL 3.75000% 17-15.02.28	2 532 000.00	2 654 800.22	0.05
USD CCO LLC/CAPITAL 4.46400% 16-23.07.22	2 890 000.00	3 053 764.45	0.05
USD CCO LLC/CAPITAL 4.90800% 16-23.07.25	2 690 000.00	3 016 526.73	0.05
USD CCO LLC/CAPITAL 5.37500% 17-01.05.47	700 000.00	806 568.21	0.01
USD CCO LLC/CAPITAL 6.38400% 16-23.10.35	3 000 000.00	3 916 862.70	0.07
USD CCO LLC/CAPITAL 6.48400% 16-23.10.45	500 000.00	649 708.00	0.01
USD CELGENE CORP 3.25000% 12-15.08.22	0.00	2 307.00	0.00
USD CELGENE CORP 3.62500% 14-15.05.24	0.00	600.00	0.00
USD CELULOSA ARAUCO Y CONSTITUCION SA 4.50000% 14-01.08.24	650 000.00	688 593.75	0.01
USD CENOVUS ENERGY INC 3.00000% 12-15.08.22	8 408 000.00	8 582 952.82	0.15
USD CENOVUS ENERGY INC 6.75000% 10-15.11.39	1 825 000.00	2 297 125.31	0.04
USD CENTENE CORP 4.75000% 14-15.05.22	1 175 000.00	1 195 606.56	0.02
USD CENTENE CORP-144A 4.25000% 19-15.12.27	784 000.00	817 320.00	0.01
USD CENTENE CORP-144A 5.25000% 20-01.04.25	85 000.00	88 081.25	0.00
USD CENTENE CORP-REG-S 4.75000% 19-15.01.25	2 750 000.00	2 838 220.00	0.05
USD CENTERPOINT ENERGY INC 2.50000% 17-01.09.22	725 000.00	734 967.45	0.01
USD CENTURYLINK INC-REG-S 4.00000% 20-15.02.27	345 000.00	347 829.00	0.01
USD CF INDUSTRIES INC-144A 4.50000% 16-01.12.26	1 800 000.00	1 986 382.08	0.04
USD CHENIERE CORPUS CHRISTI HLDGS LLC 5.87500% 17-31.03.25	3 685 000.00	4 177 684.50	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 - U S マルチ・クレジット

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD CHENIERE ENERGY PARTNERS LP 5.25000% 18-01.10.25	550 000.00	566 500.00	0.01
USD CHURCHILL DOWNS INC-144A 4.75000% 17-15.01.28	250 000.00	257 500.00	0.00
USD CHURCHILL DOWNS INC-144A 5.50000% 19-01.04.27	328 000.00	346 040.00	0.01
USD CIMAREX ENERGY CO 3.90000% 17-15.05.27	2 090 000.00	2 168 790.07	0.04
USD CITIGROUP INC-SUB 4.60000% 16-09.03.26	1 620 000.00	1 815 794.50	0.03
USD CLEAN HARBORS INC-144A 5.12500% 19-15.07.29	528 000.00	562 320.00	0.01
USD CLECO CORPORATE HOLDINGS LLC 3.74300% 17-01.05.26	2 400 000.00	2 520 490.56	0.04
USD CLEVELAND ELECTRIC ILLUMINATING CO-144A 3.50000% 17-01.04.28	530 000.00	570 897.88	0.01
USD COMCAST CORP 3.37500% 15-15.08.25	4 650 000.00	4 997 718.16	0.09
USD COMMScope INC-144A 5.00000% 14-15.06.21	345 000.00	345 000.00	0.01
USD COMPASS BANK-SUB 5.50000% 05-01.04.20	1 490 000.00	1 498 346.23	0.03
USD CONTINENTAL AIRLINES 4.00000% 12-29.10.24	2 170 000.00	1 624 134.81	0.03
USD CONTINENTAL RESOURCES INC 3.80000% 14-01.06.24	4 390 000.00	4 575 383.56	0.08
USD COX COMMUNICATION INC-144A 3.35000% 16-15.09.26	4 350 000.00	4 611 206.63	0.08
USD COX COMMUNICATIONS INC-144A 3.15000% 17-15.08.24	1 940 000.00	2 029 470.67	0.04
USD COX COMMUNICATIONS INC-144A 3.50000% 17-15.08.27	2 500 000.00	2 668 443.00	0.05
USD CSC HOLDINGS INC-144A 5.37500% 18-01.02.28	300 000.00	318 000.00	0.01
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 5.37500% 18-15.07.23	382 000.00	390 136.60	0.01
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 5.50000% 18-15.05.26	300 000.00	314 311.50	0.01
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 6.62500% 15-15.10.25	750 000.00	791 812.50	0.01
USD CSX CORP 2.60000% 16-01.11.26	2 000 000.00	2 074 842.40	0.04
USD CYRUSONE LP / CYRUSONE FIN CORP 2.90000% 19-15.11.24	3 965 000.00	4 022 254.60	0.07
USD DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA LLC-144A 3.70000% 18-04.05.23	3 215 000.00	3 374 676.19	0.06
USD DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA LLC-144A 3.40000% 19-22.02.22	5 900 000.00	6 073 693.64	0.11
USD DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA LLC-144A 3.65000% 19-22.02.24	5 879 000.00	6 224 514.71	0.11
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP-144A 6.02000% 16-15.06.26	2 483 000.00	2 899 477.31	0.05
USD DEUTSCHE TELEKOM INTL FINANCE BV-144A 2.48500% 16-19.09.23	730 000.00	744 025.92	0.01
USD DEVON ENERGY CORP 5.85000% 15-15.12.25	1 950 000.00	2 329 844.01	0.04
USD DIAMONDBACK ENERGY INC 5.37500% 17-31.05.25	1 565 000.00	1 636 947.59	0.03
USD DIAMONDBACK ENERGY INC 3.25000% 19-01.12.26	8 385 000.00	8 584 161.36	0.15
USD DIGITAL REALTY TRUST LP 3.62500% 12-01.10.22	4 550 000.00	4 730 419.33	0.08
USD DIGITAL REALTY TRUST LP 3.95000% 15-01.07.22	425 000.00	444 926.12	0.01
USD DISCOVER BANK 3.35000% 18-06.02.23	505 000.00	524 452.86	0.01
USD DISCOVER FINANCIAL SERVICES 3.85000% 13-21.11.22	3 515 000.00	3 686 668.03	0.06
USD DOMINION ENERGY INC 3.90000% 15-01.10.25	1 500 000.00	1 637 791.65	0.03
USD DOMINION ENERGY INC 4.25000% 18-01.06.28	2 900 000.00	3 268 942.06	0.06
USD DOMINION ENERGY INC-SUB STEP-UP 16-01.04.21	7 350 000.00	7 521 689.39	0.13
USD DOMINION ENERGY INC-SUB STEP-UP 17-01.07.20	5 130 000.00	5 145 195.06	0.09
USD DOMINION GAS HOLDINGS LLC 3.00000% 19-15.11.29	3 000 000.00	3 092 315.40	0.05
USD DOW CHEMICAL CO 3.62500% 19-15.05.26	2 756 000.00	2 964 796.77	0.05
USD DTE ENERGY CO 3.50000% 14-01.06.24	2 100 000.00	2 213 873.55	0.04
USD DUKE ENERGY CORP 2.40000% 17-15.08.22	2 275 000.00	2 308 272.55	0.04
USD DUKE ENERGY CORP 3.05000% 12-15.08.22	2 685 000.00	2 755 589.19	0.05
USD DUQUESNE LIGHT HOLDINGS INC-144A 6.40000% 10-15.09.20	1 622 000.00	1 664 715.20	0.03
USD ECOLAB INC 4.35000% 11-08.12.21	1 306 000.00	1 368 245.53	0.02
USD ELANCO ANIMAL HEALTH INC 4.27200% 19-28.08.23	7 050 000.00	7 506 246.39	0.13
USD EMPRESAS PUBLICAS DE MEDELLIN ESP-144A 4.25000% 19-18.07.29	811 000.00	844 119.21	0.01
USD ENABLE MIDSTREAM PARTNERS LP 4.40000% 17-15.03.27	670 000.00	675 116.12	0.01
USD ENBRIDGE ENERGY PARTNERS LP 4.20000% 11-15.09.21	1 280 000.00	1 321 879.43	0.02
USD ENBRIDGE INC 4.25000% 16-01.12.26	6 265 000.00	7 017 524.86	0.12
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-144A 3.62500% 17-25.05.27	2 810 000.00	2 999 897.27	0.05
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-144A 3.50000% 17-06.04.28	460 000.00	485 491.32	0.01
USD ENERSIS AMERICAS SA 4.00000% 16-25.10.26	686 000.00	727 588.75	0.01
USD ENI SPA-144A 4.25000% 19-09.05.29	867 000.00	976 995.07	0.02
USD ENLINK MIDSTREAM PARTNERS LP 4.40000% 14-01.04.24	10 150 000.00	9 690 712.50	0.17
USD EOG RESOURCES INC 4.10000% 10-01.02.21	2 010 000.00	2 054 796.47	0.04
USD EPR PROPERTIES 4.50000% 15-01.04.25	865 000.00	935 402.87	0.02
USD ERP OPERATING LP 3.25000% 17-01.08.27	1 460 000.00	1 570 238.47	0.03
USD ERP OPERATING LTD PARTNERSHIP 4.62500% 11-15.12.21	2 000 000.00	2 090 828.00	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 - U S マルチ・クレジット

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD EXELON GENERATION CO LLC 4.25000% 13-15.06.22	2 320 000.00	2 433 835.67	0.04
USD EXPEDIA INC 5.00000% 16-15.02.26	4 171 000.00	4 659 952.99	0.08
USD FAMILY DOLLAR STORES INC 5.00000% 11-01.02.21	1 500 000.00	1 543 050.00	0.03
USD FARMERS EXCHANGE CAPITAL-144A-SUB 7.05000% 98-15.07.28	1 915 000.00	2 405 220.85	0.04
USD FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES 3.50000% 13-15.04.23	1 481 000.00	1 554 379.10	0.03
USD FIFTH THIRD BANK 2.25000% 20-01.02.27	9 000 000.00	9 057 478.50	0.16
USD FIRST MIDWEST BANCORP INC/IL-SUB 5.87500% 16-29.09.26	6 695 000.00	7 667 089.90	0.14
USD FMG RESOURCES AUGUST 2006 PTY LTD-144A 5.12500% 17-15.05.24	1 305 000.00	1 374 974.10	0.02
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.08700% 20-09.01.23	3 125 000.00	3 151 924.68	0.06
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.37500% 13-06.08.23	5 700 000.00	5 973 651.30	0.11
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.14000% 18-15.02.23	2 660 000.00	2 754 840.17	0.05
USD FORTIS INC 3.05500% 17-04.10.26	3 880 000.00	4 051 124.68	0.07
USD GANNETT CO INC-144A 4.87500% 14-15.09.21	545 000.00	545 681.25	0.01
USD GENERAL DYNAMICS CORP 3.37500% 18-15.05.23	1 093 000.00	1 152 759.44	0.02
USD GENERAL DYNAMICS CORP 3.00000% 18-11.05.21	1 675 000.00	1 704 674.80	0.03
USD GENERAL ELECTRIC CO 2.70000% 12-09.10.22	8 440 000.00	8 600 249.44	0.15
USD GENERAL MOTORS CO 4.20000% 17-01.10.27	2 200 000.00	2 328 849.38	0.04
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 3.70000% 15-24.11.20	2 000 000.00	2 023 711.20	0.04
USD GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC 4.15000% 18-19.06.23	7 707 000.00	8 134 305.36	0.14
USD GEORGIA-PACIFIC LLC-144A 5.40000% 10-01.11.20	651 000.00	668 115.44	0.01
USD GEORGIA-PACIFIC LLC-144A 3.73400% 13-15.07.23	2 508 000.00	2 647 682.30	0.05
USD GLENORE FINANCE CANADA LTD-144A 4.95000% 11-15.11.21	3 080 000.00	3 217 429.60	0.06
USD GLENORE FUNDING LLC-144A 4.12500% 13-30.05.23	1 445 000.00	1 520 069.19	0.03
USD GLENORE FUNDING LLC-144A 4.12500% 19-12.03.24	2 455 000.00	2 610 046.02	0.05
USD GLOBAL PAYMENTS INC 3.75000% 13-01.06.23	688 000.00	724 545.32	0.01
USD GLP CAPITAL LP / GLP FINANC II INC 5.37500% 16-15.04.26	1 320 000.00	1 497 804.00	0.03
USD GLP CAPITAL LP / GLP FINANC II INC 3.35000% 19-01.09.24	270 000.00	279 479.70	0.00
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 2.60000% 17-27.12.20	3 000 000.00	3 009 768.90	0.05
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.50000% 15-23.01.25	3 000 000.00	3 194 137.50	0.06
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.75000% 15-22.05.25	4 965 000.00	5 345 435.68	0.09
USD GROUP 1 AUTOMOTIVE INC-144A 5.25000% 15-15.12.23	390 000.00	400 725.00	0.01
USD GULF POWER CO 3.30000% 17-30.05.27	2 105 000.00	2 244 652.86	0.04
USD GULFPORT ENERGY CORP 6.37500% 17-15.05.25	59 000.00	29 500.00	0.00
USD HARLEY-DAVIDSON FIN.SERV INC-144A 4.05000% 19-04.02.22	1 425 000.00	1 478 810.00	0.03
USD HCA INC 5.00000% 14-15.03.24	3 000 000.00	3 321 312.00	0.06
USD HCP INC 4.25000% 13-15.11.23	1 314 000.00	1 416 605.66	0.02
USD HEALTHCARE TRUST OF AMERICA HOLDINGS LP 3.70000% 13-15.04.23	750 000.00	781 770.68	0.01
USD HELMERICH & PAYNE INC 4.65000% 19-15.03.25	2 000 000.00	2 194 631.60	0.04
USD HESS CORP 7.87500% 99-01.10.29	1 000 000.00	1 327 333.00	0.02
USD HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO STEP-UP/DOWN 16-15.10.22	4 440 000.00	4 705 790.38	0.08
USD HIGH STREET FUNDING TRUST-144A 4.11100% 18-15.02.28	2 485 000.00	2 734 242.27	0.05
USD HOLOGIC INC-144A 4.37500% 17-15.10.25	335 000.00	341 140.55	0.01
USD HOST HOTELS & RESORTS LP 3.87500% 17-01.04.24	4 121 000.00	4 403 767.77	0.08
USD HUMANA INC 3.95000% 17-15.03.27	1 055 000.00	1 154 404.11	0.02
USD HUSKY ENERGY INC 4.00000% 14-15.04.24	2 240 000.00	2 383 554.66	0.04
USD HUSKY ENERGY INC 4.40000% 19-15.04.29	4 354 000.00	4 757 347.16	0.08
USD IHS MARKIT LTD-144A 4.75000% 17-15.02.25	957 000.00	1 057 293.60	0.02
USD IHS MARKIT LTD-144A 4.00000% 17-01.03.26	1 206 000.00	1 306 158.30	0.02
USD ING BANK NV-144A-SUB 5.80000% 13-25.09.23	1 173 000.00	1 313 883.05	0.02
USD INTESA SANPAOLO SPA-144A 3.12500% 17-14.07.22	1 586 000.00	1 617 330.16	0.03
USD INTESA SANPAOLO SPA-144A 3.37500% 18-12.01.23	2 165 000.00	2 226 342.67	0.04
USD INVERSIONES CMPC SA-144A 4.37500% 17-04.04.27	1 434 000.00	1 526 923.20	0.03
USD INVERSIONES CMPC SA-REG-S 3.85000% 20-13.01.30	1 100 000.00	1 130 250.00	0.02
USD IPALCO ENTERPRISES INC 3.70000% 18-01.09.24	955 000.00	1 001 576.02	0.02
USD JACKSON NATIONAL LIFE GLOBAL FUND-144A 2.50000% 17-27.06.22	1 980 000.00	2 014 251.43	0.04
USD JACKSON NATIONAL LIFE GLOBAL FUND-REG-S 3.30000% 19-01.02.22	1 925 000.00	1 984 082.49	0.03
USD JERSEY CENTRAL POWER & LIGHT CO-144A 4.70000% 13-01.04.24	1 573 000.00	1 729 886.93	0.03
USD JERSEY CENTRAL POWER & LIGHT CO-144A 4.30000% 15-15.01.26	1 896 000.00	2 106 350.39	0.04
USD JPMORGAN CHASE & CO-SUB 3.37500% 13-01.05.23	2 810 000.00	2 940 890.92	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 - U S マルチ・クレジット

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD KEYBANK NA/CLEVELAND OH 2.40000% 17-09.06.22	2 000 000.00	2 033 208.00	0.04
USD KEYSpan GAS EAST CORP-144A 2.74200% 16-15.08.26	1 250 000.00	1 280 126.13	0.02
USD KINDER MORGAN ENERGY PARTNERS LP 4.30000% 14-01.05.24	3 645 000.00	3 937 708.08	0.07
USD KINDER MORGAN ENERGY PARTNERS LP 5.80000% 05-15.03.35	1 973 000.00	2 436 957.27	0.04
USD KINDER MORGAN ENERGY PARTNERS LP 5.30000% 10-15.09.20	1 925 000.00	1 964 967.62	0.03
USD KINDER MORGAN ENERGY PARTNERS LP 3.50000% 13-01.09.23	1 325 000.00	1 389 522.99	0.02
USD KINDER MORGAN INC 5.00000% 13-15.02.21	5 665 000.00	5 821 925.03	0.10
USD KINDER MORGAN INC-144A 5.62500% 13-15.11.23	565 000.00	631 530.72	0.01
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 3.50000% 12-06.06.22	1 250 000.00	1 295 661.87	0.02
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 4.37500% 16-01.06.46	1 400 000.00	1 432 669.14	0.03
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 3.00000% 16-01.06.26	2 100 000.00	2 136 144.99	0.04
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 2.80000% 16-02.07.20	486 000.00	486 958.93	0.01
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 3.50000% 16-15.07.22	1 000 000.00	1 034 788.60	0.02
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 5.00000% 16-15.07.35	795 000.00	917 671.52	0.02
USD LABORATORY CORP AMERICA HOLDINGS 3.20000% 15-01.02.22	501 000.00	514 077.05	0.01
USD LABORATORY CORP AMERICA HOLDINGS 3.60000% 15-01.02.25	529 000.00	562 737.19	0.01
USD LAMAR MEDIA CORP-REG-S 3.75000% 20-15.02.28	225 000.00	226 503.00	0.00
USD LAMB WESTON HOLDINGS INC-144A 4.62500% 16-01.11.24	75 000.00	78 750.00	0.00
USD LENNAR CORP STEP-UP/DOWN 13-15.11.22	700 000.00	737 625.00	0.01
USD LEUCADIA NATIONAL CORP 5.50000% 13-18.10.23	1 750 000.00	1 917 105.23	0.03
USD LEVEL 3 FINANCING INC-144A 3.40000% 19-01.03.27	5 100 000.00	5 239 230.00	0.09
USD LIBERTY MUTUAL GROUP INC-144A 4.56900% 19-01.02.29	5 000 000.00	5 774 946.50	0.10
USD LINCOLN NATIONAL CORP 4.00000% 13-01.09.23	2 075 000.00	2 231 152.47	0.04
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC-SUB 4.58200% 16-10.12.25	4 110 000.00	4 518 697.99	0.08
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 4.37500% 18-22.03.28	400 000.00	451 090.16	0.01
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 3.75000% 17-11.01.27	4 800 000.00	5 151 743.52	0.09
USD LPL HOLDINGS INC-144A 5.75000% 17-15.09.25	796 000.00	829 830.00	0.01
USD LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV 5.75000% 12-15.04.24	500 000.00	571 265.10	0.01
USD MARATHON OIL CORP 4.40000% 17-15.07.27	2 275 000.00	2 488 793.81	0.04
USD MARATHON PETROLEUM CORP 4.75000% 19-15.12.23	2 430 000.00	2 657 798.89	0.05
USD MARATHON PETROLEUM CORP 5.12500% 19-15.12.26	1 580 000.00	1 819 021.61	0.03
USD MARS INC-144A 3.87500% 19-01.04.39	5 405 000.00	6 373 433.31	0.11
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-144A 2.00000% 16-15.04.21	3 000 000.00	3 014 769.00	0.05
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-144A 2.95000% 18-11.01.25	540 000.00	564 722.50	0.01
USD MATTHEWS INTERNATIONAL CORP-144A 5.25000% 17-01.12.25	250 000.00	250 000.00	0.00
USD MCCORMICK & CO 3.15000% 17-15.08.24	2 605 000.00	2 731 177.86	0.05
USD MCDONALD ' S CORP 3.70000% 15-30.01.26	3 330 000.00	3 629 953.41	0.06
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-144A 3.87500% 12-11.04.22	1 170 000.00	1 224 649.29	0.02
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING I-144A 3.00000% 13-10.01.23	1 500 000.00	1 552 472.85	0.03
USD MGM CHINA HOLDINGS LTD-144A 5.37500% 19-15.05.24	456 000.00	467 400.00	0.01
USD MICHAEL KORS USA INC-144A 4.00000% 17-01.11.24	1 225 000.00	1 292 852.26	0.02
USD MICROCHIP TECHNOLOGY INC 3.92200% 18-01.06.21	3 100 000.00	3 175 253.43	0.06
USD MIDWEST CONNECTOR CAPITAL CO LLC-144A 3.90000% 19-01.04.24	7 420 000.00	7 882 032.27	0.14
USD MIDWEST CONNECTOR CAPITAL CO LLC-144A 3.62500% 19-01.04.22	3 180 000.00	3 279 903.51	0.06
USD MORGAN STANLEY 3.70000% 14-23.10.24	5 020 000.00	5 411 405.38	0.10
USD MORGAN STANLEY 3.75000% 13-25.02.23	3 765 000.00	3 975 216.52	0.07
USD MORGAN STANLEY 3.87500% 14-29.04.24	2 000 000.00	2 154 291.40	0.04
USD MPLX LP-144A 3.50000% 19-01.12.22	1 780 000.00	1 842 389.36	0.03
USD MUFG UNION BANK NA 2.10000% 19-09.12.22	5 600 000.00	5 649 468.72	0.10
USD MYLAN INC-144A 3.12500% 12-15.01.23	3 090 000.00	3 167 754.90	0.06
USD MYLAN NV 3.15000% 17-15.06.21	2 530 000.00	2 570 115.43	0.05
USD MYLAN NV 3.95000% 17-15.06.26	7 527 000.00	8 033 924.64	0.14
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD/NY 3.70000% 18-04.11.21	2 670 000.00	2 757 736.20	0.05
USD NAVIENT CORP 6.62500% 16-26.07.21	790 000.00	832 541.50	0.01
USD NEWFIELD EXPLORATION CO 5.62500% 12-01.07.24	3 370 000.00	3 719 585.93	0.07
USD NEWMONT GOLDCORP CORP 3.62500% 19-09.06.21	1 600 000.00	1 632 184.00	0.03
USD NEXTERA ENERGY CAPITAL HOLDINGS INC 3.55000% 17-01.05.27	1 375 000.00	1 488 816.58	0.03
USD NISOURCE INC 3.65000% 19-15.06.23	2 260 000.00	2 383 418.37	0.04
USD NORDEA BANK ABP-144A 3.75000% 18-30.08.23	1 065 000.00	1 127 177.57	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 - U S マルチ・クレジット

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD NRG ENERGY INC-144A 3.75000% 19-15.06.24	4 500 000.00	4 703 250.60	0.08
USD NUTRIEN LTD 3.37500% 18-15.03.25	4 465 000.00	4 722 941.71	0.08
USD NXP BV / NXP FDNG LLC / NXP USA-144A 3.87500% 19-18.06.26	1 555 000.00	1 674 414.82	0.03
USD NXP BV / NXP FDNG LLC / NXP USA-144A 4.30000% 19-18.06.29	1 310 000.00	1 449 363.17	0.03
USD NXP BV / NXP FUNDING LLC-144A 4.12500% 16-01.06.21	5 355 000.00	5 500 816.11	0.10
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 4.85000% 19-15.03.21	996 000.00	1 025 685.78	0.02
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 6.95000% 19-01.07.24	665 000.00	789 587.28	0.01
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 5.55000% 19-15.03.26	1 230 000.00	1 421 600.42	0.03
USD OHIO NATIONAL LIFE INSURANC C0144A-SUB 6.87500% 12-15.06.42	2 500 000.00	2 813 014.25	0.05
USD OI EUROPEAN GROUP BV-144A 4.00000% 17-15.03.23	99 000.00	100 485.00	0.00
USD ONCOR ELECTRIC DELIVERY CO 5.75000% 11-30.09.20	2 203 000.00	2 259 596.17	0.04
USD ONEOK PARTNERS LP 3.37500% 12-01.10.22	1 145 000.00	1 179 973.34	0.02
USD ONTARIO TEACHERS CADILLAC FAIRVIEW-144A 3.12500% 17-20.03.22	3 000 000.00	3 074 812.20	0.05
USD PANTHER BF AGGR 2/PANTHER FIN CO-144A 6.25000% 19-15.05.26	359 000.00	385 064.11	0.01
USD PARK AEROSPACE HOLDINGS LTD-144A 5.50000% 17-15.02.24	2 415 000.00	2 667 608.99	0.05
USD PARK AEROSPACE HOLDINGS LTD-144A 4.50000% 17-15.03.23	1 190 000.00	1 261 816.50	0.02
USD PEIDMONT OPERATING PARTNERSHIP LP 3.40000% 13-01.06.23	1 500 000.00	1 548 460.05	0.03
USD PENNSYLVANIA ELECTRIC CO-144A 3.25000% 17-15.03.28	305 000.00	322 479.86	0.01
USD PENSKE TRUCK LEASING/PTL FIN CORP-144A 3.90000% 18-01.02.24	2 500 000.00	2 672 081.00	0.05
USD PENSKE TRUCK LEASING/PTL FIN CORP-144A 4.45000% 19-29.01.26	2 680 000.00	2 958 967.09	0.05
USD PENSKE TRUCK LEASING/PTL FIN CORP-144A 3.45000% 19-01.07.24	2 865 000.00	3 023 610.41	0.05
USD PERNOD RICARD SA-144A 4.45000% 11-15.01.22	2 000 000.00	2 101 330.00	0.04
USD PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV-144A 5.09300% 19-15.01.30	158 000.00	173 191.70	0.00
USD PETROLEOS MEXICANOS-144A 6.49000% 19-23.01.27	770 000.00	835 450.00	0.01
USD PETROLEOS MEXICANOS-144A 5.95000% 20-28.01.31	2 300 000.00	2 333 925.00	0.04
USD PHILLIPS 66 4.30000% 12-01.04.22	920 000.00	967 140.06	0.02
USD PHILLIPS 66 PARTNERS LP 3.55000% 16-01.10.26	2 445 000.00	2 612 542.40	0.05
USD PIPELINE FUNDING CO LLC-144A 7.50000% 09-15.01.30	1 550 000.00	1 795 872.09	0.03
USD PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP 3.85000% 13-15.10.23	3 004 000.00	3 141 450.13	0.06
USD PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP 4.65000%15-15.10.25	1 250 000.00	1 365 941.50	0.02
USD PNC BANK NATIONAL ASSOCIATION 2.50000% 18-22.01.21	1 815 000.00	1 828 216.83	0.03
USD PROVIDENCE HEALTH & SERV OBLIG 4.37900% 13-01.10.23	2 500 000.00	2 724 557.25	0.05
USD PSEG POWER LLC 3.85000% 18-01.06.23	4 730 000.00	5 001 372.87	0.09
USD PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC 2.65000% 17-15.11.22	2 500 000.00	2 550 924.25	0.04
USD RABOBANK NEDERLAND NV-SUB 3.87500% 18-26.09.23	4 050 000.00	4 331 450.70	0.08
USD RECKITT BENCKISER TREAS SERV-144A 2.75000% 17-26.06.24	1 530 000.00	1 582 614.56	0.03
USD RECKITT BENCKISER TREAS SERV-REG-S 2.75000% 17-26.06.24	5 650 000.00	5 844 295.59	0.10
USD REGIONS BANK/BIRMINGHAM AL 2.75000% 18-01.04.21	6 850 000.00	6 924 408.13	0.12
USD RITE AID CORP-144A 6.12500% 15-01.04.23	602 000.00	549 325.00	0.01
USD ROCK-TENN CO 4.90000% 13-01.03.22	1 275 000.00	1 349 088.08	0.02
USD ROCKIES EXPRESS PIPELINE LLC-144A 5.62500% 10-15.04.20	755 000.00	758 775.00	0.01
USD ROCKIES EXPRESS PIPELINE LLC-144A 4.95000% 19-15.07.29	775 000.00	773 820.12	0.01
USD RUBY PIPELINE LLC-144A 6.00000% 12-01.04.22	2 140 000.00	1 649 373.59	0.03
USD SABINE PASS LIQUEFACTION LLC 5.75000% 14-15.05.24	3 350 000.00	3 772 396.47	0.07
USD SABINE PASS LIQUEFACTION LLC 5.62500% 16-01.03.25	3 215 000.00	3 656 814.62	0.06
USD SANTANDER HOLDINGS USA INC/PA 2.65000% 15-17.04.20	1 640 000.00	1 641 722.33	0.03
USD SANTANDER UK PLC-144A-SUB 5.00000% 13-07.11.23	2 030 000.00	2 207 710.46	0.04
USD SERVICE PROPERTIES TRUST 3.95000% 17-15.01.28	1 188 000.00	1 191 785.44	0.02
USD SES SA-144A 3.60000% 13-04.04.23	2 000 000.00	2 066 633.40	0.04
USD SIEMENS FINANCIERINGSMATSCH NV-144A 2.00000% 16-15.09.23	1 000 000.00	1 008 754.30	0.02
USD SIRIUS XM RADIO INC-144A 3.87500% 17-01.08.22	325 000.00	329 127.50	0.01
USD SKY PLC-144A 3.75000% 14-16.09.24	2 000 000.00	2 167 867.20	0.04
USD SMBC AVIATION CAPITAL FINANCE DAC-REG-S 2.65000% 16-15.07.21	9 915 000.00	10 014 298.73	0.18
USD SMITHFIELD FOODS INC-144A 5.20000% 19-01.04.29	4 395 000.00	5 021 016.32	0.09
USD SOCIETE GENERALE-144A 2.62500% 19-16.10.24	1 980 000.00	2 007 116.89	0.04
USD SPRINT NEXTEL CORP-144A 7.00000% 12-01.03.20	1 247 000.00	1 250 865.70	0.02
USD SPRINT SPECTRUM CO III LLC-144A STEP-DOWN 16-20.09.21	2 450 000.00	1 080 583.98	0.02
USD SPRINT SPECTRUM CO III LLC-144A 4.73800% 18-20.03.25	2 915 000.00	3 078 968.75	0.05
USD SPRINT SPECTRUM CO III LLC-144A 5.15200% 18-20.03.28	2 305 000.00	2 512 450.00	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 - U S マルチ・クレジット

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD SRC ENERGY INC 6.25000% 18-01.12.25	3 560 000.00	3 586 700.00	0.06
USD SS&C TECHNOLOGIES INC-144A 5.50000% 19-30.09.27	244 000.00	258 103.20	0.00
USD SUNCOR ENERGY INC 3.60000% 14-01.12.24	1 665 000.00	1 776 589.30	0.03
USD SUNOCO LOGISTICS PARTNERS OPERATIONS LP 4.25000% 14-01.04.24	1 260 000.00	1 336 774.32	0.02
USD SUNOCO LP/FINANCE CORP 4.87500% 18-15.01.23	748 000.00	767 635.00	0.01
USD TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD-REG-S 2.45000% 17-18.01.22	3 000 000.00	3 022 500.00	0.05
USD TC PIPELINES LP 3.90000% 17-25.05.27	1 800 000.00	1 895 999.94	0.03
USD TC PIPELINES LP 4.65000% 11-15.06.21	620 000.00	637 312.76	0.01
USD TENET HEALTHCARE CORP-144A 4.87500% 19-01.01.26	349 000.00	361 869.38	0.01
USD TERVITA ESCROW CORP-144A 7.62500% 16-01.12.21	563 000.00	572 852.50	0.01
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 6.00000% 18-15.04.24	4 300 000.00	4 386 000.00	0.08
USD TEXAS EASTERN TRANSMISSION LP-144A 2.80000% 12-15.10.22	1 375 000.00	1 396 334.23	0.02
USD THOMSON REUTERS CORP 4.30000% 13-23.11.23	2 516 000.00	2 723 392.62	0.05
USD TRANSCONTINENTAL GAS PIPE LINE 4.60000% 18-15.03.48	1 955 000.00	2 163 829.38	0.04
USD TRANSOCEAN PONTUS LTD-144A 6.12500% 18-01.08.25	255 000.00	233 758.50	0.00
USD TRANSOCEAN POSEIDON LTD-144A 6.87500% 19-01.02.27	479 000.00	500 555.00	0.01
USD TRIMBLE INC 4.75000% 14-01.12.24	1 300 000.00	1 429 281.88	0.03
USD TUCSON ELECTRIC POWER CO 3.05000% 15-15.03.25	1 425 000.00	1 498 948.80	0.03
USD UBS GROUP AG-REG-S 3.49100% 17-23.05.23	1 850 000.00	1 913 811.12	0.03
USD UNITED AIRLINES AA PASS THROUGH TRUST 3.50000% 18-01.03.30	1 350 000.00	1 381 613.57	0.02
USD UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC-144A 4.75000% 14-01.08.22	1 555 000.00	1 565 720.17	0.03
USD US BANK NA/CINCINNATI OH 3.40000% 18-24.07.23	3 785 000.00	4 001 428.95	0.07
USD VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-144A 7.00000% 17-15.03.24	525 000.00	544 267.50	0.01
USD VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-144A 9.25000% 18-01.04.26	85 000.00	97 006.25	0.00
USD VENTAS REALITY LP/VENT CAP CORP 3.25000% 12-15.08.22	2 000 000.00	2 062 945.80	0.04
USD VENTAS REALTY LP 4.12500% 15-15.01.26	1 960 000.00	2 147 876.98	0.04
USD VERISK ANALYTICS INC 4.12500% 12-12.09.22	1 500 000.00	1 582 631.85	0.03
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 4.01600% 19-03.12.29	9 247 000.00	10 510 794.90	0.19
USD VIACOMCBS INC 3.87500% 11-15.12.21	833 000.00	864 859.91	0.02
USD VICI PROPERTIES LP / VICI NOTE CO-REG-S 3.50000% 20-15.02.25	375 000.00	380 715.00	0.01
USD VIRGINIA ELECTRIC & POWER CO 4.00000% 16-15.11.46	725 000.00	841 924.38	0.01
USD VM HOLDING SA-144A 5.37500% 17-04.05.27	730 000.00	785 662.50	0.01
USD VOLKSWAGEN GRP OF AMERICA FINANCE-144A 3.87500% 18-13.11.20	625 000.00	634 504.37	0.01
USD VOLKSWAGEN GRP OF AMERICA FINANCE-144A 4.00000% 18-12.11.21	9 315 000.00	9 646 590.71	0.17
USD VOLKSWAGEN GRP OF AMERICA FINANCE-144A 4.25000% 18-13.11.23	7 175 000.00	7 743 241.34	0.14
USD VOLKSWAGEN GRP OF AMERICA FINANCE-144A 4.62500% 18-13.11.25	1 445 000.00	1 627 149.77	0.03
USD WALGREEN CO 3.10000% 12-15.09.22	2 295 000.00	2 360 369.86	0.04
USD WALT DISNEY CO 3.00000% 19-15.09.22	6 600 000.00	6 831 978.12	0.12
USD WALT DISNEY CO 3.70000% 19-15.10.25	2 100 000.00	2 308 890.99	0.04
USD WASTE MANAGEMENT INC 3.15000% 17-15.11.27	1 700 000.00	1 817 606.34	0.03
USD WEA FIN LLC/ WESTF UK&EUR FIN PLC-144A 3.75000% 14-17.09.24	605 000.00	645 763.33	0.01
USD WEA FIN LLC/ WESTF UK&EUR FIN PLC-REG-S 3.25000% 15-05.10.20	3 200 000.00	3 225 335.68	0.06
USD WEA FINANCE LLC-144A 4.12500% 18-20.09.28	6 685 000.00	7 418 921.41	0.13
USD WELLS FARGO BANK NA 2.60000% 18-15.01.21	2 645 000.00	2 667 552.60	0.05
USD WELLTOWER INC 3.75000% 12-15.03.23	500 000.00	525 202.20	0.01
USD WELLTOWER INC 4.25000% 16-01.04.26	1 230 000.00	1 365 190.78	0.02
USD WILLIAMS COMPANIES INC 3.70000% 12-15.01.23	1 181 000.00	1 228 816.44	0.02
USD WILLIAMS COS INC/THE 3.75000% 17-15.06.27	6 025 000.00	6 366 592.80	0.11
USD WILLIAMS COS INC/THE 4.00000% 11-15.11.21	640 000.00	659 477.89	0.01
USD WRKCO INC 3.00000% 19-15.09.24	1 630 000.00	1 692 686.87	0.03
USD WRKCO INC 3.75000% 19-15.03.25	2 240 000.00	2 400 491.52	0.04
USD WRKCO INC 4.65000% 19-15.03.26	730 000.00	822 488.37	0.01
USD XYLEM INC/NY 4.87500% 12-01.10.21	500 000.00	525 001.20	0.01
USD YAMANA GOLD INC 4.62500% 18-15.12.27	970 000.00	1 030 081.80	0.02
USD ZF NORTH AMERICA CAPITAL INC-144A 4.00000% 15-29.04.20	1 518 000.00	1 523 693.11	0.03
USD ZF NORTH AMERICA CAPITAL INC-144A 4.75000% 15-29.04.25	2 065 000.00	2 213 742.77	0.04
米ドル合計		1 027 111 409.48	18.11
ノート、固定利付債合計		1 027 111 409.48	18.11

