

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 令和3年5月31日

【発行者名】 バークレイズ・ポートフォリオ
(Barclays Portfolios SICAV)

【代表者の役職氏名】 取締役 ニコラス・オドノーグ
(Nicholas O'Donoghue)

【本店の所在の場所】 ルクセンブルグ大公国、ルードランジュ L - 3364、
シャトー・ドー通り10番地
(10, rue du Château d'Eau, L-3364 Leudelange,
Grand Duchy of Luxembourg)

【代理人の氏名
又は名称】 弁護士 三 浦 健

【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

【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】

バークレイズ・ポートフォリオ -

バークレイズ・グローバルベータ

- 1 . バークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 1
(Barclays GlobalBeta Portfolio 1)
- 2 . バークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 2
(Barclays GlobalBeta Portfolio 2)
- 3 . バークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 3
(Barclays GlobalBeta Portfolio 3)
- 4 . バークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 4
(Barclays GlobalBeta Portfolio 4)
- 5 . バークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 5
(Barclays GlobalBeta Portfolio 5)

バークレイズ・マルチマネジャー

- 1 . バークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 1
(Barclays MultiManager Portfolio 1)
- 2 . バークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 2
(Barclays MultiManager Portfolio 2)
- 3 . バークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 3
(Barclays MultiManager Portfolio 3)
- 4 . バークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 4
(Barclays MultiManager Portfolio 4)
- 5 . バークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 5
(Barclays MultiManager Portfolio 5)

【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】

記名式無額面株式・追加型

以下の各サブ・ファンドのクラスA(分配型・円建)株式、クラスA(累積型・円建)株式、クラスA(分配型・米ドル建)株式、クラスA(累積型・米ドル建)株式を募集します。

各クラス株式についての上限見込額は、以下のとおりです。

パークレイズ・グローバルベータ

	サブ・ファンド	募集クラス株式	上限見込額 (注1)	2020年11月末現在 1株当たり純資産価格
1.	パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ 1	クラスA(円建)株式 (分配型/累積型)	約1,072億円	1,072.086円
		クラスA(米ドル建)株式 (分配型/累積型)	約15億米ドル (約1,594億円)	15.341米ドル(注2)
2.	パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ 2	クラスA(円建)株式 (分配型/累積型)	約1,120億円	1,119.734円
		クラスA(米ドル建)株式 (分配型/累積型)	約15億米ドル (約1,594億円)	15.140米ドル
3.	パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ 3	クラスA(円建)株式 (分配型/累積型)	約1,226億円	1,226.438円
		クラスA(米ドル建)株式 (分配型/累積型)	約14億米ドル (約1,488億円)	14.095米ドル
4.	パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ 4	クラスA(円建)株式 (分配型/累積型)	約1,532億円	1,531.940円
		クラスA(米ドル建)株式 (分配型/累積型)	約18億米ドル (約1,913億円)	18.446米ドル
5.	パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ 5	クラスA(円建)株式 (分配型/累積型)	約1,000億円	1,000円(注3)
		クラスA(米ドル建)株式 (分配型/累積型)	約26億米ドル (約2,763億円)	25.627米ドル(注2)

パークレイズ・マルチマネジャー

	サブ・ファンド	募集クラス株式	上限見込額 (注1)	2020年11月末現在 1株当たり純資産価格
1.	パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ 1	クラスA(円建)株式 (分配型/累積型)	約1,056億円	1,056.289円
		クラスA(米ドル建)株式 (分配型/累積型)	約11億米ドル (約1,169億円)	10.522米ドル
2.	パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ 2	クラスA(円建)株式 (分配型/累積型)	約1,157億円	1,157.231円
		クラスA(米ドル建)株式 (分配型/累積型)	約11億米ドル (約1,169億円)	10.547米ドル
3.	パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ 3	クラスA(円建)株式 (分配型/累積型)	約1,210億円	1,210.051円
		クラスA(米ドル建)株式 (分配型/累積型)	約12億米ドル (約1,275億円)	11.864米ドル
4.	パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ 4	クラスA(円建)株式 (分配型/累積型)	約1,358億円	1,357.941円
		クラスA(米ドル建)株式 (分配型/累積型)	約15億米ドル (約1,594億円)	15.363米ドル

5 .	パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ 5	クラス A (円建) 株式 (分配型 / 累積型)	約1,000億円	1,000円 (注3)
		クラス A (米ドル建) 株式 (分配型 / 累積型)	約15億米ドル (約1,594億円)	15.359米ドル

(注1) 上限見込額は、便宜上、2020年11月末日現在における各クラス A 株式 (分配型) の 1 株当たり純資産価格にそれぞれ 1 億株を乗じた金額を記載しています。

(注2) パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 1、クラス A (米ドル建) 株式およびパークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 5、クラス A (米ドル建) 株式については、2020年11月末日現在、分配型が運用されていないため、累積型の 1 株当たり純資産価格を記載しています。

(注3) パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 5 およびパークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 5 の各クラス A (円建) 株式については、2020年11月末日現在、分配型、累積型いずれも運用されていないため、当初発行価格を記載しています。

【縦覧に供する場所】 該当事項なし

(注1) 本書中、ポンド、米ドルおよびユーロの円貨換算は、2021年2月26日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値 (1ポンド = 148.48円、1米ドル = 106.25円、1ユーロ = 129.15円) によります。

(注2) 本書の中で金額および比率を表示する場合、四捨五入してあります。従って、合計の数字が一致しない場合があります。また円貨への換算は、本書の中でそれに対応する数字につき所定の換算率で単純計算のうえ、必要な場合四捨五入してあります。従って、本書中の同一情報につき異なった円貨表示がなされている場合もあります。

(注3) 本書中、「ファンド株式」または「株式」とは、投資信託及び投資法人に関する法律 (昭和26年法律第198号 (改正済)) に定義される「外国投資証券」を意味し、「株主」とは、同法に定義される「投資主」を意味します。

(注4) 各サブ・ファンドの正式名称は「パークレイズ・ポートフォリオ」と各サブ・ファンドの短縮名で構成されています。本書中では、冒頭に付すべき「パークレイズ・ポートフォリオ」が省略されている場合があります。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2021年2月26日付をもって提出した有価証券届出書(以下「原届出書」という。)につきまして、本日、半期報告書を提出いたしましたので、その関係情報を新たな情報により訂正および追加し、原届出書のその他記載事項を訂正するため、また、ファンドの投資対象、投資リスクに関連する記載および定義が変更され、これらを反映するため、ファンドの設立地における目論見書が更新されましたので、これらに関する記載を訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

なお、本訂正届出書の記載事項のうち外貨数字の円換算については、直近の為替レート(2021年2月26日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1ポンド=148.48円、1米ドル=106.25円、1ユーロ=129.15円))を用いておりますので、訂正前の換算レートとは異なっております。

2【訂正の内容】

(1) 半期報告書の提出による訂正

原届出書の下記事項については、半期報告書の記載内容(下記*参照)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
(5) 外国投資法人の出資総額	(2) 外国投資法人の出資総額	更新
(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	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
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 「合算純資産計算書」 「合算損益計算書」 財務諸表に対する注記中の重要な会計方針の要約	追加
第三部 外国投資法人の詳細情報 第1 外国投資法人の追加情報 2 役員状況	1 外国投資法人の概況 (4) 役員状況	更新
5 その他 訴訟事件その他の重要事項	(5) その他	追加
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) 大株主の状況 (4) 役員状況 (5) 事業内容及び営業の概況	3 資産運用会社の概況 (1) 名称及び資本金の額 (2) 大株主の状況 (3) 役員状況 (4) 事業内容及び営業の概況	更新

第5 外国投資法人の経理状況	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

(1) 主要な経営指標等の推移

各サブ・ファンドの直近3中間計算期間および直近2計算期間に係る主要な経営指標等の推移は以下のとおりです。下表の情報は、各期間に関するファンドの無監査中間財務書類および監査済年次財務書類に基づくものです。