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 - U S マルチ・クレジット

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / 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 AMERICAN EXPRESS CO 3M LIBOR+65BP 18-27.02.23	3 000 000.00	3 022 369.50	0.05
USD AT&T INC 3M LIBOR+118 BP 18-12.06.24	14 695 000.00	14 956 989.81	0.26
USD AVIATION CAPITAL GROUP LLC-144A 3M LIBOR+95BP 18-01.06.21	1 000 000.00	1 006 000.00	0.02
USD BANCO SANTANDER SA 3M LIBOR+112BP 18-12.04.23	400 000.00	403 411.28	0.01
USD BANK OF AMERICA CORP 2.738%/VAR 18-23.01.22	1 090 000.00	1 099 977.54	0.02
USD BANK OF AMERICA CORP 3.419%/VAR 18-20.12.28	9 553 000.00	10 253 364.82	0.18
USD BECTON DICKINSON & CO 3M LIBOR+87.5BP 18-29.12.20	4 305 000.00	4 307 226.10	0.08
USD BK OF AMERICA CORP 3.004%/VAR 18-20.12.23	2 861 000.00	2 946 923.55	0.05
USD BNP PARIBAS-REG-S 3.052%/VAR 20-13.01.31	3 300 000.00	3 391 334.76	0.06
USD CAPITAL ONE BANK 2.280%/VAR 20-28.01.26	2 995 000.00	3 010 652.17	0.05
USD CIGNA CORP 3M LIBOR+65BP 19-17.09.21	6 000 000.00	6 000 666.00	0.11
USD CITIGROUP INC 2.666%/VAR 20-29.01.31	6 045 000.00	6 119 181.22	0.11
USD CITIZENS BANK NA/PROVIDENCE RI 3M LIBOR+95BP 18-29.03.23	9 370 000.00	9 500 178.35	0.17
USD CONAGRA BRANDS INC 3M LIBOR+50BP 17-09.10.20	2 000 000.00	2 003 814.00	0.04
USD DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA-144A 3M LIBOR+90BP 19-15.02.22	3 500 000.00	3 538 048.50	0.06
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 3.961%/VAR 19-26.11.25	1 700 000.00	1 772 857.41	0.03
USD DUPONT DE NEMOURS INC 3M LIBOR+111BP 18-15.11.23	2 380 000.00	2 429 056.56	0.04
USD ENERGY TRANSFER PARTNERS-SUB 6.250%/VAR 17-PRP	720 000.00	684 000.00	0.01
USD FARMERS EXCHANGE CAPITAL II-144A-SUB 6.151%/VAR 13-01.11.53	1 000 000.00	1 259 909.70	0.02
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3M LIBOR+108BP 17-03.08.22	1 750 000.00	1 732 277.75	0.03
USD HARTFORD FINANCIAL-144A-SUB 3M LIBOR+212.5BP 17-12.02.47	2 070 000.00	1 992 375.00	0.04
USD HSBC HOLDINGS PLC 3.262%/VAR 17-13.03.23	2 500 000.00	2 564 664.25	0.05
USD HSBC HOLDINGS PLC 4.292%/VAR 18-12.09.26	2 120 000.00	2 323 685.36	0.04
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.559%/VAR 18-23.04.24	8 581 000.00	9 017 851.85	0.16
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.207%/VAR 19-01.04.23	4 000 000.00	4 117 564.00	0.07
USD JPMORGAN CHASE & CO 2.739%/VAR 19-15.10.30	1 270 000.00	1 303 735.01	0.02
USD JPMORGAN CHASE BANK NA 2.604%/3M LIBOR+28BP 18-01.02.21	5 735 000.00	5 735 000.00	0.10
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 2.907%/3M LIBOR+81BP 17-07.11.23	3 410 000.00	3 481 952.71	0.06
USD MACQUARIE GROUP LTD-144A 3.189%/VAR 17-28.11.23	7 935 000.00	8 176 370.01	0.14
USD NATIONWIDE MUT INS-144A-SUB 5.81%/3M LIBOR+229BP 08-15.12.24	3 000 000.00	3 001 390.20	0.05
USD NEXTERA ENERGY CAP 3M LIBOR+55BP 18-28.08.21	1 000 000.00	1 000 205.50	0.02
USD OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 3M LIBOR+125BP 19-13.08.21	1 585 000.00	1 593 652.04	0.03
USD PRUDENTIAL FINANCIAL INC-SUB 5.875%/VAR 12-15.09.42	2 070 000.00	2 225 250.00	0.04
USD PRUDENTIAL FINANCIAL INC-SUB 5.625%/VAR 12-15.06.43	6 349 000.00	6 866 258.11	0.12
USD REYNOLDS GROUP INC/LLC/LUX-144A 3M LIBOR+350BP 16-15.07.21	200 000.00	200 002.00	0.00
USD ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC 3M LIBOR+147BP 17-15.05.23	1 070 000.00	1 087 754.72	0.02
USD ROYAL BK OF SCOTLAND GP PLC 3.498%/VAR 17-15.05.23	1 900 000.00	1 953 592.16	0.03
USD STATE STREET CORP 3.776%/3M LIBOR+77BP 18-03.12.24	3 755 000.00	4 022 425.47	0.07
USD TEACHER INS&AN-144A-SUB 4.375%/3M LIBOR+266.1BP 14-15.09.54	400 000.00	422 786.60	0.01
USD TYSON FOODS INC 3M LIBOR+45BP 17-21.08.20	1 000 000.00	1 001 327.50	0.02
USD VOYA FINANCIAL INC-SUB 5.650%/VAR 13-15.05.53	1 470 000.00	1 561 875.00	0.03
USD VULCAN MATERIALS CO 3M LIBOR+60BP 17-15.06.20	2 865 000.00	2 868 405.91	0.05
USD WELLS FARGO BANK NA 3.325%/VAR 18-23.07.21	5 500 000.00	5 540 291.90	0.10
米ドル合計		151 496 654.32	2.67
ノート、変動利付債合計		151 496 654.32	2.67

中期債券、固定利付債

USD			
USD AIB GROUP PLC-144A 4.75000% 18-12.10.23	1 755 000.00	1 905 741.69	0.03
USD BANK OF AMERICA CORP-SUB 4.00000% 15-22.01.25	2 862 000.00	3 102 123.23	0.06
USD BPCE SA-144A-SUB 4.62500% 14-11.07.24	4 620 000.00	5 035 516.33	0.09
USD GENERAL ELECTRIC CO 5.55000% 05-05.01.26	1 095 000.00	1 276 968.41	0.02
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 3.85000% 14-08.07.24	16 760 000.00	17 971 536.82	0.32

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - U S マルチ・クレジット

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-144A 3.40000% 19-08.03.26	6 100 000.00	6 559 477.01	0.12
USD MCDONALD ' S CORP 3.35000% 18-01.04.23	2 400 000.00	2 514 233.76	0.04
USD PNC BANK NATIONAL ASSOCIATION-SUB 2.95000% 13-30.01.23	3 500 000.00	3 615 922.10	0.06
USD RABOBANK NEDERLAND NVNY 2.50000% 16-19.01.21	4 000 000.00	4 031 176.80	0.07
USD SOCIETE GENERALE SA-144A 3.87500% 19-28.03.24	1 665 000.00	1 772 638.58	0.03
USD TORONTO-DOMINION BANK 2.12500% 16-07.04.21	5 000 000.00	5 032 819.00	0.09
USD TORONTO-DOMINION BANK 3.25000% 18-11.06.21	2 675 000.00	2 735 143.63	0.05
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 3.40000% 18-14.04.25	3 460 000.00	3 729 253.05	0.07
USD WELLS FARGO & CO 3.00000% 15-19.02.25	3 500 000.00	3 661 330.05	0.06
USD WELLS FARGO & CO-SUB 3.45000% 13-13.02.23	1 670 000.00	1 742 697.61	0.03
米ドル合計		64 686 578.07	1.14
中期債券、固定利付債合計		64 686 578.07	1.14
中期債券、変動利付債			
USD			
USD AVALON BAY COMMUNITIES INC 3M LIBOR+43BP 17-15.01.21	3 000 000.00	3 000 202.80	0.05
USD BANK OF AMERICA CORP 2.881%/VAR 17-24.04.23	1 795 000.00	1 834 104.07	0.03
USD BANK OF AMERICA CORP 2.369%/VAR 17-21.07.21	2 055 000.00	2 061 168.91	0.04
USD BANK OF AMERICA CORP 3M LIBOR+79BP 18-05.03.24	3 000 000.00	3 020 899.49	0.05
USD BANK OF AMERICA CORP 3.974%/VAR 19-07.02.30	1 300 000.00	1 458 746.90	0.03
USD GENERAL ELECTRIC CO 3M LIBOR+48BP 06-15.08.36	10 141 000.00	8 155 552.83	0.14
USD WELLS FARGO & CO 2.406%/VAR 19-30.10.25	3 050 000.00	3 097 416.52	0.06
USD WELLS FARGO & CO 2.879%/VAR 19-30.10.30	3 000 000.00	3 093 938.10	0.05
米ドル合計		25 722 029.62	0.45
中期債券、変動利付債合計		25 722 029.62	0.45
債券、固定利付債			
USD			
USD ALTA WIND HOLDINGS LLC-144A 7.00000% 10-30.06.35	1 500 000.00	916 364.82	0.02
USD AMERICA WEST AIRLINES PASS THROUGH TRST 7.10000% 02-02.04.21	4 500 000.00	723 179.67	0.01
USD AMERICAN AIR 2013-2 CL B PASS TT-144A 5.60000% 14-15.07.20	4 347 000.00	1 573 871.33	0.03
USD AMERICAN AIRLINES 2019-1 CLASS AA 3.15000% 19-15.02.32	4 500 000.00	4 723 327.35	0.08
USD AMERICAN AIRLINES 3.20000% 16-15.06.28	2 000 000.00	1 820 131.83	0.03
USD ANTHEM INC 3.30000% 12-15.01.23	1 200 000.00	1 250 081.52	0.02
USD BARNABAS HEALTH INC 4.00000% 12-01.07.28	2 000 000.00	2 183 193.00	0.04
USD BMW US CAPITAL LLC-144A 3.10000% 18-12.04.21	2 000 000.00	2 033 407.60	0.04
USD CAPITAL ONE BANK USA NA-SUB 3.37500% 13-15.02.23	8 300 000.00	8 631 604.09	0.15
USD COMCAST CORP 3.15000% 17-15.02.28	4 285 000.00	4 591 733.15	0.08
USD COMMONWEALTH BK OF AUSTRALIA-144A-SUB 4.50000% 15-09.12.25	4 880 000.00	5 365 706.40	0.09
USD CONTINENTAL AIRLINES PASS THRU TRUST 5.98300% 07-19.04.22	3 000 000.00	2 048 902.15	0.04
USD CONTINENTAL AIRLINES PASS THROUGH TRUST 6.90300% 07-19.04.22	16 415 000.00	2 282 110.68	0.04
USD CONTINENTAL RESOURCES INC 4.50000% 13-15.04.23	6 453 000.00	6 812 578.59	0.12
USD COX ENTERPRISES INC-144A 7.37500% 97-15.07.27	280 000.00	357 749.14	0.01
USD DANONE-REG-S 2.58900% 16-02.11.23	8 910 000.00	9 144 064.81	0.16
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP-144A 4.90000% 19-01.10.26	2 455 000.00	2 733 046.67	0.05
USD DELTA AIR LINES INC PASS THROUGH TRUSTS 6.71800% 02-02.01.23	8 775 000.00	2 324 222.97	0.04
USD DELTA AIR LINES INC 6.82100% 07-10.08.22	1 700 000.00	763 159.48	0.01
USD DEUTSCHE TELEKOM INTL FINANCE BV-144A 4.37500% 18-21.06.28	1 200 000.00	1 369 839.00	0.02
USD DOW CHEMICAL CO 3.50000% 14-01.10.24	1 145 000.00	1 219 693.73	0.02
USD ENERGY TRANSFER OPERATING LP 4.25000% 19-15.03.23	1 750 000.00	1 841 450.10	0.03
USD ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LLC 3.75000% 14-15.02.25	1 230 000.00	1 321 436.48	0.02
USD FARMERS INSURANCE EXCHANGE-144A-SUB 8.62500% 94-01.05.24	700 000.00	847 050.89	0.02
USD FIFTH THIRD BANCORP-SUB 4.30000% 13-16.01.24	2 200 000.00	2 384 200.72	0.04
USD FIVE CORNERS FUNDING TRUST-144A 4.41900% 13-15.11.23	9 320 000.00	10 192 535.60	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 - U S マルチ・クレジット

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD INTERSTATE POWER & LIGHT CO 3.60000% 19-01.04.29	4 280 000.00	4 693 649.59	0.08
USD MAGNA INTERNATIONAL INC 3.62500% 14-15.06.24	2 800 000.00	3 001 728.80	0.05
USD METLIFE INC 4.36800% 13-15.09.23	975 000.00	1 064 135.57	0.02
USD METROPOLITAN EDISON CO-144A 4.00000% 14-15.04.25	2 400 000.00	2 583 405.84	0.05
USD MYLAN INC 4.20000% 13-29.11.23	2 190 000.00	2 323 841.19	0.04
USD NBD BANK NA MICHIGAN-SUB 8.25000% 94-01.11.24	1 300 000.00	1 638 794.82	0.03
USD PACIFIC LIFE CORP-144A 6.60000% 03-15.09.33	4 500 000.00	6 094 050.75	0.11
USD PEOPLES UNITED BANK-SUB 4.00000% 14-15.07.24	1 450 000.00	1 529 338.63	0.03
USD PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP 4.50000% 16-15.12.26	1 000 000.00	1 084 050.60	0.02
USD PUGET ENERGY INC 6.00000% 11-01.09.21	2 500 000.00	2 662 521.75	0.05
USD ROCHESTER GAS & ELECTRIC CORP-144A 3.10000% 17-01.06.27	3 500 000.00	3 684 195.20	0.07
USD SEAGATE HDD CAYMAN 4.87500% 17-01.03.24	3 079 000.00	3 296 426.66	0.06
USD SEALED AIR CORP-144A 5.50000% 15-15.09.25	480 000.00	526 200.00	0.01
USD SMBC AVIATION CAPITAL FINANCE DAC-144A 3.00000% 17-15.07.22	1 750 000.00	1 791 052.73	0.03
USD SUTTER HEALTH 3.69500% 18-15.08.28	9 125 000.00	10 023 908.31	0.18
USD SYDNEY AIRPORT FINANCE CO PTY LTD-144A 3.62500% 16-28.04.26	520 000.00	551 902.00	0.01
USD US AIRWAYS 2012-1 CLASS A PAS THRO TRST 5.90000% 12-01.10.24	1 000 000.00	658 093.17	0.01
USD WILLIAMS COMPANIES INC 7.50000% 01-15.01.31	150 000.00	198 141.93	0.00
米ドル合計		126 860 079.31	2.24
債券、固定利付債合計		126 860 079.31	2.24
債券、変動利付債			
USD			
USD CITIGROUP INC-SUB 4.700%/VAR 20-PRP	963 000.00	981 056.25	0.02
USD CITIZENS FINANCIAL GROUP INC-SUB 5.500%/VAR 15-PRP	301 000.00	302 128.75	0.00
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 4.223%/VAR 18-01.05.29	495 000.00	558 418.07	0.01
USD JP MORGAN CHASE & CO-SUB 4.600%/VAR 20-PRP	1 103 000.00	1 124 177.60	0.02
USD JPMORGAN CHASE & CO-SUB 5.000%/VAR 19-PRP	1 498 000.00	1 566 908.00	0.03
USD METLIFE CAPITAL TRUST IV-144A-SUB 7.875%/VAR 07-15.12.37	1 200 000.00	1 632 000.00	0.03
USD WELLS FARGO & CO-SUB 7.980%/3M LIBOR+377BP 08-PRP	1 050 000.00	1 056 615.00	0.02
米ドル合計		7 221 303.67	0.13
債券、変動利付債合計		7 221 303.67	0.13
地方債、固定利付債			
USD			
USD BAY AREA TOLL AUTHORITY 2.57400% 19-01.04.31	5 970 000.00	6 181 457.40	0.11
USD CALIFORNIA, STATE OF 7.95000% 10-01.03.36	1 500 000.00	1 507 305.00	0.03
USD CALIFORNIA, STATE OF 4.60000% 18-01.04.38	3 600 000.00	4 079 556.00	0.07
USD HOUSTON TEXAS WATER & SEWER SYSTEM 3.82800% 14-15.05.28	800 000.00	884 824.00	0.01
USD LOS ANGELES DEPARTMENT OF POWER 5.51600% 10-01.07.27	1 520 000.00	1 870 390.40	0.03
USD LOS ANGELES UNIFIED SCHOOL DISTRICT 6.75800% 10-01.07.34	1 285 000.00	1 851 145.30	0.03
USD NEW YORK CITY TRANS FINANCE AUTH REV 5.26700% 10-01.05.27	1 400 000.00	1 689 254.00	0.03
USD NEW YORK CITY TRANS FIN AUTH REV-SUB 3.95000% 18-01.08.32	1 000 000.00	1 114 420.00	0.02
USD NEW YORK STATE DORMITORY AUTHORITY 5.50000% 10-15.03.30	1 765 000.00	2 133 496.70	0.04
USD RUTGERS STATE UNIVERSITY 4.14600% 18-01.05.48	5 655 000.00	6 122 611.95	0.11
USD UNIVERSITY OF CALIFORNIA 4.60100% 13-15.05.31	1 385 000.00	1 633 856.80	0.03
USD WASHINGTON, STATE OF 5.04000% 10-01.08.31	925 000.00	1 123 246.00	0.02
米ドル合計		30 191 563.55	0.53
地方債、固定利付債合計		30 191 563.55	0.53
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		1 502 484 376.41	26.49

添付の注記は当財務書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

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されていない譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
アセット・バック証券、変動利付債			
USD			
USD NAVIENT STUDENT LOAN TRUST-144A VAR 16-25.06.65	1 000 000.00	1 023 457.30	0.02
米ドル合計		1 023 457.30	0.02
アセット・バック証券、変動利付債合計		1 023 457.30	0.02
モーゲージ・バック証券、固定利付債			
USD			
USD BANK 2017-BNK6-SUB 3.12500% 17-01.07.60	6 000 000.00	6 255 136.80	0.11
USD FANNIE MAE 3.11000% 15-01.06.27	770 000.00	767 039.26	0.01
USD FANNIE MAE 3.46000% 15-01.12.30	795 000.00	822 914.78	0.01
USD FANNIE MAE 3.50000% 15-01.08.30	795 000.00	815 909.51	0.01
USD FANNIE MAE 3.55000% 15-01.08.30	825 000.00	859 752.10	0.02
USD JP MORGAN CHASE COM MTG SEC TRUST-SUB 3.80460% 14-01.07.47	4 750 000.00	5 107 445.57	0.09
米ドル合計		14 628 198.02	0.25
モーゲージ・バック証券、固定利付債合計		14 628 198.02	0.25
ノート、固定利付債			
USD			
USD AIR CANADA CLASS AA PASS THR TRT-144A 3.30000% 17-15.01.30	1 750 000.00	1 702 970.51	0.03
USD AKER BP ASA-REG-S 3.00000% 20-15.01.25	1 450 000.00	1 461 991.50	0.03
USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC 4.00000% 18-15.01.24	4 185 000.00	4 509 732.14	0.08
USD ALIMENTATION COUCHE TARD INC-144A 3.55000% 17-26.07.27	3 530 000.00	3 759 812.54	0.07
USD AMERICAN WATER CAPITAL CORP 2.95000% 17-01.09.27	3 250 000.00	3 393 886.92	0.06
USD BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUT-144A 3.75000% 18-20.07.23	2 470 000.00	2 622 615.62	0.05
USD BAYER US FINANCE II LLC-144A 3.50000% 18-25.06.21	1 900 000.00	1 941 399.10	0.03
USD BAYLOR SCOTT & WHITE HOLDINGS 1.94700% 16-15.11.21	2 000 000.00	2 006 516.60	0.04
USD BBVA USA 2.50000% 19-27.08.24	6 470 000.00	6 520 145.74	0.12
USD BRISTOL MYERS SQUIBB CO-144A 3.45000% 19-15.11.27	500 000.00	546 348.80	0.01
USD BRISTOL MYERS SQUIBB CO-REG-S 2.75000% 19-15.02.23	5 150 000.00	5 299 278.93	0.09
USD BRISTOL MYERS SQUIBB CO-REG-S 3.25000% 19-20.02.23	5 850 000.00	6 101 135.81	0.11
USD CAMERON LNG LLC-REG-S 2.90200% 19-15.07.31	3 200 000.00	3 307 815.36	0.06
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.00000% 17-01.02.28	850 000.00	889 312.50	0.02
USD CCO LLC/CAPITAL 4.20000% 17-15.03.28	1 785 000.00	1 927 300.91	0.03
USD CENTENE CORP-144A 5.37500% 20-15.08.26	74 000.00	78 625.00	0.00
USD CENTERPOINT ENERGY INC 2.50000% 19-01.09.24	3 284 000.00	3 343 635.14	0.06
USD CHENIERE ENERGY PARTNERS LP-REG-S 4.50000% 19-01.10.29	1 890 000.00	1 923 075.00	0.03
USD CIGNA CORP-REG-S 3.25000% 19-15.04.25	2 550 000.00	2 673 850.70	0.05
USD CITIZENS BANK NA/PROVIDENCE RI 2.65000% 17-26.05.22	1 000 000.00	1 018 523.10	0.02
USD COMERICA BANK 2.50000% 19-23.07.24	5 700 000.00	5 864 014.65	0.10
USD COMPASS BANK 2.87500% 17-29.06.22	1 830 000.00	1 871 764.26	0.03
USD CONCHO RESOURCES INC 3.75000% 17-01.10.27	2 030 000.00	2 145 252.84	0.04
USD CVS HEALTH CORP 4.78000% 18-25.03.38	490 000.00	571 541.44	0.01
USD DANSKE BANK AS-144A 5.00000% 19-12.01.22	800 000.00	842 869.04	0.02
USD DH EUROPE FINANCE II SARL 2.20000% 19-15.11.24	5 265 000.00	5 349 548.00	0.09
USD DH EUROPE FINANCE II SARL 2.60000% 19-15.11.29	5 650 000.00	5 794 878.99	0.10
USD DIAMONDBACK ENERGY INC 2.87500% 19-01.12.24	1 695 000.00	1 723 265.48	0.03
USD DISCOVER BANK 2.45000% 19-12.09.24	5 865 000.00	5 930 960.72	0.11
USD DTE ENERGY CO STEP-UP 19-01.10.24	2 800 000.00	2 860 482.52	0.05
USD EMERA US FINANCE LP 2.70000% 17-15.06.21	8 260 000.00	8 358 996.92	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 - U S マルチ・クレジット

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD ENSTAR GROUP LTD 4.50000% 17-10.03.22	6 870 000.00	7 199 057.20	0.13
USD FOX CORP-144A 4.70900% 19-25.01.29	5 422 000.00	6 312 070.64	0.11
USD GLP CAPITAL LP / GLP FINANC II INC 5.75000% 18-01.06.28	2 555 000.00	2 980 816.30	0.05
USD HUNTINGTON BANCSHARES INC/OH 4.00000% 18-15.05.25	4 400 000.00	4 823 509.24	0.09
USD HUNTINGTON BANCSHARES INC/OH 2.55000% 20-04.02.30	6 750 000.00	6 781 146.53	0.12
USD HUNTINGTON NATIONAL BANK 2.50000% 17-07.08.22	2 610 000.00	2 655 737.64	0.05
USD IHS MARKIT LTD-144A 5.00000% 16-01.11.22	3 417 000.00	3 660 686.43	0.06
USD JACKSON NATIONAL LIFE GLOBAL FUND-REG-S 2.50000% 17-27.06.22	2 200 000.00	2 238 057.14	0.04
USD KEURIG DR PEPPER INC 4.05700% 19-25.05.23	9 085 000.00	9 697 940.42	0.17
USD KEURIG DR PEPPER INC 4.41700% 19-25.05.25	5 155 000.00	5 724 981.14	0.10
USD KFC HLDG/PIZZA HUT HLDG/TACO BELL-144A 4.75000% 17-01.06.27	300 000.00	316 038.00	0.01
USD LEAR CORP 3.80000% 17-15.09.27	1 611 000.00	1 679 742.01	0.03
USD MPLX LP-REG-S 3.50000% 19-01.12.22	690 000.00	714 184.64	0.01
USD MPLX LP-REG-S 4.25000% 19-01.12.27	525 000.00	559 192.41	0.01
USD NEXTERA ENERGY CAPITAL HOLDINGS INC 2.80000% 17-15.01.23	3 160 000.00	3 246 473.72	0.06
USD NUVEEN LLC-REG-S 4.00000% 18-01.11.28	4 315 000.00	4 933 837.45	0.09
USD O' REILLY AUTOMOTIVE INC 4.35000% 18-01.06.28	2 415 000.00	2 749 108.01	0.05
USD ONEOK INC 4.00000% 17-13.07.27	536 000.00	576 827.33	0.01
USD PROTECTIVE LIVE CORP-REG-S 4.30000% 18-30.09.28	5 700 000.00	6 391 440.21	0.11
USD PROVIDENCE ST JOSEPH HEALTH OBLGTD GRP 2.53200% 19-01.10.29	3 500 000.00	3 563 486.50	0.06
USD REGIONS FINANCIAL CORP 2.75000% 17-14.08.22	3 750 000.00	3 834 309.75	0.07
USD SABRA HEALTH CARE LP 4.80000% 19-01.06.24	2 812 000.00	3 016 207.44	0.05
USD SANTANDER HOLDINGS USA INC-144A 3.24400% 19-05.10.26	4 612 000.00	4 727 024.20	0.08
USD SL GREEN OPERATING PARTNERSHIP LP 3.25000% 17-15.10.22	1 685 000.00	1 734 777.77	0.03
USD STRYKER CORP 3.65000% 18-07.03.28	1 160 000.00	1 277 033.44	0.02
USD TARGA RESOURCES PARTNERS 6.87500% 19-15.01.29	173 000.00	190 624.38	0.00
USD USA COMPRESSION PARTNERS LLC 6.87500% 19-01.09.27	184 000.00	191 801.60	0.00
USD VEREIT OPERATING PARTNERSHIP LP 3.10000% 19-15.12.29	2 825 000.00	2 875 247.71	0.05
USD VIRGINIA ELECTRIC & POWER CO 3.80000% 18-01.04.28	565 000.00	625 961.24	0.01
USD WALT DISNEY CO 3.70000% 19-15.09.24	1 600 000.00	1 734 610.08	0.03
USD WALT DISNEY CO 7.75000% 19-20.01.24	478 000.00	575 560.37	0.01
USD WESTERN GAS PARTNERS LP 4.50000% 18-01.03.28	2 430 000.00	2 453 420.58	0.04
USD WILLIS NORTH AMERICA INC 2.95000% 19-15.09.29	5 800 000.00	5 920 168.46	0.10
USD XCEL ENERGY INC 4.00000% 18-15.06.28	2 530 000.00	2 830 006.39	0.05
米ドル合計		205 132 633.15	3.62
ノート、固定利付債合計		205 132 633.15	3.62
ノート、変動利付債			
USD			
USD CIT BANK NA 2.969%/VAR 19-27.09.25	6 750 000.00	6 800 625.00	0.12
USD CONAGRA BRANDS INC 3M LIBOR+75BP 18-22.10.20	1 925 000.00	1 925 190.96	0.03
USD ENTERPRISE PRODUCTS-SUB 5.375%/VAR 18-15.02.78	1 975 000.00	2 004 625.00	0.03
USD GENERAL MILLS INC 3M LIBOR+101BP 18-17.10.23	1 005 000.00	1 021 756.47	0.02
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.272%/VAR 17-29.09.25	9 790 000.00	10 286 471.46	0.18
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.220%/VAR 17-01.03.25	17 153 000.00	18 014 801.03	0.32
USD JPMORGAN CHASE & CO 3.509%/3M LIBOR+94.5BP 18-23.01.29	8 705 000.00	9 441 604.91	0.17
USD KINDER MORGAN INC 3M LIBOR+128BP 17-15.01.23	2 725 000.00	2 757 077.88	0.05
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC 2.438%/VAR 20-05.02.26	11 889 000.00	11 967 991.71	0.21
USD PNC BANK NATIONAL ASSOCIATION 2.232%/VAR 19-22.07.22	3 180 000.00	3 204 906.71	0.06
USD WABTEC CORP 3M LIBOR+105BP 18-15.09.21	1 835 000.00	1 835 375.44	0.03
USD WELLS FARGO BANK NA 2.082%/VAR 19-09.09.22	5 000 000.00	5 021 257.50	0.09
米ドル合計		74 281 684.07	1.31
ノート、変動利付債合計		74 281 684.07	1.31

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - U S マルチ・クレジット

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
中期債券、固定利付債			
USD			
USD JOHN DEERE CAPITAL CORP 2.45000% 20-09.01.30	3 300 000.00	3 366 573.21	0.06
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 3.60000% 19-11.01.24	7 570 000.00	8 083 241.46	0.14
USD METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 2.40000% 19-17.06.22	2 875 000.00	2 922 147.13	0.05
USD RYDER SYSTEM INC 2.50000% 17-01.09.22	1 235 000.00	1 252 523.17	0.02
USD TRUIST BANK 3.00000% 18-02.02.23	2 515 000.00	2 603 860.73	0.05
米ドル合計		18 228 345.70	0.32
中期債券、固定利付債合計		18 228 345.70	0.32
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	883 000.00	945 347.22	0.02
USD BANK OF AMERICA CORP 2.456%/VAR 19-22.10.25	5 900 000.00	6 027 351.50	0.10
USD MORGAN STANLEY 2.699%/VAR 20-22.01.31	2 810 000.00	2 855 672.61	0.05
USD WELLS FARGO & CO 3.196%/3M LIBOR+117BP 19-17.06.27	5 320 000.00	5 598 581.80	0.10
米ドル合計		15 426 953.13	0.27
中期債券、変動利付債合計		15 426 953.13	0.27
債券、固定利付債			
USD			
USD ADVOCATE HEALTH & HOSPITALS CORP 3.82900% 18-15.08.28	980 000.00	1 114 970.79	0.02
USD AMERICAN AIRLINES 2019-1 CLASS A 3.50000% 19-15.08.33	4 200 000.00	4 453 827.42	0.08
USD ARES CAPITAL CORP 3.50000% 17-10.02.23	4 165 000.00	4 258 848.69	0.07
USD DUKE ENERGY FLORIDA LLC 3.80000% 18-15.07.28	1 575 000.00	1 760 817.24	0.03
USD ENERGY TRANSFER OPERATING LP 5.87500% 19-15.01.24	500 000.00	557 902.40	0.01
USD ENTERGY ARKANSAS LLC 4.00000% 18-01.06.28	5 500 000.00	6 141 012.35	0.11
USD MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-REG-S 2.25000% 19-01.07.22	2 900 000.00	2 945 330.19	0.05
USD NORTHWELL HEALTHCARE INC 3.39100% 17-01.11.27	8 000 000.00	8 439 914.40	0.15
米ドル合計		29 672 623.48	0.52
債券、固定利付債合計		29 672 623.48	0.52
地方債、固定利付債			
USD			
USD LOS ANGELES UNIFIED SCHOOL DISTRICT A-1 5.75000% 09-01.07.34	3 750 000.00	5 040 937.50	0.09
米ドル合計		5 040 937.50	0.09
地方債、固定利付債合計		5 040 937.50	0.09
転換社債型新株予約権付社債、変動利付債			
USD			
USD BANK OF MONTREAL-SUB 4.338%/VAR 18-05.10.28	8 910 000.00	9 485 496.90	0.17
米ドル合計		9 485 496.90	0.17
転換社債型新株予約権付社債、変動利付債合計		9 485 496.90	0.17
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		372 920 329.25	6.57

添付の注記は当財務書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

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
最近発行された譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
ノート、固定利付債			
USD			
USD ALCON FINANCE CORP-144A 3.00000% 19-23.09.29	2 500 000.00	2 597 622.25	0.05
USD ALIMENTATION COUCHE TARD INC-144A 2.95000% 20-25.01.30	8 435 000.00	8 528 151.07	0.15
USD ALIMENTATION COUCHE TARD INC-144A 3.80000% 20-25.01.50	385 000.00	387 116.65	0.01
USD ASB BANK LTD-144A 3.12500% 19-23.05.24	5 985 000.00	6 248 630.28	0.11
USD BRISTOL MYERS SQUIBB CO-144A 3.25000% 19-15.08.22	7 690 000.00	7 985 965.80	0.14
USD BRISTOL MYERS SQUIBB CO-144A 3.87500% 19-15.08.25	3 735 000.00	4 096 571.53	0.07
USD BRISTOL-MYERS SQUIBB CO-144A 3.90000% 19-20.02.28	2 145 000.00	2 406 461.12	0.04
USD BRISTOL-MYERS SQUIBB CO-144A 2.90000% 19-26.07.24	2 940 000.00	3 069 335.89	0.05
USD BRISTOL-MYERS SQUIBB CO-144A 3.40000% 19-26.07.29	10 595 000.00	11 609 133.27	0.20
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.37500% 19-01.06.29	314 000.00	335 980.00	0.01
USD CELULOSA ARAUCO Y CONSTITUCION SA-144A 4.20000% 19-29.01.30	511 000.00	519 948.88	0.01
USD CIGNA CORP-144A 3.00000% 19-15.07.23	2 106 000.00	2 170 288.18	0.04
USD CIGNA CORP-144A 3.05000% 19-15.10.27	2 625 000.00	2 723 800.80	0.05
USD CIGNA CORP-144A 3.25000% 19-15.04.25	2 000 000.00	2 097 137.80	0.04
USD CIGNA CORP-144A 3.40000% 19-01.03.27	710 000.00	753 089.62	0.01
USD CIGNA CORP-144A 3.50000% 19-15.06.24	1 243 000.00	1 312 989.98	0.02
USD CIGNA CORP-144A 4.50000% 19-25.02.26	2 470 000.00	2 759 620.59	0.05
USD CLECO CORPORATE HOLDINGS LLC-144A 3.37500% 19-15.09.29	320 000.00	324 090.94	0.01
USD DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA-144A 2.55000% 19-15.08.22	2 900 000.00	2 939 007.03	0.05
USD DOMINION ENERGY INC-144A 2.45000% 19-15.01.23	3 500 000.00	3 547 833.80	0.06
USD EXPERIAN FINANCE PLC-144A 2.75000% 19-08.03.30	5 250 000.00	5 345 071.72	0.09
USD HESS MIDSTREAM PARTNERS LP-144A 5.62500% 19-15.02.26	435 000.00	455 316.68	0.01
USD IMPERIAL BRANDS FINANCE PLC-144A 3.50000% 19-26.07.26	926 000.00	958 755.49	0.02
USD INTESA SANPAOLO SPA-144A 3.25000% 19-23.09.24	2 000 000.00	2 043 167.60	0.04
USD IQVIA INC-144A 5.00000% 19-15.05.27	236 000.00	248 989.44	0.00
USD IRON MOUNTAIN INC-144A 4.87500% 19-15.09.29	977 000.00	996 637.70	0.02
USD JACKSON NATIONAL LIFE GLOBAL FUND-144A 2.65000% 19-21.06.24	6 130 000.00	6 319 526.12	0.11
USD KRAFT HEINZ FOODS CO-144A 3.75000% 19-01.04.30	4 760 000.00	5 038 876.97	0.09
USD LEVEL 3 FINANCING INC-144A 4.62500% 19-15.09.27	171 000.00	175 705.92	0.00
USD NRG ENERGY INC-144A 4.45000% 19-15.06.29	2 435 000.00	2 642 356.32	0.05
USD OHIO NATIONAL FINANCIAL SRVCS INC-144A 5.55000% 20-24.01.30	2 500 000.00	2 566 557.75	0.05
USD PROSUS NV-144A 3.68000% 20-21.01.30	552 000.00	563 038.79	0.01
USD RELIANCE STAND LIFE-144A 2.62500% 19-22.07.22	4 780 000.00	4 871 041.79	0.09
USD ROCKIES EXPRESS PIPELINE LLC-144A 3.60000% 20-15.05.25	1 020 000.00	1 027 231.80	0.02
USD ROCKIES EXPRESS PIPELINE LLC-144A 4.80000% 20-15.05.30	900 000.00	884 610.00	0.02
USD SEALED AIR CORP-144A 4.00000% 19-01.12.27	1 197 000.00	1 202 985.00	0.02
USD VISTRA OPERATIONS CO LLC-144A 3.55000% 19-15.07.24	10 070 000.00	10 358 401.78	0.18
USD VISTRA OPERATIONS CO LLC-144A 3.70000% 19-30.01.27	580 000.00	582 674.56	0.01
USD VOLKSWAGEN GROUP OF AMERICA FIN-144A 2.50000% 19-24.09.21	635 000.00	641 015.36	0.01
米ドル合計		113 334 736.27	2.01
ノート、固定利付債合計		113 334 736.27	2.01
ノート、変動利付債			
USD			
USD BNP PARIBAS-144A 2.819%/VAR 19-19.11.25	5 565 000.00	5 709 431.23	0.10
USD BNP PARIBAS-144A 3.052%/VAR 20-13.01.31	7 585 000.00	7 789 691.84	0.13
米ドル合計		13 499 123.07	0.23
ノート、変動利付債合計		13 499 123.07	0.23

添付の注記は当財務書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

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
中期債券、固定利付債			
USD			
USD SOCIETE GENERALE SA-144A 2.62500% 20-22.01.25	1 780 000.00	1 799 779.36	0.03
米ドル合計		1 799 779.36	0.03
中期債券、固定利付債合計		1 799 779.36	0.03
最近発行された譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		128 633 638.70	2.27
第41条(1)h)に規定されたその他の短期金融商品			
国内コマーシャル・ペーパー、ゼロ・クーポン			
USD			
USD FORD MOTOR CREDIT CO LLC-144A CP 0.00000% 12.01.20-08.10.20	2 770 000.00	2 715 768.94	0.05
米ドル合計		2 715 768.94	0.05
国内コマーシャル・ペーパー、ゼロ・クーポン合計		2 715 768.94	0.05
第41条(1)h)に規定されたその他の短期金融商品合計		2 715 768.94	0.05
投資有価証券合計		5 484 696 982.83	96.71

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 06.03.20	-3.00	-8 211.76	0.00
USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 20.03.20	346.00	1 180 594.93	0.02
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.20	526.00	514 057.43	0.01
USD US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 20.03.20	-34.00	-248 015.66	-0.01
USD US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.20	619.00	460 323.28	0.01
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 20.03.20	-360.00	-716 101.44	-0.01
USD US LONG BOND FUTURE 20.03.20	-243.00	-1 135 124.87	-0.02
債券に係る金融先物合計		47 521.91	0.00
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		47 521.91	0.00
派生商品合計		47 521.91	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 - U S マルチ・クレジット

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
先渡為替契約			
先渡為替契約(購入/売却)			
USD 1 994 789.55	EUR 1 786 799.00 2020年2月4日	14 658.90	0.00
EUR 1 497 857 274.27	USD 1 668 965 000.00 2020年2月14日	-7 825 476.20	-0.14
CHF 1 146 979 205.11	USD 1 181 336 000.00 2020年2月14日	8 904 105.10	0.16
GBP 82 936 037.94	USD 107 768 000.00 2020年2月14日	1 593 073.71	0.03
JPY 3 136 769 004.00	USD 28 590 000.00 2020年2月14日	370 495.48	0.01
CHF 16 437 708.00	USD 17 000 000.00 2020年2月14日	57 693.12	0.00
CHF 32 747 032.00	USD 34 000 000.00 2020年2月14日	-17 840.05	0.00
EUR 10 810 976.38	USD 12 000 000.00 2020年2月14日	-10 513.11	0.00
CHF 16 448 537.00	USD 17 000 000.00 2020年2月14日	68 930.56	0.00
USD 1 974 163.28	EUR 1 786 799.00 2020年3月3日	-9 365.38	0.00
EUR 1 786 799.00	USD 1 970 774.08 2020年2月4日	9 356.57	0.00
EUR 23 516 600.01	USD 26 000 000.00 2020年2月14日	80 157.58	0.00
CHF 18 383 526.00	USD 19 000 000.00 2020年2月14日	76 902.02	0.00
GBP 1 370 599.42	USD 1 800 000.00 2020年2月14日	7 299.07	0.00
JPY 50 075 508.00	USD 460 000.00 2020年2月14日	2 326.53	0.00
先渡為替契約(購入/売却)合計		3 321 803.90	0.06
現金預金、要求払預金および預託金勘定その他の流動資産		180 606 492.75	3.18
当座借越およびその他の短期負債		-331 714.81	-0.01
その他の資産および負債		2 731 646.43	0.06
純資産総額		5 671 072 733.01	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