下記の注記は下表に対するものです。

- (注1) 営業収益には投資収益ならびに実現および未実現投資利益(損失)を含めています。
- (注2) 経常利益(損失)は営業収益から費用を控除したものです。
- (注3) 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ます。
- (注4) ファンドの性格上、算定していません(n/a:該当なし)。

2021年2月末現在、以下のクラスの株式は運用されておりません。

- 各サブ・ファンドのクラスA(円建・累積型)株式
- パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ5のクラスA(円建・分配型)株式
- パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ5のクラスA(円建・分配型)株式
- パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ1のクラスA(米ドル建・分配型)株式
- パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ5のクラスA(米ドル建・分配型)株式
- パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ5のクラスA(米ドル建・累積型)株式

パークレイズ・グローバルベータ

1. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 1

(単位：千ポンド(百万円)、ただし、1株当たりの情報については各該当取引通貨(円))

	2019年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第13期中)	2019年 8月31日 に終了した 年度 (第13期)	2020年 2月29日 に終了した 6ヶ月間 (第14期中)	2020年 8月31日 に終了した 年度 (第14期)	2021年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第15期中)
営業収益(注1)	190 (28)	1,084 (161)	327 (49)	41 (6)	52 (8)
経常利益/損失金額(注2)	272 (40)	922 (137)	402 (60)	202 (30)	117 (17)
当期純利益/損失金額	272 (40)	922 (137)	402 (60)	202 (30)	117 (17)
出資総額(注3)	14,720 (2,186)	14,233 (2,113)	13,918 (2,067)	12,282 (1,824)	7,297 (1,083)
発行済株式総数(株)					
クラスA(円建・分配型)	24,000	18,000	204,000	204,000	104,000
クラスA(円建・累積型)	-	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・分配型)	-	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・累積型)	70,170	62,045	54,015	54,014	3,621
純資産額	14,720 (2,186)	14,233 (2,113)	13,918 (2,067)	12,282 (1,824)	7,297 (1,083)
総資産額	15,251 (2,264)	14,454 (2,146)	14,367 (2,133)	13,018 (1,933)	7,488 (1,112)
1株当たり純資産額					
クラスA(円建・分配型)	1,033.015	1,055.362	1,037.590	1,064.894	1,061.061
クラスA(円建・累積型)	-	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・分配型)	-	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・累積型)	13.935 (1,481)	14.513 (1,542)	14.560 (1,547)	15.135 (1,608)	15.225 (1,618)
1株当たり当期純利益/損失金額(注4)	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a
自己資本比率	96.52%	98.47%	96.87%	94.35%	97.45%
自己資本利益率	1.85%	6.48%	2.89%	1.64%	1.60%

2. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ2

(単位：千ポンド(百万円)、ただし、1株当たりの情報については各該当取引通貨(円))

	2019年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第13期中)	2019年 8月31日 に終了した 年度 (第13期)	2020年 2月29日 に終了した 6ヶ月間 (第14期中)	2020年 8月31日 に終了した 年度 (第14期)	2021年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第15期中)
営業収益(注1)	1,951 (290)	5,604 (832)	2,244 (333)	1,538 (228)	1,342 (199)
経常利益/損失金額(注2)	2,240 (333)	5,032 (747)	2,511 (373)	1,004 (149)	1,121 (166)
当期純利益/損失金額	2,240 (333)	5,032 (747)	2,511 (373)	1,004 (149)	1,121 (166)
出資総額(注3)	77,856 (11,560)	81,215 (12,059)	73,889 (10,971)	66,282 (9,842)	57,659 (8,561)
発行済株式総数(株)					
クラスA(円建・分配型)	117,500	153,500	171,000	171,000	126,000
クラスA(円建・累積型)	-	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・分配型)	146,663	114,696	114,737	107,771	69,809
クラスA(米ドル建・累積型)	60,390	60,390	27,867	27,867	15,239
純資産額	77,856 (11,560)	81,215 (12,059)	73,889 (10,971)	66,282 (9,842)	57,659 (8,561)
総資産額	79,941 (11,870)	82,198 (12,205)	75,528 (11,214)	69,611 (10,336)	59,718 (8,867)
1株当たり純資産額					
クラスA(円建・分配型)	1,046.919	1,092.137	1,058.714	1,098.607	1,107.619
クラスA(円建・累積型)	-	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・分配型)	13.693 (1,455)	14.488 (1,539)	14.204 (1,509)	14.843 (1,577)	15.001 (1,594)
クラスA(米ドル建・累積型)	15.570 (1,654)	16.626 (1,767)	16.489 (1,752)	17.383 (1,847)	17.754 (1,886)
1株当たり当期純利益/損失金額(注4)	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a
自己資本比率	97.39%	98.80%	97.83%	95.22%	96.55%
自己資本利益率	2.88%	6.20%	3.40%	1.51%	1.94%

3. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ3

(単位：千ポンド(百万円)、ただし、1株当たりの情報については各該当取引通貨(円))

	2019年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第13期中)	2019年 8月31日 に終了した 年度 (第13期)	2020年 2月29日 に終了した 6ヶ月間 (第14期中)	2020年 8月31日 に終了した 年度 (第14期)	2021年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第15期中)
営業収益(注1)	3,041 (452)	11,684 (1,735)	3,936 (584)	6,661 (989)	6,379 (947)
経常利益/損失金額(注2)	3,506 (521)	10,724 (1,592)	4,469 (664)	5,603 (832)	5,864 (871)
当期純利益/損失金額	3,506 (521)	10,724 (1,592)	4,469 (664)	5,603 (832)	5,864 (871)
出資総額(注3)	140,388 (20,845)	162,042 (24,060)	159,162 (23,632)	166,835 (24,772)	164,878 (24,481)
発行済株式総数(株)					
クラスA(円建・分配型)	152,000	185,500	168,500	173,500	163,500
クラスA(円建・累積型)	-	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・分配型)	166,836	152,336	152,336	148,336	148,836
クラスA(米ドル建・累積型)	89,719	47,613	40,602	19,720	40,038
純資産額	140,388 (20,845)	162,042 (24,060)	159,162 (23,632)	166,835 (24,772)	164,878 (24,481)
総資産額	142,878 (21,215)	164,240 (24,386)	161,692 (24,008)	178,259 (26,468)	166,351 (24,700)
1株当たり純資産額					
クラスA(円建・分配型)	1,116.380	1,181.708	1,134.463	1,191.932	1,220.350
クラスA(円建・累積型)	-	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・分配型)	12.412 (1,319)	13.319 (1,415)	12.931 (1,374)	13.680 (1,454)	14.046 (1,492)
クラスA(米ドル建・累積型)	14.744 (1,567)	15.985 (1,698)	15.720 (1,670)	16.804 (1,785)	17.445 (1,854)
1株当たり当期純利益/損失金額(注4)	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a
自己資本比率	98.26%	98.66%	98.44%	93.59%	99.11%
自己資本利益率	2.50%	6.62%	2.81%	3.36%	3.56%

4. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ4

(単位：千ポンド(百万円)、ただし、1株当たりの情報については各該当取引通貨(円))