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 比率 （%）
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
アセット・バック証券、固定利付債			
EUR			
EUR CRC BREEZE FINANCE SA 5.29000% 06-08.05.26	1 550 000.00	669 900.19	0.02
EUR CRC BREEZE FINANCE SA 6.11000% 06-08.05.26	550 000.00	149 628.69	0.00
EUR CRC BREEZE FINANCE SA 6.70800% 07-19.04.27	900 000.00	271 325.12	0.01
EUR CRC BREEZE FINANCE SA 4.52400% 07-19.04.27	4 100 000.00	1 560 414.60	0.03
ユーロ合計		2 651 268.60	0.06
アセット・バック証券、固定利付債合計		2 651 268.60	0.06
ノート、固定利付債			
CHF			
CHF SELECTA GROUP BV-REG-S 5.87500% 18-01.02.24	1 375 000.00	1 437 283.39	0.03
スイスフラン合計		1 437 283.39	0.03
EUR			
EUR 3AB OPTIQUE DEVELOPPEMENT SAS-REG-S 4.00000% 17-01.10.23	2 485 000.00	2 802 069.84	0.06
EUR ADIENT GLOBAL HOLDINGS LTD-REG-S 3.50000% 16-15.08.24	3 436 000.00	3 657 748.85	0.08
EUR ALGECO SCOTSMAN GLOBAL FINANCE-REG-S 6.50000% 18-15.02.23	1 800 000.00	1 979 719.50	0.04
EUR ALTICE FRANCE-REG-S 5.87500% 18-01.02.27	9 695 000.00	11 885 548.89	0.27
EUR ALTICE LUXEMBOURG SA-REG-S 8.00000% 19-15.05.27	6 300 000.00	7 889 275.80	0.18
EUR ARAMARK INTERNATIONAL FIN SARL-REG-S 3.12500% 17-01.04.25	500 000.00	565 182.00	0.01
EUR ARD FINANCE SA-REG-S (PIK) 5.00000% 19-30.06.27	2 900 000.00	3 268 767.77	0.07
EUR ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-REG-S 2.12500% 19-15.08.26	3 120 000.00	3 538 145.70	0.08
EUR ARENA LUXEMBOURG FINANCE SARL-REG-S 1.87500% 20-01.02.28	2 075 000.00	2 296 640.61	0.05
EUR ASHLAND SERVICES BV-REG-S 2.00000% 20-30.01.28	2 885 000.00	3 193 959.84	0.07
EUR AVANTOR INC-REG-S 4.75000% 17-01.10.24	1 160 000.00	1 351 677.31	0.03
EUR AVIS BUDGET FINANCE PLC-REG-S 4.75000% 18-30.01.26	2 550 000.00	2 972 009.55	0.07
EUR BALL CORP 0.87500% 19-15.03.24	2 115 000.00	2 343 655.49	0.05
EUR BALL CORP 4.37500% 15-15.12.23	6 500 000.00	8 173 915.86	0.18
EUR BANIJAY GROUP SAS-REG-S 4.00000% 17-01.07.22	300 000.00	338 962.92	0.01
EUR BLITZ F18-674 GMBH-REG-S 6.00000% 18-30.07.26	2 175 000.00	2 593 896.47	0.06
EUR CEMEX SAB DE CV-REG-S 2.75000% 17-05.12.24	4 810 000.00	5 463 911.47	0.12
EUR CEMEX SAB DE CV-REG-S 3.12500% 19-19.03.26	1 150 000.00	1 333 372.39	0.03
EUR CONSUS REAL ESTATE AG-REG-S 9.62500% 19-15.05.24	4 800 000.00	5 944 916.73	0.13
EUR COTY INC-REG-S 4.00000% 18-15.04.23	1 475 000.00	1 667 335.94	0.04
EUR COTY INC-REG-S 4.75000% 18-15.04.26	2 000 000.00	2 327 264.33	0.05
EUR CROWN EUROPEAN HOLDINGS SA-REG-S 2.25000% 18-01.02.23	1 111 000.00	1 280 458.61	0.03
EUR CROWN EUROPEAN HOLDINGS SA-REG-S 2.87500% 18-01.02.26	1 350 000.00	1 608 155.57	0.04
EUR CROWN EUROPEAN HOLDINGS SA-REG-S 0.75000% 19-15.02.23	6 100 000.00	6 728 545.36	0.15
EUR DEMIRE DUTCH MITSTND REL EST AG-REG-S 1.87500% 19-15.10.24	2 600 000.00	2 916 039.91	0.07
EUR DIGI COMMUNICATIONS NV-REG-S 5.00000% 16-15.10.23	400 000.00	454 084.95	0.01
EUR DKT FINANCE APS-REG-S 7.00000% 18-17.06.23	9 480 000.00	11 016 671.97	0.25
EUR DUFFRY ONE BV-REG-S 2.50000% 17-15.10.24	900 000.00	1 009 857.23	0.02
EUR DUFFRY ONE BV-REG-S 2.00000% 19-15.02.27	2 400 000.00	2 640 497.94	0.06
EUR EDREAMS ODIGEO SA-REG-S 5.50000% 18-01.09.23	1 320 000.00	1 514 022.84	0.03
EUR EG GLOBAL FINANCE PLC-REG-S 4.37500% 19-07.02.25	2 550 000.00	2 803 867.91	0.06
EUR EG GLOBAL FINANCE PLC-REG-S 6.25000% 19-30.10.25	1 300 000.00	1 491 083.10	0.03
EUR EIRCOM FINANCE DAC-REG-S 1.75000% 19-01.11.24	4 370 000.00	4 762 675.42	0.11
EUR EL CORTE INGLES SA-REG-S 3.00000% 18-15.03.24	8 090 000.00	9 253 573.61	0.21
EUR ELLAKTOR VALUE PLC-REG-S 6.37500% 19-15.12.24	3 245 000.00	3 685 263.74	0.08
EUR ELLAKTOR VALUE PLC-REG-S 6.37500% 20-15.12.24	100 000.00	113 567.45	0.00
EUR EQUINIX INC 2.87500% 17-01.02.26	1 500 000.00	1 719 313.57	0.04
EUR EUROPCAR MOBILITY GROUP-REG-S 4.12500% 17-15.11.24	1 200 000.00	1 253 321.01	0.03

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR EUROPCAR MOBILITY GROUP-REG-S 4.00000% 19-30.04.26	1 825 000.00	1 880 746.83	0.04
EUR FINANCIAL & RISK US HOLDINGS INC-REG-S 6.87500% 18-15.11.26	3 000 000.00	3 768 999.28	0.08
EUR FINANCIAL & RISK US HOLDINGS INC-REG-S 4.50000% 18-15.05.26	6 940 000.00	8 335 021.55	0.19
EUR FORTUNE STAR BVI LTD-REG-S 4.35000% 19-06.05.23	1 630 000.00	1 837 977.41	0.04
EUR GARRETT LX I SARL/BORROWING LLC-REG-S 5.12500% 18-15.10.26	4 250 000.00	4 641 557.18	0.10
EUR GETLINK SE-REG-S 3.62500% 18-01.10.23	3 800 000.00	4 370 257.62	0.10
EUR GRIFOLS SA-REG-S 1.62500% 19-15.02.25	2 030 000.00	2 274 954.52	0.05
EUR HEMA BONDCO II BV-REG-S 8.50000% 17-15.01.23	1 542 000.00	768 979.98	0.02
EUR HOUSE OF FINANCE NV/THE-REG-S 4.37500% 19-15.07.26	2 575 000.00	2 843 728.09	0.06
EUR IHO VERWALTUNGS GMBH-REG-S (PIK) 3.62500% 19-15.05.25	2 050 000.00	2 332 103.83	0.05
EUR IHO VERWALTUNGS GMBH-REG-S (PIK) 3.87500% 19-15.05.27	4 675 000.00	5 358 796.69	0.12
EUR INEOS FINANCE PLC-REG-S 2.87500% 19-01.05.26	1 800 000.00	2 027 174.85	0.05
EUR INFOR US INC 5.75000% 16-15.05.22	3 500 000.00	3 924 080.79	0.09
EUR INTERNATIONAL DESIGN GROUP SPA-REG-S 6.50000% 18-15.11.25	5 000 000.00	5 818 050.00	0.13
EUR INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC-REG-S 4.75000% 15-15.02.23	3 500 000.00	4 184 535.49	0.09
EUR INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC-REG-S 3.50000% 19-15.06.26	705 000.00	822 298.26	0.02
EUR INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC-REG-S 2.37500% 19-15.04.28	1 000 000.00	1 086 062.60	0.02
EUR INTERTRUST GROUP BV-REG-S 3.37500% 18-15.11.25	4 575 000.00	5 284 882.24	0.12
EUR INTERXION HOLDING NV-REG-S 4.75000% 18-15.06.25	13 270 000.00	15 777 867.85	0.35
EUR INTRUM AB-REG-S 3.00000% 19-15.09.27	3 605 000.00	3 924 348.42	0.09
EUR IQVIA INC-REG-S 2.25000% 19-15.01.28	3 235 000.00	3 637 339.72	0.08
EUR JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-REG-S 4.50000% 18-15.01.26	600 000.00	651 621.60	0.02
EUR JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-REG-S 6.87500% 19-15.11.26	1 658 000.00	1 954 897.06	0.04
EUR JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-REG-S 5.87500% 19-15.11.24	1 625 000.00	1 893 477.45	0.04
EUR JAMES HARDIE INTERNATIONAL LTD-REG-S 3.62500% 18-01.10.26	1 360 000.00	1 599 992.56	0.04
EUR KLEOPATRA HOLDGS 1 SCA-REG-S (PIK) STEP UP 17-30.06.23	2 800 000.00	1 723 551.72	0.04
EUR KRONOS INTERNATIONAL INC-REG-S 3.75000% 17-15.09.25	4 895 000.00	5 525 255.20	0.12
EUR LA FINANCIERE ATALIAN SA-REG-S 5.12500% 18-15.05.25	3 730 000.00	3 461 878.28	0.08
EUR LHMC FINCO SARL-REG-S 6.25000% 18-20.12.23	2 090 000.00	2 427 081.01	0.05
EUR LINCOLN FINANCING SARL-REG-S 3.62500% 19-01.04.24	3 945 000.00	4 459 285.98	0.10
EUR LINCOLN FINANCING SARL-REG-S 3.62500% 20-01.04.24	4 225 000.00	4 775 787.90	0.11
EUR LOXAM SAS-REG-S 2.87500% 19-15.04.26	2 118 000.00	2 349 514.77	0.05
EUR LOXAM SAS-REG-S 3.75000% 19-15.07.26	700 000.00	806 769.60	0.02
EUR LOXAM SAS-REG-S-SUB 5.75000% 19-15.07.27	3 325 000.00	3 795 307.95	0.09
EUR MATTERHORN TELECOM SA-REG-S 4.00000% 17-15.11.27	3 700 000.00	4 320 733.27	0.10
EUR MONITCHEM HOLDCO 2 SA-REG-S-SUB 9.50000% 19-15.09.26	1 000 000.00	1 136 348.28	0.03
EUR MONITCHEM HOLDCO 3 SA-REG-S 5.25000% 19-15.03.25	500 000.00	579 594.14	0.01
EUR MOTION BONDCO DAC-REG-S 4.50000% 19-15.11.27	650 000.00	756 346.50	0.02
EUR MYTILINEOS FINANCIAL PARTNERS SA-REG-S 2.50000% 19-01.12.24	1 810 000.00	2 061 002.66	0.05
EUR NETFLIX INC 3.62500% 17-15.05.27	11 085 000.00	13 095 781.43	0.29
EUR NETFLIX INC-REG-S 3.87500% 19-15.11.29	2 074 000.00	2 422 718.43	0.05
EUR NETFLIX INC-REG-S 3.62500% 19-15.06.30	4 974 000.00	5 718 177.22	0.13
EUR NEXI SPA-REG-S 1.75000% 19-31.10.24	5 220 000.00	5 867 237.46	0.13
EUR NIDDA BONDCO GMBH-REG-S 5.00000% 17-30.09.25	850 000.00	951 399.12	0.02
EUR NIDDA HEALTHCARE HOLDING AG-REG-S 3.50000% 17-30.09.24	14 525 000.00	16 299 422.22	0.37
EUR NIDDA HEALTHCARE HOLDING AG-REG-S 3.50000% 20-30.09.24	3 954 000.00	4 425 641.03	0.10
EUR NITROGENMUEK RT-REG-S 7.00000% 18-14.05.25	1 260 000.00	1 268 152.64	0.03
EUR NOMAD FOODS BONDCO PLC-REG-S 3.25000% 17-15.05.24	2 900 000.00	3 279 212.56	0.07
EUR OCI NV-REG-S 3.12500% 19-01.11.24	6 430 000.00	7 250 426.20	0.16
EUR PEACH PROPERTY FINANCE GMBH-REG-S 3.50000% 19-15.02.23	2 190 000.00	2 496 887.15	0.06
EUR PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 4.75000% 14-14.01.25	1 000 000.00	1 286 897.25	0.03
EUR PIAGGIO & C SPA-REG-S 3.62500% 18-30.04.25	430 000.00	497 969.67	0.01
EUR PICARD BONDCO SA-REG-S 5.50000% 17-30.11.24	1 500 000.00	1 606 297.11	0.04
EUR PLAYTECH PLC-REG-S 3.75000% 18-12.10.23	1 300 000.00	1 481 228.98	0.03
EUR PLAYTECH PLC-REG-S 4.25000% 19-07.03.26	2 325 000.00	2 662 879.92	0.06
EUR PROGROUPE AG-REG-S 3.00000% 18-31.03.26	7 650 000.00	8 386 594.41	0.19
EUR PROMONTORIA HOLDING-REG-S 6.75000% 18-15.08.23	2 000 000.00	2 016 924.00	0.05
EUR PVH CORP-REG-S 3.12500% 17-15.12.27	1 000 000.00	1 241 402.43	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

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR QUINTILES IMS INC-REG-S 2.87500% 17-15.09.25	6 025 000.00	6 802 430.81	0.15
EUR RAFFINERIE HEIDE GMBH-REG-S 6.37500% 17-01.12.22	1 660 000.00	1 785 096.93	0.04
EUR REKEEP SPA-REG-S 9.00000% 17-15.06.22	1 600 000.00	1 652 193.22	0.04
EUR SALINI IMPREGILO SPA-REG-S 1.75000% 17-26.10.24	800 000.00	828 614.44	0.02
EUR SALINI IMPREGILO SPA-REG-S 3.62500% 20-28.01.27	300 000.00	322 153.74	0.01
EUR SAPPI PAPIER HOLDING GMBH-REG-S 3.12500% 19-15.04.26	2 000 000.00	2 138 133.37	0.05
EUR SAZKA GROUP AS-REG-S 4.12500% 19-20.11.24	1 800 000.00	2 062 841.16	0.05
EUR SAZKA GROUP AS-REG-S 3.87500% 20-15.02.27	700 000.00	769 115.18	0.02
EUR SCHAEFFLER FINANCE BV-REG-S 3.25000% 15-15.05.25	2 500 000.00	2 833 756.06	0.06
EUR SCIENTIFIC GAMES INTERNATIONAL-REG-S 5.50000% 18-15.02.26	1 400 000.00	1 597 558.95	0.04
EUR SELECTA GROUP BV-REG-S 5.87500% 18-01.02.24	4 550 000.00	5 092 733.10	0.11
EUR SILGAN HOLDINGS INC 3.25000% 18-15.03.25	1 760 000.00	1 975 725.20	0.04
EUR SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 3.12500% 17-19.09.25	2 625 000.00	2 985 968.71	0.07
EUR SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 4.00000% 17-19.09.29	1 740 000.00	2 041 148.81	0.05
EUR SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 5.00000% 18-15.04.28	5 731 000.00	7 028 057.33	0.16
EUR SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 4.00000% 18-20.04.23	4 500 000.00	5 311 796.52	0.12
EUR SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 4.50000% 18-20.04.25	1 575 000.00	1 903 113.24	0.04
EUR SPCM SA-REG-S 2.87500% 15-15.06.23	1 350 000.00	1 505 046.42	0.03
EUR STANDARD INDUSTRIES INC/NJ-REG-S 2.25000% 19-21.11.26	6 380 000.00	7 164 296.77	0.16
EUR SWISSPORT FINANCING SARL-REG-S 5.25000% 19-15.08.24	4 150 000.00	4 799 087.81	0.11
EUR SWISSPORT FINANCING SARL-REG-S 9.00000% 19-15.02.25	875 000.00	1 021 038.69	0.02
EUR TASTY BONDCO-REG-S 6.25000% 19-15.05.26	2 325 000.00	2 702 172.55	0.06
EUR TELE COLUMBUS AG-REG-S 3.87500% 18-02.05.25	600 000.00	643 310.10	0.01
EUR TELENET FINANCE LUXEMBOURG-REG-S 3.50000% 17-01.03.28	3 700 000.00	4 406 143.37	0.10
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 3.25000% 18-15.04.22	480 000.00	536 091.75	0.01
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 4.50000% 18-01.03.25	275 000.00	308 183.49	0.01
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV-REG-S 6.00000% 19-31.01.25	1 140 000.00	1 353 756.33	0.03
EUR TRANSPORT AEROS PORTUGUES SGPS-REG-S 5.62500% 19-02.12.24	2 200 000.00	2 407 544.29	0.05
EUR UKRAINE, GOVERNMENT OF-REG-S 4.37500% 20-27.01.30	190 000.00	208 662.98	0.01
EUR UNILABS SUBHOLDING AB-REG-S 5.75000% 17-15.05.25	450 000.00	512 758.04	0.01
EUR UNITED GROUP BV-REG-S 4.37500% 17-01.07.22	900 000.00	1 017 477.20	0.02
EUR UNITED GROUP BV-REG-S 4.87500% 19-01.07.24	1 225 000.00	1 404 434.61	0.03
EUR VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-REG-S 4.50000% 15-15.05.23	20 477 000.00	22 825 227.00	0.51
EUR VERITAS US INC / BERMUDA LTD-REG-S 7.50000% 16-01.02.23	2 925 000.00	3 176 655.30	0.07
EUR VICTORIA PLC-REG-S 5.25000% 19-15.07.24	3 390 000.00	3 933 743.18	0.09
EUR VICTORIA PLC-REG-S 5.25000% 20-15.07.24	200 000.00	232 167.90	0.01
EUR VIRIDIAN GROUP FIN/ POWER & ENER-REG-S 4.00000% 17-15.09.25	2 275 000.00	2 590 486.76	0.06
EUR WMG ACQUISITION CORP-REG-S 3.62500% 18-15.10.26	6 925 000.00	8 057 692.28	0.18
EUR ZF EUROPE FINANCE BV-REG-S 2.00000% 19-23.02.26	900 000.00	1 025 565.96	0.02
ユーロ合計		460 234 415.36	10.32
GBP			
GBP ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-REG-S 4.75000% 17-15.07.27	2 750 000.00	3 764 672.43	0.08
GBP CPUK FINANCE LTD-REG-S 4.87500% 17-28.08.25	800 000.00	1 086 839.14	0.02
GBP EI GROUP PLC-REG-S 7.50000% 18-15.03.24	640 000.00	899 595.95	0.02
GBP HEATHROW FINANCE PLC-REG-S 5.75000% 14-03.03.25	2 058 000.00	3 051 962.55	0.07
GBP MPT OPERATING PARTNERSHIP LP/FIN CORP 3.69200% 19-05.06.28	800 000.00	1 121 389.57	0.03
GBP PINNACLE BIDCO PLC-REG-S 6.37500% 18-15.02.25	3 250 000.00	4 490 474.67	0.10
GBP SHOP DIRECT FUNDING PLC-REG-S 7.75000% 17-15.11.22	700 000.00	894 035.41	0.02
GBP VIRGIN MEDIA SECURED FINANCE PLC-REG-S 5.25000% 19-15.05.29	1 750 000.00	2 488 514.44	0.06
GBP VIRGIN MEDIA SECURED FINANCE PLC-REG-S 4.25000% 19-15.01.30	2 080 000.00	2 800 942.99	0.06
英ポンド合計		20 598 427.15	0.46
USD			
USD ACADIA HEALTHCARE CO INC 5.62500% 15-15.02.23	750 000.00	759 997.50	0.02
USD ACADIA HEALTHCARE CO INC 6.50000% 16-01.03.24	1 650 000.00	1 698 984.37	0.04
USD ADVANCED MICRO DEVICES INC 7.50000% 13-15.08.22	500 000.00	564 040.00	0.01
USD AECOM GLOBAL II LLC/URS FOX US LP STEP-UP/DOWN 14-01.04.22	2 603 000.00	2 694 105.00	0.06

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD AES CORP 4.00000% 18-15.03.21	252 000.00	254 961.00	0.01
USD AES CORP 4.50000% 18-15.03.23	700 000.00	713 664.00	0.02
USD AES CORP 5.50000% 15-15.04.25	1 031 000.00	1 063 218.75	0.02
USD AES CORP 6.00000% 16-15.05.26	2 527 000.00	2 662 826.25	0.06
USD AKER BP ASA-144A 5.87500% 18-31.03.25	2 040 000.00	2 139 450.00	0.05
USD ALGECO SCOTSMAN GLOBAL FINANCE-144A 8.00000% 18-15.02.23	775 000.00	773 062.50	0.02
USD ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC 5.87500% 19-01.12.27	1 379 000.00	1 406 373.15	0.03
USD ALTICE FINCO SA-144A 8.12500% 13-15.01.24	606 000.00	623 043.75	0.01
USD ALTICE FRANCE SA/FRANCE-144A 5.50000% 19-15.01.28	2 005 000.00	2 047 646.35	0.05
USD ALTICE FRANCE-144A 7.37500% 16-01.05.26	8 747 000.00	9 316 254.76	0.21
USD ALTICE LUXEMBOURG SA-144A 10.50000% 19-15.05.27	2 145 000.00	2 480 263.50	0.06
USD AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC-SUB 5.75000% 15-15.06.25	2 704 000.00	2 406 560.00	0.05
USD AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC-SUB 5.87500% 17-15.11.26	2 191 000.00	1 895 215.00	0.04
USD AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC-SUB 6.12500% 17-15.05.27	2 435 000.00	2 069 750.00	0.05
USD AMC NETWORKS INC 4.75000% 17-01.08.25	800 000.00	807 664.00	0.02
USD AMC NETWORKS INC 5.00000% 16-01.04.24	200 000.00	204 000.00	0.00
USD AMERICAN AXLE & MANUFACTURING INC 6.25000% 18-15.03.26	1 975 000.00	2 009 562.50	0.05
USD AMERICAN EQTY INVT LIFE HLD 5.00000% 17-15.06.27	900 000.00	984 245.67	0.02
USD AMERIGAS FINANCE LLC/AMERIGAS FIN CORP 5.62500% 16-20.05.24	800 000.00	850 160.00	0.02
USD AMERIGAS FINANCE LLC/AMERIGAS FIN CORP 5.87500% 16-20.08.26	2 125 000.00	2 325 812.50	0.05
USD AMERIGAS PARTNERS LP/FINANCE CORP 5.50000% 16-20.05.25	1 255 000.00	1 342 850.00	0.03
USD AMERIGAS PARTNERS LP/FINANCE CORP 5.75000% 17-20.05.27	800 000.00	874 000.00	0.02
USD ANTERO RESOURCES CORP 5.62500% 15-01.06.23	2 311 000.00	1 663 920.00	0.04
USD ARCONIC INC 5.12500% 14-01.10.24	4 015 000.00	4 335 276.55	0.10
USD ARCONIC INC 5.95000% 07-01.02.37	670 000.00	746 895.90	0.02
USD ARCONIC INC 6.15000% 10-15.08.20	1 000 000.00	1 018 290.00	0.02
USD ARD FINANCE SA-144A (PIK) 6.50000% 19-30.06.27	6 152 000.00	6 351 324.80	0.14
USD ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-144A 6.00000% 17-15.02.25	2 825 000.00	2 952 125.00	0.07
USD ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-144A 4.12500% 19-15.08.26	850 000.00	874 439.20	0.02
USD ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-144A 5.25000% 19-15.08.27	2 205 000.00	2 312 493.75	0.05
USD ASSURANT INC 3.70000% 19-22.02.30	700 000.00	736 789.34	0.02
USD B&G FOODS INC 5.25000% 17-01.04.25	4 449 000.00	4 541 895.12	0.10
USD B&G FOODS INC 5.25000% 19-15.09.27	1 849 000.00	1 844 377.50	0.04
USD BANFF MERGER SUB INC-144A 9.75000% 18-01.09.26	1 800 000.00	1 846 890.00	0.04
USD BARRY CALLEBAUT SERVICES NV-REG-S 5.50000% 13-15.06.23	1 954 000.00	2 142 072.50	0.05
USD BAUSCH HEALTH COS INC-REG-S 6.50000% 17-15.03.22	1 600 000.00	1 629 696.00	0.04
USD BED BATH & BEYOND INC 4.91500% 14-01.08.34	730 000.00	582 029.00	0.01
USD BED BATH & BEYOND INC 5.16500% 14-01.08.44	610 000.00	450 796.10	0.01
USD BLUE CUBE SPINCO INC 9.75000% 16-15.10.23	1 160 000.00	1 236 873.20	0.03
USD BLUE CUBE SPINCO INC 10.00000% 16-15.10.25	4 226 000.00	4 614 496.18	0.10
USD BOMBARDIER INC-144A 8.75000% 16-01.12.21	4 303 000.00	4 604 210.00	0.10
USD BUCKEYE PARTNERS LP 3.95000% 16-01.12.26	760 000.00	749 577.55	0.02
USD BUCKEYE PARTNERS LP 4.12500% 17-01.12.27	335 000.00	330 412.86	0.01
USD CABLEVISION SYSTEMS CORP 5.87500% 12-15.09.22	3 565 000.00	3 814 550.00	0.09
USD CALPINE CORP 5.50000% 15-01.02.24	1 995 000.00	2 020 935.00	0.05
USD CDK GLOBAL INC 5.87500% 18-15.06.26	2 146 000.00	2 280 125.00	0.05
USD CEDAR FAIR LP/CANADA WL CO/MMC/MOP 5.37500% 18-15.04.27	350 000.00	370 686.75	0.01
USD CENTENE CORP 4.75000% 16-15.01.25	2 220 000.00	2 291 217.60	0.05
USD CENTURYLINK INC 5.62500% 15-01.04.25	1 070 000.00	1 134 200.00	0.03
USD CENTURYLINK INC 6.75000% 13-01.12.23	3 192 000.00	3 539 130.00	0.08
USD CENTURYLINK INC 7.50000% 16-01.04.24	184 000.00	207 612.72	0.00
USD CENTURYLINK INC 7.65000% 12-15.03.42	600 000.00	650 538.00	0.01
USD CF INDUSTRIES INC 4.95000% 13-01.06.43	1 000 000.00	1 070 000.00	0.02
USD CF INDUSTRIES INC 5.37500% 14-15.03.44	1 145 000.00	1 287 896.00	0.03
USD CHEMOURS CO/THE 6.62500% 16-15.05.23	890 000.00	876 142.70	0.02
USD CHEMOURS CO/THE 7.00000% 16-15.05.25	930 000.00	890 010.00	0.02
USD CINEMARK USA INC 4.87500% 13-01.06.23	1 655 000.00	1 675 687.50	0.04
USD CIT GROUP INC 4.12500% 18-09.03.21	2 465 000.00	2 504 440.00	0.06

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD CIT GROUP INC-SUB 6.12500% 18-09.03.28	1 595 000.00	1 898 935.22	0.04
USD CLEARWATER SEAFOODS INC-144A 6.87500% 17-01.05.25	4 061 000.00	4 230 221.87	0.09
USD CLEARWAY ENERGY OPERATING LLC 5.75000% 19-15.10.25	900 000.00	945 900.00	0.02
USD CNO FINANCIAL GROUP INC 5.25000% 19-30.05.29	900 000.00	1 014 750.00	0.02
USD COLUMBIA HCA HEALTHCARE CORP 7.69000% 95-15.06.25	1 970 000.00	2 395 421.50	0.05
USD COOPER-STANDARD AUTOMOTIVE INC-144A 5.62500% 16-15.11.26	100 000.00	92 700.00	0.00
USD CORNERSTONE BUILDING BRANDS INC-144A 8.00000% 18-15.04.26	4 275 000.00	4 483 406.25	0.10
USD COVANTA HOLDING CORP 5.87500% 17-01.07.25	940 000.00	974 956.25	0.02
USD COVANTA HOLDING CORP 6.00000% 18-01.01.27	1 040 000.00	1 078 173.20	0.02
USD CRESTWOOD MIDSTREAM PART LP/FIN 6.25000% 16-01.04.23	4 944 000.00	4 989 237.60	0.11
USD CRESTWOOD MIDSTREAM PART LP/FIN 5.75000% 17-01.04.25	75 000.00	76 147.50	0.00
USD CSC HOLDINGS LLC 6.75000% 11-15.11.21	2 000 000.00	2 147 540.00	0.05
USD DANA INC 5.37500% 19-15.11.27	725 000.00	747 656.25	0.02
USD DCP MIDSTREAM OPERATING LP 5.12500% 19-15.05.29	330 000.00	348 150.00	0.01
USD DISH DBS CORP 6.75000% 11-01.06.21	308 000.00	323 015.00	0.01
USD DOMINICAN REPUBLIC-REG-S 6.87500% 16-29.01.26	350 000.00	399 218.75	0.01
USD DRAX FINCO PLC-144A 6.62500% 18-01.11.25	1 837 000.00	1 943 509.26	0.04
USD ENCOMPASS HEALTH CORP 4.50000% 19-01.02.28	1 260 000.00	1 297 850.40	0.03
USD ENCOMPASS HEALTH CORP 4.75000% 19-01.02.30	550 000.00	572 000.00	0.01
USD ENLINK MIDSTREAM LLC 5.37500% 19-01.06.29	1 593 000.00	1 441 665.00	0.03
USD F-BRASILE SPA / F-BRASILE US LLC-144A 7.37500% 19-15.08.26	465 000.00	494 062.50	0.01
USD FIRST QUANTUM MINERALS LTD-144A 7.25000% 17-01.04.23	1 612 000.00	1 608 308.52	0.04
USD FREEPORT-MCMORAN INC 4.55000% 14-14.11.24	285 000.00	301 031.25	0.01
USD GEMS MENASA CAYMAN LTD/GEDL-144A 7.12500% 19-31.07.26	3 301 000.00	3 444 387.18	0.08
USD GENESIS ENERGY LP 6.50000% 17-01.10.25	980 000.00	955 500.00	0.02
USD GENESIS ENERGY LP 6.25000% 17-15.05.26	1 080 000.00	1 031 270.40	0.02
USD GENESIS ENERGY LP 7.75000% 20-01.02.28	6 709 000.00	6 764 550.52	0.15
USD GROUP 1 AUTOMOTIVE INC 5.00000% 15-01.06.22	500 000.00	502 500.00	0.01
USD GULFPORT ENERGY CORP 6.00000% 17-15.10.24	500 000.00	275 600.00	0.01
USD HALYARD HEALTH INC 6.25000% 15-15.10.22	2 400 000.00	2 427 000.00	0.05
USD HCA INC 5.37500% 18-01.09.26	2 710 000.00	3 048 885.50	0.07
USD HCA INC 5.62500% 18-01.09.28	875 000.00	1 013 906.25	0.02
USD HCA INC 5.87500% 15-15.02.26	1 980 000.00	2 274 525.00	0.05
USD HCA INC 5.87500% 19-01.02.29	2 893 000.00	3 414 029.30	0.08
USD HCA INC 7.50000% 11-15.02.22	7 799 000.00	8 560 884.31	0.19
USD HILTON WORLDWIDE FIN LLC/CORP 4.87500% 17-01.04.27	2 150 000.00	2 262 875.00	0.05
USD ICAHN ENTERPRISES LP/FINANCE CORP 6.25000% 17-01.02.22	428 000.00	435 490.00	0.01
USD ICAHN ENTERPRISES LP/FINANCE CORP 6.75000% 17-01.02.24	1 250 000.00	1 296 875.00	0.03
USD IHEARTCOMMUNICATIONS INC-144A 4.75000% 19-15.01.28	150 000.00	152 890.50	0.00
USD INEOS GROUP HOLDINGS SA-144A 5.62500% 16-01.08.24	3 310 000.00	3 392 750.00	0.08
USD INMARSAT FINANCE PLC-144A 4.87500% 14-15.05.22	1 000 000.00	1 012 500.00	0.02
USD IRON MOUNTAIN INC 6.00000% 13-15.08.23	2 670 000.00	2 726 737.50	0.06
USD ISTAR INC 4.75000% 19-01.10.24	1 975 000.00	2 054 000.00	0.05
USD JC PENNEY CORP INC 6.37500% 07-15.10.36	1 470 000.00	443 440.20	0.01
USD KB HOME 4.80000% 19-15.11.29	887 000.00	920 262.50	0.02
USD KB HOME 6.87500% 19-15.06.27	3 450 000.00	4 058 062.50	0.09
USD L BRANDS INC 6.87500% 15-01.11.35	250 000.00	250 625.00	0.01
USD L BRANDS INC 7.50000% 19-15.06.29	1 400 000.00	1 504 125.00	0.03
USD LAREDO PETROLEUM 9.50000% 20-15.01.25	1 454 000.00	1 323 140.00	0.03
USD LAREDO PETROLEUM INC 10.12500% 20-15.01.28	562 000.00	501 500.70	0.01
USD LEVEL 3 FINANCING INC 5.12500% 16-01.05.23	700 000.00	703 290.00	0.02
USD LEVEL 3 FINANCING INC 5.37500% 16-01.05.25	300 000.00	309 750.00	0.01
USD LEVEL 3 FINANCING INC 5.37500% 16-15.01.24	3 720 000.00	3 764 937.60	0.08
USD MANITOWOC FOODSERVICE INC 9.50000% 16-15.02.24	7 435 000.00	7 825 337.50	0.18
USD MDC HOLDINGS INC 6.00000% 13-15.01.43	3 920 000.00	4 363 469.60	0.10
USD MERITAGE HOMES CORP 5.12500% 17-06.06.27	210 000.00	225 750.00	0.01
USD MGM RESORTS INTL 5.50000% 19-15.04.27	1 875 000.00	2 062 500.00	0.05
USD MGM RESORTS INTL 5.75000% 18-15.06.25	2 090 000.00	2 329 973.80	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

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD MGM RESORTS INTL 7.75000% 12-15.03.22	1 500 000.00	1 661 310.00	0.04
USD MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA-144A 5.12500% 17-15.01.28	1 300 000.00	1 366 625.00	0.03
USD MONTAGE RESOURCES CORP 8.87500% 16-15.07.23	2 400 000.00	2 013 000.00	0.05
USD MOTION BONDCO DAC-144A 6.62500% 19-15.11.27	451 000.00	479 187.50	0.01
USD MPT OPERATING PARTNERSHIP LP/FIN CORP 5.00000% 17-15.10.27	9 020 000.00	9 481 824.00	0.21
USD MPT OPERATING PARTNERSHIP LP/FIN CORP 4.62500% 19-01.08.29	2 830 000.00	2 957 350.00	0.07
USD MSCI INC-144A 4.75000% 16-01.08.26	1 566 000.00	1 640 385.00	0.04
USD MURPHY OIL USA INC 4.75000% 19-15.09.29	1 910 000.00	1 995 950.00	0.04
USD MURPHY OIL USA INC 5.62500% 17-01.05.27	245 000.00	263 375.00	0.01
USD NABORS INDUSTRIES INC 5.10000% 14-15.09.23	1 670 000.00	1 523 875.00	0.03
USD NAVIENT CORP 5.00000% 20-15.03.27	950 000.00	947 625.00	0.02
USD NAVIENT CORP 7.25000% 16-25.09.23	6 116 000.00	6 758 180.00	0.15
USD NEPTUNE ENERGY BONDCO PLC-144A 6.62500% 18-15.05.25	3 640 000.00	3 585 400.00	0.08
USD NETFLIX INC 5.50000% 15-15.02.22	1 000 000.00	1 056 350.00	0.02
USD NEWELL BRANDS INC 4.20000% 16-01.04.26	1 750 000.00	1 827 529.55	0.04
USD NIGERIA, FEDERAL REPUBLIC OF-REG-S 8.74700% 18-21.01.31	325 000.00	362 984.38	0.01
USD NOBLE HOLDING INTERNATIONAL LTD 7.75000% 16-15.01.24	147 000.00	75 705.00	0.00
USD NOKIA OYJ 3.37500% 17-12.06.22	550 000.00	558 250.00	0.01
USD NRG ENERGY INC 5.75000% 18-15.01.28	1 035 000.00	1 113 970.50	0.02
USD NRG ENERGY INC 7.25000% 17-15.05.26	2 574 000.00	2 786 406.48	0.06
USD NRG YIELD OPERATING LLC 5.00000% 17-15.09.26	250 000.00	257 500.00	0.01
USD NUSTAR LOGISTICS LP 5.62500% 17-28.04.27	3 400 000.00	3 502 000.00	0.08
USD OASIS PETROLEUM INC 6.87500% 12-15.01.23	1 600 000.00	1 513 500.00	0.03
USD OCEANEERING INTERNATIONAL INC 6.00000% 18-01.02.28	400 000.00	381 722.00	0.01
USD OLIN CORP 5.00000% 18-01.02.30	5 870 000.00	5 975 073.00	0.13
USD OXFORD FINANCE LLC/ ISSUER II INC-144A 6.37500% 17-15.12.22	593 000.00	609 307.50	0.01
USD PRECISION DRILLING CORP 6.50000% 12-15.12.21	65 000.00	17 398.23	0.00
USD PULTEGROUP INC 5.00000% 16-15.01.27	2 980 000.00	3 292 900.00	0.07
USD QEP RESOURCES INC 5.37500% 12-01.10.22	600 000.00	601 500.00	0.01
USD QEP RESOURCES INC 5.62500% 17-01.03.26	1 165 000.00	1 039 704.25	0.02
USD RADIAN GROUP INC 4.87500% 19-15.03.27	900 000.00	951 750.00	0.02
USD RANGE RESOURCES CORP 4.87500% 16-15.05.25	1 550 000.00	1 209 000.00	0.03
USD RANGE RESOURCES CORP 5.87500% 17-01.07.22	94 000.00	89 300.00	0.00
USD REVLO CONSUMER PRODUCTS CORP 6.25000% 16-01.08.24	1 730 000.00	787 150.00	0.02
USD REYNOLDS GROUP INC/LLC/LUX 5.75000% 12-15.10.20	6 357 000.00	6 174 787.15	0.14
USD RHP HOTEL PROPERTIES/RHP FINANCE 5.00000% 15-15.04.23	637 000.00	648 147.50	0.01
USD ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC-SUB 6.12500% 12-15.12.22	500 000.00	547 865.80	0.01
USD SEALED AIR CORP-144A 5.12500% 14-01.12.24	306 000.00	330 480.00	0.01
USD SERVICE PROPERTIES TRUST 4.95000% 17-15.02.27	350 000.00	369 874.05	0.01
USD SIGMA HOLDCO BV-144A 7.87500% 18-15.05.26	7 032 000.00	7 242 960.00	0.16
USD SM ENERGY CO 6.62500% 18-15.01.27	503 000.00	455 215.00	0.01
USD SM ENERGY CO 6.75000% 16-15.09.26	3 686 000.00	3 347 090.73	0.07
USD SPCM SA-144A 4.87500% 17-15.09.25	2 661 000.00	2 747 482.50	0.06
USD SPECTRUM BRANDS INC 5.75000% 16-15.07.25	3 370 000.00	3 500 587.50	0.08
USD SPRINGLEAF FINANCE CORP 7.12500% 18-15.03.26	3 120 000.00	3 579 732.00	0.08
USD SPRINGLEAF FINANCE CORP 6.12500% 19-15.03.24	700 000.00	759 500.00	0.02
USD SPRINGLEAF FINANCE CORP 6.62500% 19-15.01.28	1 325 000.00	1 490 625.00	0.03
USD SPRINGLEAF FINANCE CORP 5.37500% 19-15.11.29	1 225 000.00	1 273 877.50	0.03
USD SPRINT CORP 7.62500% 18-01.03.26	4 910 000.00	5 124 321.50	0.11
USD SPRINT NEXTEL CORP 6.00000% 12-15.11.22	1 570 000.00	1 621 025.00	0.04
USD SPRINT NEXTEL CORP 7.00000% 12-15.08.20	2 494 000.00	2 538 143.80	0.06
USD STARFRUIT US HOLDCO LLC / FINCO BV-144A 8.00000% 18-01.10.26	2 641 000.00	2 740 037.50	0.06
USD STENA INTERNATIONAL SA-144A 6.12500% 20-01.02.25	510 000.00	523 387.50	0.01
USD SUMMIT MATERIALS LLC/FIN 6.12500% 15-15.07.23	8 961 000.00	9 050 610.00	0.20
USD SUMMIT MIDSTREAM HLDG LLC/FIN CORP 5.75000% 17-15.04.25	1 738 000.00	1 336 817.46	0.03
USD T-MOBILE USA INC 4.50000% 18-01.02.26	2 250 000.00	2 313 967.50	0.05
USD T-MOBILE USA INC 4.75000% 18-01.02.28	445 000.00	473 368.75	0.01
USD T-MOBILE USA INC 5.12500% 17-15.04.25	450 000.00	463 414.50	0.01