	2019年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第13期中)	2019年 8月31日 に終了した 年度 (第13期)	2020年 2月29日 に終了した 6ヶ月間 (第14期中)	2020年 8月31日 に終了した 年度 (第14期)	2021年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第15期中)
営業収益(注1)	2,343 (348)	6,094 (905)	3,214 (477)	4,297 (638)	4,569 (678)
経常利益/損失金額(注2)	2,587 (384)	5,590 (830)	3,512 (521)	3,702 (550)	4,272 (634)
当期純利益/損失金額	2,587 (384)	5,590 (830)	3,512 (521)	3,702 (550)	4,272 (634)
出資総額(注3)	72,096 (10,705)	86,348 (12,821)	85,970 (12,765)	92,133 (13,680)	102,128 (15,164)
発行済株式総数(株)					
クラスA(円建・分配型)	29,000	29,000	29,000	17,000	17,000
クラスA(円建・累積型)	-	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・分配型)	34,000	18,000	18,000	18,000	19,500
クラスA(米ドル建・累積型)	15,845	12,039	12,039	12,039	12,039
純資産額	72,096 (10,705)	86,348 (12,821)	85,970 (12,765)	92,133 (13,680)	102,128 (15,164)
総資産額	72,889 (10,823)	87,643 (13,013)	92,128 (13,679)	100,850 (14,974)	104,097 (15,456)
1株当たり純資産額					
クラスA(円建・分配型)	1,333.276	1,432.812	1,378.676	1,473.326	1,541.329
クラスA(円建・累積型)	-	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・分配型)	15.562 (1,653)	16.957 (1,802)	16.456 (1,748)	17.715 (1,882)	18.591 (1,975)
クラスA(米ドル建・累積型)	21.092 (2,241)	23.071 (2,451)	22.489 (2,389)	24.333 (2,585)	25.621 (2,722)
1株当たり当期純利益/損失金額(注4)	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a
自己資本比率	98.91%	98.52%	93.32%	91.36%	98.11%
自己資本利益率	3.59%	6.47%	4.09%	4.02%	4.18%

5. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ5

(単位：千ポンド(百万円)、ただし、1株当たりの情報については各該当取引通貨(円))

	2019年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第13期中)	2019年 8月31日 に終了した 年度 (第13期)	2020年 2月29日 に終了した 6ヶ月間 (第14期中)	2020年 8月31日 に終了した 年度 (第14期)	2021年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第15期中)
営業収益(注1)	2,269 (337)	3,148 (467)	2,093 (311)	2,742 (407)	3,485 (517)
経常利益/損失金額(注2)	2,459 (365)	2,777 (412)	2,306 (342)	2,341 (348)	3,299 (490)
当期純利益/損失金額	2,459 (365)	2,777 (412)	2,306 (342)	2,341 (348)	3,299 (490)
出資総額(注3)	46,387 (6,888)	53,997 (8,017)	51,179 (7,599)	55,221 (8,199)	59,384 (8,817)
発行済株式総数(株)					
クラスA(円建・分配型)	-	-	-	-	-
クラスA(円建・累積型)	-	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・分配型)	26,500	22,000	22,000	-	-
クラスA(米ドル建・累積型)	9,317	9,317	9,317	9,317	-
純資産額	46,387 (6,888)	53,997 (8,017)	51,179 (7,599)	55,221 (8,199)	59,384 (8,817)
総資産額	48,428 (7,191)	54,438 (8,083)	51,615 (7,664)	57,384 (8,520)	61,059 (9,066)
1株当たり純資産額					
クラスA(円建・分配型)	-	-	-	-	-
クラスA(円建・累積型)	-	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・分配型)	16.363 (1,739)	17.911 (1,903)	17.337 (1,842)	-	-
クラスA(米ドル建・累積型)	20.961 (2,227)	23.014 (2,445)	22.361 (2,376)	24.426 (2,595)	-
1株当たり当期純利益/損失金額(注4)	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a
自己資本比率	95.79%	99.19%	99.16%	96.23%	97.26%
自己資本利益率	5.30%	5.14%	4.51%	4.24%	5.56%

パークレイズ・マルチマネジャー

1. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 1

(単位：千ポンド(百万円)、ただし、1株当たりの情報については各該当取引通貨(円))

	2019年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第13期中)	2019年 8月31日 に終了した 年度 (第13期)	2020年 2月29日 に終了した 6ヶ月間 (第14期中)	2020年 8月31日 に終了した 年度 (第14期)	2021年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第15期中)
営業収益(注1)	2,437 (362)	2,876 (427)	2,434 (361)	635 (94)	121 (18)
経常利益/損失金額(注2)	2,743 (407)	2,279 (338)	2,708 (402)	1,181 (175)	350 (52)
当期純利益/損失金額	2,743 (407)	2,279 (338)	2,708 (402)	1,181 (175)	350 (52)
出資総額(注3)	69,343 (10,296)	69,956 (10,387)	60,475 (8,979)	54,993 (8,165)	45,189 (6,710)
発行済株式総数(株)					
クラスA(円建・分配型)	14,000	14,000	14,000	4,500	4,500
クラスA(円建・累積型)	-	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・分配型)	942,872	943,606	852,324	852,973	853,701
クラスA(米ドル建・累積型)	303,789	260,609	254,542	237,705	220,362
純資産額	69,343 (10,296)	69,956 (10,387)	60,475 (8,979)	54,993 (8,165)	45,189 (6,710)
総資産額	71,059 (10,551)	71,149 (10,564)	61,397 (9,116)	55,733 (8,275)	47,725 (7,086)
1株当たり純資産額					
クラスA(円建・分配型)	1,033.054	1,047.010	1,029.147	1,039.649	1,046.091
クラスA(円建・累積型)	-	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・分配型)	9.952 (1,057)	10.221 (1,086)	10.166 (1,080)	10.342 (1,099)	10.439 (1,109)
クラスA(米ドル建・累積型)	12.184 (1,295)	12.617 (1,341)	12.654 (1,344)	12.967 (1,378)	13.176 (1,400)
1株当たり当期純利益/損失金額(注4)	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a
自己資本比率	97.59%	98.32%	98.50%	98.67%	94.69%
自己資本利益率	3.96%	3.26%	4.48%	2.15%	0.77%

2. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ2

(単位：千ポンド(百万円)、ただし、1株当たりの情報については各該当取引通貨(円))

	2019年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第13期中)	2019年 8月31日 に終了した 年度 (第13期)	2020年 2月29日 に終了した 6ヶ月間 (第14期中)	2020年 8月31日 に終了した 年度 (第14期)	2021年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第15期中)
営業収益(注1)	5,915 (878)	7,077 (1,051)	4,414 (655)	141 (21)	2,360 (350)
経常利益/損失金額(注2)	6,903 (1,025)	5,167 (767)	5,231 (777)	1,425 (212)	1,681 (250)
当期純利益/損失金額	6,903 (1,025)	5,167 (767)	5,231 (777)	1,425 (212)	1,681 (250)
出資総額(注3)	140,796 (20,905)	134,944 (20,036)	111,165 (16,506)	102,532 (15,224)	92,329 (13,709)
発行済株式総数(株)					
クラスA(円建・分配型)	75,000	75,000	67,000	67,000	67,000
クラスA(円建・累積型)	-	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・分配型)	365,987	208,263	182,060	179,863	156,061
クラスA(米ドル建・累積型)	1,365,956	1,318,293	1,192,991	1,092,275	995,497
純資産額	140,796 (20,905)	134,944 (20,036)	111,165 (16,506)	102,532 (15,224)	92,329 (13,709)
総資産額	144,176 (21,407)	137,274 (20,382)	112,961 (16,772)	104,951 (15,583)	97,254 (14,440)
1株当たり純資産額					
クラスA(円建・分配型)	1,098.012	1,136.433	1,103.844	1,123.062	1,152.210
クラスA(円建・累積型)	-	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・分配型)	9.683 (1,029)	10.158 (1,079)	9.978 (1,060)	10.227 (1,087)	10.516 (1,117)
クラスA(米ドル建・累積型)	12.002 (1,275)	12.705 (1,350)	12.627 (1,342)	13.055 (1,387)	13.547 (1,439)
1株当たり当期純利益/損失金額(注4)	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a
自己資本比率	97.66%	98.30%	98.41%	97.70%	94.94%
自己資本利益率	4.90%	3.83%	4.71%	1.39%	1.82%

3. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ3

(単位:千ポンド(百万円)、ただし、1株当たりの情報については各該当取引通貨(円))