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD T-MOBILE USA INC 6.00000% 14-01.03.23	3 372 000.00	3 433 640.16	0.08
USD T-MOBILE USA INC 6.00000% 16-15.04.24	4 562 000.00	4 696 008.75	0.11
USD T-MOBILE USA INC 6.37500% 14-01.03.25	2 218 000.00	2 289 397.42	0.05
USD TALEN ENERGY SUPPLY LLC 6.50000% 16-01.06.25	1 450 000.00	1 131 000.00	0.03
USD TARGA RESOURCES PARTNERS 5.87500% 18-15.04.26	425 000.00	448 375.00	0.01
USD TELECOM ITALIA CAPITAL 6.37500% 04-15.11.33	1 110 000.00	1 294 593.00	0.03
USD TELECOM ITALIA CAPITAL 7.20000% 06-18.07.36	5 950 000.00	7 378 000.00	0.17
USD TELECOM ITALIA CAPITAL 7.72100% 08-06.04.38	1 900 000.00	2 468 195.00	0.06
USD TELECOM ITALIA SPA-144A 5.30300% 14-30.05.24	1 607 000.00	1 751 630.00	0.04
USD TELEFLEX INC 4.62500% 17-15.11.27	900 000.00	947 250.00	0.02
USD TELEFLEX INC 4.87500% 16-01.06.26	1 660 000.00	1 730 550.00	0.04
USD TENET HEALTHCARE CORP III 5.12500% 17-01.05.25	3 814 000.00	3 880 745.00	0.09
USD TENET HEALTHCARE CORP 7.00000% 17-01.08.25	1 400 000.00	1 450 162.00	0.03
USD TENNECO INC 5.00000% 16-15.07.26	750 000.00	691 875.00	0.02
USD TESLA INC-144A 5.30000% 17-15.08.25	4 330 000.00	4 373 386.60	0.10
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE CO BV 3.65000% 11-10.11.21	250 000.00	247 812.50	0.01
USD TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NL III BV 2.80000% 16-21.07.23	600 000.00	561 750.00	0.01
USD TRANSDIGM INC-SUB 6.50000% 15-15.05.25	5 684 000.00	5 911 360.00	0.13
USD TRANSDIGM INC-SUB 7.50000% 19-15.03.27	480 000.00	525 600.00	0.01
USD TRANSOCEAN LTD 7.50000% 01-15.04.31	510 000.00	371 025.00	0.01
USD TRANSOCEAN PHOENIX 2 LTD-144A 7.75000% 16-15.10.24	100 000.00	74 200.00	0.00
USD TRINITY INDUSTRIES INC 4.55000% 14-01.10.24	1 400 000.00	1 458 145.50	0.03
USD TRIUMPH GROUP INC 7.75000% 18-15.08.25	70 000.00	68 381.25	0.00
USD TRIVIMUM PACKAGING FINANCE BV-144A 5.50000% 19-15.08.26	3 873 000.00	4 081 173.75	0.09
USD TRIVIMUM PACKAGING FINANCE BV-144A 8.50000% 19-15.08.27	769 000.00	845 900.00	0.02
USD TURKEY, REPUBLIC OF 4.87500% 16-09.10.26	375 000.00	376 054.69	0.01
USD UNITED RENTALS NORTH AMERICA INC 6.50000% 18-15.12.26	1 000 000.00	1 086 250.00	0.02
USD UNITED RENTALS NORTH AMERICA INC 3.87500% 19-15.11.27	200 000.00	202 000.00	0.00
USD UNITED STATES STEEL CORP 6.87500% 17-15.08.25	664 000.00	597 394.16	0.01
USD VALARIS PLC 5.75000% 14-01.10.44	850 000.00	350 625.00	0.01
USD VERISIGN INC 4.75000% 17-15.07.27	2 080 000.00	2 194 400.00	0.05
USD VIRGIN MEDIA FINANCE PLC-144A 6.00000% 14-15.10.24	2 500 000.00	2 575 250.00	0.06
USD VIRGIN MEDIA SECURED FINANCE PLC-144A 5.50000% 16-15.08.26	1 050 000.00	1 101 208.50	0.02
USD VIRGIN MEDIA SECURED FINANCE PLC-144A 5.50000% 19-15.05.29	6 255 000.00	6 583 387.50	0.15
USD WESTERN DIGITAL CORP 4.75000% 18-15.02.26	1 380 000.00	1 473 150.00	0.03
USD WILLIAM LYON HOMES INC 7.00000% 15-15.08.22	33 000.00	33 082.50	0.00
USD WPX ENERGY INC 4.50000% 20-15.01.30	265 000.00	266 648.30	0.01
USD WPX ENERGY INC 5.25000% 19-15.10.27	331 000.00	345 895.00	0.01
USD XEROX CORP 4.07000% 17-17.03.22	448 000.00	458 080.00	0.01
USD XEROX CORP 6.75000% 09-15.12.39	3 960 000.00	4 316 400.00	0.10
USD XEROX CORP STEP UP 17-15.03.23	1 550 000.00	1 604 250.00	0.04
USD YPSO FINANCE BIS SA-144A 6.00000% 20-15.02.28	2 272 000.00	2 250 802.24	0.05
USD ZAYO GROUP LLC/ CAPITAL INC 6.37500% 15-15.05.25	2 102 000.00	2 148 244.00	0.05
USD ZAYO GROUP LLC/ CAPITAL INC 6.00000% 15-01.04.23	3 928 000.00	4 011 470.00	0.09
USD ZIGGO BOND CO BV-144A 6.00000% 16-15.01.27	4 730 000.00	4 967 539.18	0.11
USD ZIGGO BV-144A 4.87500% 19-15.01.30	640 000.00	659 051.46	0.01
USD ZIGGO BV-144A 5.50000% 16-15.01.27	8 711 000.00	9 233 660.00	0.21
米ドル合計		446 864 343.64	10.02
ノート、固定利付債合計		929 134 469.54	20.83
ノート、変動利付債			
EUR ACCOR SA-REG-S-SUB 2.625%/VAR 19-PRP	3 200 000.00	3 546 523.70	0.08
EUR AGEAS-REG-S-SUB 3.875%/VAR 19-PRP	800 000.00	925 329.27	0.02
EUR ALGECO SCOTSMAN FIN PLC-REG-S 3M EURIBOR+625BP 18-15.02.23	500 000.00	542 523.74	0.01
EUR BANCA MONT DEI PAS DI SIENA-REG-S-SUB 8.000%/VAR 20-22.01.30	1 925 000.00	2 217 549.76	0.05
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB 6.125%/VAR 17-PRP	2 200 000.00	2 573 726.68	0.06

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB 2.000%/VAR 20-17.01.30	800 000.00	881 515.47	0.02
EUR BNP PARIBAS CARDIF SA-SUB 4.032%/3M EURIBOR+393BP 14-PRP	3 300 000.00	4 141 620.45	0.09
EUR EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA-REG-S-SUB 4.496%/VAR 19-30.04.79	1 500 000.00	1 854 814.29	0.04
EUR EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA-REG-S-SUB 1.700%/VAR 20-20.07.80	1 700 000.00	1 873 710.21	0.04
EUR FIRE BC SPA-REG-S 3M EURIBOR+475BP 18-30.09.24	1 500 000.00	1 662 300.00	0.04
EUR GALAPAGO SA/LUX-REG-S *DEFAULT* 3M EURIBOR+475BP 14-15.06.21	1 066 000.00	70.88	0.00
EUR GUALA CLOSURES SPA-REG-S 3M EURIBOR+350BP 18-15.04.24	350 000.00	391 748.70	0.01
EUR HEIMSTADEN BOSTAD AB-REG-S-SUB 3.248%/VAR 19-PRP	2 320 000.00	2 616 016.92	0.06
EUR KONINKLIJKE KPN NV-REG-S-SUB 2.000%/VAR 19-PRP	2 900 000.00	3 243 796.71	0.07
EUR PARTS EUROPE SA-REG-S 3M EURIBOR+550BP 19-01.05.22	610 000.00	678 875.01	0.02
EUR RCI BANQUE SA-REG-S-SUB 2.625%/VAR 19-18.02.30	3 000 000.00	3 350 624.97	0.07
EUR SELECTA GROUP BV-REG-S 3M EURIBOR+537.5BP 18-01.02.24	275 000.00	303 383.60	0.01
EUR UNICREDIT SPA-REG-S-SUB 2.731%/VAR 20-15.01.32	3 690 000.00	4 191 309.52	0.09
ユーロ合計		34 995 439.88	0.78
GBP			
GBP STONEGATE PUB CO FIN PLC-REG-S 3M LIBOR+625BP 19-15.03.22	275 000.00	362 957.98	0.01
GBP TVL FINANCE PLC-REG-S 3M LIBOR+537.5BP 19-15.07.25	1 075 000.00	1 424 150.33	0.03
英ポンド合計		1 787 108.31	0.04
USD			
USD AERCAP HOLDINGS NV-SUB 5.875%/VAR 19-10.10.79	410 000.00	438 700.00	0.01
USD BNP PARIBAS SA-REG-S-SUB 6.625%/VAR 19-PRP	460 000.00	501 400.00	0.01
USD COMMERZBANK AG-REG-S-SUB 7.000%/VAR 19-PRP	1 600 000.00	1 730 009.60	0.04
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-144A-SUB 5.100%/VAR 20-PRP	550 000.00	555 500.00	0.01
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S-SUB 6.375%/VAR 19-PRP	1 760 000.00	1 951 400.00	0.05
USD DEUTSCHE BANK AG-SUB 4.296%/VAR 13-24.05.28	1 500 000.00	1 487 904.45	0.03
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY-SUB 4.875%/VAR 17-01.12.32	850 000.00	848 079.00	0.02
USD ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC-SUB 7.500%/VAR 15-PRP	1 300 000.00	1 329 900.00	0.03
USD SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN-REG-S-SUB 5.625%/VAR 17-PRP	1 800 000.00	1 874 250.00	0.04
USD SOCIETE GENERALE SA-REG-S-SUB 7.375%/VAR 18-PRP	2 500 000.00	2 758 525.00	0.06
USD SOCIETE GENERALE SA-REG-S-SUB 7.375%/VAR 16-PRP	1 250 000.00	1 331 000.00	0.03
USD SOFTBANK GROUP CORP-REG-S-SUB 6.000%/VAR 17-PRP	2 250 000.00	2 182 635.00	0.05
USD STANDARD CHARTERED PLC-144A 3M LIBOR+115BP 18-20.01.23	900 000.00	908 042.40	0.02
USD UBS GROUP AG-144A-SUB 7.000%/VAR 19-PRP	1 000 000.00	1 101 110.00	0.03
米ドル合計		18 998 455.45	0.43
ノート、変動利付債合計		55 781 003.64	1.25
中期債券、固定利付債			
EUR			
EUR ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA-REG-S 0.62500% 19-15.07.25	4 600 000.00	5 045 749.97	0.11
EUR ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA-REG-S 1.62500% 19-15.07.29	1 600 000.00	1 807 116.74	0.04
EUR ALDESA FINANCIAL SERVICES SA REG-S 7.25000% 14-01.04.21	1 270 000.00	1 337 043.31	0.03
EUR ALTICE FINANCING SA-REG-S 5.25000% 15-15.02.23	1 500 000.00	1 686 902.04	0.04
EUR AUTOSTRADA PER L' ITALIA SPA 1.62500% 15-12.06.23	200 000.00	218 315.40	0.00
EUR AUTOSTRADA PER L' ITALIA SPA 5.87500% 04-09.06.24	400 000.00	517 274.96	0.01
EUR AUTOSTRADA PER L' ITALIA SPA 2.87500% 13-26.02.21	1 811 000.00	2 034 545.77	0.05
EUR AUTOSTRADA PER L' ITALIA SPA-REG-S 1.87500% 15-04.11.25	170 000.00	186 510.06	0.00
EUR BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA-REG-S 3.62500% 19-24.09.24	600 000.00	699 003.73	0.02
EUR BANCO BPM SPA 2.50000% 19-21.06.24	1 050 000.00	1 221 131.90	0.03
EUR BANCO BPM SPA-REG-S-SUB 6.00000% 10-05.11.20	600 000.00	689 455.55	0.02
EUR BANCO BPM SPA-REG-S-SUB 6.37500% 11-31.05.21	1 850 000.00	2 185 846.15	0.05
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB 5.62500% 16-06.05.26	500 000.00	665 717.90	0.01
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S 1.12500% 19-27.03.25	800 000.00	893 521.27	0.02
EUR BANK OF IRELAND-REG-S-SUB 10.00000% 12-19.12.22	1 500 000.00	2 112 384.35	0.05
EUR BANKIA SA-REG-S 1.00000% 19-25.06.24	4 000 000.00	4 537 715.51	0.10
EUR BANQUE FEDER DU CREDIT MUTUE-REG-S-SUB 1.87500% 19-18.06.29	1 800 000.00	2 139 084.88	0.05

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR CAIXABANK SA-REG-S 1.37500% 19-19.06.26	3 100 000.00	3 585 480.87	0.08
EUR CASINO GUICHARD PERRACHON SA-REG-S 3.31100% 13-25.01.23	500 000.00	540 194.31	0.01
EUR CASINO GUICHARD PERRACHON SA-REG-S STEP-UP 14-07.03.24	5 000 000.00	5 042 310.00	0.11
EUR CASINO GUICHARD PERRACHON SA-REG-S 2.79800% 14-05.08.26	1 700 000.00	1 585 158.42	0.04
EUR CASINO GUICHARD PERRACHON SA-REG-S STEP-UP 14-07.02.25	3 000 000.00	2 831 362.34	0.06
EUR CASINO GUICHARD PERRACHON SA-REG-S 1.86500% 17-13.06.22	2 500 000.00	2 694 477.48	0.06
EUR COMMERZBANK AG-REG-S-SUB 4.00000% 16-23.03.26	3 000 000.00	3 838 270.65	0.09
EUR CONSTELLUM SE-REG-S 4.62500% 14-15.05.21	1 320 000.00	975 264.80	0.02
EUR COTT CORP-REG-S 5.50000% 16-01.07.24	4 850 000.00	5 579 247.76	0.13
EUR DEUTSCHE BANK AG-REG-S 0.37500% 18-18.01.21	1 000 000.00	1 109 419.02	0.02
EUR DEUTSCHE BANK AG-REG-S 1.75000% 18-17.01.28	3 000 000.00	3 443 953.14	0.08
EUR DEUTSCHE BANK AG-SUB 4.50000% 16-19.05.26	7 600 000.00	9 574 863.96	0.21
EUR DOMETIC GROUP AB-REG-S 3.00000% 19-08.05.26	1 000 000.00	1 128 147.60	0.03
EUR EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 5.62500% 18-16.04.30	190 000.00	221 020.11	0.00
EUR ELIS SA-REG-S 1.00000% 19-03.04.25	900 000.00	986 468.66	0.02
EUR ELIS SA-REG-S 1.75000% 19-11.04.24	1 500 000.00	1 702 610.77	0.04
EUR ELIS SA-REG-S 1.87500% 18-15.02.23	6 600 000.00	7 489 658.89	0.17
EUR FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV-REG-S 3.75000% 16-29.03.24	2 000 000.00	2 483 569.28	0.06
EUR FIAT CHRYSLER FINANCE EUROPE-REG-S 4.75000% 14-22.03.21	4 600 000.00	5 362 036.79	0.12
EUR GESTAMP AUTOMOCION SA-REG-S 3.25000% 18-30.04.26	1 000 000.00	1 120 667.25	0.03
EUR GLOBALWORTH REAL ESTATE INVEST-REG-S 3.00000% 18-29.03.25	1 000 000.00	1 206 552.75	0.03
EUR GREIF LUXEMBOURG FINANCE SCA-REG-S 7.37500% 11-15.07.21	489 000.00	592 713.84	0.01
EUR INTESA SANPAOLO SPA-REG-S-SUB 3.92800% 14-15.09.26	3 100 000.00	3 927 798.14	0.09
EUR INTRUM JUSTITIA AB-REG-S 3.50000% 19-15.07.26	2 230 000.00	2 513 792.12	0.06
EUR IPD 3 BV-REG-S 4.50000% 17-15.07.22	5 250 000.00	5 935 574.61	0.13
EUR LEONARDO SPA-REG-S 1.50000% 17-07.06.24	1 250 000.00	1 425 932.02	0.03
EUR MAX TWO LTD 5.70000% 04-02.04.24	350 000.00	110 305.03	0.00
EUR MOBILUX FINANCE SAS-REG-S 5.50000% 16-15.11.24	2 789 000.00	3 173 695.16	0.07
EUR NOKIA OYJ-REG-S 1.00000% 17-15.03.21	6 398 000.00	7 150 814.46	0.16
EUR NOKIA OYJ-REG-S 2.00000% 17-15.03.24	3 100 000.00	3 602 759.30	0.08
EUR NOKIA OYJ-REG-S 2.00000% 19-11.03.26	5 075 000.00	5 842 049.47	0.13
EUR ORANO SA 4.87500% 09-23.09.24	2 900 000.00	3 711 851.63	0.08
EUR ORANO SA-REG-S 3.12500% 14-20.03.23	800 000.00	935 453.78	0.02
EUR ORANO SA-REG-S 3.37500% 19-23.04.26	7 400 000.00	8 856 734.40	0.20
EUR OTE PLC 3.50000% 14-09.07.20	466 000.00	523 547.81	0.01
EUR PHOENIX PIB DUTCH FINANCE BV-REG-S 3.12500% 13-27.05.20	500 000.00	558 283.45	0.01
EUR PPF ARENA 1 BV-REG-S 2.12500% 19-31.01.25	1 070 000.00	1 212 453.92	0.03
EUR RAIFFEISEN BANK INTL AG-REG-S-SUB 6.00000% 13-16.10.23	1 000 000.00	1 323 744.90	0.03
EUR REXEL SA-REG-S 2.62500% 17-15.06.24	1 000 000.00	1 120 880.03	0.03
EUR ROADSTER FINANCE DESIGNATED ACTIVITY CO 2.37500% 17-08.12.27	400 000.00	468 768.60	0.01
EUR SAIPEM FINANCE INTERNATIONAL BV-REG-S 3.00000% 16-08.03.21	500 000.00	570 510.22	0.01
EUR SAIPEM FINANCE INTERNATIONAL BV-REG-S 2.75000% 17-05.04.22	1 359 000.00	1 571 710.32	0.04
EUR SAIPEM FINANCE INTERNATIONAL BV-REG-S 2.62500% 17-07.01.25	2 100 000.00	2 450 562.66	0.05
EUR SAMSONITE FINCO SARL-REG-S 3.50000% 18-15.05.26	1 310 000.00	1 448 432.02	0.03
EUR SEALED AIR CORP-REG-S 4.50000% 15-15.09.23	2 500 000.00	3 101 186.88	0.07
EUR TAKKO LUXEMBOURG 2 S.C.A-REG-S 5.37500% 17-15.11.23	1 500 000.00	1 587 496.50	0.04
EUR TELECOM ITALIA FINANCE SA 7.75000% 03-24.01.33	1 690 000.00	2 809 287.00	0.06
EUR TELECOM ITALIA SPA-REG-S 2.50000% 17-19.07.23	2 000 000.00	2 343 843.00	0.05
EUR TELECOM ITALIA SPA-REG-S 2.87500% 18-28.01.26	5 320 000.00	6 238 171.54	0.14
EUR TELECOM ITALIA SPA-REG-S 4.00000% 19-11.04.24	6 633 000.00	8 126 188.47	0.18
EUR TELECOM ITALIA SPA-REG-S 2.75000% 19-15.04.25	2 682 000.00	3 142 487.15	0.07
EUR TELEFON AB L M ERICSSON REG-S 0.87500% 17-01.03.21	1 349 000.00	1 507 561.34	0.03
EUR TELEFON AB L M ERICSSON-REG-S 1.87500% 17-01.03.24	1 750 000.00	2 054 768.48	0.05
EUR TEOLLISUUDEN VOIMA OY-REG-S 1.12500% 19-09.03.26	1 590 000.00	1 766 189.72	0.04
EUR THYSSENKRUPP AG-REG-S 2.75000% 16-08.03.21	1 174 000.00	1 317 289.64	0.03
EUR THYSSENKRUPP AG-REG-S 2.87500% 19-22.02.24	4 200 000.00	4 770 763.76	0.11
EUR THYSSENKRUPP AG-REG-S 1.87500% 19-06.03.23	3 115 000.00	3 443 412.89	0.08
EUR VOLVO CAR AB-REG-S 2.12500% 19-02.04.24	1 660 000.00	1 904 815.20	0.04
ユーロ合計		193 619 883.80	4.34

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
GBP			
GBP ANGLIAN WATER/OSPREY FINANCING-REG-S 5.00000% 15-30.04.23	906 000.00	1 236 805.90	0.03
GBP ANGLIAN WATER/OSPREY FINANCING-REG-S 4.00000% 17-08.03.26	1 000 000.00	1 318 200.00	0.03
GBP PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 6.25000% 11-14.12.26	1 500 000.00	2 362 255.60	0.05
GBP TELECOM ITALIA SPA 5.87500% 06-19.05.23	3 000 000.00	4 427 799.53	0.10
GBP THAMES WATER KEMBLE FINANCE PLC-REG-S 5.87500% 15-15.07.22	1 854 000.00	2 538 398.25	0.06
GBP WILLIAM HILL PLC-REG-S 4.75000% 19-01.05.26	800 000.00	1 098 904.25	0.02
英ポンド合計		12 982 363.53	0.29
USD			
USD ALTICE FINCO SA-144A-SUB 7.62500% 15-15.02.25	200 000.00	208 000.00	0.00
USD EGYPT, REPUBLIC OF-REG-S 7.50000% 17-31.01.27	200 000.00	228 812.50	0.00
USD NAVIENT CORP 5.62500% 03-01.08.33	1 435 000.00	1 302 262.50	0.03
USD NAVIENT CORP 6.12500% 14-25.03.24	700 000.00	745 724.00	0.02
USD NAVIENT CORP 8.00000% 10-25.03.20	330 000.00	332 310.00	0.01
USD SPRINT CAPITAL CORPORATION 8.75000% 02-15.03.32	6 515 000.00	7 215 362.50	0.16
米ドル合計		10 032 471.50	0.22
中期債券、固定利付債合計		216 634 718.83	4.85
中期債券、変動利付債			
EUR			
EUR AGEAS-REG-S-SUB 3.250%/3M EURIBOR+380BP 19-02.07.49	600 000.00	742 126.33	0.02
EUR AIB GROUP PLC-REG-S-SUB 1.875%/VAR 19-19.11.29	850 000.00	961 596.88	0.02
EUR ALLIED IRISH BANKS PLC-REG-S-SUB 4.125%/VAR 15-26.11.25	1 500 000.00	1 713 688.35	0.04
EUR ARKEMA SA-REG-S-SUB 2.750%/VAR 19-PRP	4 300 000.00	5 053 405.74	0.11
EUR AXA SA-REG-S-SUB 3.250%/VAR 18-28.05.49	2 250 000.00	2 877 084.99	0.06
EUR AXA SA-REG-S-SUB 3.941%/VAR 14-PRP	2 750 000.00	3 427 939.09	0.08
EUR BANCA MONT DEI PAS DI SIENA-REG-S-SUB 5.375%/VAR 18-18.01.28	650 000.00	667 205.66	0.01
EUR BANCO COMERCIAL PORTUGUES-REG-S-SUB 4.500%/VAR 17-07.12.27	2 000 000.00	2 341 072.50	0.05
EUR BANCO COMERCIAL PORTUGUES-REG-S-SUB 3.871%/VAR 19-27.03.30	1 200 000.00	1 380 772.87	0.03
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB 5.375%/VAR 18-12.12.28	1 300 000.00	1 626 217.01	0.04
EUR BANKIA SA-REG-S-SUB 3.750%/VAR 19-15.02.29	7 800 000.00	9 464 582.98	0.21
EUR BARCLAYS PLC-REG-S-SUB 2.000%/VAR 17-07.02.28	1 850 000.00	2 107 164.73	0.05
EUR CAIXABANK SA-REG-S-SUB 2.750%/VAR 17-14.07.28	1 200 000.00	1 409 789.98	0.03
EUR CAIXABANK-REG-S-SUB 2.250%/VAR 18-17.04.30	500 000.00	580 048.17	0.01
EUR DANSKE BANK AS-REG-S-SUB 5.875%/VAR 15-PRP	400 000.00	479 850.60	0.01
EUR DANSKE BANK AS-REG-S-SUB 1.375%/VAR 19-12.02.30	1 725 000.00	1 932 497.23	0.04
EUR DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG-REG-S-SUB 2.875%/VAR 17-28.06.27	2 700 000.00	3 073 286.84	0.07
EUR ELM BV SWISS LIFE INS & PEN GRP-REG-S-SUB 4.500%/VAR 16-PRP	400 000.00	528 064.39	0.01
EUR ERSTE GROUP BANK AG-REG-S-SUB 8.875%/VAR 16-PRP	1 600 000.00	2 010 987.59	0.05
EUR INTESA SANPAOLO SPA-REG-S-SUB 7.000%/VAR 16-PRP	1 451 000.00	1 694 428.11	0.04
EUR NAVIERA ARMAS SA-REG-S 3M EURIBOR+425BP 17-15.11.24	1 520 000.00	1 094 901.60	0.02
EUR NN GROUP NV-REG-S-SUB 3M EURIBOR+290BP 14-PRP	1 000 000.00	1 235 558.78	0.03
EUR NN GROUP NV-REG-S-SUB 4.625%/VAR 17-13.01.48	2 720 000.00	3 602 093.28	0.08
EUR ORANGE SA REG-S-SUB 4.000%/VAR 14-PRP	400 000.00	469 876.80	0.01
EUR ORANGE SA REG-S-SUB 5.000%/VAR 14-PRP	6 200 000.00	8 361 097.71	0.19
EUR OTP BANK NYRT-REG-S-SUB 2.875%/VAR 19-15.07.29	2 050 000.00	2 339 350.91	0.05
EUR RWE AG-REG-S-SUB 2.750%/VAR 15-21.04.75	4 733 000.00	5 317 608.53	0.12
EUR TALANX FINANZ LUX-SUB 8.3673%/VAR 12-15.06.42	1 000 000.00	1 318 523.06	0.03
EUR TDC A/S 3.750%/RATING LINKED 12-02.03.22	350 000.00	423 759.61	0.01
EUR TOTAL SA-REG-S-SUB 2.625%/VAR 15-PRP	2 750 000.00	3 288 093.12	0.07
EUR TOTAL SA-REG-S-SUB 3.369%/VAR 16-PRP	3 000 000.00	3 794 199.75	0.09
EUR TRAFIGURA GROUP PTE LTD-REG-S-SUB 7.500%/VAR 19-PRP	799 000.00	863 368.63	0.02
EUR UNICREDIT SPA-REG-S-SUB 5.750%/VAR 13-28.10.25	2 300 000.00	2 646 833.08	0.06
EUR UNICREDIT SPA-REG-S-SUB 4.375%/VAR 16-03.01.27	800 000.00	940 072.76	0.02
EUR UNIONE DI BANCHE ITALIANE-REG-S-SUB 4.250%/VAR 16-05.05.26	4 025 000.00	4 605 471.42	0.10

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR UNIONE DI BANCHE ITALIANE-REG-S-SUB 4.450%/VAR 17-15.09.27	1 875 000.00	2 190 080.25	0.05
EUR UNIONE DI BANCHE ITALIANE-REG-S-SUB 5.875%/VAR 19-04.03.29	600 000.00	738 500.05	0.02
EUR UNIONE DI BANCHE ITALIANE-REG-S-SUB 4.375%/VAR 19-12.07.29	625 000.00	728 225.92	0.02
EUR UNIPOLSAI SPA-SUB 5.750%/VAR 14-PRP	1 100 000.00	1 322 965.83	0.03
ユーロ合計		89 352 391.13	2.00
USD			
USD BANK OF IRELAND GROUP PLC-REG-S-SUB 4.125%/VAR 17-19.09.27	1 370 000.00	1 398 649.44	0.03
USD ERSTE GROUP BANK AG-REG-S-SUB 5.500%/VAR 14-26.05.25	1 600 000.00	1 616 121.60	0.04
USD JPMORGAN CHASE & CO-SUB 6.750%/3M LIBOR+378BP 14-PRP	1 600 000.00	1 803 776.00	0.04
USD ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC-SUB 8.000%/VAR 15-PRP	1 000 000.00	1 166 880.00	0.03
米ドル合計		5 985 427.04	0.14
中期債券、変動利付債合計		95 337 818.17	2.14
債券、固定利付債			
CHF			
CHF TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE 0.50000% 16-28.07.22	525 000.00	526 660.27	0.01
スイスフラン合計		526 660.27	0.01
EUR			
EUR ADLER REAL ESTATE AG-REG-S 1.87500% 18-27.04.23	600 000.00	680 711.85	0.01
EUR ADLER REAL ESTATE AG-REG-S 3.00000% 18-27.04.26	1 400 000.00	1 656 204.90	0.04
EUR ADLER REAL ESTATE AG-REG-S 1.50000% 17-06.12.21	1 540 000.00	1 738 627.27	0.04
EUR ALMAVIVA-THE ITALIAN INNOVATION-REG-S 7.25000% 17-15.10.22	1 430 000.00	1 491 437.05	0.03
EUR ALTICE FINANCING SA-REG-S 3.00000% 20-15.01.28	10 234 000.00	11 114 492.42	0.25
EUR ALTICE FRANCE-REG-S 3.37500% 19-15.01.28	5 411 000.00	6 089 187.62	0.14
EUR ALTICE FRANCE-REG-S 2.50000% 19-15.01.25	2 170 000.00	2 401 788.00	0.05
EUR ALTICE FRANCE-REG-S 2.12500% 20-15.02.25	1 150 000.00	1 248 941.40	0.03
EUR ALTICE LUXEMBOURG SA-REG-S 6.25000% 15-15.02.25	1 000 000.00	1 145 391.19	0.03
EUR ARDAGH PACKAGING FINANCE/MP-REG-S 2.75000% 17-15.03.24	2 406 000.00	2 705 470.91	0.06
EUR ARENA LUXEMBOURG FINANCE SARL-REG-S 2.87500% 17-01.11.24	1 350 000.00	1 544 213.54	0.03
EUR AXALTA COATING SYSTEMS LLC-REG-S 4.25000% 16-15.08.24	5 000 000.00	5 674 427.28	0.13
EUR AXALTA COATING SYSTEMS DUTCH HLDG-REG-S 3.75000% 16-15.01.25	6 100 000.00	6 863 962.07	0.15
EUR BELDEN INC-REG-S-SUB 4.12500% 16-15.10.26	4 550 000.00	5 367 639.83	0.12
EUR BELDEN INC-REG-S-SUB 3.37500% 17-15.07.27	2 250 000.00	2 597 950.49	0.06
EUR BELDEN INC-REG-S-SUB 3.87500% 18-15.03.28	5 068 000.00	5 956 619.01	0.13
EUR BERRY GLOBAL INC-REG-S 1.00000% 20-15.01.25	2 854 000.00	3 131 174.77	0.07
EUR BERRY GLOBAL INC-REG-S 1.50000% 20-15.01.27	2 596 000.00	2 864 671.93	0.06
EUR BWAY HOLDING CO-REG-S 4.75000% 18-15.04.24	4 610 000.00	5 216 802.08	0.12
EUR CATALENT PHARMA SOLUTIONS INC-REG-S 4.75000% 16-15.12.24	2 675 000.00	3 031 016.21	0.07
EUR CEMEX FINANCE LLC-REG-S 4.62500% 16-15.06.24	1 590 000.00	1 830 316.98	0.04
EUR CHEMOURS CO/THE 4.00000% 18-15.05.26	7 465 000.00	7 501 365.24	0.17
EUR CMA CGM SA-REG-S 5.25000% 17-15.01.25	2 000 000.00	1 734 333.00	0.04
EUR COLFAX CORP-REG-S 3.25000% 17-15.05.25	2 187 000.00	2 472 203.01	0.06
EUR CONSTANTIN INVESTISSEMENT 3 SASU-REG-S 5.37500% 18-15.04.25	300 000.00	335 784.60	0.01
EUR CONTOURGLOBAL POWER HOLDINGS SA-REG-S 3.37500% 18-01.08.23	1 300 000.00	1 472 262.32	0.03
EUR CONTOURGLOBAL POWER HOLDINGS SA-REG-S 4.12500% 18-01.08.25	550 000.00	634 652.29	0.01
EUR CROWN EUROPEAN HOLDINGS SA-REG-S 4.00000% 14-15.07.22	2 000 000.00	2 379 150.25	0.05
EUR CROWN EUROPEAN HOLDINGS SA-REG-S 3.37500% 15-15.05.25	4 969 000.00	5 995 691.02	0.13
EUR CROWN EUROPEAN HOLDINGS SA-REG-S 2.62500% 16-30.09.24	4 500 000.00	5 254 945.87	0.12
EUR CRYSTAL ALMOND SARL-REG-S 4.25000% 19-15.10.24	2 000 000.00	2 284 000.20	0.05
EUR CTC BONDCO GMBH-REG-S 5.25000% 17-15.12.25	4 000 000.00	4 593 090.05	0.10
EUR EC FINANCE PLC-REG-S 2.37500% 17-15.11.22	2 240 000.00	2 489 854.82	0.06
EUR EIRCOM FINANCE DAC-REG-S 3.50000% 19-15.05.26	6 719 000.00	7 715 913.15	0.17
EUR EIRCOM FINANCE DAC-REG-S 2.62500% 19-15.02.27	2 600 000.00	2 852 506.80	0.06
EUR ENERGIZER GAMMA ACQUISITION BV-REG-S 4.62500% 18-15.07.26	3 050 000.00	3 527 905.71	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