	2019年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第13期中)	2019年 8月31日 に終了した 年度 (第13期)	2020年 2月29日 に終了した 6ヶ月間 (第14期中)	2020年 8月31日 に終了した 年度 (第14期)	2021年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第15期中)
営業収益(注1)	15,676 (2,328)	23,337 (3,465)	11,426 (1,697)	2,371 (352)	11,886 (1,765)
経常利益/損失金額(注2)	18,254 (2,710)	18,361 (2,726)	13,586 (2,017)	1,754 (260)	10,009 (1,486)
当期純利益/損失金額	18,254 (2,710)	18,361 (2,726)	13,586 (2,017)	1,754 (260)	10,009 (1,486)
出資総額(注3)	350,837 (52,092)	339,190 (50,363)	291,688 (43,310)	279,087 (41,439)	257,991 (38,307)
発行済株式総数(株)					
クラスA(円建・分配型)	249,000	232,000	217,500	217,500	148,000
クラスA(円建・累積型)	-	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・分配型)	1,311,225	1,240,611	1,207,685	1,107,847	1,102,560
クラスA(米ドル建・累積型)	1,823,323	1,733,127	1,540,946	1,454,290	1,310,236
純資産額	350,837 (52,092)	339,190 (50,363)	291,688 (43,310)	279,087 (41,439)	257,991 (38,307)
総資産額	359,870 (53,433)	344,955 (51,219)	296,894 (44,083)	283,492 (42,093)	272,835 (40,511)
1株当たり純資産額					
クラスA(円建・分配型)	1,105.196	1,169.479	1,129.375	1,163.352	1,210.961
クラスA(円建・累積型)	-	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・分配型)	10.512 (1,117)	11.272 (1,198)	10.997 (1,168)	11.396 (1,211)	11.893 (1,264)
クラスA(米ドル建・累積型)	12.806 (1,361)	13.849 (1,471)	13.668 (1,452)	14.283 (1,518)	15.041 (1,598)
1株当たり当期純利益/損失金額(注4)	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a
自己資本比率	97.49%	98.33%	98.25%	98.45%	94.56%
自己資本利益率	5.20%	5.41%	4.66%	0.63%	3.88%

4. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ4

(単位:千ポンド(百万円)、ただし、1株当たりの情報については各該当取引通貨(円))

	2019年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第13期中)	2019年 8月31日 に終了した 年度 (第13期)	2020年 2月29日 に終了した 6ヶ月間 (第14期中)	2020年 8月31日 に終了した 年度 (第14期)	2021年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第15期中)
営業収益(注1)	4,289 (637)	5,530 (821)	3,058 (454)	680 (101)	4,002 (594)
経常利益/損失金額(注2)	4,916 (730)	4,309 (640)	3,606 (535)	367 (54)	3,519 (523)
当期純利益/損失金額	4,916 (730)	4,309 (640)	3,606 (535)	367 (54)	3,519 (523)
出資総額(注3)	84,283 (12,514)	82,023 (12,179)	70,680 (10,495)	67,697 (10,052)	63,723 (9,462)
発行済株式総数(株)					
クラスA(円建・分配型)	113,000	113,000	113,000	113,000	113,000
クラスA(円建・累積型)	-	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・分配型)	415,195	401,770	401,974	388,299	303,599
クラスA(米ドル建・累積型)	391,089	276,957	258,098	225,828	204,390
純資産額	84,283 (12,514)	82,023 (12,179)	70,680 (10,495)	67,697 (10,052)	63,723 (9,462)
総資産額	86,710 (12,875)	83,037 (12,329)	71,990 (10,689)	68,760 (10,209)	67,292 (9,992)
1株当たり純資産額					
クラスA(円建・分配型)	1,178.625	1,270.835	1,228.728	1,289.810	1,372.136
クラスA(円建・累積型)	-	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・分配型)	12.962 (1,377)	14.163 (1,505)	13.824 (1,469)	14.579 (1,549)	15.551 (1,652)
クラスA(米ドル建・累積型)	13.114 (1,393)	14.334 (1,523)	14.003 (1,488)	14.767 (1,569)	15.753 (1,674)
1株当たり当期純利益/損失金額(注4)	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a
自己資本比率	97.20%	98.78%	98.18%	98.45%	94.70%
自己資本利益率	5.83%	5.25%	5.10%	0.54%	5.52%

5. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ5

(単位:千ポンド(百万円)、ただし、1株当たりの情報については各該当取引通貨(円))

	2019年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第13期中)	2019年 8月31日 に終了した 年度 (第13期)	2020年 2月29日 に終了した 6ヶ月間 (第14期中)	2020年 8月31日 に終了した 年度 (第14期)	2021年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第15期中)
営業収益 ^(注1)	2,311 (343)	1,601 (238)	1,385 (206)	318 (47)	1,835 (272)
経常利益 / 損失金額 ^(注2)	2,619 (389)	1,020 (151)	1,628 (242)	153 (23)	1,636 (243)
当期純利益 / 損失金額	2,619 (389)	1,020 (151)	1,628 (242)	153 (23)	1,636 (243)
出資総額 ^(注3)	30,855 (4,581)	29,642 (4,401)	24,642 (3,659)	24,528 (3,642)	19,617 (2,913)
発行済株式総数(株)					
クラスA(円建・分配型)	-	-	-	-	-
クラスA(円建・累積型)	-	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・分配型)	128,887	128,789	91,289	91,289	91,154
クラスA(米ドル建・累積型)	67,377	41,926	38,688	26,845	24,786
純資産額	30,855 (4,581)	29,642 (4,401)	24,642 (3,659)	24,528 (3,642)	19,617 (2,913)
総資産額	32,052 (4,759)	30,169 (4,479)	25,313 (3,758)	25,006 (3,713)	20,677 (3,070)
1株当たり純資産額					
クラスA(円建・分配型)	-	-	-	-	-
クラスA(円建・累積型)	-	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・分配型)	12.800 (1,360)	14.049 (1,493)	13.669 (1,452)	14.473 (1,538)	15.670 (1,665)
クラスA(米ドル建・累積型)	12.809 (1,361)	14.060 (1,494)	13.678 (1,453)	14.484 (1,539)	15.681 (1,666)
1株当たり当期純利益 / 損失金額 ^(注4)	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a
自己資本比率	96.27%	98.25%	97.35%	98.09%	94.87%
自己資本利益率	8.49%	3.44%	6.61%	0.62%	8.34%

(2) 外国投資法人の出資総額

パークレイズ・グローバルベータ

1 パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 1

発行済ファンド証券総数		2021年3月末日
クラスA(円建)株式	分配型	104,000.00株
	累積型	0株
クラスA(米ドル建)株式	分配型	0株
	累積型	3,620.75株

	純資産総額(サブ・ファンド)	
	ポンド	千円
2021年3月末日	7,322,216.21	1,087,203

2 パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 2

発行済ファンド証券総数		2021年3月末日
クラスA(円建)株式	分配型	126,000.00株
	累積型	0株
クラスA(米ドル建)株式	分配型	75,322.40株
	累積型	15,239.31株

	純資産総額(サブ・ファンド)	
	ポンド	千円
2021年3月末日	55,091,736.27	8,180,021

3 パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 3

発行済ファンド証券総数		2021年3月末日
クラスA(円建)株式	分配型	183,500.00株
	累積型	0株
クラスA(米ドル建)株式	分配型	148,835.74株
	累積型	40,037.56株

	純資産総額(サブ・ファンド)	
	ポンド	千円
2021年3月末日	168,030,021.92	24,949,098

4 パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 4

発行済ファンド証券総数		2021年3月末日
クラスA(円建)株式	分配型	17,000.00株
	累積型	0株
クラスA(米ドル建)株式	分配型	30,500.00株
	累積型	12,039.31株

	純資産総額(サブ・ファンド)	
	ポンド	千円
2021年3月末日	96,096,265.50	14,268,374

5 バークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ5

発行済ファンド証券総数		2021年3月末日
クラスA(円建)株式	分配型	0株
	累積型	0株
クラスA(米ドル建)株式	分配型	0株
	累積型	0株

	純資産総額(サブ・ファンド)	
	ポンド	千円
2021年3月末日	61,282,807.66	9,099,271

バークレイズ・マルチマネジャー

1 バークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ1

発行済ファンド証券総数		2021年3月末日
クラスA(円建)株式	分配型	4,500.00株
	累積型	0株
クラスA(米ドル建)株式	分配型	853,668.35株
	累積型	220,362.45株

	純資産総額(サブ・ファンド)	
	ポンド	千円
2021年3月末日	44,534,341.79	6,612,459

2 バークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ2

発行済ファンド証券総数		2021年3月末日
クラスA(円建)株式	分配型	67,000.00株
	累積型	0株
クラスA(米ドル建)株式	分配型	154,468.87株
	累積型	974,580.72株

	純資産総額(サブ・ファンド)	
	ポンド	千円
2021年3月末日	90,054,181.20	13,371,245

3 パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ3

発行済ファンド証券総数		2021年3月末日
クラスA(円建)株式	分配型	148,000.00株
	累積型	0株
クラスA(米ドル建)株式	分配型	1,105,558.45株
	累積型	1,300,147.51株

	純資産総額(サブ・ファンド)	
	ポンド	千円
2021年3月末日	257,852,609.08	38,285,955

4 パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ4

発行済ファンド証券総数		2021年3月末日
クラスA(円建)株式	分配型	113,000.00株
	累積型	0株
クラスA(米ドル建)株式	分配型	303,598.90株
	累積型	192,782.84株

	純資産総額(サブ・ファンド)	
	ポンド	千円
2021年3月末日	64,810,405.87	9,623,049

5 パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ5

発行済ファンド証券総数		2021年3月末日
クラスA(円建)株式	分配型	0株
	累積型	0株
クラスA(米ドル建)株式	分配型	91,154.16株
	累積型	25,160.99株

	純資産総額(サブ・ファンド)	
	ポンド	千円
2021年3月末日	19,563,632.77	2,904,808

(3) 主要な投資主の状況

2021年3月末現在、各サブ・ファンドの主要株主(所有株数上位5位)は以下のとおりです。株主の氏名/名称および住所/所在地は、ルクセンブルグの機密保持規則により開示できません。

パークレイズ・グローバルベータ

1. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ1

	株主 (株主名簿上の 登録形態)	所在国	所有株数 (株)	発行済株式総数	発行済株式総数に 対する 所有比率 (%)
全円建クラス					
	法人	日本	104,000.000	104,000.000	100.00
全米ドル建クラス					
1	法人	ルクセンブルグ	229,118.000	232,768.754	98.43
2	個人	スペイン	3,620.754		1.56
3	法人	英国	30.000		0.01

2. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ2

	株主 (株主名簿上の 登録形態)	所在国	所有株数 (株)	発行済株式総数	発行済株式総数に 対する 所有比率 (%)
全円建クラス					
	法人	日本	126,000.000	126,000.000	100.00
全米ドル建クラス					
1	法人	ルクセンブルグ	126,001.271	489,137.004	25.76
2	法人	ルクセンブルグ	116,464.478		23.81
3	法人	英国	88,731.145		18.14
4	法人	日本	71,500.000		14.62
5	法人	英国	28,810.180		5.89

3. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ3

	株主 (株主名簿上の 登録形態)	所在国	所有株数 (株)	発行済株式総数	発行済株式総数に 対する 所有比率 (%)
全円建クラス					
	法人	日本	183,500.000	183,500.000	100.00
全米ドル建クラス					
1	法人	ルクセンブルグ	375,145.414	979,027.373	38.32
2	法人	ルクセンブルグ	221,988.079		22.67
3	法人	日本	139,000.000		14.20
4	法人	英国	67,928.309		6.94
5	法人	英国	66,126.530		6.75

4. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ4

	株主 (株主名簿上の 登録形態)	所在国	所有株数 (株)	発行済株式総数	発行済株式総数に 対する 所有比率 (%)
全円建クラス					
	法人	日本	17,000.000	17,000.000	100.00
全米ドル建クラス					
1	法人	英国	179,834.544	556,165.464	32.33
2	法人	英国	114,359.652		20.56
3	法人	ルクセンブルグ	90,740.932		16.32
4	法人	ルクセンブルグ	85,688.729		15.41
5	法人	ルクセンブルグ	43,002.293		7.73

5. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ5

	株主 (株主名簿上の 登録形態)	所在国	所有株数 (株)	発行済株式総数	発行済株式総数に 対する 所有比率 (%)
全米ドル建クラス					
1	法人	ルクセンブルグ	208,656.412	268,449.605	77.73
2	法人	英国	38,913.021		14.50
3	法人	ルクセンブルグ	7,602.539		2.83
4	法人	ルクセンブルグ	7,369.799		2.75
5	法人	英国	5,687.513		2.12

パークレイズ・マルチマネジャー

1. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 1

	株主 (株主名簿上の 登録形態)	所在国	所有株数 (株)	発行済株式総数	発行済株式総数に 対する 所有比率 (%)
全円建クラス					
	法人	日本	4,500.000	4,500.000	100.00
全米ドル建クラス					
1	法人	日本	600,000.000	1,168,632.789	51.34
2	法人	ルクセンブルグ	163,863.037		14.02
3	法人	スペイン	110,162.411		9.43
4	法人	ルクセンブルグ	108,486.716		9.28
5	法人	スイス	87,102.367		7.45

2. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 2

	株主 (株主名簿上の 登録形態)	所在国	所有株数 (株)	発行済株式総数	発行済株式総数に 対する 所有比率 (%)
全円建クラス					
	法人	日本	67,000.000	67,000.000	100.00
全米ドル建クラス					
1	法人	ルクセンブルグ	901,261.766	1,393,660.092	64.67
2	法人	ルクセンブルグ	190,454.047		13.67
3	法人	スペイン	55,420.040		3.98
4	法人	ルクセンブルグ	43,071.976		3.09
5	法人	ルクセンブルグ	30,971.305		2.22

3. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ3

	株主 (株主名簿上の 登録形態)	所在国	所有株数 (株)	発行済株式総数	発行済株式総数に 対する 所有比率 (%)
全円建クラス					
	法人	日本	148,000.000	148,000.000	100.00
全米ドル建クラス					
1	法人	ルクセンブルグ	1,012,870.047	4,211,112.488	24.05
2	法人	ルクセンブルグ	900,631.520		21.39
3	法人	ルクセンブルグ	503,865.812		11.97
4	法人	ルクセンブルグ	276,603.420		6.57
5	法人	ルクセンブルグ	260,306.921		6.18

4. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ4

	株主 (株主名簿上の 登録形態)	所在国	所有株数 (株)	発行済株式総数	発行済株式総数に 対する 所有比率 (%)
全円建クラス					
	法人	日本	113,000.000	113,000.000	100.00
全米ドル建クラス					
1	法人	ルクセンブルグ	114,105.271	624,615.670	18.27
2	法人	ルクセンブルグ	113,656.142		18.20
3	法人	ルクセンブルグ	112,328.672		17.98
4	法人	日本	58,000.000		9.29
5	個人	南アフリカ	38,351.620		6.14

5. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ5

	株主 (株主名簿上の 登録形態)	所在国	所有株数 (株)	発行済株式総数	発行済株式総数に 対する 所有比率 (%)
全米ドル建クラス					
1	法人	ルクセンブルグ	78,667.126	206,350.500	38.12
2	法人	日本	37,000.000		17.93
3	法人	ルクセンブルグ	30,198.807		14.63
4	個人	英国	23,612.134		11.44
5	法人	ルクセンブルグ	15,052.199		7.29

(4) 役員の状況

ファンドの取締役は、以下のとおりです。

(2021年5月末日現在)