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR EQUINIX INC 2.87500% 17-01.10.25	13 324 000.00	15 156 356.09	0.34
EUR FAURECIA SA-REG-S 2.62500% 18-15.06.25	2 230 000.00	2 547 895.87	0.06
EUR FAURECIA SA-REG-S 3.12500% 19-15.06.26	3 885 000.00	4 499 141.12	0.10
EUR FAURECIA SE-REG-S 2.37500% 19-15.06.27	4 275 000.00	4 816 634.26	0.11
EUR FNAC DARTY SA-REG-S 2.62500% 19-30.05.26	3 000 000.00	3 407 715.00	0.08
EUR GALAPAGO SA/LUX-REG-S *DEFAULT* 5.37500% 14-15.06.21	1 680 000.00	111.70	0.00
EUR GOODYEAR DUNLOP TIRES EUROPE BV-REG-S 3.75000% 15-15.12.23	2 857 000.00	3 203 740.99	0.07
EUR GRIFOLS SA-REG-S 2.25000% 19-15.11.27	5 775 000.00	6 543 851.74	0.15
EUR GRIFOLS SA-REG-S 3.20000% 17-01.05.25	5 065 000.00	5 712 383.68	0.13
EUR GRUPO-ANTOLIN IRAUSA SA-REG-S 3.25000% 17-30.04.24	600 000.00	644 048.16	0.01
EUR HANESBRANDS FINANCE LUXEMBOURG SC-REG-S 3.50000% 16-15.06.24	1 750 000.00	2 093 516.69	0.05
EUR HERTZ HOLDINGS NETHER BV-REG-S 5.50000% 18-30.03.23	5 025 000.00	5 713 602.70	0.13
EUR HORNBAACH BAUMARKT AG 3.25000% 19-25.10.26	1 500 000.00	1 768 369.71	0.04
EUR HP PELZER HOLDING GMBH-REG-S 4.12500% 17-01.04.24	700 000.00	739 497.42	0.02
EUR IHO VERWALTUNGS GMBH-REG-S (PIK) 3.75000% 16-15.09.26	7 100 000.00	8 133 205.91	0.18
EUR INEOS GROUP HOLDINGS SA-REG-S 5.37500% 16-01.08.24	500 000.00	566 545.09	0.01
EUR INEOS STYROLUTION GROUP GMBH-REG-S 2.25000% 20-16.01.27	1 650 000.00	1 805 684.35	0.04
EUR INTER MEDIA COMMUNICATION SRL-REG-S 4.87500% 17-31.12.22	2 460 000.00	2 706 895.24	0.06
EUR INTRUM JUSTITIA AB-REG-S 2.75000% 17-15.07.22	6 800 000.00	3 809 515.09	0.09
EUR INTRUM JUSTITIA AB-REG-S 3.12500% 17-15.07.24	1 800 000.00	2 025 718.68	0.05
EUR JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC-REG-S 2.20000% 17-15.01.24	725 000.00	765 281.36	0.02
EUR KAEFER ISOLIERTTECHNIK-REG-S 5.50000% 18-10.01.24	2 975 000.00	3 445 255.27	0.08
EUR KAPLA HOLDING SAS-REG-S 3.37500% 19-15.12.26	5 370 000.00	6 011 377.48	0.13
EUR KIRK BEAUTY ONE GMBH-REG-S 8.75000% 15-15.07.23	6 385 000.00	5 443 102.98	0.12
EUR KME AG-REG-S 6.75000% 18-01.02.23	3 620 000.00	3 129 113.52	0.07
EUR KONGSBERG ACTUATION SYSTEMS BV-REG-S 5.00000% 18-15.07.25	1 000 000.00	1 146 987.00	0.03
EUR KRATON POLYMERS LLC/CAPITAL CORP-REG-S 5.25000% 18-15.05.26	3 200 000.00	3 644 782.92	0.08
EUR LA FINANCIERE ATALIAN SA-REG-S 4.00000% 17-15.05.24	790 000.00	731 024.13	0.02
EUR LHC3 PLC-REG-S (PIK) 4.12500% 17-15.08.24	2 600 000.00	2 961 132.58	0.07
EUR LHMC FINCO 2 SARL-REG-S (PIK) 7.25000% 19-02.10.25	800 000.00	912 314.57	0.02
EUR LKQ EUROPEAN HOLDINGS BV-REG-S 3.62500% 18-01.04.26	7 925 000.00	9 091 189.36	0.20
EUR LKQ EUROPEAN HOLDINGS BV-REG-S 4.12500% 18-01.04.28	1 950 000.00	2 367 234.89	0.05
EUR LKQ ITALIA BONDCO SPA-REG-S 3.87500% 16-01.04.24	3 000 000.00	3 685 851.04	0.08
EUR LOUVRE BIDCO SAS-REG-S 4.25000% 17-30.09.24	1 540 000.00	1 764 185.74	0.04
EUR LOXAM SAS-REG-S 3.25000% 19-14.01.25	3 025 000.00	3 417 762.10	0.08
EUR LOXAM SAS-REG-S 3.50000% 16-03.05.23	2 420 000.00	2 711 612.47	0.06
EUR LOXAM SAS-REG-S 3.50000% 17-15.04.22	620 000.00	695 672.55	0.02
EUR LOXAM SAS-REG-S 4.25000% 17-15.04.24	1 060 000.00	1 200 065.35	0.03
EUR LOXAM SAS-REG-S 6.00000% 17-15.04.25	1 100 000.00	1 256 699.91	0.03
EUR LSF10 WOLVERINE INVESTMENTS SCA-REG-S 5.00000% 18-15.03.24	740 000.00	836 001.92	0.02
EUR LSF9 BALTA ISSUER SA-REG-S 7.75000% 15-15.09.22	1 330 000.00	1 109 118.63	0.02
EUR MANGROVE LUXCO III-REG-S (PIK) 7.77500% 19-09.10.25	1 121 547.00	1 168 324.49	0.03
EUR MASARIA INVESTMENTS SAU-REG-S 5.00000% 17-15.09.24	500 000.00	566 157.22	0.01
EUR MATTERHORN TELECOM SA-REG-S 2.62500% 19-15.09.24	340 000.00	389 937.90	0.01
EUR MATTERHORN TELECOM SA-REG-S 3.12500% 19-15.09.26	4 670 000.00	5 298 207.23	0.12
EUR MAXEDA DIY HOLDING BV-REG-S 6.12500% 17-15.07.22	3 040 000.00	3 233 766.61	0.07
EUR MEDIABANCA SPA-SUB 5.75000% 13-18.04.23	1 000 000.00	1 261 246.85	0.03
EUR MEDIABANCA-BANCA DI CREDITO FIN SPA-SUB 5.00000% 10-15.11.20	500 000.00	574 346.82	0.01
EUR MOBY SPA-REG-S 7.75000% 16-15.02.23	2 000 000.00	702 187.21	0.02
EUR MPT OPERATING PARTNERSHIP LP/FIN CORP 4.00000% 15-19.08.22	750 000.00	902 836.69	0.02
EUR MPT OPERATING PARTNERSHIP LP/FIN CORP 3.32500% 17-24.03.25	6 000 000.00	7 381 050.85	0.17
EUR NEMAK SAB DE CV-REG-S 3.25000% 17-15.03.24	747 000.00	861 455.81	0.02
EUR NETFLIX INC 4.62500% 18-15.05.29	6 081 000.00	7 507 745.23	0.17
EUR NEXANS SA-REG-S 3.25000% 16-26.05.21	2 000 000.00	2 273 228.50	0.05
EUR NH HOTEL GROUP SA-REG-S 3.75000% 16-01.10.23	2 800 000.00	2 832 054.04	0.06
EUR NIDDA BONDCO GMBH-REG-S 7.25000% 18-30.09.25	300 000.00	349 162.79	0.01
EUR OBRASCON HUARTE LAIN SA-REG-S 4.75000% 14-15.03.22	500 000.00	429 892.95	0.01
EUR OCI NV-REG-S 5.0000% 18-15.04.23	379 000.00	432 608.03	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

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR OI EUROPEAN GROUP BV-REG-S 3.12500% 16-15.11.24	4 366 000.00	5 080 321.26	0.11
EUR OI EUROPEAN GROUP BV-REG-S 2.87500% 19-15.02.25	3 669 000.00	4 167 635.45	0.09
EUR PAPREC HOLDING-REG-S 4.00000% 18-31.03.25	2 040 000.00	2 062 914.30	0.05
EUR PHOENIX PIB DUTCH FINANCE BV-REG-S 3.62500% 14-30.07.21	1 000 000.00	1 159 620.48	0.03
EUR PLATIN 1426 GMBH-REG-S 5.37500% 17-15.06.23	4 150 000.00	4 570 378.05	0.10
EUR PLATIN 1426 GMBH-REG-S 6.87500% 18-15.06.23	670 000.00	753 631.41	0.02
EUR POLYGON AB-REG-S 4.00000% 18-23.02.23	2 500 000.00	2 818 983.75	0.06
EUR PRESTIGE BIDCO GMBH-REG-S 6.25000% 16-15.12.23	1 800 000.00	2 058 408.80	0.05
EUR PRO-GEST SPA-REG-S 3.25000% 17-15.12.24	1 300 000.00	864 396.00	0.02
EUR PVH CORP-REG-S 3.62500% 16-15.07.24	900 000.00	1 120 157.48	0.02
EUR QUATRIM SASU-REG-S 5.87500% 19-15.01.24	2 980 000.00	3 442 789.53	0.08
EUR QUINTILES IMS INC-REG-S 3.50000% 16-15.10.24	14 348 000.00	16 140 550.45	0.36
EUR QUINTILES IMS INC-REG-S 3.25000% 17-15.03.25	5 078 000.00	5 711 851.19	0.13
EUR RADISSON HOTEL-REG-S 6.87500% 18-15.07.23	3 040 000.00	3 571 063.68	0.08
EUR RCS & RDS SA-REG-S 3.25000% 20-05.02.28	1 900 000.00	2 099 242.20	0.05
EUR RESIDOMO SRO-REG-S 3.37500% 17-15.10.24	9 175 000.00	10 498 186.39	0.23
EUR REXEL SA-REG-S 2.12500% 17-15.06.25	1 250 000.00	1 401 789.88	0.03
EUR REXEL SA-REG-S 2.75000% 19-15.06.26	8 665 000.00	9 947 591.92	0.22
EUR ROSSINI SARL-REG-S 6.75000% 18-30.10.25	3 040 000.00	3 703 799.44	0.08
EUR SAFARI HOLDING VERWALTUNGS GMBH-REG-S 5.37500% 17-30.11.22	500 000.00	469 289.46	0.01
EUR SALINI IMPREGILO SPA-REG-S 3.75000% 16-24.06.21	1 800 000.00	2 026 620.30	0.05
EUR SAPPI PAPIER HOLDING AG-REG-S 4.00000% 16-01.04.23	1 400 000.00	1 567 479.64	0.03
EUR SCHMOLZ + BICKENBACH LUXEMBOURG-REG-S 5.62500% 17-15.07.22	1 500 000.00	1 672 024.46	0.04
EUR SCHOELLER PACKAGING BV-REG-S 6.37500% 19-01.11.24	1 380 000.00	1 605 820.18	0.04
EUR SGL CARBON SE-REG-S 4.62500% 19-30.09.24	2 225 000.00	2 354 786.48	0.05
EUR SMURFIT KAPPA ACQUISITIONS-REG-S 2.87500% 18-15.01.26	5 335 000.00	6 444 810.39	0.14
EUR SMURFIT KAPPA TREASURY ULC-REG-S 1.50000% 19-15.09.27	5 335 000.00	5 932 230.40	0.13
EUR SOFTBANK GROUP CORP-REG-S 4.00000% 15-30.07.22	1 000 000.00	1 180 177.59	0.03
EUR SPECTRUM BRANDS INC-REG-S 4.00000% 16-01.10.26	6 490 000.00	7 551 828.90	0.17
EUR SPIE SA-REG-S 2.62500% 19-18.06.26	16 800 000.00	19 179 830.18	0.43
EUR SPIE SA-REG-S 3.12500% 17-22.03.24	2 600 000.00	3 065 004.15	0.07
EUR STARFRUIT US HOLDCO LLC / FINCO BV-144A 6.50000% 18-01.10.26	2 250 000.00	2 616 875.78	0.06
EUR STENA INTERNATIONAL SA-REG-S 3.75000% 20-01.02.25	300 000.00	337 862.48	0.01
EUR SUMMER BC HOLDCO B SARL-REG-S 5.75000% 19-31.10.26	5 980 000.00	6 913 058.87	0.15
EUR SUMMER BIDCO BV-REG-S (PIK) 9.00000% 20-15.11.25	800 000.00	937 537.20	0.02
EUR SUMMIT GERMANY LTD-144A 2.00000% 18-31.01.25	500 000.00	551 767.24	0.01
EUR SUMMIT GERMANY LTD-REG-S 2.00000% 18-31.01.25	500 000.00	551 767.24	0.01
EUR SUNSHINE MID BV-REG-S 6.50000% 18-15.05.26	1 575 000.00	1 826 838.61	0.04
EUR SUPERIOR INDUSTRIES INTERNATIONAL-REG-S 6.00000% 17-15.06.25	300 000.00	326 086.08	0.01
EUR SYNLAB UNSECURED BONDCO PLC-REG-S 8.25000% 15-01.07.23	1 000 000.00	1 159 952.94	0.03
EUR TECHEM VERWALTUNGSGESELLSCHAFT-REG-S 2.00000% 20-15.07.25	9 282 000.00	10 260 596.63	0.23
EUR TENNECO INC-REG-S 4.87500% 17-15.04.22	2 000 000.00	2 217 073.78	0.05
EUR TEREOS FINANCE GROUPE I SA-REG-S 4.12500% 16-16.06.23	1 000 000.00	980 606.29	0.02
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV-REG-S 1.25000% 15-31.03.23	2 700 000.00	2 821 027.00	0.06
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV-REG-S 1.87500% 15-31.03.27	4 870 000.00	4 629 557.45	0.10
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV-REG-S 0.37500% 16-25.07.20	2 500 000.00	1 677 337.47	0.04
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV-REG-S 1.12500% 16-15.10.24	14 330 000.00	14 133 650.34	0.32
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV-REG-S 1.62500% 16-15.10.28	5 397 000.00	4 844 573.88	0.11
EUR TRANSCOM HOLDING AB 6.50000% 18-22.03.23	2 000 000.00	2 172 072.00	0.05
EUR TRIVIUM PACKAGING FINANCE BV-REG-S 3.75000% 19-15.08.26	3 450 000.00	3 997 364.40	0.09
EUR TUI AG-REG-S 2.12500% 16-26.10.21	2 000 000.00	2 252 416.50	0.05
EUR UGI INTERNATIONAL LLC-REG-S 3.25000% 18-01.11.25	1 470 000.00	1 707 362.63	0.04
EUR UNITED GROUP BV-REG-S 3.12500% 20-15.02.26	3 190 000.00	3 505 816.19	0.08
EUR UPC HOLDING BV-REG-S 3.87500% 17-15.06.29	750 000.00	871 843.10	0.02
EUR UPCB FINANCE IV LTD-REG-S 4.00000% 15-15.01.27	5 500 000.00	5 728 053.08	0.13
EUR UPCB FINANCE VII LTD-REG-S 3.62500% 17-15.06.29	3 100 000.00	3 620 355.53	0.08
EUR VALLOUREC SA-REG-S 2.25000% 14-30.09.24	2 500 000.00	2 015 117.63	0.04
EUR VALLOUREC SA-REG-S 6.62500% 17-15.10.22	870 000.00	868 723.30	0.02

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR VALLOUREC SA-REG-S 6.37500% 18-15.10.23	1 070 000.00	1 028 559.34	0.02
EUR VERISURE HOLDING AB-REG-S 3.50000% 18-15.05.23	1 650 000.00	1 867 057.12	0.04
EUR VERISURE MIDHOLDING AB-REG-S 5.75000% 17-01.12.23	15 317 000.00	17 379 815.41	0.39
EUR VIVION INVESTMENTS SARL-REG-S 3.00000% 19-08.08.24	4 100 000.00	4 716 913.67	0.11
EUR VZ VENDOR FINANCING BV-REG-S 2.50000% 19-31.01.24	3 285 000.00	3 695 043.56	0.08
EUR WEPA HYGIENEPRODUKTE GMBH-REG-S 2.87500% 19-15.12.27	2 269 000.00	2 559 766.90	0.06
EUR WEPA HYGIENEPRODUKTE GMBH-REG-S 2.87500% 20-15.12.27	225 000.00	252 773.49	0.01
EUR WMG ACQUISITION CORP-REG-S 4.12500% 16-01.11.24	5 020 000.00	5 162 310.22	0.12
EUR ZIGGO BOND CO BV-REG-S 4.62500% 15-15.01.25	4 480 000.00	5 062 362.57	0.11
EUR ZIGGO BV-REG-S 2.87500% 19-15.01.30	1 235 000.00	1 415 680.39	0.03
EUR ZIGGO BV-REG-S 4.25000% 16-15.01.27	6 982 000.00	8 269 170.13	0.18
ユーロ合計		563 137 069.84	12.63
GBP			
GBP AA BOND CO LTD-REG-S 5.50000% 15-31.07.22	850 000.00	998 618.89	0.02
GBP ARQIVA BROADCAST FINANCE PLC-REG-S 6.75000% 18-30.09.23	1 230 000.00	1 722 515.08	0.04
GBP CPUK FINANCE LTD-REG-S 4.25000% 17-28.08.22	325 000.00	435 572.41	0.01
GBP GALAXY BIDCO LTD-REG-S 6.50000% 19-31.07.26	770 000.00	1 073 572.19	0.02
GBP HEATHROW FINANCE PLC-REG-S 4.75000% 18-01.03.24	350 000.00	493 816.31	0.01
GBP HEATHROW FINANCE PLC-REG-S 4.12500% 19-01.09.29	1 050 000.00	1 421 480.97	0.03
GBP MOTO FINANCE PLC-REG-S 4.50000% 17-01.10.22	1 880 000.00	2 514 150.13	0.06
GBP PENSION INSURANCE CORP PLC-REG-S-SUB 8.00000% 16-23.11.26	875 000.00	1 482 024.24	0.03
GBP PINWOOD FINCO PLC-REG-S 3.25000% 19-30.09.25	990 000.00	1 331 118.36	0.03
GBP RAC BOND CO PLC-REG-S 5.00000% 17-06.11.22	825 000.00	990 083.10	0.02
GBP SAGA PLC-REG-S 3.37500% 17-12.05.24	660 000.00	794 059.95	0.02
GBP VIRGIN MEDIA REC FINANCE NT I DAC-REG-S 5.50000% 16-15.09.24	2 080 000.00	2 810 402.40	0.06
GBP VIRGIN MEDIA SECURED FINANCE PLC-REG-S 4.87500% 15-15.01.27	1 142 000.00	1 557 091.33	0.04
GBP VIRGIN MEDIA SECURED FINANCE PLC-REG-S 5.00000% 17-15.04.27	2 450 000.00	3 403 180.46	0.08
GBP WILLIAM HILL PLC-REG-S 4.87500% 16-07.09.23	600 000.00	844 307.10	0.02
英ポンド合計		21 871 992.92	0.49
USD			
USD ALCATEL-LUCENT USA INC 6.45000% 99-15.03.29	1 230 000.00	1 303 800.00	0.03
USD ALLEGHENY LUDLUM CORP 6.95000% 95-15.12.25	130 000.00	137 956.00	0.00
USD BALL CORP 4.87500% 18-15.03.26	6 760 000.00	7 402 200.00	0.17
USD BUCKEYE PARTNERS L P 4.35000% 14-15.10.24	540 000.00	544 850.66	0.01
USD CHEMOURS CO/THE 5.37500% 17-15.05.27	90 000.00	78 075.00	0.00
USD DELL INC 7.10000% 98-15.04.28	2 000 000.00	2 420 240.00	0.06
USD DENBURY RESOURCES INC-144A 9.00000% 16-15.05.21	224 000.00	210 560.00	0.01
USD HCA INC 5.37500% 15-01.02.25	3 965 000.00	4 431 284.00	0.10
USD IHO VERWALTUNGS GMBH-144A (PIK) 6.00000% 19-15.05.27	400 000.00	425 000.00	0.01
USD NEW ALBERTSONS LP 7.45000% 99-01.08.29	943 000.00	997 222.50	0.02
USD NUSTAR LOGISTICS LP 6.00000% 19-01.06.26	2 680 000.00	2 819 896.00	0.06
USD SPRINT CAPITAL CORPORATION 6.87500% 98-15.11.28	5 407 000.00	5 501 622.50	0.12
USD T-MOBILE USA INC 6.50000% 15-15.01.26	1 975 000.00	2 106 238.75	0.05
USD TELECOM ITALIA CAPITAL 6.00000% 05-30.09.34	800 000.00	899 164.00	0.02
USD YUM BRANDS INC 6.87500% 07-15.11.37	1 275 000.00	1 504 500.00	0.03
米ドル合計		30 782 609.41	0.69
債券、固定利付債合計		616 318 332.44	13.82
債券、ゼロ・クーポン債			
USD			
USD NYRSTAR HOLDINGS PLC-REG-S 0.00000% 19-31.07.26	763 000.00	444 209.06	0.01
米ドル合計		444 209.06	0.01
債券、ゼロ・クーポン債合計		444 209.06	0.01

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / 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 AAREAL BANK AG-REG-S-SUB 7.625%/VAR 14-PRP	1 200 000.00	1 346 236.93	0.03
EUR ABN AMRO BANK NV-REG-S-SUB 5.750%/VAR 15-PRP	3 500 000.00	3 995 061.00	0.09
EUR ABN AMRO BANK NV-REG-S-SUB 4.750%/VAR 17-PRP	1 800 000.00	2 186 755.65	0.05
EUR ACCOR SA-REG-S-SUB 4.375%/VAR 19-PRP	3 000 000.00	3 550 539.81	0.08
EUR AKELIUS RESIDENTIAL PROPERT-REG-S-SUB 3.875%/VAR 18-05.10.78	1 430 000.00	1 685 356.10	0.04
EUR ARKEMA SA-REG-S-SUB 4.750%/VAR 14-PRP	300 000.00	342 699.77	0.01
EUR ASR NEDERLAND NV-REG-S-SUB 4.625%/VAR 17-PRP	790 000.00	945 236.09	0.02
EUR ASR NEDERLAND NV-REG-S-SUB 3.375%/VAR 19-02.05.49	2 125 000.00	2 593 361.15	0.06
EUR ASSEMBLIN FINANCING AB-REG-S 3M EURIBOR+500BP 19-15.05.25	2 200 000.00	2 469 490.72	0.05
EUR BANCO BPM SPA-REG-S-SUB 4.375%/VAR 17-21.09.27	1 000 000.00	1 155 032.54	0.03
EUR BANCO COMERCIAL PORTUGUES SA-REG-S-SUB 9.250%/VAR 19-PRP	1 200 000.00	1 505 602.29	0.03
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S-SUB 6.500%/VAR 17-PRP	2 000 000.00	2 340 850.86	0.05
EUR BANCO SANTANDER SA-REG-S-SUB 6.250%/VAR 14-PRP	1 500 000.00	1 670 528.39	0.04
EUR BANCO SANTANDER SA-REG-S-SUB 4.375%/VAR 20-PRP	2 200 000.00	2 526 784.65	0.06
EUR BANKIA SA-REG-S-SUB 3.375%/VAR 17-15.03.27	500 000.00	584 010.32	0.01
EUR BANKINTER SA-REG-S-SUB 2.500%/VAR 17-06.04.27	2 000 000.00	2 312 489.80	0.05
EUR BAYER AG-REG-S-SUB 3.750%/VAR 14-01.07.74	3 000 000.00	3 596 831.55	0.08
EUR BAYER AG-REG-S-SUB 3.125%/VAR 19-12.11.79	1 800 000.00	2 089 259.76	0.05
EUR BELFIUS BANK SA/NV-REG-S-SUB 3.625%/VAR 18-PRP	1 200 000.00	1 296 556.77	0.03
EUR BHP BILLITON FINANCE LTD-REG-S-SUB 5.625%/VAR 15-22.10.79	1 000 000.00	1 338 169.23	0.03
EUR BNP PARIBAS SA-REG-S-SUB 6.125%/VAR 15-PRP	1 750 000.00	2 157 670.38	0.05
EUR CAIXABANK SA-REG-S-SUB 6.750%/VAR 17-PRP	2 400 000.00	3 038 684.40	0.07
EUR CPI PROPERTY GROUP SA-REG-S-SUB 4.875%/VAR 19-PRP	975 000.00	1 165 246.32	0.03
EUR CREDIT AGRICOLE ASSURANCES SA-REG-S-SUB 4.250%/VAR 15-PRP	3 800 000.00	4 727 111.33	0.11
EUR CREDIT AGRICOLE SA REG-S-SUB 6.500%/VAR 14-PRP	2 500 000.00	2 974 131.75	0.07
EUR DANSKE BANK AS-REG-S-SUB 5.750%/VAR 14-PRP	375 000.00	418 234.68	0.01
EUR DIOCLE SPA-REG-S 3M EURIBOR+387.5BP 19-30.06.26	850 000.00	951 389.70	0.02
EUR ELM BV-REG-S-SUB 2.600%/VAR 15-PRP	2 500 000.00	2 995 921.74	0.07
EUR ENGIE SA-REG-S-SUB 3.87500%/VAR 14-PRP	4 000 000.00	4 942 572.01	0.11
EUR EVOCA SPA-REG-S 3M EURIBOR+425BP 19-01.11.26	1 120 000.00	1 252 322.39	0.03
EUR GAS NATURAL FENOSA FINANCE BV-REG-S-SUB 4.125%/VAR 14-PRP	4 700 000.00	5 627 962.89	0.13
EUR HEMA BONDCO I BV-REG-S 3M EURIBOR+625BP 17-15.07.22	3 325 000.00	2 901 015.48	0.06
EUR HOLCIM FINANCE LUXEMBOURG SA-REG-S-SUB 3.000%/VAR 19-PRP	8 500 000.00	9 924 690.12	0.22
EUR HSBC HOLDINGS PLC-144A-REG-S-SUB 5.250%/VAR 14-PRP	1 300 000.00	1 572 120.22	0.03
EUR INTERNATIONAL DESIGN GRP-REG-S 3M EURIBOR+600BP 18-15.11.25	400 000.00	448 843.16	0.01
EUR INTESA SANPAOLO SPA-REG-S-SUB 7.750%/VAR 17-PRP	2 000 000.00	2 752 768.80	0.06
EUR KBC GROEP NV-REG-S-SUB 4.250%/VAR 18-PRP	2 600 000.00	3 036 190.95	0.07
EUR LA POSTE SA-REG-S-SUB 3.125%/VAR 18-PRP	5 000 000.00	5 957 505.89	0.13
EUR LIBERBANK SA-REG-S-SUB 6.875%/VAR 17-14.03.27	600 000.00	735 567.75	0.02
EUR LIMACORPORATE SPA-REG-S 3M EURIBOR+375BP 17-15.08.23	400 000.00	443 147.02	0.01
EUR LLOYDS BANKING GROUP PLC-REG-S-SUB 6.375%/VAR 14-PRP	601 000.00	678 516.23	0.01
EUR LOUVRE BIDCO SAS-REG-S 3M EURIBOR+537.5BP 18-30.09.24	470 000.00	529 968.94	0.01
EUR MERCK KGAA-REG-S-SUB 2.875%/VAR 19-25.06.79	800 000.00	957 277.35	0.02
EUR NAVIERA ARMAS SA-REG-S 3M EURIBOR+650BP 16-31.07.23	1 700 000.00	1 305 608.10	0.03
EUR NN GROUP NV-REG-S-SUB 4.625/3M EURIBOR+395BP 14-08.04.44	3 000 000.00	3 780 874.75	0.08
EUR NOVEM GROUP GMBH-REG-S 3M EURIBOR+525BP 19-15.05.24	3 100 000.00	3 482 258.52	0.08
EUR OMV AG-REG-S-SUB 6.250%/VAR 15-PRP	800 000.00	1 121 711.17	0.02
EUR ORANGE SA-REG-S-SUB 4.250%/VAR 14-PRP	8 113 000.00	8 990 826.60	0.20
EUR ORANGE-SUB-REG-S 5.25000%/VAR 14-PRP	1 200 000.00	1 547 601.30	0.03
EUR ORSTED A/S-SUB VAR 13-PRP	4 400 000.00	5 742 851.98	0.13
EUR PICARD GROUPE SA-REG-S 3M EURIBOR+300BP 17-30.11.23	1 175 000.00	1 256 560.27	0.03
EUR RABOBANK NEDERLAND NV REG-S 5.500%/VAR 15-PRP	1 000 000.00	1 128 845.76	0.02
EUR RABOBANK NEDERLAND NV-REG-S-SUB 6.625%/VAR 16-PRP	1 800 000.00	2 160 045.82	0.05
EUR RABOBANK NEDERLAND NV-REG-S-SUB 3.250%/VAR 19-PRP	3 200 000.00	3 622 909.71	0.08
EUR RAIFFEISEN BANK INTL AG-REG-S-SUB 6.125%/VAR 17-PRP	600 000.00	723 931.65	0.02
EUR REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S-SUB 3.875%/VAR 15-PRP	2 943 000.00	3 384 714.75	0.08

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR REPSOL INTERNATIONAL FINANC-REG-S-SUB 4.500%/VAR 15-25.03.75	6 000 000.00	7 587 761.19	0.17
EUR SAMHALLSBYGGNADSBOLAGET I NOR-REG-S-SUB 4.625%/VAR 19-PRP	2 500 000.00	3 030 317.49	0.07
EUR SAMHALLSBYGGNADSBOLAGET I NOR-REG-S-SUB 2.624%/VAR 20-PRP	1 665 000.00	1 850 503.95	0.04
EUR SAMPO OYJ-REG-S-SUB 3.375%/VAR 19-23.05.49	950 000.00	1 188 441.99	0.03
EUR SES SA-REG-S-SUB 5.625%/VAR 16-PRP	1 500 000.00	1 840 654.81	0.04
EUR SISAL PAY SPA-REG-S 3M EURIBOR+387.5BP 19-17.12.26	225 000.00	251 215.09	0.01
EUR SOLVAY FIN SA-REG-S-SUB 5.425%/VAR 13-PRP	5 300 000.00	6 719 531.91	0.15
EUR SOLVAY FINANCE SA-REG-S-SUB 5.869%/VAR 15-PRP	5 000 000.00	6 523 929.08	0.15
EUR SOLVAY SA-REG-S-SUB 4.250%/VAR 18-PRP	600 000.00	733 103.56	0.02
EUR SWISS LIFE AG VIA DEMETER INV BV-SUB 4.375%/VAR 15-PRP	2 912 000.00	3 711 011.08	0.08
EUR TAKKO LUXEMBOURG 2-REG-S 3M EURIBOR+537.5BP 17-15.11.23	1 000 000.00	1 048 368.29	0.02
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 7.625%/VAR 13-PRP	5 000 000.00	6 102 303.30	0.14
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 5.875%/VAR 14-PRP	3 200 000.00	4 107 730.36	0.09
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 3.750%/VAR 16-PRP	1 500 000.00	1 749 637.24	0.04
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 3.000%/VAR 18-PRP	14 300 000.00	16 463 401.47	0.37
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 3.875%/VAR 18-PRP	3 800 000.00	4 558 580.70	0.10
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 4.375%/VAR 19-PRP	9 400 000.00	11 576 230.16	0.26
EUR TENNET HOLDING BV-REG-S-SUB 2.993%/VAR 17-PRP	6 000 000.00	7 131 267.00	0.16
EUR TRIVIUM PACKAGING FIN BV-REG-S 3M EURIBOR+375BP 19-15.08.26	614 000.00	688 613.62	0.02
EUR UBS GROUP AG-REG-S-SUB 5.750%/VAR 15-PRP	1 000 000.00	1 205 256.16	0.03
EUR UNIBAIL-RODAMCO SE-REG-S-SUB 2.125%/VAR 18-PRP	600 000.00	684 036.45	0.01
EUR UNIBAIL-RODAMCO SE-REG-S-SUB 2.875%/VAR 18-PRP	700 000.00	826 163.10	0.02
EUR UNICREDIT SPA-REG-S-SUB 7.500%/VAR 19-PRP	600 000.00	788 768.00	0.02
EUR VODAFONE GROUP PLC-REG-S-SUB 3.100%/VAR 18-03.01.79	12 872 000.00	14 946 805.19	0.33
EUR VOLKSWAGEN INTL FIN NV-REG-S-SUB 3.875%/VAR 17-PRP	1 000 000.00	1 196 838.26	0.03
EUR VOLKSWAGEN INTL FINANCE NV-REG-S-SUB 4.625%/VAR 18-PRP	4 600 000.00	5 796 413.52	0.13
EUR VOLVO TREASURY AB-REG-S-SUB 4.200%/VAR 14-10.06.75	1 750 000.00	1 964 006.90	0.04
EUR VONOVIA FINANCE BV-REG-S-SUB 4.000%/VAR 14-PRP	1 400 000.00	1 656 173.87	0.04
EUR WEPA HYGIENEPRODUKTE-REG-S 3M EURIBOR+287.5BP 19-15.11.26	600 000.00	674 188.99	0.01
ユーロ合計		254 569 705.99	5.71
GBP			
GBP AVIVA PLC-REG-S-SUB 4.375%/FLR 16-12.09.49	1 025 000.00	1 500 281.98	0.03
GBP BARCLAYS PLC-REG-S-SUB 7.875%/VAR 15-PRP	790 000.00	1 156 127.44	0.03
GBP QUILTER PLC-REG-S-SUB 4.478%/VAR 18-28.02.28	1 775 000.00	2 459 720.01	0.05
GBP STONEGATE PUB CO FIN PLC-REG-S 3M LIBOR+437.5BP 17-15.03.22	1 000 000.00	1 316 380.88	0.03
英ポンド合計		6 432 510.31	0.14
USD			
USD BARCLAYS PLC-SUB 7.750%/VAR 18-PRP	1 100 000.00	1 204 500.00	0.03
USD CREDIT SUISSE GROUP AG-REG-S-SUB 7.125%/VAR 17-PRP	900 000.00	970 875.00	0.02
USD DANSKE BANK AS-REG-S-SUB 6.125%/VAR 17-PRP	1 300 000.00	1 382 875.00	0.03
USD DNB BANK ASA-REG-S-SUB 6.500%/VAR 16-PRP	800 000.00	851 000.00	0.02
USD ING GROEP NV-SUB 5.750%/VAR 19-PRP	2 400 000.00	2 569 200.00	0.06
USD PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP 6.125%/VAR 17-PRP	1 445 000.00	1 338 503.50	0.03
USD SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN-REG-S-SUB 5.125%/VAR 19-PRP	1 000 000.00	1 026 500.00	0.02
USD SVENSKA HANDELSBANKEN AB-REG-S-SUB 5.250%/VAR 15-PRP	1 800 000.00	1 839 996.00	0.04
USD VODAFONE GROUP PLC-REG-S-SUB 6.250%/VAR 18-03.10.78	4 000 000.00	4 370 000.00	0.10
米ドル合計		15 553 449.50	0.35
債券、変動利付債合計		276 555 665.80	6.20
転換社債型新株予約権付社債、固定利付債			
EUR			
EUR TELECOM ITALIA SPA-REG-S 1.12500% 15-26.03.22	3 700 000.00	4 120 841.70	0.10
ユーロ合計		4 120 841.70	0.10
転換社債型新株予約権付社債、固定利付債合計		4 120 841.70	0.10

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
転換社債型新株予約権付社債、変動利付債			
EUR			
EUR BANCO BPM SPA-REG-S-SUB COCO 6.125%/VAR 20-PRP	800 000.00	891 994.61	0.02
EUR BANKIA SA-REG-S-SUB 6.375%/VAR 18-PRP	1 000 000.00	1 224 937.79	0.03
EUR ERSTE GROUP BANK AG-REG-S-SUB COCO 5.125%/VAR 19-PRP	1 000 000.00	1 233 969.62	0.03
EUR KBC GROUP NV-REG-S-SUB 4.750%/VAR 19-PRP	1 200 000.00	1 457 172.18	0.03
EUR UNIONE DI BANCHE ITALIANE-REG-S-SUB COCO 5.875%/VAR 20-PRP	765 000.00	885 270.01	0.02
ユーロ合計		5 693 344.21	0.13
GBP			
GBP BARCLAYS PLC-REG-S-SUB COCO 6.375%/VAR 19-PRP	430 000.00	627 873.16	0.01
英ポンド合計		627 873.16	0.01
USD			
USD BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA-SUB COCO 6.500%/VAR 19-PRP	600 000.00	641 970.00	0.01
USD BARCLAYS PLC-SUB COCO 8.000%/VAR 19-PRP	1 050 000.00	1 181 649.00	0.03
USD DANSKE BANK AS-REG-S-SUB 7.000%/VAR 18-PRP	1 450 000.00	1 611 863.50	0.04
USD LLOYDS BANKING GROUP PLC-SUB 6.750%/VAR 19-PRP	800 000.00	891 616.00	0.02
米ドル合計		4 327 098.50	0.10
転換社債型新株予約権付社債、変動利付債合計		10 648 315.87	0.24
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
合計		2 207 626 643.65	49.50
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
財務省証券(T-bill)、ゼロ・クーポン			
USD			
USD AMERICA, UNITED STATES OF TB 0.00000% 20.06.19-18.06.20	1 800 000.00	1 789 788.67	0.04
米ドル合計		1 789 788.67	0.04
財務省証券(T-bill)、ゼロ・クーポン合計		1 789 788.67	0.04
ノート、固定利付債			
GBP			
GBP WAGAMAMA FINANCE PLC-REG-S 4.12500% 17-01.07.22	2 260 000.00	3 004 263.95	0.07
英ポンド合計		3 004 263.95	0.07
USD			
USD 1011778 BC ULC/NEW RED FINANCE INC-144A 4.25000% 17-15.05.24	1 409 000.00	1 438 941.25	0.03
USD 1011778 BC ULC/NEW RED FINANCE INC-144A 5.00000% 17-15.10.25	8 638 000.00	8 911 824.60	0.20
USD 1011778 BC ULC/NEW RED FINANCE INC-144A 3.87500% 19-15.01.28	592 000.00	595 759.20	0.01
USD ACCO BRANDS CORP-144A 5.25000% 16-15.12.24	3 454 000.00	3 574 890.00	0.08
USD ACI WORLDWIDE INC-144A 5.75000% 18-15.08.26	4 351 000.00	4 657 332.16	0.10
USD ACRISURE LLC / FINANCE INC-144A 7.00000% 17-15.11.25	1 255 000.00	1 229 900.00	0.03
USD ACRISURE LLC / FINANCE INC-144A 8.12500% 19-15.02.24	9 825 000.00	10 500 468.75	0.24
USD ADT CORP 4.12500% 13-15.06.23	2 250 000.00	2 286 562.50	0.05
USD ADT CORP-144A 4.87500% 16-15.07.32	696 000.00	647 140.80	0.01
USD ADVANCED DISPOSAL SERVICES INC-144A 5.62500% 16-15.11.24	2 842 000.00	2 959 943.00	0.07
USD ALBERTSONS COS LLC / SAFEWAY INC-144A 7.50000% 19-15.03.26	520 000.00	575 900.00	0.01
USD ALBERTSONS COS LLC / SAFEWAY INC-144A 4.62500% 19-15.01.27	1 821 000.00	1 846 275.48	0.04
USD ALBERTSONS COS LLC / SAFEWAY INC 6.62500% 17-15.06.24	418 000.00	434 720.00	0.01
USD ALBERTSONS COS LLC / SAFEWAY INC 5.75000% 17-15.03.25	417 000.00	431 603.34	0.01
USD ALCOA NEDERLAND HOLDING BV-144A 6.75000% 16-30.09.24	3 905 000.00	4 100 640.50	0.09