氏名	役職名	主要略歴
クロード・クレマー (Claude Kremer)	取締役	アーレント・アンド・メーデルナッハ法律事務所のパートナー弁護士。彼のプロとしての全キャリアはグローバル・ファンドおよびアセット・マネジメント業界にささげられている。多くの投資法人の取締役を務め、ルクセンブルク大学でファンド法について教鞭をとる。ルクセンブルクファンド協会(ALFI)および欧州投信・投資顧問業協会(EFAMA)の会長を歴任。ルクセンブルグ在住。
トーマス・ニューマー (Thomas Nummer)	取締役	トーマス・ニューマー氏はルクセンブルグに居住し、元投資マネージャーとして、および独立社外取締役としての経験を有している。彼は、数多くのルクセンブルグおよびケイマンファンドのディレクターに任命され、金融業界において、20年以上の経験を有している。彼は、UCITSおよびオルタナティブ投資ファンドに関して、投資コンプライアンスおよびリスク・マネジメントの専門知識を有する、経験豊富なリスク・マネージャーである。
ニコラス・オドノーグ (Nicholas O' Donoghue)	取締役	パークレイズ・バンク・ユーケー・ピーエルシーの取締役およびファンド部長。金融業界での経験は16年以上に及び、ウェルス運用業務および投資銀行業務を網羅する。英国在住。

(注) 上記の取締役のうち、同日現在、ファンド株式を所有している者はいません。

(5) その他

半期報告書提出日前6ヶ月以内において、訴訟事件その他ファンドおよび各サブ・ファンドに重要な影響を与えた事実および重要な影響を与えることが予想される事実はありません。

[次へ](#)

2 外国投資法人の運用状況

(1) 投資状況

パークレイズ・グローバルベータ1. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ1

(2021年3月末現在)

投資資産の種類	国/地域	時 価 (ポンド)	投資比率(%)
			対資産総額
投資信託/投資法人	アイルランド	6,896,430.59	93.38
	ルクセンブルグ	430,172.30	5.82
	小 計	7,326,602.89	99.20
その他資産 (現金およびデリバティブポジション)		58,930.27	0.80
資 産 総 額		7,385,533.16	100.00
負 債 総 額		63,316.95	0.86
純 資 産 総 額		7,322,216.21 (約1,087百万円)	99.14

2. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ2

(2021年3月末現在)

投資資産の種類	国/地域	時 価 (ポンド)	投資比率(%)
			対資産総額
投資信託/投資法人	アイルランド	51,388,649.33	92.74
	ルクセンブルグ	3,475,162.14	6.27
	小 計	54,863,811.47	99.02
その他資産 (現金およびデリバティブポジション)		544,857.43	0.98
資 産 総 額		55,408,668.90	100.00
負 債 総 額		316,932.63	0.57
純 資 産 総 額		55,091,736.27 (約8,180百万円)	99.43

3. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ3

(2021年3月末現在)

投資資産の種類	国/地域	時 価 (ポンド)	投資比率(%)
			対資産総額
投資信託/投資法人	アイルランド	157,013,445.19	92.63
	ルクセンブルグ	10,293,694.71	6.07
	小 計	167,307,139.90	98.70
その他資産 (現金およびデリバティブポジション)		2,200,760.52	1.30
資 産 総 額		169,507,900.42	100.00
負 債 総 額		1,477,878.50	0.87
純 資 産 総 額		168,030,021.92 (約24,949百万円)	99.13

4. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ4

(2021年3月末現在)

投資資産の種類	国/地域	時 価 (ポンド)	投資比率(%)
			対資産総額
投資信託/投資法人	アイルランド	90,346,917.20	91.47
	ルクセンブルグ	5,407,260.81	5.47
	小 計	95,754,178.01	96.95
その他資産 (現金およびデリバティブポジション)		3,015,957.47	3.05
資 産 総 額		98,770,135.48	100.00
負 債 総 額		2,673,869.98	2.71
純 資 産 総 額		96,096,265.50 (約14,268百万円)	97.29

5. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ5

(2021年3月末現在)

投資資産の種類	国/地域	時 価 (ポンド)	投資比率(%)
			対資産総額
投資信託/投資法人	アイルランド	58,724,995.13	95.33
	ルクセンブルグ	2,536,351.16	4.12
	小 計	61,261,346.29	99.45
その他資産 (現金およびデリバティブポジション)		340,897.28	0.55
資 産 総 額		61,602,243.57	100.00
負 債 総 額		319,435.91	0.52
純 資 産 総 額		61,282,807.66 (約9,099百万円)	99.48

パークレイズ・マルチマネジャー

1. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ1

(2021年3月末現在)

投資資産の種類	国/地域	時 価 (ポンド)	投資比率(%)
			対資産総額
投資信託/投資法人	アイルランド	44,590,127.65	97.22
	小 計	44,590,127.65	97.22
その他資産 (現金およびデリバティブポジション)		1,276,926.56	2.78
資 産 総 額		45,867,054.21	100.00
負 債 総 額		1,332,712.42	2.91
純 資 産 総 額		44,534,341.79 (約6,612百万円)	97.09

2. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ2

(2021年3月末現在)

投資資産の種類	国/地域	時 価 (ポンド)	投資比率(%)
			対資産総額
投資信託/投資法人	アイルランド	87,101,286.90	92.76
	英国	3,181,083.82	3.39
	小 計	90,282,370.72	96.14
その他資産 (現金およびデリバティブポジション)		3,621,744.42	3.86
資 産 総 額		93,904,115.14	100.00
負 債 総 額		3,849,933.94	4.10
純 資 産 総 額		90,054,181.20 (約13,371百万円)	95.90

3. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ3

(2021年3月末現在)

投資資産の種類	国/地域	時 価 (ポンド)	投資比率(%)
			対資産総額
投資信託/投資法人	アイルランド	246,546,915.99	90.88
	小 計	246,546,915.99	90.88
その他資産 (現金およびデリバティブポジション)		24,753,449.74	9.12
資 産 総 額		271,300,365.73	100.00
負 債 総 額		13,447,756.65	4.96
純 資 産 総 額		257,852,609.08 (約38,286百万円)	95.04

4. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ4

(2021年3月末現在)

投資資産の種類	国/地域	時 価 (ポンド)	投資比率(%)
			対資産総額
投資信託/投資法人	アイルランド	62,909,680.91	94.66
	小 計	62,909,680.91	94.66
その他資産 (現金およびデリバティブポジション)		3,546,763.36	5.34
資 産 総 額		66,456,444.27	100.00
負 債 総 額		1,646,038.40	2.48
純 資 産 総 額		64,810,405.87 (約9,623百万円)	97.52

5. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ5

(2021年3月末現在)

投資資産の種類	国/地域	時 価 (ポンド)	投資比率(%)
			対資産総額
投資信託/投資法人	アイルランド	18,614,551.95	89.97
	小 計	18,614,551.95	89.97
その他資産 (現金およびデリバティブポジション)		2,075,828.46	10.03
資 産 総 額		20,690,380.41	100.00
負 債 総 額		1,126,747.64	5.45
純 資 産 総 額		19,563,632.77 (約2,905百万円)	94.55

[次へ](#)