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD ALCOA NEDERLAND HOLDING BV-144A 7.00000% 16-30.09.26	950 000.00	1 029 610.00	0.02
USD ALGECO SCOTSMAN FIN 2 PLC-144A-SUB 10.00000% 18-15.08.23	775 000.00	767 250.00	0.02
USD ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC STEP-UP 13-15.08.23	1 275 000.00	1 396 380.00	0.03
USD ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP-144A 4.75000% 19-15.12.24	5 435 000.00	5 418 966.75	0.12
USD ALLISON TRANSMISSION INC-144A 4.75000% 17-01.10.27	5 760 000.00	5 968 800.00	0.13
USD ALPHA 2 BV-144A (PIK) 8.75000% 18-01.06.23	400 000.00	407 040.00	0.01
USD ALTICE FRANCE-144A 8.12500% 18-01.02.27	6 089 000.00	6 804 457.50	0.15
USD ALTICE LUXEMBOURG SA-144A 7.62500% 15-15.02.25	1 391 000.00	1 446 222.70	0.03
USD AMERI MIDSTRM PARTNERS LP/FIN CORP-144A STEP-UP 16-15.12.21	10 363 000.00	10 337 092.50	0.23
USD AMERICAN AXLE & MANUFACTURING INC 6.50000% 18-01.04.27	75 000.00	76 687.50	0.00
USD AMERICAN WOODMARK CORP-144A 4.87500% 18-15.03.26	2 470 000.00	2 541 012.50	0.06
USD ANKOR TECHNOLOGY INC-144A 6.62500% 19-15.09.27	4 975 000.00	5 404 093.75	0.12
USD AMSTED INDUSTRIES INC-144A 5.62500% 19-01.07.27	1 000 000.00	1 063 055.00	0.02
USD AMSTED INDUSTRIES INC-144A 4.62500% 19-15.05.30	1 600 000.00	1 620 000.00	0.04
USD AMWINS-144A 7.75000% 18-01.07.26	2 055 000.00	2 243 351.03	0.05
USD ANIXTER INC 6.00000% 19-01.12.25	850 000.00	901 000.00	0.02
USD ANTERO MIDSTREAM PARTNERS/FIN CORP-144A 5.75000% 19-01.03.27	2 553 000.00	1 990 574.10	0.04
USD ANTERO MIDSTREAM PARTNERS/FIN CORP-144A 5.75000% 19-15.01.28	1 650 000.00	1 283 205.00	0.03
USD ANTERO RESOURCES CORP 5.37500% 14-01.11.21	2 248 000.00	2 146 840.00	0.05
USD ANTERO RESOURCES FIN CORP 5.12500% 14-01.12.22	4 350 000.00	3 751 875.00	0.08
USD APX GROUP INC 7.87500% 16-01.12.22	75 000.00	76 275.97	0.00
USD APX GROUP INC 8.75000% 13-01.12.20	80 000.00	80 125.00	0.00
USD ARAMARK SERVICES INC-144A 5.00000% 17-01.04.25	3 195 000.00	3 328 455.15	0.07
USD ARAMARK SERVICES INC-144A 5.00000% 18-01.02.28	2 810 000.00	2 943 475.00	0.07
USD ASCEND LEARNING LLC-144A 6.87500% 19-01.08.25	2 893 000.00	3 023 185.00	0.07
USD ASCENT RESOURCES UTICA HOLDINGS-144A 10.00000% 17-01.04.22	3 473 000.00	3 403 540.00	0.08
USD ASCENT RESOURCES UTICA HOLDINGS-144A 7.00000% 18-01.11.26	5 202 000.00	3 693 420.00	0.08
USD ASHLAND INC 4.75000% 13-15.08.22	232 000.00	243 878.40	0.01
USD AVANTOR INC-144A 6.00000% 17-01.10.24	1 250 000.00	1 328 125.00	0.03
USD AVIS BUDGET CAR RENT LLC/FIN INC 5.50000% 13-01.04.23	43 000.00	43 537.50	0.00
USD AXALTA COATING SYSTEMS LLC-144A 4.87500% 16-15.08.24	4 452 000.00	4 585 560.00	0.10
USD BASIC ENERGY SERVICES INC-144A 10.75000% 18-15.10.23	575 000.00	368 000.00	0.01
USD BAUSCH HEALTH COS INC-144A 5.75000% 19-15.08.27	592 000.00	633 380.80	0.01
USD BAUSCH HEALTH COS INC-144A 7.25000% 19-30.05.29	469 000.00	528 661.49	0.01
USD BAUSCH HEALTH COS INC-144A 5.00000% 19-30.01.28	1 117 000.00	1 129 915.31	0.03
USD BAUSCH HEALTH COS INC-144A 5.25000% 19-30.01.30	1 851 000.00	1 883 577.60	0.04
USD BBA US HOLDINGS INC-144A 5.37500% 18-01.05.26	600 000.00	622 500.00	0.01
USD BEACON ROOFING SUPPLY INC-144A 4.87500% 17-01.11.25	3 063 000.00	3 046 766.10	0.07
USD BEAZER HOMES USA INC 5.87500% 18-15.10.27	2 210 000.00	2 292 875.00	0.05
USD BERRY GLOBAL ESCROW CORP-144A 4.87500% 19-15.07.26	2 300 000.00	2 403 159.60	0.05
USD BERRY PLASTICS CORP 5.50000% 14-15.05.22	5 421 000.00	5 461 657.50	0.12
USD BERRY PLASTICS CORP 5.12500% 15-15.07.23	3 858 000.00	3 925 592.16	0.09
USD BERRY PLASTICS CORP-144A 4.50000% 18-15.02.26	1 085 000.00	1 101 275.00	0.02
USD BEVERAGES & MORE INC-144A 11.50000% 17-15.06.22	1 800 000.00	1 152 000.00	0.03
USD BIG RIVER STEEL LLC/BRS FIN CORP-144A 7.25000% 17-01.09.25	525 000.00	551 360.25	0.01
USD BLUE RACER MIDSTREAM / FINANC CORP-144A 6.12500% 14-15.11.22	4 762 000.00	4 652 950.20	0.10
USD BLUE RACER MIDSTREAM / FINANC CORP-144A 6.62500% 18-15.07.26	4 115 000.00	3 785 800.00	0.08
USD BMC EAST LLC-144A 5.50000% 16-01.10.24	1 175 000.00	1 210 250.00	0.03
USD BOMBARDIER INC-144A 5.75000% 12-15.03.22	636 000.00	634 410.00	0.01
USD BOMBARDIER INC-144A 6.12500% 13-15.01.23	2 526 000.00	2 492 985.18	0.06
USD BOMBARDIER INC-144A 6.00000% 14-15.10.22	1 999 000.00	1 959 020.00	0.04
USD BOMBARDIER INC-144A 7.50000% 15-15.03.25	2 220 000.00	2 133 975.00	0.05
USD BOMBARDIER INC-144A 7.50000% 17-01.12.24	70 000.00	67 987.50	0.00
USD BOMBARDIER INC-144A 7.87500% 19-15.04.27	3 313 000.00	3 138 901.85	0.07
USD BOOZ ALLEN HAMILTON INC-144A 5.12500% 17-01.05.25	1 255 000.00	1 289 512.50	0.03
USD BOYD GAMING CORP 6.00000% 18-15.08.26	350 000.00	371 875.00	0.01
USD BOYNE USA INC-144A 7.25000% 18-01.05.25	500 000.00	542 500.00	0.01
USD BROOKFIELD PROPERTY REIT-144A 5.75000% 19-15.05.26	2 010 000.00	2 097 294.30	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

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD BROOKFIELD RESIDENT PROPERTIES INC-144A 6.37500% 15-15.05.25	1 050 000.00	1 086 750.00	0.02
USD BRUIN E&P PARTNERS LLC-144A 8.87500% 18-01.08.23	625 000.00	402 343.75	0.01
USD BUILDERS FIRSTSOURCE INC-144A 5.62500% 16-01.09.24	927 000.00	961 484.40	0.02
USD BUILDERS FIRSTSOURCE INC-144A 6.75000% 19-01.06.27	3 696 000.00	4 047 859.20	0.09
USD BWAY HOLDING CO-144A 5.50000% 17-15.04.24	5 372 000.00	5 535 684.84	0.12
USD BWAY HOLDING CO-144A 7.25000% 17-15.04.25	9 783 000.00	9 734 085.00	0.22
USD BWX TECHNOLOGIES INC-144A 5.37500% 18-15.07.26	2 323 000.00	2 462 380.00	0.06
USD C&S GROUP ENTERPRISES LLC-144A 5.37500% 14-15.07.22	1 125 000.00	1 129 218.75	0.03
USD CALIFORNIA RESOURCES CORP-144A 8.00000% 15-15.12.22	900 000.00	306 000.00	0.01
USD CALPINE CORP 5.75000% 14-15.01.25	2 017 000.00	2 073 516.34	0.05
USD CALPINE CORP-144A 5.25000% 16-01.06.26	1 440 000.00	1 486 944.00	0.03
USD CALUMET SPECIALTY PROD PART LP/FIN 7.62500% 14-15.01.22	3 310 000.00	3 305 862.50	0.07
USD CAMELOT FINANCE SA-144A 4.50000% 19-01.11.26	7 885 000.00	8 022 987.50	0.18
USD CARVANA CO-144A 8.87500% 18-01.10.23	3 805 000.00	3 996 011.00	0.09
USD CATALENT PHARMA SOLUTIONS INC-144A 4.87500% 17-15.01.26	3 691 000.00	3 792 502.50	0.09
USD CATALENT PHARMA SOLUTIONS INC-144A 5.00000% 19-15.07.27	2 060 000.00	2 168 459.00	0.05
USD CBS OUTDOOR AMERICAS CAPITAL LLC-144A 4.62500% 19-15.03.30	350 000.00	360 500.00	0.01
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP 5.25000% 12-30.09.22	6 056 000.00	6 116 560.00	0.14
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP 5.12500% 12-15.02.23	2 400 000.00	2 418 048.00	0.05
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP 5.75000% 13-15.01.24	1 070 000.00	1 092 737.50	0.02
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.12500% 15-01.05.23	3 062 000.00	3 110 471.46	0.07
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.87500% 15-01.05.27	4 438 000.00	4 675 699.28	0.10
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.75000% 15-15.02.26	5 752 000.00	6 035 803.68	0.14
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.87500% 16-01.04.24	1 510 000.00	1 558 440.80	0.04
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.50000% 16-01.05.26	4 350 000.00	4 545 750.00	0.10
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.12500% 17-01.05.27	500 000.00	522 525.00	0.01
USD CDK GLOBAL INC-144A 5.25000% 19-15.05.29	2 253 000.00	2 410 710.00	0.05
USD CENGAGE LEARNING INC-144A 9.50000% 16-15.06.24	2 428 000.00	2 245 900.00	0.05
USD CENTENE CORP 6.12500% 16-15.02.24	5 671 000.00	5 855 307.50	0.13
USD CENTENE CORP-144A 4.25000% 19-15.12.27	3 440 000.00	3 586 200.00	0.08
USD CENTENE CORP-144A 4.62500% 19-15.12.29	4 542 000.00	4 882 195.80	0.11
USD CENTENE CORP-144A 5.37500% 18-01.06.26	5 760 000.00	6 127 200.00	0.14
USD CENTENNIAL RESOURCE PRODUCTION LLC-144A 5.37500% 17-15.01.26	1 250 000.00	1 175 000.00	0.03
USD CENTENNIAL RESOURCE PRODUCTION LLC-144A 6.87500% 19-01.04.27	1 436 000.00	1 432 410.00	0.03
USD CENTRAL GARDEN & PET CO 6.12500% 15-15.11.23	1 914 000.00	1 971 253.49	0.04
USD CENTURY COMMUNITIES INC 5.87500% 17-15.07.25	2 110 000.00	2 215 500.00	0.05
USD CENTURYLINK INC 7.60000% 09-15.09.39	1 000 000.00	1 081 750.00	0.02
USD CENTURYLINK INC-144A 5.12500% 19-15.12.26	7 278 000.00	7 496 340.00	0.17
USD CHANGE HC HLDS LLC/CHNG HC FIN INC-144A 5.75000% 17-01.03.25	8 651 000.00	8 810 870.48	0.20
USD CHARLES RIVER LABORATORIES INC-144A 5.50000% 18-01.04.26	2 800 000.00	2 978 500.00	0.07
USD CHENIERE CORPUS CHRISTI HLDGS LLC 5.12500% 17-30.06.27	825 000.00	919 246.43	0.02
USD CHENIERE ENERGY PARTNERS LP 5.25000% 18-01.10.25	1 510 000.00	1 555 300.00	0.03
USD CHENIERE ENERGY PARTNERS LP 5.62500% 19-01.10.26	1 055 000.00	1 105 114.61	0.02
USD CHENIERE ENERGY PARTNERS LP-144A 4.50000% 19-01.10.29	3 348 000.00	3 406 590.00	0.08
USD CHOBANI LLC/FINANCE CORP-144A 7.50000% 17-15.04.25	1 558 000.00	1 549 617.96	0.03
USD CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC 6.25000% 17-31.03.23	75 000.00	76 500.00	0.00
USD CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC-144A STEP DOWN 18-30.06.23	550 000.00	517 000.00	0.01
USD CHURCHILL DOWNS INC-144A 4.75000% 17-15.01.28	7 120 000.00	7 333 600.00	0.16
USD CHURCHILL DOWNS INC-144A 5.50000% 19-01.04.27	3 844 000.00	4 055 420.00	0.09
USD CIMPRESS PLC-144A 7.00000% 18-15.06.26	2 020 000.00	2 134 746.10	0.05
USD CINCINNATI BELL INC-144A 7.00000% 16-15.07.24	6 910 000.00	7 229 587.50	0.16
USD CLEAN HARBORS INC-144A 4.87500% 19-15.07.27	488 000.00	513 571.20	0.01
USD CLEAN HARBORS INC-144A 5.12500% 19-15.07.29	1 692 000.00	1 801 980.00	0.04
USD CLEAR CHANNEL WRDLWDE HDGS INC-144A-SUB 9.25000% 19-15.02.24	1 608 000.00	1 750 710.00	0.04
USD CLEAVER-BROOKS INC-144A 7.87500% 17-01.03.23	1 925 000.00	1 913 777.25	0.04
USD CLEVELAND-CLIFFS INC-144A 5.87500% 19-01.06.27	1 050 000.00	968 625.00	0.02
USD CLEVELAND-CLIFFS INC 5.75000% 18-01.03.25	3 523 000.00	3 417 310.00	0.08
USD CLOUD CRANE LLC-144A 10.12500% 16-01.08.24	680 000.00	724 621.60	0.02

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD COGENT COMMUNICATIONS GROUP INC-144A 5.37500% 15-01.03.22	500 000.00	521 250.00	0.01
USD COLFAX CORP-144A 6.00000% 19-15.02.24	397 000.00	417 969.54	0.01
USD COLFAX CORP-144A 6.37500% 19-15.02.26	648 000.00	695 790.00	0.02
USD COMMScope FINANCE LLC-144A 8.25000% 19-01.03.27	3 476 000.00	3 571 590.00	0.08
USD COMMScope FINANCE LLC-144A 5.50000% 19-01.03.24	3 094 000.00	3 179 085.00	0.07
USD COMMScope FINANCE LLC-144A 6.00000% 19-01.03.26	4 928 000.00	5 168 249.86	0.12
USD COMMScope INC-144A 5.00000% 14-15.06.21	203 000.00	203 000.00	0.00
USD COMMScope INC-144A 5.50000% 14-15.06.24	935 000.00	930 325.00	0.02
USD COMMScope TECHNOLOGIES LLC-144A 6.00000% 15-15.06.25	2 179 000.00	2 086 392.50	0.05
USD COMMScope TECHNOLOGIES LLC-144A 5.00000% 17-15.03.27	838 000.00	760 485.00	0.02
USD COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC-144A 6.00000% 15-15.04.23	595 000.00	569 712.50	0.01
USD COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC 8.25000% 15-15.10.23	225 000.00	182 250.00	0.00
USD COMPASS GROUP DIVERSIFIED HOLDINGS-144A 8.00000% 18-01.05.26	2 186 000.00	2 380 007.50	0.05
USD CONSOL ENERGY INC 5.87500% 14-15.04.22	2 960 000.00	2 923 000.00	0.07
USD CONSOL ENERGY INC-144A 7.25000% 19-14.03.27	4 285 000.00	3 497 631.25	0.08
USD CONSTELLUM SE-144A 5.87500% 17-15.02.26	1 639 000.00	1 692 267.50	0.04
USD CORE & MAIN HOLDINGS LP-144A (PIK) 8.62500% 19-15.09.24	2 613 000.00	2 724 052.50	0.06
USD CORE & MAIN LP-144A 6.12500% 17-15.08.25	800 000.00	821 896.00	0.02
USD CORNERSTONE CHEMICAL CO-144A 6.75000% 17-15.08.24	1 260 000.00	1 212 384.60	0.03
USD COVANTA HOLDING CORP 5.875000% 14-01.03.24	2 000 000.00	2 035 000.00	0.05
USD CRC ESCROW ISSUER LLC / FINCO INC-144A 5.25000% 17-15.10.25	4 515 000.00	4 582 273.50	0.10
USD CREDIT ACCEPTANCE CORP-144A 6.62500% 19-15.03.26	3 800 000.00	4 094 500.00	0.09
USD CROWN AMERICAS CAPITAL CORP VI 4.75000% 19-01.02.26	1 955 000.00	2 026 064.25	0.05
USD CROWN AMERICAS LLC/CAPITAL CORP V 4.25000% 17-30.09.26	790 000.00	823 575.00	0.02
USD CROWNROCK LP / CROWNROCK FIN INC-144A 5.62500% 17-15.10.25	9 350 000.00	9 432 934.50	0.21
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 5.25000% 14-01.06.24	2 000 000.00	2 160 000.00	0.05
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 5.50000% 16-15.04.27	1 217 000.00	1 291 541.25	0.03
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 5.50000% 18-15.05.26	1 745 000.00	1 828 245.23	0.04
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 7.75000% 18-15.07.25	500 000.00	526 885.00	0.01
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 7.50000% 18-01.04.28	1 873 000.00	2 130 912.10	0.05
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 6.50000% 19-01.02.29	1 927 000.00	2 141 089.70	0.05
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 10.87500% 15-15.10.25	3 894 000.00	4 313 383.80	0.10
USD CSC HOLDINGS LLC-144A 6.62500% 15-15.10.25	250 000.00	263 937.50	0.01
USD CURO GROUP HOLDINGS CORP-144A 8.25000% 18-01.09.25	3 142 000.00	2 770 207.14	0.06
USD DAE FUNDING LLC-144A 4.50000% 17-01.08.22	1 520 000.00	1 547 329.60	0.03
USD DAE FUNDING LLC-144A 5.00000% 17-01.08.24	3 355 000.00	3 518 556.25	0.08
USD DAE FUNDING LLC-144A 5.25000% 18-15.11.21	2 236 000.00	2 325 775.40	0.05
USD DANA FINANCING LUXEMBOURG SARL-144A 5.75000% 17-15.04.25	700 000.00	729 750.00	0.02
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP-144A 5.87500% 16-15.06.21	4 616 000.00	4 662 160.00	0.10
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP-144A 7.12500% 16-15.06.24	9 291 000.00	9 767 163.75	0.22
USD DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP-REG-S 5.87500% 16-15.06.21	1 097 000.00	1 107 970.00	0.02
USD DELPHI JERSEY HOLDINGS PLC-144A 5.00000% 17-01.10.25	917 000.00	1 015 577.50	0.02
USD DENBURY RESOURCES INC-144A 9.25000% 17-31.03.22	930 000.00	823 050.00	0.02
USD DIAMOND RESORTS INTL INC-144A 10.75000% 16-01.09.24	75 000.00	78 000.00	0.00
USD DIAMOND RESORTS INTL INC-144A 7.75000% 16-01.09.23	75 000.00	77 137.50	0.00
USD DIEBOLD INC 8.50000% 16-15.04.24	2 460 000.00	2 361 600.00	0.05
USD DIGICEL GROUP ONE LTD-144A 8.25000% 18-30.12.22	2 805 000.00	1 822 373.44	0.04
USD DIGICEL LTD-144A 6.00000% 13-15.04.21	392 000.00	309 582.00	0.01
USD DIGICEL LTD-144A 8.25000% 18-30.09.22	3 000 000.00	780 000.00	0.02
USD DISH DBS CORP 5.00000% 13-15.03.23	3 210 000.00	3 258 214.20	0.07
USD DISH DBS CORP 5.87500% 12-15.07.22	6 222 000.00	6 533 100.00	0.15
USD DISH DBS CORP 5.87500% 14-15.11.24	75 000.00	75 894.75	0.00
USD DISH DBS CORP 7.75000% 16-01.07.26	5 483 000.00	5 757 150.00	0.13
USD DKT FINANCE APS-144A 9.37500% 18-17.06.23	500 000.00	533 975.00	0.01
USD DPL INC 7.25000% 12-15.10.21	438 000.00	464 280.00	0.01
USD DUN & BRADSTREET CORP-144A 10.25000% 19-15.02.27	6 688 000.00	7 666 454.40	0.17
USD EAGLE HOLDING CO II LLC-144A (PIK) 7.62500% 17-15.05.22	5 296 000.00	5 348 960.00	0.12
USD EIG INVESTORS CORP 10.87500% 17-01.02.24	4 246 000.00	4 383 995.00	0.10

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD ELDORADO GOLD CORP-144A 9.50000% 19-01.06.24	2 813 000.00	3 014 607.71	0.07
USD ELDORADO RESORTS INC 7.00000% 16-01.08.23	4 572 000.00	4 727 233.12	0.11
USD ELDORADO RESORTS INC 6.00000% 17-01.04.25	1 149 000.00	1 202 348.07	0.03
USD ELDORADO RESORTS INC 6.00000% 19-15.09.26	1 644 000.00	1 802 235.00	0.04
USD ENDEAVOR ENERGY RESOURCES LP/FIN-144A 5.50000% 17-30.01.26	2 634 000.00	2 703 142.50	0.06
USD ENDEAVOR ENERGY RESOURCES LP/FIN-144A 5.75000% 17-30.01.28	1 286 000.00	1 337 440.00	0.03
USD ENDO FINANCE LLC-144A 5.87500% 17-15.10.24	554 000.00	549 845.00	0.01
USD ENDO FINANCE LLC-144A 6.00000% 15-15.07.23	900 000.00	688 500.00	0.02
USD ENERGIZER HOLDINGS INC-144A 6.37500% 18-15.07.26	930 000.00	990 496.50	0.02
USD ENERGIZER SPINCO INC-144A 5.50000% 15-15.06.25	2 584 000.00	2 667 980.00	0.06
USD ENERPAC TOOL GROUP CORP 5.62500% 12-15.06.22	500 000.00	503 125.00	0.01
USD ENERSYS-144A 5.00000% 15-30.04.23	350 000.00	368 375.00	0.01
USD ENLINK MIDSTREAM PARTNERS LP 4.40000% 14-01.04.24	750 000.00	716 062.50	0.02
USD ENOVA INTERNATIONAL INC-144A 8.50000% 17-01.09.24	5 050 000.00	4 961 625.00	0.11
USD ENPRO INDUSTRIES INC 5.75000% 19-15.10.26	900 000.00	949 500.00	0.02
USD ENSIGN DRILLING INC-144A 9.25000% 19-15.04.24	550 000.00	515 625.00	0.01
USD ENTEGRIS INC-144A 4.62500% 17-10.02.26	1 585 000.00	1 636 512.50	0.04
USD ENTERCOM MEDIA CORP-144A 7.25000% 16-01.11.24	1 731 000.00	1 819 713.75	0.04
USD ENTERPRISE MERGER SUB INC-144A 8.75000% 18-15.10.26	6 173 000.00	3 722 319.00	0.08
USD EP ENERGY LLC/ EVEREST ACQUIS FIN-144A 7.75000% 18-15.05.26	592 000.00	396 640.00	0.01
USD EQUINIX INC 5.87500% 15-15.01.26	500 000.00	530 550.00	0.01
USD ESH HOSPITALITY INC-144A 5.25000% 15-01.05.25	2 100 000.00	2 152 500.00	0.05
USD EVERI PAYMENTS INC-144A 7.50000% 17-15.12.25	2 299 000.00	2 454 182.50	0.06
USD EXTRACTION OIL & GAS INC-144A 7.37500% 17-15.05.24	412 000.00	203 940.00	0.00
USD EXTRACTION OIL & GAS INC-144A 5.62500% 18-01.02.26	788 000.00	386 120.00	0.01
USD FAGE DAIRY INDUSTRY SA/USA DAIRY-144A 5.62500% 16-15.08.26	1 750 000.00	1 623 125.00	0.04
USD FAIR ISSAC CORP-144A 5.25000% 18-15.05.26	1 641 000.00	1 809 202.50	0.04
USD FIDELITY&GUARANTY LIFE HOLDING INC-144A 5.50000% 18-01.05.25	3 200 000.00	3 408 000.00	0.08
USD FINANCIAL & RISK US HOLDINGS INC-144A 6.25000% 18-15.05.26	6 771 000.00	7 321 482.30	0.16
USD FINANCIAL & RISK US HOLDINGS INC-144A 8.25000% 18-15.11.26	3 844 000.00	4 281 447.20	0.10
USD FIRST QUANTUM MINERALS LTD-144A 7.50000% 17-01.04.25	835 000.00	827 597.73	0.02
USD FIRST QUANTUM MINERALS LTD-144A 6.87500% 18-01.03.26	2 575 000.00	2 549 250.00	0.06
USD FIVE POINT OPERATING/CAPITAL CORP-144A 7.87500% 17-15.11.25	519 000.00	537 165.00	0.01
USD FLEX ACQUISITION CO INC-144A 6.87500% 17-15.01.25	300 000.00	301 125.00	0.01
USD FLEX ACQUISITION CO INC-144A 7.87500% 18-15.07.26	4 825 000.00	4 897 375.00	0.11
USD FMG RESOURCES AUGUST 2006 PTY LTD-144A 4.75000% 17-15.05.22	4 695 000.00	4 831 201.95	0.11
USD FMG RESOURCES AUGUST 2006 PTY LTD-144A 5.12500% 17-15.05.24	1 780 000.00	1 875 443.60	0.04
USD FMG RESOURCES AUGUST 2006 PTY LTD-144A 5.12500% 18-15.03.23	1 090 000.00	1 140 118.20	0.03
USD FORESTAR GROUP INC-144A 8.00000% 19-15.04.24	2 023 000.00	2 205 070.00	0.05
USD FORTRESS TRANS & INFRA INV LLC-144A 6.50000% 18-01.10.25	70 000.00	74 316.90	0.00
USD FOXTROT ESCROW ISSUER LLC-144A 12.25000% 19-15.11.26	75 000.00	77 625.15	0.00
USD FREEDOM MORTGAGE CORP-144A 8.12500% 17-15.11.24	75 000.00	74 625.00	0.00
USD FREEDOM MORTGAGE CORP-144A 8.25000% 18-15.04.25	7 042 000.00	6 980 382.50	0.16
USD FREEPORT-MCMORAN INC 5.45000% 13-15.03.43	2 724 000.00	2 778 480.00	0.06
USD FRONTIER COMMUNICATIONS CORP 11.00000% 16-15.09.25	750 000.00	343 593.75	0.01
USD FRONTIER COMMUNICATIONS CORPORATIO-144A 8.50000% 18-01.04.26	1 100 000.00	1 127 500.00	0.03
USD FXI HOLDINGS INC-144A 7.87500% 17-01.11.24	80 000.00	75 800.00	0.00
USD GANNETT CO INC-144A 5.50000% 14-15.09.2024	1 570 000.00	1 617 100.00	0.04
USD GARTNER INC-144A 5.12500% 17-01.04.25	3 536 000.00	3 675 954.88	0.08
USD GATEWAY CASINO & ENTERTAINMENT LTD-144A 8.25000% 17-01.03.24	2 000 000.00	2 083 340.00	0.05
USD GEMS MENASA CAYMAN LTD/GEDL-REG-S 7.12500% 19-31.07.26	475 000.00	495 632.81	0.01
USD GENESIS ENERGY LP 5.62500% 14-15.06.24	4 157 000.00	4 042 682.50	0.09
USD GENESIS ENERGY LP 6.00000% 15-15.05.23	6 915 000.00	6 947 500.50	0.16
USD GENWORTH HOLDINGS INC 7.62500% 11-24.09.21	70 000.00	73 850.00	0.00
USD GETTY IMAGES INC-144A 9.75000% 19-01.03.27	3 942 000.00	3 961 710.00	0.09
USD GFL ENVIRONMENTAL INC-144A 5.37500% 18-01.03.23	1 300 000.00	1 327 625.00	0.03
USD GFL ENVIRONMENTAL INC-144A 5.12500% 19-15.12.26	1 261 000.00	1 298 640.85	0.03
USD GLP CAPITAL LP / GLP FINANC II INC 4.00000% 19-15.01.30	950 000.00	1 002 639.50	0.02

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD GOEASY LTD-144A 5.37500% 19-01.12.24	2 550 000.00	2 610 562.50	0.06
USD GOGO INTERMEDIATE HOLDINGS/FIN CO-144A 9.87500% 19-01.05.24	6 474 000.00	6 959 808.96	0.16
USD GOLDEN ENTERTAINMENT INC-144A 7.62500% 19-15.04.26	4 152 000.00	4 480 028.76	0.10
USD GOLDEN NUGGET INC-144A-SUB 8.75000% 17-01.10.25	992 000.00	1 042 363.84	0.02
USD GOLDEN NUGGET INC-144A 6.75000% 17-15.10.24	2 942 000.00	3 023 493.40	0.07
USD GRAHAM HOLDINGS CO-144A 5.75000% 18-01.06.26	1 575 000.00	1 677 375.00	0.04
USD GRANITE MERGER SUB 2 INC-144A 11.00000% 19-15.07.27	4 255 000.00	4 680 500.00	0.10
USD GRANITE US HOLDINGS CORP-144A 11.00000% 19-01.10.27	459 000.00	480 802.50	0.01
USD GRAY ESCROW INC-144A 7.00000% 18-15.05.27	2 110 000.00	2 297 368.00	0.05
USD GRAY TELEVISION INC-144A 5.12500% 16-15.10.24	425 000.00	438 812.50	0.01
USD GREAT LAKES DREDGE & DOCK CORP 8.00000% 17-15.05.22	3 600 000.00	3 780 000.00	0.08
USD GREAT WESTERN PETROLEUM/FIN INC-144A 9.00000% 16-30.09.21	902 000.00	852 390.00	0.02
USD GREYSTAR REAL ESTATE PARTNERS LLC-144A 5.75000% 17-01.12.25	8 137 000.00	8 412 600.19	0.19
USD GTCR AP FINANCE INC-144A 8.00000% 19-15.05.27	1 605 000.00	1 701 300.00	0.04
USD GTT COMMUNICATIONS INC-144A 7.87500% 17-31.12.24	5 362 000.00	4 182 360.00	0.09
USD GULFPORT ENERGY CORP 6.62500% 15-01.05.23	1 050 000.00	714 000.00	0.02
USD GULFPORT ENERGY CORP 6.37500% 17-15.05.25	536 000.00	268 000.00	0.01
USD H&E EQUIPMENT SERVICES INC 5.62500% 18-01.09.25	1 550 000.00	1 615 875.00	0.04
USD HARSCO CORP-144A 5.75000% 19-31.07.27	2 250 000.00	2 300 625.00	0.05
USD HC2 HOLDINGS INC-144A 11.50000% 18-01.12.21	2 078 000.00	2 083 195.00	0.05
USD HD SUPPLY INC-144A 5.37500% 18-15.10.26	1 200 000.00	1 272 000.00	0.03
USD HEARTLAND DENTAL LLC-144A 8.50000% 18-01.05.26	1 818 000.00	1 867 995.00	0.04
USD HECLA MINING CO 6.87500% 13-01.05.21	2 477 000.00	2 472 046.00	0.06
USD HERC HOLDINGS INC-144A 5.50000% 19-15.07.27	2 008 000.00	2 097 757.60	0.05
USD HERTZ CORP-144A 6.00000% 19-15.01.28	2 825 000.00	2 849 718.75	0.06
USD HERTZ CORP/THE-144A 5.50000% 16-15.10.24	75 000.00	76 093.50	0.00
USD HILCORP ENERGY I LP/FINANCE CO-144A 5.75000% 15-01.10.25	107 000.00	96 746.19	0.00
USD HILCORP ENERGY I LP/FINANCE CO-144A 6.25000% 18-01.11.28	6 451 000.00	5 741 390.00	0.13
USD HILL-ROM HOLDINGS INC-144A 5.00000% 17-15.02.25	2 682 000.00	2 772 517.50	0.06
USD HILL-ROM HOLDINGS INC-144A 4.37500% 19-15.09.27	165 000.00	168 712.50	0.00
USD HILLMAN GROUP INC-144A 6.37500% 14-15.07.22	628 000.00	587 180.00	0.01
USD HILTON DOMESTIC OPERATING CO INC 4.25000% 17-01.09.24	600 000.00	609 000.00	0.01
USD HILTON DOMESTIC OPERATING CO INC 4.87500% 19-15.01.30	3 790 000.00	4 007 925.00	0.09
USD HLF FIN SARL LLC / HERBALF INT INC-144A 7.25000% 18-15.08.26	1 375 000.00	1 433 437.50	0.03
USD HOLLY ENERGY PARTNERS LP FIN CORP-144A 6.00000% 16-01.08.24	350 000.00	365 820.00	0.01
USD HOLOGIC INC-144A 4.37500% 17-15.10.25	700 000.00	712 831.00	0.02
USD HOWARD HUGHES CORP-144A 5.37500% 17-15.03.25	3 724 000.00	3 835 720.00	0.09
USD HUB INTERNATIONAL LTD-144A 7.00000% 18-01.05.26	2 559 000.00	2 654 962.50	0.06
USD HUDBAY MINERALS INC-144A 7.25000% 16-15.01.23	2 140 000.00	2 164 075.00	0.05
USD HUGHES SATELLITE SYSTEMS CORP 5.25000% 17-01.08.26	580 000.00	629 242.00	0.01
USD HUGHES SATELLITE SYSTEMS CORP 6.62500% 17-01.08.26	4 155 000.00	4 596 468.75	0.10
USD HULK FINANCE CORP-144A 7.00000% 18-01.06.26	6 119 000.00	6 377 221.80	0.14
USD HUNT COS INC-144A 6.25000% 18-15.02.26	3 250 000.00	3 145 528.75	0.07
USD IAA SPINCO INC-144A 5.50000% 19-15.06.27	1 667 000.00	1 768 937.05	0.04
USD IAMGOLD CORP-144A 7.00000% 17-15.04.25	650 000.00	669 500.00	0.02
USD ICAHN ENTERPRISES CORP-144A 5.25000% 19-15.05.27	4 967 000.00	4 985 675.92	0.11
USD ICAHN ENTERPRISES LP/FINANCE CORP 5.87500% 14-01.02.22	2 100 000.00	2 100 000.00	0.05
USD ICAHN ENTERPRISES LP/FINANCE CORP 6.37500% 18-15.12.25	1 885 000.00	1 967 468.75	0.04
USD ICAHN ENTERPRISES LP/FINANCE CORP 6.25000% 19-15.05.26	5 047 000.00	5 297 734.96	0.12
USD IHEARTCOMMUNICATIONS INC 8.37500% 19-01.05.27	530 000.00	576 369.70	0.01
USD IMMUCOR INC-144A 11.12500% 17-15.02.22	750 000.00	742 500.00	0.02
USD INDIGO NATURAL RESOURCES LLC-144A 6.87500% 18-15.02.26	6 297 000.00	5 761 755.00	0.13
USD INFOR US INC 6.50000% 16-15.05.22	2 000 000.00	2 015 000.00	0.05
USD INFORMATICA CORP-144A 7.12500% 15-15.07.23	5 013 000.00	5 063 130.00	0.11
USD INGEVITY CORP-144A 4.50000% 18-01.02.26	275 000.00	277 750.00	0.01
USD INTELSAT JACKSON HOLDINGS SA 5.50000% 14-01.08.23	1 802 000.00	1 446 105.00	0.03
USD INTELSAT JACKSON HOLDINGS SA-144A 9.75000% 17-15.07.25	3 305 000.00	2 817 512.50	0.06
USD INTELSAT JACKSON HOLDINGS SA-144A 8.50000% 18-15.10.24	3 024 000.00	2 540 160.00	0.06

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD INTERTAPE POLYMER GROUP INC-144A 7.00000% 18-15.10.26	1 350 000.00	1 427 625.00	0.03
USD IRB HOLDING CORP-144A 6.75000% 18-15.02.26	1 950 000.00	2 029 852.50	0.05
USD IRON MOUNTAIN INC-144A 4.87500% 17-15.09.27	2 310 000.00	2 379 300.00	0.05
USD ITRON INC-144A 5.00000% 17-15.01.26	2 624 000.00	2 728 960.00	0.06
USD J2 CLD SER LLC/GLB CO-OBLIGOR INC-144A 6.00000% 17-15.07.25	1 855 000.00	1 957 025.00	0.04
USD JAGGED PEAK ENERGY LLC 5.87500% 19-01.05.26	1 146 000.00	1 180 380.00	0.03
USD JAGUAR HOLDINGS/PHARMA PROD DEV-144A 6.37500% 15-01.08.23	8 014 000.00	8 234 385.00	0.18
USD JBS USA LUX SA/FOOD/FINANCE INC-144A 5.50000% 19-15.01.30	4 717 000.00	5 094 360.00	0.11
USD JEFFERIE LOANCORE LLC/JLC FIN CORP-144A 6.87500% 13-01.06.20	1 650 000.00	1 652 062.50	0.04
USD JELD-WEN INC-144A 4.62500% 17-15.12.25	1 728 000.00	1 762 560.00	0.04
USD JELD-WEN INC-144A 4.87500% 17-15.12.27	1 552 000.00	1 606 320.00	0.04
USD KAISER ALUMINUM CORP-144A 4.62500% 19-01.03.28	1 175 000.00	1 198 500.00	0.03
USD KAR AUCTION SERVICES INC-144A 5.12500% 17-01.06.25	1 801 000.00	1 847 519.83	0.04
USD KEHE DIST LLC / KEHE FIN CORP-144A 8.62500% 19-15.10.26	1 150 000.00	1 220 437.50	0.03
USD KENNEDY-WILSON INC 5.87500% 14-01.04.24	1 900 000.00	1 938 000.00	0.04
USD KGA ESCROW LLC-144A 7.50000% 18-15.08.23	2 938 000.00	3 099 590.00	0.07
USD KOPPERS INC-144A 6.00000% 17-15.02.25	3 485 000.00	3 570 382.50	0.08
USD KORN FERRY-144A 4.62500% 19-15.12.27	1 066 000.00	1 070 104.10	0.02
USD KRAFT HEINZ FOODS CO-144A 4.87500% 15-15.02.25	4 816 000.00	4 942 371.84	0.11
USD KRATON POLYMERS LLC/CAPITAL CORP-144A 7.00000% 17-15.04.25	350 000.00	356 125.00	0.01
USD KRONOS ACQUISITION HOLDINGS INC-144A 9.00000% 15-15.08.23	7 542 000.00	7 243 185.96	0.16
USD LAMAR MEDIA CORP-144A 3.75000% 20-15.02.28	1 300 000.00	1 308 684.00	0.03
USD LAMB WESTON HOLDINGS INC-144A 4.62500% 16-01.11.24	556 000.00	583 800.00	0.01
USD LAMB WESTON HOLDINGS INC-144A 4.87500% 16-01.11.26	5 023 000.00	5 296 125.63	0.12
USD LAUREATE EDUCATION INC-144A 8.25000% 17-01.05.25	3 783 000.00	4 052 538.75	0.09
USD LBC TANK TERMINALS HDNG NETH BV-144A 6.87500% 13-15.05.23	3 815 000.00	3 881 762.50	0.09
USD LENNAR CORP 5.87500% 18-15.11.24	400 000.00	450 500.00	0.01
USD LEVEL 3 FINANCING INC 5.37500% 14-15.08.22	6 201 000.00	6 225 803.99	0.14
USD LEVEL 3 FINANCING INC 5.25000% 17-15.03.26	1 575 000.00	1 638 157.50	0.04
USD LGI HOMES INC-144A 6.87500% 18-15.07.26	2 180 000.00	2 302 625.00	0.05
USD LIONS GATE CAPITAL HOLDINGS LLC-144A 6.37500% 19-01.02.24	75 000.00	75 375.00	0.00
USD LITHIA MOTORS INC-144A 4.62500% 19-15.12.27	1 229 000.00	1 256 652.50	0.03
USD LIVE NATION ENTERTAINMENT INC-144A 4.87500% 16-01.11.24	7 098 000.00	7 336 492.80	0.16
USD LPL HOLDINGS INC-144A 5.75000% 17-15.09.25	450 000.00	469 125.00	0.01
USD LPL HOLDINGS INC-144A 4.62500% 19-15.11.27	600 000.00	610 500.00	0.01
USD LTF MERGER SUB INC-144A-SUB 8.50000% 15-15.06.23	5 116 000.00	5 204 481.22	0.12
USD M/I HOMES INC-144A 4.95000% 20-01.02.28	420 000.00	432 600.00	0.01
USD MAGNOLIA OIL & GAS OPERATING LLC-144A 6.00000% 18-01.08.26	3 140 000.00	3 242 050.00	0.07
USD MANITOWOC CO INC/THE-144A 9.00000% 19-01.04.26	2 760 000.00	2 939 400.00	0.07
USD MASONITE INTERNATIONAL CORP-144A 5.75000% 18-15.09.26	700 000.00	742 000.00	0.02
USD MATADOR RESOURCES CO 5.87500% 18-15.09.26	2 063 000.00	2 019 264.40	0.05
USD MATCH GROUP INC 6.37500% 16-01.06.24	3 615 000.00	3 786 712.50	0.08
USD MATCH GROUP INC-144A 5.00000% 17-15.12.27	159 000.00	166 950.00	0.00
USD MATCH GROUP INC-144A 5.62500% 19-15.02.29	3 425 000.00	3 694 718.75	0.08
USD MATTAMY GROUP CORP-144A 5.25000% 19-15.12.27	800 000.00	836 000.00	0.02
USD MATTEL INC 3.15000% 13-15.03.23	900 000.00	891 000.00	0.02
USD MATTEL INC-144A 5.87500% 19-15.12.27	1 350 000.00	1 419 052.50	0.03
USD MATTEL INC-144A 6.75000% 17-31.12.25	2 909 000.00	3 119 902.50	0.07
USD MATTERHORN FINANCE SUB INC-144A 8.50000% 18-01.06.26	2 325 000.00	2 040 187.50	0.05
USD MATTHEWS INTERNATIONAL CORP-144A 5.25000% 17-01.12.25	3 934 000.00	3 934 000.00	0.09
USD MCGRAW-HILL GLOBAL EDUCATION-144A 7.87500% 16-15.05.24	6 604 000.00	5 811 520.00	0.13
USD MDC PARTNERS INC-144A 6.50000% 16-01.05.24	4 881 000.00	4 417 305.00	0.10
USD MEDNAX INC-144A 6.25000% 18-15.01.27	2 420 000.00	2 465 375.00	0.06
USD MEG ENERGY CORP-144A 7.00000% 13-31.03.24	465 000.00	468 487.50	0.01
USD MERCER INTERNATIONAL INC 5.50000% 18-15.01.26	355 000.00	358 976.00	0.01
USD MERCER INTERNATIONAL INC 7.37500% 19-15.01.25	1 350 000.00	1 428 192.00	0.03
USD MEREDITH CORP 6.87500% 19-01.02.26	4 967 000.00	5 111 564.53	0.11
USD MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-144A 5.75000% 18-15.06.26	2 190 000.00	2 392 575.00	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