(2) 運用実績

純資産等の推移

2021年3月末日前1年間における各月末の純資産等の推移は以下のとおりです。

(注1) 各計算期間末(8月末)の資産総額および純資産総額は、当該計算期間の監査済財務書類に基づくものです。

(注2) 中間計算期間末(2月末)の資産総額および純資産総額は、中間財務書類に基づくものです。

(注3) 端数処理の違いにより、財務書類に記載の1株当たり純資産価格と下表に記載の公表されている1株当たり純資産価格とは異なる場合があります。

2021年3月末現在、以下のクラスの株式は運用されておりません。

各サブ・ファンドのクラスA(円建・累積型)株式

パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ5のクラスA(円建・分配型)株式

パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ5のクラスA(円建・分配型)株式

パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ1のクラスA(米ドル建・分配型)株式

パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ5のクラスA(米ドル建・分配型)株式

パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ5のクラスA(米ドル建・累積型)株式

パークレイズ・グローバルベータ

1. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ1

	資産総額		純資産総額		1株当たり純資産価格(クラスA株式)					
					円建		米ドル建			
	千ポンド	百万円	千ポンド	百万円	分配型	累積型	分配型		累積型	
					円	円	米ドル	円	米ドル	円
2020年4月末	12,646	1,878	12,509	1,857	1,031.773	-	-	-	14.592	1,550
2020年5月末	13,772	2,045	12,898	1,915	1,046.969	-	-	-	14.826	1,575
2020年6月末	13,115	1,947	13,031	1,935	1,055.437	-	-	-	14.964	1,590
2020年7月末	13,174	1,956	12,481	1,853	1,059.294	-	-	-	15.040	1,598
2020年8月末	13,018	1,933	12,282	1,824	1,064.894	-	-	-	15.135	1,608
2020年9月末	11,856	1,760	11,333	1,683	1,060.570	-	-	-	15.090	1,603
2020年10月末	11,205	1,664	11,175	1,659	1,052.627	-	-	-	15.047	1,599
2020年11月末	11,356	1,686	11,057	1,642	1,072.086	-	-	-	15.341	1,630
2020年12月末	11,352	1,686	11,133	1,653	1,077.737	-	-	-	15.449	1,641
2021年1月末	10,624	1,577	10,459	1,553	1,073.157	-	-	-	15.389	1,635
2021年2月末	7,488	1,112	7,297	1,083	1,061.061	-	-	-	15.225	1,618
2021年3月末	7,386	1,097	7,322	1,087	1,063.632	-	-	-	15.289	1,624

2. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ2

	資産総額		純資産総額		1株当たり純資産価格(クラスA株式)					
					円建		米ドル建			
	千ポンド	百万円	千ポンド	百万円	分配型	累積型	分配型		累積型	
					円	円	米ドル	円	米ドル	円
2020年4月末	70,004	10,394	69,455	10,313	1,035.027	-	13.960	1,483	16.278	1,730
2020年5月末	75,303	11,181	72,432	10,755	1,066.451	-	14.384	1,528	16.771	1,782
2020年6月末	66,839	9,924	66,435	9,864	1,079.537	-	14.568	1,548	17.062	1,813
2020年7月末	67,992	10,095	65,905	9,786	1,084.600	-	14.648	1,556	17.155	1,823
2020年8月末	69,611	10,336	66,282	9,842	1,098.607	-	14.843	1,577	17.383	1,847
2020年9月末	61,265	9,097	59,210	8,792	1,087.917	-	14.704	1,562	17.306	1,839
2020年10月末	58,386	8,669	58,280	8,653	1,079.970	-	14.600	1,551	17.184	1,826
2020年11月末	61,800	9,176	60,868	9,038	1,119.734	-	15.140	1,609	17.819	1,893
2020年12月末	62,104	9,221	60,732	9,017	1,126.115	-	15.244	1,620	18.038	1,917
2021年1月末	59,887	8,892	59,316	8,807	1,119.564	-	15.160	1,611	17.939	1,906
2021年2月末	59,718	8,867	57,659	8,561	1,107.619	-	15.001	1,594	17.754	1,886
2021年3月末	55,409	8,227	55,092	8,180	1,114.278	-	15.098	1,604	17.929	1,905

3. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ3

	資産総額		純資産総額		1株当たり純資産価格(クラスA株式)					
					円建		米ドル建			
	千ポンド	百万円	千ポンド	百万円	分配型	累積型	分配型		累積型	
					円	円	米ドル	円	米ドル	円
2020年4月末	156,038	23,169	155,085	23,027	1,097.747	-	12.575	1,336	15.365	1,633
2020年5月末	165,841	24,624	162,198	24,083	1,144.964	-	13.118	1,394	16.029	1,703
2020年6月末	165,272	24,540	164,796	24,469	1,164.143	-	13.349	1,418	16.389	1,741
2020年7月末	169,557	25,176	165,353	24,552	1,168.708	-	13.409	1,425	16.469	1,750
2020年8月末	178,259	26,468	166,835	24,772	1,191.932	-	13.680	1,454	16.804	1,785
2020年9月末	169,297	25,137	166,539	24,728	1,178.223	-	13.531	1,438	16.704	1,775
2020年10月末	164,510	24,426	164,062	24,360	1,165.166	-	13.385	1,422	16.523	1,756
2020年11月末	175,091	25,998	172,409	25,599	1,226.438	-	14.095	1,498	17.400	1,849
2020年12月末	175,955	26,126	174,950	25,977	1,237.896	-	14.241	1,513	17.690	1,880
2021年1月末	174,699	25,939	174,199	25,865	1,226.822	-	14.118	1,500	17.537	1,863
2021年2月末	166,351	24,700	164,878	24,481	1,220.350	-	14.046	1,492	17.445	1,854
2021年3月末	169,508	25,169	168,030	24,949	1,235.521	-	14.232	1,512	17.743	1,885

4. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ4

	資産総額		純資産総額		1株当たり純資産価格(クラスA株式)					
					円建		米ドル建			
	千ポンド	百万円	千ポンド	百万円	分配型	累積型	分配型		累積型	
					円	円	米ドル	円	米ドル	円
2020年4月末	88,940	13,206	88,099	13,081	1,326.445	-	15.920	1,692	21.866	2,323
2020年5月末	93,890	13,941	91,675	13,612	1,393.530	-	16.728	1,777	22.976	2,441
2020年6月末	92,175	13,686	91,752	13,623	1,431.857	-	17.203	1,828	23.629	2,511
2020年7月末	94,017	13,960	92,347	13,712	1,434.750	-	17.251	1,833	23.695	2,518
2020年8月末	100,850	14,974	92,133	13,680	1,473.326	-	17.715	1,882	24.333	2,585
2020年9月末	94,608	14,047	93,372	13,864	1,459.247	-	17.558	1,866	24.198	2,571
2020年10月末	93,306	13,854	92,731	13,769	1,438.836	-	17.317	1,840	23.866	2,536
2020年11月末	99,236	14,735	97,043	14,409	1,531.940	-	18.446	1,960	25.421	2,701
2020年12月末	101,994	15,144	100,931	14,986	1,561.955	-	18.828	2,000	25.947	2,757
2021年1月末	104,557	15,525	103,838	15,418	1,543.233	-	18.608	1,977	25.645	2,725
2021年2月末	104,097	15,456	102,128	15,164	1,541.329	-	18.591	1,975	25.621	2,722
2021年3月末	98,770	14,665	96,096	14,268	1,578.675	-	19.047	2,024	26.320	2,797

5. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ5

	資産総額		純資産総額		1株当たり純資産価格(クラスA株式)					
					円建		米ドル建			
	千ポンド	百万円	千ポンド	百万円	分配型	累積型	分配型		累積型	
					円	円	米ドル	円	米ドル	円
2020年4月末	50,325	7,472	50,014	7,426	-	-	-	-	21.700	2,306
2020年5月末	53,556	7,952	52,445	7,787	-	-	-	-	22.860	2,429
2020年6月末	54,751	8,129	54,619	8,110	-	-	-	-	23.614	2,509
2020年7月末	54,517	8,095	53,733	7,978	-	-	-	-	23.630	2,511
2020年8月末	57,384	8,520	55,221	8,199	-	-	-	-	24.426	2,595
2020年9月末	55,775	8,281	55,089	8,180	-	-	-	-	24.266	2,578
2020年10月末	57,327	8,512	55,775	8,281	-	-	-	-	23.920	2,542
2020年11月末	59,866	8,889	59,218	8,793	-	-	-	-	25.627	2,723
2020年12月末	61,962	9,200	60,046	8,916	-	-	-	-	26.239	2,788
2021年1月末	59,348	8,812	59,126	8,779	-	-	-	-	-	-
2021年2月末	61,059	9,066	59,384	8,817	-	-	-	-	-	-
2021年3月末	61,602	9,147	61,283	9,099	-	-	-	-	-	-

(注) パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ5、クラスA(米ドル建)株式(分配型)は2020年4月22日付で、クラスA(米ドル建)株式(累積型)は2021年1月24日付で、それぞれ運用が停止され、2021年3月末日現在、運用されていない。