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD MGM GROWTH POP LP/CO-ISSUER INC 4.50000% 17-01.09.26	385 000.00	400 536.68	0.01
USD MGM GROWTH POP LP/CO-ISSUER INC 5.62500% 17-01.05.24	5 475 000.00	5 972 075.25	0.13
USD MGM GROWTH POP LP/CO-ISSUER INC 4.50000% 18-15.01.28	3 200 000.00	3 301 776.00	0.07
USD MIDAS INTERMEDIATE HOLDCO II LLC-144A 7.87500% 14-01.10.22	3 550 000.00	3 394 687.50	0.08
USD MOHEGAN TRIBAL GAMING AUTHORITY-144A 7.87500% 16-15.10.24	1 600 000.00	1 624 000.00	0.04
USD MOOG INC-144A 4.25000% 19-15.12.27	997 000.00	1 022 074.55	0.02
USD MOSS CREEK RESOURCES HOLDINGS INC-144A 7.50000% 18-15.01.26	780 000.00	572 325.00	0.01
USD MPH ACQUISITION HOLDINGS LLC-144A 7.12500% 16-01.06.24	6 439 000.00	6 236 944.18	0.14
USD MSCI INC-144A 5.25000% 14-15.11.24	2 634 000.00	2 713 020.00	0.06
USD MTS SYSTEMS CORP-144A 5.75000% 19-15.08.27	1 907 000.00	2 002 350.00	0.04
USD MUELLER WATER PRODUCTS INC-144A 5.50000% 18-15.06.26	1 460 000.00	1 529 350.00	0.03
USD NABORS INDUSTRIES INC 5.75000% 18-01.02.25	1 699 000.00	1 393 180.00	0.03
USD NABORS INDUSTRIES LTD-144A 7.25000% 20-15.01.26	1 196 000.00	1 188 931.64	0.03
USD NATHAN 'S FAMOUS INC-144A 6.62500% 17-01.11.25	1 500 000.00	1 524 140.70	0.03
USD NATIONAL CINEMEDIA LLC 5.75000% 16-15.08.26	270 000.00	266 625.00	0.01
USD NATIONAL FINANCIAL PARTNERS -144A 6.87500% 17-15.07.25	800 000.00	813 608.00	0.02
USD NAVIENT CORP 5.50000% 13-25.01.23	700 000.00	731 500.00	0.02
USD NAVIENT CORP 6.62500% 16-26.07.21	250 000.00	263 462.50	0.01
USD NAVISTAR INTERNATIONAL CORP-144A 6.62500% 17-01.11.25	2 643 000.00	2 764 128.69	0.06
USD NCR CORP 6.37500% 14-15.12.23	1 625 000.00	1 666 080.00	0.04
USD NCR CORP-144A 5.75000% 19-01.09.27	4 645 000.00	4 947 877.22	0.11
USD NEON HOLDINGS INC-144A 10.12500% 19-01.04.26	1 075 000.00	1 080 375.00	0.02
USD NETFLIX INC 5.87500% 18-15.11.28	3 860 000.00	4 346 939.00	0.10
USD NETFLIX INC-144A 4.87500% 19-15.06.30	3 692 000.00	3 851 217.50	0.09
USD NEW ENTERPRISE STONE&LIME CO INC-144A 6.25000% 18-15.03.26	7 240 000.00	7 565 800.00	0.17
USD NEW GOLD INC-144A 6.37500% 17-15.05.25	2 975 000.00	2 796 500.00	0.06
USD NEW GOLD INC-144A 6.25000% 12-15.11.22	2 455 000.00	2 459 603.12	0.06
USD NEWMARK GROUP INC 6.12500% 19-15.11.23	1 800 000.00	1 974 059.28	0.04
USD NEXSTAR BROADCASTING INC-144A 5.62500% 16-01.08.24	2 368 000.00	2 462 720.00	0.06
USD NEXSTAR ESCROW INC-144A 5.62500% 19-15.07.27	4 269 000.00	4 490 006.13	0.10
USD NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD-144A 5.87500% 14-15.11.21	705 000.00	718 218.75	0.02
USD NEXTERA ENERGY PARTNERS LP-144A 4.50000% 17-15.09.27	2 712 000.00	2 828 222.76	0.06
USD NGL ENRGY PARTNRS LP/ FINANCE CORP 7.50000% 17-01.11.23	550 000.00	548 460.00	0.01
USD NGL ENRGY PARTNRS LP/ FINANCE CORP-144A 7.50000% 19-15.04.26	8 560 000.00	8 303 200.00	0.19
USD NGPL PIPECO LLC-144A 4.37500% 17-15.08.22	85 000.00	88 322.28	0.00
USD NIELSEN CO LUXEMBOURG SARL/THE-144A 5.50000% 13-01.10.21	3 695 000.00	3 700 542.50	0.08
USD NIELSEN CO LUXEMBOURG SARL/THE-144A 5.00000% 17-01.02.25	2 175 000.00	2 213 323.50	0.05
USD NIELSEN FINANCE LLC/CO-144A 5.00000% 14-15.04.22	2 272 000.00	2 274 840.00	0.05
USD NINE ENERGY SERVICE INC-144A 8.75000% 18-01.11.23	375 000.00	317 812.50	0.01
USD NOBLE HOLDING INTERNATIONAL LTD-144A 7.87500% 18-01.02.26	935 000.00	668 525.00	0.02
USD NOVA CHEMICALS CORP-144A 5.25000% 13-01.08.23	3 460 000.00	3 503 250.00	0.08
USD NOVA CHEMICALS CORP-144A 4.87500% 17-01.06.24	1 000 000.00	1 015 000.00	0.02
USD NOVELIS CORP-144A 5.87500% 16-30.09.26	3 450 000.00	3 657 000.00	0.08
USD NRG ENERGY INC-144A 5.25000% 19-15.06.29	574 000.00	618 571.10	0.01
USD NUFARM AUSTRALIA LTD/AMERICAS-144A 5.75000% 18-30.04.26	4 509 000.00	4 373 730.00	0.10
USD NUSTAR LOGISTICS LP 6.75000% 13-01.02.21	650 000.00	668 980.00	0.02
USD NVA HOLDINGS INC-144A 6.87500% 18-01.04.26	6 572 000.00	7 097 760.00	0.16
USD OPE KAG FINANCE SUB INC-144A 7.87500% 15-31.07.23	9 950 000.00	9 676 375.00	0.22
USD ORTHO-CLINICAL DIAGNOSTICS INC/SA-144A 6.62500% 14-15.05.22	85 000.00	84 681.25	0.00
USD OWENS-BROCKWAY GLASS CONTAINER INC-144A 5.87500% 15-15.08.23	700 000.00	749 000.00	0.02
USD OWENS-BROCKWAY GLASS CONTAINER INC-144A 5.00000% 14-15.01.22	2 304 000.00	2 384 640.00	0.05
USD PANTHER BF AGGR 2/PANTHER FIN CO-144A 6.25000% 19-15.05.26	2 852 000.00	3 059 060.91	0.07
USD PANTHER BF AGGR 2/PANTHER FIN CO-144A 8.50000% 19-15.05.27	8 968 000.00	9 640 600.00	0.22
USD PAR PHARMACEUTICAL INC-144A 7.50000% 19-01.04.27	3 775 000.00	3 841 062.50	0.09
USD PARK AEROSPACE HOLDINGS LTD-144A 5.50000% 17-15.02.24	3 689 000.00	4 074 869.40	0.09
USD PARKLAND FUEL CORP-144A 6.00000% 18-01.04.26	4 765 000.00	5 015 162.50	0.11
USD PARSLEY ENERGY LLC/FINANCE CORP-144A 6.25000% 16-01.06.24	6 795 000.00	7 032 825.00	0.16
USD PARSLEY ENERGY LLC/FINANCE CORP-144A 5.25000% 17-15.08.25	1 240 000.00	1 271 000.00	0.03

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD PARSELY ENERGY LLC/FINANCE CORP-144A 5.62500% 17-15.10.27	1 874 000.00	1 972 385.00	0.04
USD PATTERN ENERGY GROUP INC-144A 5.87500% 17-01.02.24	675 000.00	693 562.50	0.02
USD PBF HOLDING CO LLC/FIN CORP 7.00000% 17-15.11.23	970 000.00	1 005 017.00	0.02
USD PBF HOLDING CO LLC/FIN CORP 7.25000% 17-15.06.25	1 759 000.00	1 868 198.72	0.04
USD PBF LOGISTICS LP/FINANCE CORP 6.87500% 15-15.05.23	5 488 000.00	5 638 920.00	0.13
USD PDC ENERGY INC 5.75000% 18-15.05.26	1 000 000.00	965 250.00	0.02
USD PENSKE AUTOMOTIVE GROUP INC-SUB 5.75000% 13-01.10.22	1 394 000.00	1 408 637.00	0.03
USD PERFORMANCE FOOD GROUP INC-144A 5.50000% 16-01.06.24	2 160 000.00	2 203 200.00	0.05
USD PETSMART INC-144A 5.87500% 17-01.06.25	1 419 000.00	1 456 035.90	0.03
USD PETSMART INC-144A 8.87500% 17-01.06.25	534 000.00	548 685.00	0.01
USD PILGRIMS PRIDE CORP-144A 5.87500% 17-30.09.27	7 308 000.00	7 751 595.60	0.17
USD PLANTRONICS INC-144A 5.50000% 15-31.05.23	1 430 000.00	1 379 950.00	0.03
USD POLARIS INTERMEDIATE CORP-144A (PIK) 8.50000% 17-01.12.22	7 239 000.00	6 732 364.11	0.15
USD POST HOLDINGS INC-144A 5.00000% 16-15.08.26	725 000.00	748 562.50	0.02
USD POST HOLDINGS INC-144A 5.50000% 17-01.03.25	1 000 000.00	1 035 830.00	0.02
USD POST HOLDINGS INC-144A 5.75000% 17-01.03.27	7 761 000.00	8 187 855.00	0.18
USD POST HOLDINGS INC-144A 5.62500% 17-15.01.28	2 652 000.00	2 804 490.00	0.06
USD POST HOLDINGS INC-144A 5.50000% 19-15.12.29	248 000.00	262 545.20	0.01
USD PQ CORP-144A 6.75000% 16-15.11.22	5 524 000.00	5 662 100.00	0.13
USD PRESTIGE BRANDS INC-144A 6.37500% 16-01.03.24	5 291 000.00	5 456 343.75	0.12
USD PRIME SEC SER BORROWER LLC/FIN INC-144A 9.25000% 16-15.05.23	642 000.00	672 495.00	0.02
USD PRIME SEC SER BORROWER LLC/FIN INC-144A 5.25000% 19-15.04.24	2 850 000.00	2 971 125.00	0.07
USD PRIME SEC SER BORROWER LLC/FIN INC-144A 5.75000% 19-15.04.26	1 450 000.00	1 529 750.00	0.03
USD PTC INC-144A 3.62500% 20-15.02.25	1 070 000.00	1 079 362.50	0.02
USD PTC INC-144A 4.00000% 20-15.02.28	1 686 000.00	1 702 860.00	0.04
USD QEP RESOURCES INC 5.25000% 12-01.05.23	350 000.00	336 000.00	0.01
USD QORVO INC 5.50000% 19-15.07.26	450 000.00	475 875.00	0.01
USD QUALITYTECH LP/QTS FIN CORP-144A 4.75000% 17-15.11.25	700 000.00	723 625.00	0.02
USD QUEBECOR MEDIA INC 5.75000% 13-15.01.23	7 053 000.00	7 581 975.00	0.17
USD QUICKEN LOANS INC -144A 5.75000% 15-01.05.25	1 050 000.00	1 086 750.00	0.02
USD QUICKEN LOANS INC-144A 5.25000% 17-15.01.28	2 725 000.00	2 820 375.00	0.06
USD QUINTILES IMS INC-144A 5.00000% 16-15.10.26	2 000 000.00	2 092 500.00	0.05
USD RACKSPACE HOSTING INC-144A 8.62500% 16-15.11.24	7 257 000.00	7 184 429.99	0.16
USD RANGE RESOURCES CORP 5.00000% 17-15.08.22	450 000.00	425 340.00	0.01
USD RAYONIER AM PRODUCTS INC-144A 5.50000% 14-01.06.24	5 135 000.00	3 851 250.00	0.09
USD REALOGY GROUP/CO ISSUER-144A 5.25000% 14-01.12.21	150 000.00	150 937.50	0.00
USD REALOGY GROUP/CO ISSUER-144A 4.87500% 16-01.06.23	1 330 000.00	1 320 025.00	0.03
USD REGIONALCARE HOSPITAL PTRS HLDNGS-144A 9.75000% 18-01.12.26	3 656 000.00	4 081 010.00	0.09
USD RELIANCE INTERMEDIATE HOLDINGS-144A 6.50000% 15-01.04.23	4 303 000.00	4 378 302.50	0.10
USD RESIDEO FUNDING INC-144A 6.12500% 18-01.11.26	3 899 000.00	3 830 572.55	0.09
USD REVLOON CUSTOMER PRODUCTS CORP STEP-UP/DOWN 13-15.02.21	4 259 000.00	3 747 920.00	0.08
USD REYNOLDS GROUP INC/LLC/LUX-144A 7.00000% 16-15.07.24	4 180 000.00	4 315 850.00	0.10
USD RITE AID CORP-144A 6.12500% 15-01.04.23	1 190 000.00	1 085 875.00	0.02
USD RIVERBED TECHNOLOGY INC-144A 8.87500% 15-01.03.23	1 884 000.00	1 205 760.00	0.03
USD ROWAN COS INC 5.40000% 12-01.12.42	350 000.00	169 750.00	0.00
USD SABRE GBL INC-144A 5.37500% 15-15.04.23	2 950 000.00	3 001 625.00	0.07
USD SABRE GBL INC-144A 5.25000% 15-15.11.23	810 000.00	829 253.70	0.02
USD SBA COMMUNICATIONS CORP 4.87500% 17-01.09.24	3 198 000.00	3 305 932.50	0.07
USD SBA COMMUNICATIONS CORP 4.00000% 18-01.10.22	390 000.00	396 825.00	0.01
USD SCHWEITZER-MAUDUIT INTERNATNAL INC-144A 6.87500% 18-01.10.26	2 750 000.00	2 956 250.00	0.07
USD SCIENTIFIC GAMES INTERNATIONAL-144A 8.25000% 19-15.03.26	4 860 000.00	5 273 100.00	0.12
USD SCIENTIFIC GAMES INTERNATIONAL INC-144A 7.00000% 19-15.05.28	3 001 000.00	3 166 925.29	0.07
USD SCIENTIFIC GAMES INTERNATIONAL-144A 7.25000% 19-15.11.29	2 542 000.00	2 726 295.00	0.06
USD SEALED AIR CORP-144A 4.87500% 14-01.12.22	2 588 000.00	2 723 870.00	0.06
USD SENSATA TECHNOLOGIES BV-144A 4.87500% 13-15.10.23	3 000 000.00	3 195 000.00	0.07
USD SENSATA TECHNOLOGIES BV-144A 5.62500% 14-01.11.24	1 438 000.00	1 588 990.00	0.04
USD SENSATA TECHNOLOGIES BV-144A 5.00000% 15-01.10.25	4 552 000.00	4 927 540.00	0.11
USD SENSATA TECHNOLOGIES UK FINANCING-144A 6.25000% 15-15.02.26	2 500 000.00	2 625 375.00	0.06

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD SERVICE CORP INTERNATIONAL/US 5.37500% 14-15.05.24	898 000.00	920 169.37	0.02
USD SERVICEMASTER CO LLC/THE 7.45000% 97-15.08.27	2 900 000.00	3 327 750.00	0.07
USD SERVICEMASTER CO LLC/THE-144A 5.12500% 16-15.11.24	1 250 000.00	1 291 837.50	0.03
USD SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD-144A 6.87500% 15-30.06.23	1 730 000.00	1 785 377.30	0.04
USD SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD-144A 5.37500% 17-30.09.25	650 000.00	651 625.00	0.01
USD SHELF DRILLING HOLDINGS LTD-144A 8.25000% 18-15.02.25	1 645 000.00	1 546 300.00	0.03
USD SILVERSEA CRUISE FINANCE LTD-144A 7.25000% 17-01.02.25	1 761 000.00	1 858 207.20	0.04
USD SIRIUS XM RADIO INC-144A 5.37500% 15-15.04.25	3 446 000.00	3 554 032.10	0.08
USD SIRIUS XM RADIO INC-144A 5.00000% 17-01.08.27	4 562 000.00	4 790 100.00	0.11
USD SIRIUS XM RADIO INC-144A 5.50000% 19-01.07.29	1 600 000.00	1 721 840.00	0.04
USD SIRIUS XM RADIO INC-144A 4.62500% 19-15.07.24	6 211 000.00	6 440 030.63	0.14
USD SM ENERGY CO 5.00000% 14-15.01.24	1 677 000.00	1 530 262.50	0.03
USD SM ENERGY CO 5.62500% 15-01.06.25	1 468 000.00	1 328 540.00	0.03
USD SOLERA LLC/SOLERA FINANCE INC-144A 10.50000% 16-01.03.24	10 535 000.00	11 153 931.25	0.25
USD SONIC AUTOMOTIVE INC-SUB 6.12500% 17-15.03.27	914 000.00	971 125.00	0.02
USD SOPHIA LP / SOPHIA FINANCE INC-144A 9.00000% 15-30.09.23	8 952 000.00	9 198 180.00	0.21
USD SOUTHERN STAR CENTRAL CORP-144A 5.12500% 14-15.07.22	7 422 000.00	7 508 868.57	0.17
USD SOUTHWESTERN ENERGY CO 7.75000% 17-01.10.27	3 370 000.00	2 813 950.00	0.06
USD SPECTRUM BRANDS INC-144A 5.00000% 19-01.10.29	462 000.00	480 089.61	0.01
USD SPEEDWAY MOTO/ SPEEDWAY FUNDING II-144A 4.87500% 19-01.11.27	1 547 000.00	1 558 602.50	0.04
USD SPRINT CORP 7.12500% 14-15.06.24	2 131 000.00	2 201 003.35	0.05
USD SPRINT CORP 7.62500% 15-15.02.25	2 800 000.00	2 922 500.00	0.07
USD SPRINT CORP 7.87500% 14-15.09.23	8 057 000.00	8 559 676.23	0.19
USD SPRINT CORP-144A 7.25000% 20-01.02.28	6 973 000.00	6 903 270.00	0.15
USD SPRINT NEXTEL CORP-144A 7.00000% 12-01.03.20	9 404 000.00	9 433 152.40	0.21
USD SRC ENERGY INC 6.25000% 18-01.12.25	450 000.00	453 375.00	0.01
USD SS&C TECHNOLOGIES INC-144A 5.50000% 19-30.09.27	5 800 000.00	6 135 240.00	0.14
USD SSL ROBOTICS LLC-144A 9.75000% 19-31.12.23	2 240 000.00	2 458 400.00	0.06
USD STANDARD INDUSTRIES INC/NJ-144A 5.50000% 16-15.02.23	3 171 000.00	3 218 565.00	0.07
USD STANDARD INDUSTRIES INC/NJ-144A 5.00000% 17-15.02.27	200 000.00	208 500.00	0.00
USD STANDARD INDUSTRIES INC/NJ-144A 4.75000% 17-15.01.28	2 625 000.00	2 692 265.62	0.06
USD STAPLES INC-144A 10.75000% 19-15.04.27	3 858 000.00	3 920 885.40	0.09
USD STAPLES INC-144A 7.50000% 19-15.04.26	775 000.00	793 910.00	0.02
USD STARWOOD PROPERTY TRUST INC 4.75000% 18-15.03.25	10 276 000.00	10 739 447.60	0.24
USD STATION CASINOS LLC-144A 5.00000% 17-01.10.25	2 888 000.00	2 955 723.60	0.07
USD SUBURBAN PROPANE PARTNERS LP/SUBURBAN 5.50000% 14-01.06.24	735 000.00	749 700.00	0.02
USD SUBURBAN PROPANE PARTNERS LP/SUBURBAN 5.75000% 15-01.03.25	2 950 000.00	3 001 625.00	0.07
USD SUBURBAN PROPANE PARTNERS LP/ENERGY 5.87500% 17-01.03.27	4 127 000.00	4 250 810.00	0.10
USD SUMMIT MATERIALS LLC/FIN-144A 6.50000% 19-15.03.27	938 000.00	1 015 385.00	0.02
USD SUMMIT MIDSTREAM HLDG LLC/FIN CORP 5.50000% 14-15.08.22	4 736 000.00	4 164 724.74	0.09
USD SUNOCO LP/FINANCE CORP 4.87500% 18-15.01.23	380 000.00	389 975.00	0.01
USD SUNOCO LP/FINANCE CORP 5.50000% 18-15.02.26	915 000.00	941 315.40	0.02
USD SUNOCO LP/FINANCE CORP 6.00000% 19-15.04.27	4 380 000.00	4 620 768.60	0.10
USD SUPERIOR PLUS/SUPE GEN PARTNER INC-144A 7.00000% 18-15.07.26	1 250 000.00	1 346 881.25	0.03
USD SURGERY CENTER HOLDINGS INC-144A 6.75000% 17-01.07.25	3 790 000.00	3 856 325.00	0.09
USD SURGERY CENTER HOLDINGS INC-144A 10.00000% 19-15.04.27	4 839 000.00	5 383 387.50	0.12
USD SYMANTEC CORP-144A 5.00000% 17-15.04.25	1 848 000.00	1 887 116.43	0.04
USD TALEN ENERGY SUPPLY LLC-144A 10.50000% 17-15.01.26	500 000.00	443 489.95	0.01
USD TALEN ENERGY SUPPLY LLC-144A 6.62500% 19-15.01.28	525 000.00	525 000.00	0.01
USD TALLGRASS ENRGY PART LP/FIN CORP-144A 5.50000% 17-15.01.28	233 000.00	233 000.00	0.01
USD TARGA RESOURCES PARTNERS 6.75000% 15-15.03.24	5 287 000.00	5 458 404.54	0.12
USD TARGA RESOURCES PARTNERS 5.00000% 17-15.01.28	700 000.00	712 250.00	0.02
USD TAYLOR MORRISON COMMUNITIES INC-144A 5.87500% 19-15.06.27	3 075 000.00	3 420 937.50	0.08
USD TAYLOR MORRISON COMMUNITIES INC-144A 5.75000% 19-15.01.28	953 000.00	1 043 535.00	0.02
USD TEAM HEALTH HOLDINGS INC-144A 6.37500% 17-01.02.25	1 969 000.00	1 156 846.57	0.03
USD TEGNA INC-144A 4.62500% 20-15.03.28	3 328 000.00	3 344 640.00	0.08
USD TEMPUR SEALY INTERNATIONAL INC 5.50000% 16-15.06.26	680 000.00	712 619.60	0.02
USD TENET HEALTHCARE CORP 8.12500% 13-01.04.22	4 700 000.00	5 134 938.00	0.12

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD TENET HEALTHCARE CORP-144A 6.25000% 19-01.02.27	3 300 000.00	3 490 080.00	0.08
USD TENET HEALTHCARE CORP-144A 4.87500% 19-01.01.26	5 618 000.00	5 825 163.75	0.13
USD TERRAFORM GLOBAL OPERATING LLC-144A 6.12500% 18-01.03.26	3 325 000.00	3 466 312.50	0.08
USD TERRAFORM POWER OPERATING LLC-144A 4.25000% 17-31.01.23	5 316 000.00	5 464 156.92	0.12
USD TERRAFORM POWER OPERATING LLC-144A 5.00000% 17-31.01.28	1 521 000.00	1 642 680.00	0.04
USD TERVITA ESCROW CORP-144A 7.62500% 16-01.12.21	480 000.00	488 400.00	0.01
USD TIBCO SOFTWARE-144A 11.37500% 14-01.12.21	900 000.00	930 375.00	0.02
USD TITAN ACQUISITION/CO-BORROWER LLC-144A 7.75000% 18-15.04.26	1 375 000.00	1 339 050.62	0.03
USD TITAN INTERNATIONAL INC 6.50000% 18-30.11.23	1 650 000.00	1 439 625.00	0.03
USD TMS INTERNATIONAL CORP-144A 7.25000% 17-15.08.25	826 000.00	780 570.00	0.02
USD TOPBUILD CORP-144A 5.62500% 18-01.05.26	3 020 000.00	3 148 350.00	0.07
USD TRANSDIGM INC-144A 6.25000% 19-15.03.26	2 294 000.00	2 474 079.00	0.06
USD TRANSDIGM INC-SUB 6.50000% 14-15.07.24	1 750 000.00	1 804 687.50	0.04
USD TRANSDIGM INC-SUB 6.37500% 17-15.06.26	1 980 000.00	2 088 900.00	0.05
USD TRANSDIGM UK HOLDINGS PLC-SUB 6.87500% 19-15.05.26	3 020 000.00	3 216 300.00	0.07
USD TRANSOCEAN GUARDIAN LTD-144A 5.87500% 18-15.01.24	465 000.00	396 530.80	0.01
USD TRANSOCEAN INC-144A 9.00000% 16-15.07.23	2 050 000.00	2 202 520.00	0.05
USD TRANSOCEAN INC-144A 7.50000% 17-15.01.26	1 979 000.00	1 865 207.50	0.04
USD TRANSOCEAN PONTUS LTD-144A 6.12500% 18-01.08.25	320 000.00	293 344.00	0.01
USD TRANSOCEAN POSEIDON LTD-144A 6.87500% 19-01.02.27	248 000.00	259 160.00	0.01
USD TRANSOCEAN-144A 7.25000% 18-01.11.25	813 000.00	766 252.50	0.02
USD TRI POINTE HOLDINGS INC 5.87500% 15-15.06.24	5 310 000.00	5 761 350.00	0.13
USD TRIMAS CORP-144A 4.87500% 17-15.10.25	1 875 000.00	1 921 875.00	0.04
USD TRONOX FINANCE PLC-144A 5.75000% 17-01.10.25	825 000.00	814 687.50	0.02
USD TRONOX INC-144A 6.50000% 18-15.04.26	75 000.00	74 625.00	0.00
USD TUTOR PERINI CORP-144A 6.87500% 17-01.05.25	326 000.00	306 440.00	0.01
USD TWITTER INC-144A 3.87500% 19-15.12.27	584 000.00	584 730.00	0.01
USD UBER TECHNOLOGIES INC-144A 7.50000% 18-01.11.23	1 400 000.00	1 463 000.00	0.03
USD UBER TECHNOLOGIES INC-144A 8.00000% 18-01.11.26	75 000.00	79 796.63	0.00
USD UBER TECHNOLOGIES INC-144A 7.50000% 19-15.09.27	75 000.00	79 101.75	0.00
USD ULTRA RESOURCES INC (PIK) 11.00000% 18-12.07.24	385 084.00	58 725.31	0.00
USD UNISYS CORP-144A 10.75000% 17-15.04.22	2 529 000.00	2 699 707.50	0.06
USD UNITI GROUP LP/FIBER HLDG/CSL CAP-144A 7.12500% 16-15.12.24	90 000.00	71 325.00	0.00
USD UNIVISION COMMUNICATIONS INC-144A 6.75000% 12-15.09.22	4 632 000.00	4 701 480.00	0.11
USD UNIVISION COMMUNICATIONS INC-144A 5.12500% 13-15.05.23	975 000.00	975 000.00	0.02
USD UNIVISION COMMUNICATIONS INC-144A 5.12500% 15-15.02.25	75 000.00	74 812.50	0.00
USD UPC HOLDING BV-144A 5.50000% 17-15.01.28	1 112 000.00	1 156 480.00	0.03
USD UPCB FINANCE IV LTD-144A 5.37500% 15-15.01.25	1 407 000.00	1 440 796.14	0.03
USD US FOODS INC-144A 5.87500% 16-15.06.24	4 355 000.00	4 453 553.65	0.10
USD USA COMPRESSION PARTNERS LLC 6.87500% 19-01.04.26	2 275 000.00	2 366 000.00	0.05
USD USI INC/NY-144A 6.87500% 17-01.05.25	3 390 000.00	3 474 817.80	0.08
USD VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-144A 6.12500% 15-15.04.25	155 000.00	159 436.10	0.00
USD VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-144A 5.50000% 15-01.03.23	693 000.00	694 732.50	0.02
USD VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-144A 7.00000% 17-15.03.24	10 838 000.00	11 235 754.60	0.25
USD VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-144A 5.50000% 17-01.11.25	4 167 000.00	4 316 303.61	0.10
USD VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-144A 9.00000% 17-15.12.25	4 010 000.00	4 526 287.50	0.10
USD VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-144A 9.25000% 18-01.04.26	11 110 000.00	12 679 287.50	0.28
USD VALEANT PHARMACEUTICALS INTL-144A 8.50000% 18-31.01.27	5 591 000.00	6 324 818.75	0.14
USD VALVOLINE INC 4.37500% 17-15.08.25	2 600 000.00	2 665 000.00	0.06
USD VECTOR GROUP LTD-144A 6.12500% 17-01.02.25	3 410 000.00	3 392 950.00	0.08
USD VECTOR GROUP LTD-144A 10.50000% 18-01.11.26	7 340 000.00	7 651 950.00	0.17
USD VENATOR FINANCE SARL/VEN MAT CORP-144A 5.75000% 17-15.07.25	1 248 000.00	1 141 920.00	0.03
USD VERISIGN INC 5.25000% 15-01.04.25	4 138 000.00	4 555 938.00	0.10
USD VERSCEND ESCROW CORP-144A 9.75000% 18-15.08.26	3 281 000.00	3 568 087.50	0.08
USD VIASAT INC-144A 5.62500% 17-15.09.25	7 285 000.00	7 410 302.00	0.17
USD VIASAT INC-144A 5.62500% 19-15.04.27	2 026 000.00	2 122 032.40	0.05
USD VICI PROPERTIES LP /VCI NTE CO INC-144A 4.25000% 19-01.12.26	1 480 000.00	1 518 968.40	0.03
USD VICI PROPERTIES LP /VCI NTE CO INC-144A 4.62500% 19-01.12.29	3 480 000.00	3 636 600.00	0.08

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD VICI PROPERTIES/FC INC 8.00000% 17-15.10.23	1 572 895.00	1 698 412.02	0.04
USD VIKING CRUISES LTD-144A 5.87500% 17-15.09.27	4 142 000.00	4 245 757.10	0.10
USD VISTRA ENERGY CORP-144A 8.12500% 17-30.01.26	1 580 000.00	1 682 700.00	0.04
USD VISTRA OPERATIONS CO LLC-144A 5.62500% 19-15.02.27	1 001 000.00	1 041 040.00	0.02
USD VISTRA OPERATIONS CO LLC-144A 4.30000% 19-15.07.29	176 000.00	181 095.44	0.00
USD VISTRA OPERATIONS CO LLC-144A 5.00000% 19-31.07.27	2 207 000.00	2 273 210.00	0.05
USD W&T OFFSHORE INC-144A 9.75000% 18-01.11.23	2 470 000.00	2 338 596.00	0.05
USD WAND MERGER CORP-144A 8.12500% 18-15.07.23	1 750 000.00	1 850 625.00	0.04
USD WASTE PRO USA INC-144A 5.50000% 18-15.02.26	3 609 000.00	3 707 724.20	0.08
USD WATCO COS LLC/FINANCE CORP-144A 6.37500% 13-01.04.23	11 869 000.00	12 002 526.25	0.27
USD WEST CORP-144A 8.50000% 17-15.10.25	493 000.00	391 935.00	0.01
USD WEST STREET MERGER SUB INC-144A 6.37500% 17-01.09.25	2 846 000.00	2 803 310.00	0.06
USD WEX INC-144A 4.75000% 13-01.02.23	1 225 000.00	1 237 250.00	0.03
USD WHITING PETROLEUM CORP 6.62500% 18-15.01.26	300 000.00	168 562.50	0.00
USD WILLIAM CARTER COMPANY-144A 5.62500% 19-15.03.27	675 000.00	718 777.13	0.02
USD WILLIAM LYON HOMES INC 6.00000% 18-01.09.23	4 300 000.00	4 482 750.00	0.10
USD WILLIAMS SCOTSMAN INTERNATIONAL IN-144A 7.87500% 17-15.12.22	274 000.00	285 645.00	0.01
USD WILLIAMS SCOTSMAN INTNL INC-144A 6.87500% 18-15.08.23	2 650 000.00	2 783 374.50	0.06
USD WMG ACQUISITION CORP-144A 5.00000% 16-01.08.23	1 898 000.00	1 935 960.00	0.04
USD WOLVERINE ESCROW LLC-144A 9.00000% 19-15.11.26	75 000.00	77 901.00	0.00
USD WOLVERINE ESCROW LLC-144A 8.50000% 19-15.11.24	75 000.00	77 124.75	0.00
USD WOLVERINE WORLD WIDE INC-144A 5.00000% 16-01.09.26	550 000.00	567 875.00	0.01
USD WPX ENERGY INC 5.25000% 14-15.09.24	2 675 000.00	2 802 062.50	0.06
USD WPX ENERGY INC 8.25000% 15-01.08.23	875 000.00	1 009 531.25	0.02
USD WR GRACE & CO-CONN-144A 5.12500% 14-01.10.21	962 000.00	998 988.90	0.02
USD WR GRACE & CO-CONN-144A 5.62500% 14-01.10.24	3 550 000.00	3 913 342.50	0.09
USD WR GRACE & CO-CONN-REG-S 5.12500% 14-01.10.21	1 365 000.00	1 417 484.25	0.03
USD WW INTERNATIONAL INC-144A 8.62500% 17-01.12.25	2 398 000.00	2 505 910.00	0.06
USD WYNDHAM HOTELS & RESORTS INC-144A 5.37500% 18-15.04.26	425 000.00	444 656.25	0.01
USD WYNN LAS VEGAS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.50000% 15-01.03.25	2 250 000.00	2 345 625.00	0.05
USD WYNN LAS VEGAS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.25000% 17-15.05.27	2 401 000.00	2 491 037.50	0.06
USD WYNN MACAU LTD-144A 5.12500% 19-15.12.29	397 000.00	393 109.40	0.01
USD XPO LOGISTICS INC-144A 6.50000% 15-15.06.22	1 874 000.00	1 906 795.00	0.04
USD YAMANA GOLD INC 4.62500% 18-15.12.27	638 000.00	677 517.72	0.02
USD YUM BRANDS INC 3.87500% 13-01.11.23	1 625 000.00	1 672 401.25	0.04
USD ZAYO GROUP LLC/ CAPITAL INC-144A 5.75000% 17-15.01.27	4 154 000.00	4 241 857.10	0.10
USD ZIGGO BOND CO BV-144A 5.87500% 15-15.01.25	719 000.00	739 671.25	0.02
米ドル合計		1 621 468 481.84	36.35
ノート、固定利付債合計		1 624 472 745.79	36.42
ノート、変動利付債			
USD			
USD ASSURANT INC-SUB 7.000%/VAR 18-27.03.48	450 000.00	509 148.00	0.01
USD ENERGY TRANSFER PARTNERS-SUB 6.250%/VAR 17-PRP	280 000.00	266 000.00	0.01
USD REYNOLDS GROUP INC/LLC/LUX-144A 3M LIBOR+350BP 16-15.07.21	9 004 000.00	9 004 090.04	0.20
米ドル合計		9 779 238.04	0.22
ノート、変動利付債合計		9 779 238.04	0.22
中期債券、固定利付債			
USD			
USD INTESA SANPAOLO SPA-144A-SUB 5.01700% 14-26.06.24	8 510 000.00	9 036 526.47	0.20
USD NAVIENT CORP 6.75000% 18-15.06.26	1 670 000.00	1 811 950.00	0.04
米ドル合計		10 848 476.47	0.24
中期債券、固定利付債合計		10 848 476.47	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 - ハイ・イールド

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
債券、固定利付債			
EUR			
EUR CMA CGM SA-REG-S 6.50000% 17-15.07.22	1 690 000.00	1 657 179.67	0.04
EUR NORICAN GROUP APS-REG-S 4.50000% 17-15.05.23	2 000 000.00	2 011 383.00	0.05
EUR PANTHER BF AGGR 2/PANTHER FIN CO-REG-S 4.37500% 19-15.05.26	1 350 000.00	1 540 952.10	0.03
ユーロ合計		5 209 514.77	0.12
USD			
USD ALLISON TRANSMISSION INC-144A 5.00000% 16-01.10.24	300 000.00	305 631.00	0.01
USD BUILDING MATERIALS CORP OF AMERICA-144A 6.00000% 15-15.10.25	7 209 000.00	7 524 393.75	0.17
USD CARRIAGE SERVICES INC-144A 6.62500% 18-01.06.26	2 790 000.00	2 971 350.00	0.07
USD CENTURYLINK INC 6.87500% 98-15.01.28	3 970 000.00	4 436 475.00	0.10
USD INTELSAT JACKSON HOLDINGS SA-144A 8.00000% 16-15.02.24	955 000.00	977 280.15	0.02
USD ISTAR INC 5.25000% 17-15.09.22	3 730 000.00	3 806 934.98	0.09
USD NETFLIX INC 4.37500% 16-15.11.26	1 021 000.00	1 073 071.00	0.02
USD NUANCE COMMUNICATIONS INC 5.62500% 16-15.12.26	1 380 000.00	1 467 975.00	0.03
USD PETSMART INC-144A 7.12500% 15-15.03.23	1 775 000.00	1 768 343.75	0.04
USD REYNOLDS GROUP INC/LLC/LUX-144A 5.12500% 16-15.07.23	3 085 000.00	3 143 923.50	0.07
USD SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD-144A 6.75000% 15-01.05.23	3 140 000.00	3 210 650.00	0.07
USD TULLOW OIL PLC-REG-S 7.00000% 18-01.03.25	750 000.00	603 750.00	0.01
USD UNIT CORP-SUB 6.62500% 11-15.05.21	3 089 000.00	1 361 090.62	0.03
USD XPO LOGISTICS INC-144A 6.12500% 16-01.09.23	1 300 000.00	1 343 875.00	0.03
米ドル合計		33 994 743.75	0.76
債券、固定利付債合計		39 204 258.52	0.88
債券、変動利付債			
EUR			
EUR 3AB OPTIQUE DEVELOPPEMENT 3M EURIBOR+412.5BP 17-01.10.23	150 000.00	156 339.32	0.00
ユーロ合計		156 339.32	0.00
USD			
USD CITIGROUP INC-SUB 6.300%/VAR 14-PRP	1 800 000.00	1 954 098.00	0.04
USD JP MORGAN CHASE & CO-SUB 4.600%/VAR 20-PRP	1 487 000.00	1 515 550.40	0.04
米ドル合計		3 469 648.40	0.08
債券、変動利付債合計		3 625 987.72	0.08
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
合計		1 689 720 495.21	37.88
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			
記名株式			
アメリカ合衆国			
USD ATD NEW HLDGS INC NPV	9 499.00	265 972.00	0.00
アメリカ合衆国合計		265 972.00	0.00
記名株式合計		265 972.00	0.00
ノート、固定利付債			
EUR			
EUR CONSTELLUM SE-REG-S 4.25000% 17-15.02.26	1 420 000.00	1 614 401.38	0.04
ユーロ合計		1 614 401.38	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

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 （注１）	純資産 比率 （％）	
USD				
USD	ADVANCED DRAINAGE SYSTEMS INC-144A 5.00000% 19-30.09.27	227 000.00	234 377.50	0.01
USD	AES CORP 5.12500% 17-01.09.27	190 000.00	200 583.00	0.00
USD	ALCOA NEDERLAND HOLDING BV-144A 6.12500% 18-15.05.28	736 000.00	775 560.00	0.02
USD	AMERICAN BUILDER & CONTRACT SUPPLY-144A 5.87500% 18-15.05.26	1 300 000.00	1 368 250.00	0.03
USD	ASCEND LEARNING LLC-144A 6.87500% 17-01.08.25	2 774 000.00	2 898 830.00	0.06
USD	BERRY PETROLEUM CORP-144A 7.00000% 18-15.02.26	3 910 000.00	3 626 525.00	0.08
USD	CAPITOL INVSTMNT MERGER SUB 2 LLC-144A 10.00000% 19-01.08.24	2 763 000.00	2 870 066.25	0.06
USD	CASCADES INC/CASCADES USA INC-144A 5.12500% 19-15.01.26	445 000.00	459 462.50	0.01
USD	CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.00000% 17-01.02.28	1 140 000.00	1 192 725.00	0.03
USD	CDK GLOBAL INC 4.87500% 18-01.06.27	3 970 000.00	4 164 351.35	0.09
USD	CENTENE CORP-144A 5.37500% 20-15.08.26	3 308 000.00	3 514 750.00	0.08
USD	CENTENE CORP-REG-S 5.37500% 20-15.08.26	3 285 000.00	3 490 312.50	0.08
USD	CENTENE CORP-REG-S 5.25000% 20-01.04.25	1 406 000.00	1 456 967.50	0.03
USD	CENTRAL GARDEN & PET CO 5.12500% 17-01.02.28	1 760 000.00	1 826 000.00	0.04
USD	CENTURY COMMUNITIES INC-144A 6.75000% 19-01.06.27	1 250 000.00	1 356 250.00	0.03
USD	CHARLES RIVER LABORATORIES INTER-144A 4.25000% 19-01.05.28	3 071 000.00	3 115 775.18	0.07
USD	CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC-144A 8.62500% 18-15.01.24	70 000.00	74 375.00	0.00
USD	CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC-144A 8.00000% 19-15.03.26	985 000.00	1 026 567.00	0.02
USD	CNX MIDSTREAM FINANCE CORP-144A 6.50000% 18-15.03.26	2 745 000.00	2 518 537.50	0.06
USD	COMMERCIAL METALS CO 5.75000% 19-15.04.26	6 580 000.00	6 925 450.00	0.16
USD	CSC HOLDINGS LLC-144A 5.75000% 19-15.01.30	5 080 000.00	5 461 101.60	0.12
USD	DENBURY RESOURCES INC-144A 7.75000% 19-15.02.24	400 000.00	321 000.00	0.01
USD	DUN & BRADSTREET CORP-144A 6.87500% 19-15.08.26	3 996 000.00	4 385 610.00	0.10
USD	ENERGIZER HOLDINGS INC-144A 7.75000% 19-15.01.27	4 052 000.00	4 467 532.60	0.10
USD	ENOVA INTERNATIONAL INC-144A 8.50000% 18-15.09.25	1 180 000.00	1 170 949.40	0.03
USD	EXTERRAN ENE SOL LP / EES FIN CORP 8.12500% 18-01.05.25	3 900 000.00	3 862 638.00	0.09
USD	FLEXI-VAN LEASING INC-144A 10.00000% 18-15.02.23	600 000.00	643 800.00	0.01
USD	GLP CAPITAL LP / GLP FINANC II INC 5.75000% 18-01.06.28	1 705 000.00	1 989 155.30	0.04
USD	GRINDING MEDIA INC/ CANADA INC-144A 7.37500% 16-15.12.23	3 100 000.00	3 180 972.00	0.07
USD	GULFPORT ENERGY CORP 6.37500% 18-15.01.26	5 234 000.00	2 521 767.37	0.06
USD	HUGHES SATELLITE SYSTEMS CORP 7.62500% 12-15.06.21	2 000 000.00	2 138 600.00	0.05
USD	IHS MARKIT LTD-144A 5.00000% 16-01.11.22	905 000.00	969 540.89	0.02
USD	INSTALLED BUILDING PRODUCTS INC-144A 5.75000% 19-01.02.28	400 000.00	425 000.00	0.01
USD	INTELSAT JACKSON HOLDINGS SA-144A 9.50000% 16-30.09.22	65 000.00	73 775.00	0.00
USD	JBS USA LLC/JBS USA FINANCE INC-144A 6.75000% 18-15.02.28	3 967 000.00	4 395 436.00	0.10
USD	JEFFERIES FINANCE LLC-144A 7.25000% 17-15.08.24	2 300 000.00	2 369 000.00	0.05
USD	KFC HLDG/PIZZA HUT HLDG/TACO BELL-144A 4.75000% 17-01.06.27	3 360 000.00	3 539 625.60	0.08
USD	LIONS GATE CAPITAL HOLDINGS LLC 5.87500% 17-01.11.24	1 400 000.00	1 368 500.00	0.03
USD	LITHIA MOTORS INC-144A 5.25000% 17-01.08.25	375 000.00	387 187.50	0.01
USD	MGM GROWTH POP LP/CO-ISSUER INC 5.75000% 20-01.02.27	483 000.00	537 337.50	0.01
USD	MICHAELS STORES INC-144A 8.00000% 19-15.07.27	538 000.00	480 837.50	0.01
USD	NAVIENT CORP 6.50000% 17-15.06.22	290 000.00	308 125.00	0.01
USD	NETFLIX INC 4.87500% 18-15.04.28	2 680 000.00	2 867 600.00	0.06
USD	NEXTERA ENERGY OPERATING PARTNERS-144A 4.25000% 17-15.09.24	250 000.00	260 312.50	0.01
USD	PARK-OHIO INDUSTRIES INC 6.62500% 17-15.04.27	1 740 000.00	1 766 326.20	0.04
USD	PARSLEY ENERGY LLC/FINANCE CORP-144A 5.37500% 16-15.01.25	510 000.00	524 723.70	0.01
USD	PARTY CITY HOLDINGS INC-144A 6.62500% 18-01.08.26	2 213 000.00	1 571 230.00	0.04
USD	PQ CORP-144A 5.75000% 17-15.12.25	5 192 000.00	5 425 640.00	0.12
USD	PRECISION DRILLING CORP 7.75000% 17-15.12.23	5 294 000.00	5 210 195.98	0.12
USD	PRECISION DRILLING CORP-144A 7.12500% 17-15.01.26	3 847 000.00	3 654 650.00	0.08
USD	RADIAN GROUP INC 4.50000% 17-01.10.24	1 920 000.00	2 045 184.00	0.05
USD	REALOGY GROUP/CO ISSUER-144A 9.37500% 19-01.04.27	5 487 000.00	5 691 939.45	0.13
USD	SERVICE CORP INTERNATIONAL/US 4.62500% 17-15.12.27	7 300 000.00	7 633 245.00	0.17
USD	STARS GROUP HOLDINGS BV-144A 7.00000% 18-15.07.26	5 341 000.00	5 801 661.25	0.13
USD	TALEN ENERGY SUPPLY LLC-144A 7.25000% 19-15.05.27	800 000.00	820 000.00	0.02
USD	TALLGRASS ENRGY PART LP/FIN CORP-144A 5.50000% 16-15.09.24	2 000 000.00	2 020 040.00	0.05
USD	TARGA RESOURCES PARTNERS 5.12500% 16-01.02.25	750 000.00	772 500.00	0.02

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD TARGA RESOURCES PARTNERS 6.50000% 19-15.07.27	2 236 000.00	2 437 240.00	0.05
USD TARGA RESOURCES PARTNERS 6.87500% 19-15.01.29	973 000.00	1 072 124.37	0.02
USD TEGNA INC-144A 5.00000% 19-15.09.29	1 463 000.00	1 481 287.50	0.03
USD TELENET FINANCE LUXEMBOURG-144A 5.50000% 17-01.03.28	800 000.00	848 000.00	0.02
USD TRIUMPH GROUP INC-144A 6.25000% 19-15.09.24	1 015 000.00	1 046 921.75	0.02
USD VALVOLINE INC 5.50000% 17-15.07.24	2 025 000.00	2 098 406.25	0.05
USD VERITAS US INC / BERMUDA LTD-144A 7.50000% 16-01.02.23	816 000.00	809 880.00	0.02
USD VOC ESCROW LTD-144A 5.00000% 18-15.02.28	3 178 000.00	3 289 230.00	0.07
USD WABASH NATIONAL CORP-144A 5.50000% 17-01.10.25	2 375 000.00	2 351 250.00	0.05
USD WILLIAM LYON HOMES INC 5.87500% 17-31.01.25	2 590 000.00	2 667 700.00	0.06
米ドル合計		152 260 494.49	3.41
ノート、固定利付債合計		153 874 895.87	3.45
中期債券、固定利付債			
USD			
USD RYDER SYSTEM INC 2.50000% 17-01.09.22	1 650 000.00	1 673 411.52	0.04
米ドル合計		1 673 411.52	0.04
中期債券、固定利付債合計		1 673 411.52	0.04
債券、固定利付債			
USD			
USD DELEK LOGISTICS PARTNERS LP 6.75000% 18-15.05.25	4 978 000.00	5 002 890.00	0.11
USD ENERGY TRANSFER OPERATING LP 5.87500% 19-15.01.24	50 000.00	55 790.24	0.00
USD JB POINDEXTER & CO INC-144A 7.12500% 18-15.04.26	1 550 000.00	1 666 250.00	0.04
USD PDC ENERGY INC 6.12500% 17-15.09.24	1 000 000.00	1 002 500.00	0.02
米ドル合計		7 727 430.24	0.17
債券、固定利付債合計		7 727 430.24	0.17
転換社債型新株予約権付社債、固定利付債			
USD			
USD NABORS INDUSTRIES INC 0.75000% 17-15.01.24	335 000.00	233 897.00	0.01
米ドル合計		233 897.00	0.01
転換社債型新株予約権付社債、固定利付債合計		233 897.00	0.01
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されて いない譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		163 775 606.63	3.67
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 1011778 BC ULC/NEW RED FINANCE IN-144A 4.37500% 19-15.01.28	2 277 000.00	2 282 464.80	0.05
USD ACRISURE LLC / FINANCE INC-144A 10.12500% 19-01.08.26	70 000.00	76 475.00	0.00
USD ADAMS HOMES INC-144A 7.50000% 20-15.02.25	90 000.00	92 475.00	0.00
USD ADIENT US LLC-144A 7.00000% 19-15.05.26	865 000.00	947 176.73	0.02
USD ALBERTSONS COS INC / SAFEWAY INC-144A 5.87500% 19-15.02.28	2 286 000.00	2 440 305.00	0.05
USD ALBERTSONS COS LLC / SAFEWAY INC-144A 4.87500% 20-15.02.30	1 865 000.00	1 914 385.20	0.04
USD ALLIANT HLDG INTER LLC/CO ISSUER-144A 6.75000% 19-15.10.27	4 063 000.00	4 286 465.00	0.10
USD ALLIED UNIVERSAL HOLDCO/FIN CORP-144A 6.62500% 19-15.07.26	4 515 000.00	4 800 009.37	0.11
USD ALLIED UNIVERSAL HOLDCO LLC-144A 9.75000% 19-15.07.27	4 560 000.00	4 867 800.00	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

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD AMERICAN BUILDER & CONTRACT SUPPLY-144A 4.00000% 19-15.01.28	600 000.00	604 944.00	0.01
USD AMN HEALTHCARE INC-144A 4.62500% 19-01.10.27	1 000 000.00	1 010 000.00	0.02
USD ARCHROCK PARTNERS LP/FIN CORP-144A 6.25000% 19-01.04.28	891 000.00	916 616.25	0.02
USD AVIS BUDGET CAR RENT LLC/FIN INC-144A 5.75000% 19-15.07.27	199 000.00	206 960.00	0.00
USD BAUSCH HEALTH COS INC-144A 7.00000% 19-15.01.28	450 000.00	487 413.00	0.01
USD BBA US HOLDINGS INC-144A 4.00000% 19-01.03.28	1 500 000.00	1 483 601.25	0.03
USD BEACON ROOFING SUPPLY INC-144A 4.50000% 19-15.11.26	300 000.00	308 250.00	0.01
USD BEAZER HOMES USA INC-144A 7.25000% 19-15.10.29	2 002 000.00	2 187 185.00	0.05
USD BERRY GLOBAL ESCROW CORP-144A 5.62500% 19-15.07.27	1 300 000.00	1 381 250.00	0.03
USD BOYD GAMING CORP-144A 4.75000% 19-01.12.27	350 000.00	357 875.00	0.01
USD CALPINE CORP-144A 4.50000% 19-15.02.28	2 505 000.00	2 492 475.00	0.06
USD CALPINE CORP-144A 5.12500% 19-15.03.28	1 387 000.00	1 377 464.37	0.03
USD CALUMET SPECIALTY PROD PRT LP/FIN-144A 11.00000% 19-15.04.25	3 360 000.00	3 712 867.20	0.08
USD CARGO AIRCRAFT MANAGEMENT INC-144A 4.75000% 20-01.02.28	636 000.00	645 565.44	0.01
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 5.37500% 19-01.06.29	1 329 000.00	1 422 030.00	0.03
USD CCO HOLDINGS LLC/CAPITAL CORP-144A 4.75000% 19-01.03.30	12 566 000.00	12 919 418.74	0.29
USD CENTURYLINK INC-144A 4.00000% 20-15.02.27	2 418 000.00	2 437 827.60	0.05
USD CHESAPEAKE ENERGY CORP-144A 11.50000% 19-01.01.25	740 000.00	595 478.00	0.01
USD CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC-144A 6.87500% 19-01.04.28	4 541 000.00	2 770 010.00	0.06
USD CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC-144A 6.62500% 20-15.02.25	550 000.00	555 599.00	0.01
USD CITGO HOLDING INC-144A 9.25000% 19-01.08.24	884 000.00	945 880.00	0.02
USD CLEAR CHANNEL WORLDWIDE HOLDING-144A 5.12500% 19-15.08.27	1 131 000.00	1 164 930.00	0.03
USD COMPASS MINERALS INTERNATIONAL INC-144A 6.75000% 19-01.12.27	2 750 000.00	2 945 332.50	0.07
USD CONNECT FINCO SARL / US FINCO LLC-144A 6.75000% 19-01.10.26	4 481 000.00	4 744 258.75	0.11
USD CRESTWOOD MIDSTREAM PART LP/FIN-144A 5.62500% 19-01.05.27	2 622 000.00	2 638 518.60	0.06
USD CUMULUS MEDIA NEW HOLDINGS INC-144A 6.75000% 19-01.07.26	1 400 000.00	1 471 750.00	0.03
USD DEALER TIRE LLC / DT ISSUER LLC-144A 8.00000% 20-01.02.28	1 609 000.00	1 629 112.50	0.04
USD DIAMOND SPORTS GROUP LLC-144A 5.37500% 19-15.08.26	6 213 000.00	6 188 781.72	0.14
USD DIAMOND SPORTS GROUP LLC-144A 6.62500% 19-15.08.27	9 015 000.00	8 429 025.00	0.19
USD EAGLE HOLDING CO II LLC-144A (PIK) 7.75000% 19-15.02.22	7 107 000.00	7 178 070.00	0.16
USD EG GLOBAL FINANCE PLC-144A 8.50000% 19-30.10.25	3 828 000.00	4 057 680.00	0.09
USD ENERSYS-144A 4.37500% 19-15.12.27	550 000.00	548 625.00	0.01
USD ENTERCOM MEDIA CORP-144A 6.50000% 19-01.05.27	550 000.00	588 722.75	0.01
USD ENVIVA PARTNERS LP/FINANCE CORP-144A 6.50000% 19-15.01.26	3 878 000.00	4 136 934.06	0.09
USD ESH HOSPITALITY INC-144A 4.62500% 19-01.10.27	1 117 000.00	1 122 585.00	0.03
USD FAIR ISAAC CORP-144A 4.00000% 19-15.06.28	1 406 000.00	1 430 605.00	0.03
USD FMG RESOURCES AUGUST 2006 PTY LTD-144A 4.50000% 19-15.09.27	500 000.00	506 725.00	0.01
USD GCI LLC-144A 6.62500% 19-15.06.24	700 000.00	754 250.00	0.02
USD GFL ENVIRONMENTAL INC-144A 8.50000% 19-01.05.27	3 622 000.00	3 947 980.00	0.09
USD GLOBAL AIRCRAFT LEASING CO-144A (PIK) 6.50000% 19-15.09.24	2 895 000.00	2 961 729.75	0.07
USD GLOBAL PARTNERS LP-144A 7.00000% 19-01.08.27	2 337 000.00	2 521 739.85	0.06
USD GO DADDY OPRTRNG CO LLC/GD FNE INC-144A 5.25000% 19-01.12.27	3 843 000.00	4 030 346.25	0.09
USD GRUBHUB HOLDINGS INC-144A 5.50000% 19-01.07.27	1 895 000.00	1 849 993.75	0.04
USD GW B-CR SECURITY CORP-144A 9.50000% 19-01.11.27	2 190 000.00	2 337 825.00	0.05
USD HERTZ CORP/THE-144A 7.12500% 19-01.08.26	70 000.00	74 375.00	0.00
USD HEXION INC-144A 7.87500% 19-15.07.27	1 186 000.00	1 221 580.00	0.03
USD HOLLY ENERGY PARTNERS LP FIN CORP-144A 5.00000% 20-01.02.28	2 569 000.00	2 609 949.86	0.06
USD HOUGHTON MIFF HARCOURT PUBLISH INC-144A 9.00000% 19-15.02.25	1 350 000.00	1 404 000.00	0.03
USD ICAHN ENTERPRISES FINANCE CORP-144 4.75000% 19-15.09.24	3 332 000.00	3 403 338.11	0.08
USD IHEARTCOMMUNICATIONS INC-144A 5.25000% 19-15.08.27	600 000.00	625 500.00	0.01
USD INFRABUILD AUSTRALIA PTY LTD-144A 12.00000% 19-01.10.24	883 000.00	909 781.39	0.02
USD IQVIA INC-144A 5.00000% 19-15.05.27	1 197 000.00	1 262 882.88	0.03
USD IRON MOUNTAIN INC-144A 4.87500% 19-15.09.29	1 100 000.00	1 122 110.00	0.03
USD JEFFERIES FINANCE LLC-144A 6.25000% 19-03.06.26	2 400 000.00	2 526 000.00	0.06
USD LABL ESCROW ISSUER LLC-144A 10.50000% 19-15.07.27	3 673 000.00	3 856 650.00	0.09
USD LABL ESCROW ISSUER LLC-144A 6.75000% 19-15.07.26	5 632 000.00	6 048 936.96	0.14
USD LCPR SENIOR SECURED FINANCING DAC-144A 6.75000% 19-15.10.27	1 843 000.00	1 949 046.22	0.04
USD LEVEL 3 FINANCING INC-144A 4.62500% 19-15.09.27	3 001 000.00	3 083 587.52	0.07
USD LEVEL 3 FINANCING INC-144A 3.87500% 19-15.11.29	1 400 000.00	1 454 796.00	0.03
USD LIVE NATION ENTERTAINMENT INC-144A 4.75000% 19-15.10.27	1 519 000.00	1 562 747.20	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

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 比率 （%）
USD MASONITE INTERNATIONAL CORP-144A 5.37500% 19-01.02.28	2 458 000.00	2 587 813.12	0.06
USD MEG ENERGY CORP-144A 7.12500% 20-01.02.27	2 116 000.00	2 095 495.96	0.05
USD MIDCONT COM & MIDCONT FIN CORP-144A 5.37500% 19-15.08.27	1 050 000.00	1 110 375.00	0.02
USD MINERAL RESOURCES LTD-144A 8.12500% 19-01.05.27	2 650 000.00	2 878 562.50	0.06
USD MSCI INC-144A 4.00000% 19-15.11.29	2 243 000.00	2 290 663.75	0.05
USD NABORS INDUSTRIES LTD-144A 7.50000% 20-15.01.28	605 000.00	592 409.95	0.01
USD NATIONAL CINEMEDIA LLC-144A 5.87500% 19-15.04.28	2 139 000.00	2 233 768.39	0.05
USD NATIONSTAR MORTGAGE HOLDINGS INC-144A 6.00000% 20-15.01.27	750 000.00	763 252.50	0.02
USD NCR CORP-144A 6.12500% 19-01.09.29	1 450 000.00	1 582 167.50	0.04
USD NFP CORP-144A 8.00000% 19-15.07.25	750 000.00	777 900.00	0.02
USD NOVELIS CORP-144A 4.75000% 20-30.01.30	5 759 000.00	5 784 339.60	0.13
USD OUTFRONT MEDIA CAPITAL LLC/CORP-144A 5.00000% 19-15.08.27	355 000.00	371 827.00	0.01
USD PARKLAND FUEL CORP-144A 5.87500% 19-15.07.27	963 000.00	1 020 491.10	0.02
USD PBF HOLDING CO LLC/FIN CORP-144A 6.00000% 20-15.02.28	1 618 000.00	1 654 566.80	0.04
USD PERFORMANCE FOOD GROUP INC-144A 5.50000% 19-15.10.27	2 315 000.00	2 436 537.50	0.05
USD PHOTO HOLDINGS MERGER SUB INC-144A 8.50000% 19-01.10.26	5 115 000.00	4 782 525.00	0.11
USD PRESIDIO HOLDINGS INC-144A 4.87500% 20-01.02.27	1 616 000.00	1 615 757.60	0.04
USD PRESIDIO HOLDINGS INC-144A 8.25000% 20-01.02.28	1 715 000.00	1 762 162.50	0.04
USD PRESTIGE BRANDS INC-144A 5.12500% 19-15.01.28	1 852 000.00	1 935 340.00	0.04
USD PRIME SEC SER BORROWER LLC/FIN INC-144A 6.25000% 20-15.01.28	2 341 000.00	2 312 322.75	0.05
USD QORVO INC-144A 4.37500% 19-15.10.29	550 000.00	574 750.00	0.01
USD RADIOLOGY PARTNERS INC-144A 9.25000% 20-01.02.28	1 243 000.00	1 292 720.00	0.03
USD SBA COMMUNICATIONS CORP-144A 3.87500% 20-15.02.27	400 000.00	405 500.00	0.01
USD SCRIPPS ESCROW INC-144A 5.87500% 19-15.07.27	2 221 000.00	2 332 050.00	0.05
USD SEALED AIR CORP-144A 4.00000% 19-01.12.27	1 150 000.00	1 155 750.00	0.03
USD SELECT MEDICAL CORP-144A 6.25000% 19-15.08.26	2 352 000.00	2 537 408.16	0.06
USD SENSATA TECHNOLOGIES INC-144A 4.37500% 19-15.02.30	625 000.00	633 468.75	0.01
USD SILGAN HOLDINGS INC-144A 4.12500% 19-01.02.28	822 000.00	817 068.00	0.02
USD SINCLAIR TELEVISION GROUP INC-144A 5.50000% 19-01.03.30	7 650 000.00	7 822 125.00	0.18
USD SOTHEBY 'S-144A 7.37500% 19-15.10.27	775 000.00	789 453.75	0.02
USD STATION CASINOS LLC-144A 4.50000% 20-15.02.28	2 553 000.00	2 549 068.38	0.06
USD TEEKAY CORP-144A 9.25000% 19-15.11.22	1 270 000.00	1 331 595.00	0.03
USD TELESAT CANADA/TELESAT LLC-144A 4.87500% 19-01.06.27	480 000.00	493 128.00	0.01
USD TENET HEALTHCARE CORP-144A 5.12500% 19-01.11.27	2 626 000.00	2 763 865.00	0.06
USD TENET HEALTHCARE CORP-144A 4.62500% 19-01.09.24	238 000.00	245 140.00	0.01
USD TERRIER MEDIA BUYER INC-144A 8.87500% 19-15.12.27	4 430 000.00	4 562 900.00	0.10
USD TRANSDIGM INC-144A-SUB 5.50000% 19-15.11.27	6 104 000.00	6 141 539.60	0.14
USD TRANSOCEAN INC-144A 8.00000% 20-01.02.27	2 533 000.00	2 357 716.40	0.05
USD UNIVAR SOLUTIONS USA-144A 5.12500% 19-01.12.27	3 695 000.00	3 833 562.50	0.09
USD VICI PROPERTIES LP /VCI NTE CO INC-144A 3.50000% 20-15.02.25	1 387 000.00	1 408 137.88	0.03
USD VICI PROPERTIES LP /VCI NTE CO INC-144A 3.75000% 20-15.02.27	1 361 000.00	1 367 805.00	0.03
USD VICI PROPERTIES LP /VCI NTE CO INC-144A 4.12500% 20-15.08.30	1 422 000.00	1 440 201.60	0.03
USD VIPER ENERGY PARTNERS LP-144A 5.37500% 19-01.11.27	250 000.00	260 625.00	0.01
USD VIZIENT INC-144A 6.25000% 19-15.05.27	839 000.00	904 362.29	0.02
USD WILLIAM LYON HOMES INC-144A 6.62500% 19-15.07.27	2 441 000.00	2 636 280.00	0.06
USD WYNN RESORTS FINANCE LLC / CAP CO-144A 5.12500% 19-01.10.29	631 000.00	654 662.50	0.01
米ドル合計		252 726 228.90	5.67
ノート、固定利付債合計		252 726 228.90	5.67
債券、固定利付債			
USD			
USD CVR ENERGY INC-144A 5.75000% 20-15.02.28	2 406 000.00	2 355 474.00	0.05
米ドル合計		2 355 474.00	0.05
債券、固定利付債合計		2 355 474.00	0.05
最近発行された譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		255 081 702.90	5.72

添付の注記は当財務書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

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されていない派生商品			
新株予約権			
アメリカ合衆国 USD ULTRA PETROLEUM CORP CALL WARRANT 0.000001 19-14.07.25	7 786.00	77.86	0.00
アメリカ合衆国合計		77.86	0.00
新株予約権合計		77.86	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			
		77.86	0.00
投資有価証券合計		4 316 204 526.25	96.77
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 06.03.20	-54.00	-185 246.71	-0.01
EUR EURO-BOBL FUTURE 06.03.20	-89.00	-69 029.78	0.00
EUR EURO-SCHATZ FUTURE 06.03.20	174.00	26 031.62	0.00
EUR EURO-BUXL FUTURE 06.03.20	-2.00	-22 961.90	0.00
USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 20.03.20	18.00	47 843.75	0.00
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.20	-793.00	-1 075 804.65	-0.02
USD US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 20.03.20	-4.00	-30 966.83	0.00
USD US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.20	10.00	-4 466.94	0.00
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 20.03.20	-34.00	-73 171.88	0.00
USD US LONG BOND FUTURE 20.03.20	-21.00	-80 378.35	0.00
債券に係る金融先物合計		-1 468 151.67	-0.03
通貨に係る金融先物			
USD EURO FX CURRENCY FUTURE 16.03.20	-3 316.00	2 133 243.75	0.04
USD GBP CURRENCY FUTURE 16.03.20	-229.00	-3 300.00	0.00
通貨に係る金融先物合計		2 129 943.75	0.04
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		661 792.08	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			
指数に係るスワップおよびフォワード・スワップ			
EUR BNP/IBOXX EUR LIQUID HY EQS RECEIVER PERF 19-20.12.20	4 000 000.00	39 737.04	0.00
EUR BNP/IBOXX EUR LIQUID HY INDEX SWAP PAYER 3ML 19-20.12.20			
指数に係るスワップおよびフォワード・スワップ合計		39 737.04	0.00
クレジット・デフォルト・スワップ*			
EUR SOCIETE GENERALE/ACCOR SA CDSI RECEIVER 1.00000% 19-20.12.24	250 000.00	-4 077.11	0.00
EUR SOCIETE GENERALE/ACCOR SA CDSI RECEIVER 1.00000% 19-20.12.24	500 000.00	-8 154.21	0.00
EUR BARCLAYS/ACCOR SA CDSI RECEIVER 1.00000% 19-20.12.24	1 750 000.00	-28 539.76	0.00
クレジット・デフォルト・スワップ合計		-40 771.08	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			
		-1 034.04	0.00
派生商品合計		660 758.04	0.01

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

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - ハイ・イールド

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
先渡為替契約			
先渡為替契約 (購入 / 売却)			
USD 94 580 503.09	EUR 84 067 000.00 2020年2月12日	1 360 766.77	0.03
USD 265 373 558.60	EUR 239 552 224.34 2020年2月20日	-390 348.63	-0.01
USD 2 487 600.05	EUR 2 245 622.95 2020年2月20日	-3 737.82	0.00
EUR 3 708 085.97	USD 4 132 346.63 2020年2月20日	-18 523.77	0.00
EUR 583 000.00	USD 648 986.86 2020年2月20日	-2 195.30	0.00
USD 2 117 186.57	EUR 1 902 000.00 2020年2月26日	6 292.32	0.00
USD 1 932 019.27	CHF 1 902 000.00 2020年2月26日	-43 373.76	0.00
USD 132 213 257.04	EUR 118 723 000.00 2020年3月4日	394 332.24	0.01
USD 26 861 206.05	GBP 20 370 000.00 2020年3月4日	-12 942.72	0.00
USD 2 849 050.27	EUR 2 555 236.41 2020年2月20日	14 221.19	0.00
USD 1 016 505.61	EUR 909 000.00 2020年2月20日	8 043.29	0.00
USD 3 178 650.82	EUR 2 838 000.00 2020年2月20日	30 118.30	0.00
USD 614 315.95	EUR 548 786.46 2020年2月20日	5 481.55	0.00
USD 1 418 379.85	EUR 1 266 765.73 2020年2月20日	13 005.26	0.00
USD 5 115 043.41	EUR 4 562 041.82 2020年2月20日	53 825.29	0.00
USD 3 355 128.00	EUR 3 000 000.00 2020年3月4日	24 208.34	0.00
USD 3 338 673.00	EUR 3 000 000.00 2020年2月26日	9 186.80	0.00
USD 4 731 298.65	EUR 4 225 000.00 2020年2月26日	42 272.25	0.00
USD 2 955 760.39	EUR 2 632 246.74 2020年2月20日	35 494.55	0.00
USD 18 620.19	CHF 18 000.00 2020年2月26日	-74.38	0.00
USD 9 366 882.08	EUR 8 325 000.00 2020年3月25日	111 626.79	0.00
USD 4 301 645.75	EUR 3 838 000.00 2020年2月20日	43 693.74	0.00
EUR 4 357 048.15	USD 4 855 973.73 2020年2月20日	-22 179.58	0.00
USD 1 155 802.54	EUR 1 036 827.61 2020年2月20日	5 525.78	0.00
CHF 1 109 714 439.74	USD 1 142 955 000.00 2020年2月14日	8 614 815.30	0.19
EUR 1 496 486 827.29	USD 1 667 438 000.00 2020年2月14日	-7 818 316.36	-0.19
GBP 70 227 972.52	USD 91 255 000.00 2020年2月14日	1 348 971.33	0.03
JPY 984 587 794.00	USD 8 974 000.00 2020年2月14日	116 293.33	0.00
SGD 8 451 201.38	USD 6 275 000.00 2020年2月14日	-83 336.47	0.00
USD 11 000 000.00	CHF 10 664 918.00 2020年2月14日	-67 169.37	0.00
EUR 2 187 826.82	USD 2 438 497.08 2020年2月20日	-11 279.36	0.00
GBP 1 154 220.83	USD 1 500 000.00 2020年2月14日	21 978.05	0.00
SGD 148 172.64	USD 110 000.00 2020年2月14日	-1 443.23	0.00
JPY 15 375 248.00	USD 140 000.00 2020年2月14日	1 953.33	0.00
CHF 2 900 559.00	USD 3 000 000.00 2020年2月14日	9 960.11	0.00
EUR 23 357 244.56	USD 26 000 000.00 2020年2月14日	-96 569.30	0.00
USD 16 000 000.00	CHF 15 410 400.00 2020年2月14日	8 362.11	0.00
USD 95 046 362.50	EUR 85 000 000.00 2020年2月28日	699 319.19	0.02
USD 223 638 498.88	EUR 199 999 999.00 2020年2月28日	1 645 456.90	0.04
USD 912 726.36	GBP 700 000.00 2020年2月28日	-10 659.19	0.00
EUR 3 041 181.12	USD 3 400 378.06 2020年2月20日	-26 432.44	0.00
USD 11 000 000.00	CHF 10 574 641.00 2020年2月14日	26 512.63	0.00
EUR 2 376 566.17	USD 2 657 115.05 2020年2月20日	-20 506.22	0.00
USD 3 792 057.32	EUR 3 406 080.30 2020年2月20日	13 285.44	0.00
EUR 407 685.02	USD 453 125.18 2020年2月20日	-831.47	0.00
USD 12 000 000.00	EUR 10 811 794.59 2020年2月14日	9 605.70	0.00
USD 17 000 000.00	CHF 16 447 279.00 2020年2月14日	-67 625.11	0.00
USD 1 981 451.47	EUR 1 783 000.00 2020年2月20日	3 356.51	0.00
USD 12 000 000.00	CHF 11 639 436.00 2020年2月14日	-78 443.50	0.00
EUR 1 151 222.39	USD 1 277 206.41 2020年2月20日	-17.85	0.00
EUR 2 414 531.00	USD 2 670 383.88 2020年2月28日	9 661.54	0.00
USD 12 000 000.00	CHF 11 641 644.00 2020年2月14日	-80 734.78	0.00
EUR 1 714 270.37	USD 1 894 483.04 2020年2月20日	7 361.92	0.00
USD 337 730 770.00	EUR 305 000 000.00 2020年4月1日	-1 496 882.59	-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

2020年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現 (損) 益 (注1)	純資産 比率 (%)
先渡為替契約 (続き)			
先渡為替契約 (購入 / 売却)			
USD 25 138 054.12	GBP 19 160 000.00 2020年4月8日	-163 363.17	0.00
USD 1 158 914.40	EUR 1 050 000.00 2020年2月20日	-5 976.07	0.00
EUR 520 172.22	USD 573 898.21 2020年2月20日	3 190.99	0.00
USD 3 563 184.53	EUR 3 229 685.00 2020年2月28日	-21 653.48	0.00
USD 1 077 676.78	EUR 978 000.00 2020年2月20日	-7 335.48	0.00
USD 11 000 000.00	CHF 10 676 347.00 2020年2月14日	-79 029.44	0.00
CHF 5 851 368.00	USD 6 000 000.00 2020年2月3日	67 051.69	0.00
USD 6 000 000.00	CHF 5 847 210.00 2020年2月14日	-67 750.67	0.00
EUR 2 164 774.00	USD 2 385 311.00 2020年2月28日	17 512.84	0.00
GBP 1 940 000.00	USD 2 549 881.68 2020年3月4日	9 561.06	0.00
USD 14 000 000.00	CHF 13 549 242.00 2020年2月14日	-60 282.13	0.00
CHF 13 557 082.00	USD 14 000 000.00 2020年2月5日	59 036.47	0.00
EUR 1 528 786.00	USD 1 696 621.94 2020年2月28日	277.34	0.00
先渡為替契約 (購入 / 売却) 合計		4 092 604.60	0.09
現金預金、要求払預金および預託金勘定その他の流動資産		122 824 969.46 *	2.75
当座借越およびその他の短期負債		-1 765 185.75	-0.04
その他の資産および負債		18 364 461.09	0.42
純資産総額		4 460 382 133.69	100.00

* 2020年1月31日現在、バンク・オブ・アメリカに対する50,000.00米ドルの現金が、取引相手方に対する担保となっている。

[次へ](#)

5 販売及び買戻しの実績

2020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2020年2月末日現在の発行済口数は以下のとおりである。

(エマージング・マーケット・デッド)

(クラスF - a c c 投資証券)

販売口数	買戻し口数	発行済口数
6,680,165.0710 (220,102.0710)	3,743,198.5570 (4,049.0000)	15,717,637.0410 (216,053.0710)

(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
135,247 (135,247)	4,897 (4,897)	130,350 (130,350)

(US マルチ・クレジット)

(クラスF - a c c 投資証券)

販売口数	買戻し口数	発行済口数
4,101,193.0870 (456,083.9610)	2,879,837.1500 (14,864.0000)	15,465,116.8610 (441,219.9610)

(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
351,700 (351,700)	15,293 (15,293)	336,407 (336,407)

(ハイ・イールド)

(クラスF - a c c 投資証券)

販売口数	買戻し口数	発行済口数
2,703,351.9680 (183,216.7220)	2,229,775.5870 (4,266.0000)	11,797,053.6670 (178,950.7220)

(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
108,294 (108,294)	4,658 (4,658)	103,636 (103,636)

(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。