パークレイズ・マルチマネジャー

1. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ1

	資産総額		純資産総額		1株当たり純資産価格（クラスA株式）					
					円建		米ドル建			
	千ポンド	百万円	千ポンド	百万円	分配型	累積型	分配型		累積型	
					円	円	米ドル	円	米ドル	円
2020年4月末	57,236	8,498	56,826	8,438	1,001.249	-	9.939	1,056	12.402	1,318
2020年5月末	59,312	8,807	57,750	8,575	1,020.434	-	10.132	1,077	12.657	1,345
2020年6月末	80,187	11,906	58,330	8,661	1,028.884	-	10.223	1,086	12.795	1,359
2020年7月末	56,887	8,447	56,002	8,315	1,035.787	-	10.300	1,094	12.903	1,371
2020年8月末	55,733	8,275	54,993	8,165	1,039.649	-	10.342	1,099	12.967	1,378
2020年9月末	56,590	8,402	55,214	8,198	1,036.125	-	10.314	1,096	12.947	1,376
2020年10月末	52,926	7,858	52,702	7,825	1,033.196	-	10.290	1,093	12.928	1,374
2020年11月末	51,640	7,668	51,300	7,617	1,056.289	-	10.522	1,118	13.235	1,406
2020年12月末	51,546	7,654	51,000	7,572	1,060.750	-	10.578	1,124	13.333	1,417
2021年1月末	49,624	7,368	49,200	7,305	1,054.642	-	10.520	1,118	13.268	1,410
2021年2月末	47,725	7,086	45,189	6,710	1,046.091	-	10.439	1,109	13.176	1,400
2021年3月末	45,867	6,810	44,534	6,612	1,050.882	-	10.486	1,114	13.250	1,408

2. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ2

	資産総額		純資産総額		1株当たり純資産価格(クラスA株式)					
					円建		米ドル建			
	千ポンド	百万円	千ポンド	百万円	分配型	累積型	分配型		累積型	
					円	円	米ドル	円	米ドル	円
2020年4月末	102,138	15,165	101,421	15,059	1,055.347	-	9.590	1,019	12.185	1,295
2020年5月末	109,589	16,272	105,844	15,716	1,091.165	-	9.917	1,054	12.601	1,339
2020年6月末	155,419	23,077	106,468	15,808	1,103.461	-	10.036	1,066	12.811	1,361
2020年7月末	105,765	15,704	104,408	15,502	1,113.363	-	10.135	1,077	12.938	1,375
2020年8月末	104,951	15,583	102,532	15,224	1,123.062	-	10.227	1,087	13.055	1,387
2020年9月末	105,185	15,618	102,234	15,180	1,116.781	-	10.174	1,081	13.041	1,386
2020年10月末	99,688	14,802	99,238	14,735	1,110.264	-	10.118	1,075	12.970	1,378
2020年11月末	100,210	14,879	97,890	14,535	1,157.231	-	10.547	1,121	13.519	1,436
2020年12月末	99,903	14,834	98,343	14,602	1,163.650	-	10.615	1,128	13.674	1,453
2021年1月末	96,489	14,327	95,806	14,225	1,156.549	-	10.554	1,121	13.595	1,444
2021年2月末	97,254	14,440	92,329	13,709	1,152.210	-	10.516	1,117	13.547	1,439
2021年3月末	93,904	13,943	90,054	13,371	1,160.210	-	10.597	1,126	13.698	1,455

3. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ3

	資産総額		純資産総額		1株当たり純資産価格(クラスA株式)					
					円建		米ドル建			
	千ポンド	百万円	千ポンド	百万円	分配型	累積型	分配型		累積型	
					円	円	米ドル	円	米ドル	円
2020年4月末	269,969	40,085	267,928	39,782	1,069.594	-	10.458	1,111	13.049	1,386
2020年5月末	293,333	43,554	282,794	41,989	1,119.404	-	10.946	1,163	13.657	1,451
2020年6月末	385,626	57,258	284,504	42,243	1,136.472	-	11.118	1,181	13.936	1,481
2020年7月末	283,219	42,052	280,213	41,606	1,146.367	-	11.226	1,193	14.070	1,495
2020年8月末	283,492	42,093	279,087	41,439	1,163.352	-	11.396	1,211	14.283	1,518
2020年9月末	281,927	41,861	275,525	40,910	1,156.558	-	11.335	1,204	14.267	1,516
2020年10月末	270,892	40,222	269,161	39,965	1,148.061	-	11.255	1,196	14.167	1,505
2020年11月末	279,148	41,448	276,557	41,063	1,210.051	-	11.864	1,261	14.931	1,586
2020年12月末	278,339	41,328	274,831	40,807	1,221.815	-	11.992	1,274	15.166	1,611
2021年1月末	269,086	39,954	266,994	39,643	1,209.379	-	11.874	1,262	15.017	1,596
2021年2月末	272,835	40,511	257,991	38,307	1,210.961	-	11.893	1,264	15.041	1,598
2021年3月末	271,300	40,283	257,853	38,286	1,230.584	-	12.089	1,284	15.342	1,630

4. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ4

	資産総額		純資産総額		1株当たり純資産価格(クラスA株式)					
					円建		米ドル建			
	千ポンド	百万円	千ポンド	百万円	分配型	累積型	分配型		累積型	
					円	円	米ドル	円	米ドル	円
2020年4月末	63,985	9,500	63,195	9,383	1,163.265	-	13.125	1,395	13.295	1,413
2020年5月末	70,202	10,424	67,533	10,027	1,226.254	-	13.837	1,470	14.016	1,489
2020年6月末	81,397	12,086	68,787	10,213	1,254.852	-	14.168	1,505	14.351	1,525
2020年7月末	68,565	10,181	67,906	10,083	1,262.942	-	14.270	1,516	14.454	1,536
2020年8月末	68,760	10,209	67,697	10,052	1,289.810	-	14.579	1,549	14.767	1,569
2020年9月末	68,442	10,162	67,010	9,950	1,286.378	-	14.548	1,546	14.736	1,566
2020年10月末	65,524	9,729	65,220	9,684	1,272.420	-	14.393	1,529	14.579	1,549
2020年11月末	69,250	10,282	68,780	10,212	1,357.941	-	15.363	1,632	15.562	1,653
2020年12月末	68,891	10,229	68,097	10,111	1,382.597	-	15.658	1,664	15.862	1,685
2021年1月末	65,748	9,762	65,323	9,699	1,362.637	-	15.439	1,640	15.639	1,662
2021年2月末	67,292	9,992	63,723	9,462	1,372.136	-	15.551	1,652	15.753	1,674
2021年3月末	66,456	9,867	64,810	9,623	1,412.279	-	16.009	1,701	16.218	1,723

5. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ5

	資産総額		純資産総額		1株当たり純資産価格(クラスA株式)					
					円建		米ドル建			
	千ポンド	百万円	千ポンド	百万円	分配型	累積型	分配型		累積型	
					円	円	米ドル	円	米ドル	円
2020年4月末	22,866	3,395	22,664	3,365	-	-	12.924	1,373	12.933	1,374
2020年5月末	25,246	3,749	24,130	3,583	-	-	13.648	1,450	13.658	1,451
2020年6月末	26,786	3,977	24,715	3,670	-	-	14.032	1,491	14.041	1,492
2020年7月末	24,416	3,625	24,177	3,590	-	-	14.102	1,498	14.112	1,499
2020年8月末	25,006	3,713	24,528	3,642	-	-	14.473	1,538	14.484	1,539
2020年9月末	24,930	3,702	24,534	3,643	-	-	14.466	1,537	14.477	1,538
2020年10月末	23,638	3,510	23,507	3,490	-	-	14.299	1,519	14.309	1,520
2020年11月末	24,924	3,701	24,554	3,646	-	-	15.359	1,632	15.370	1,633
2020年12月末	20,919	3,106	20,679	3,070	-	-	15.683	1,666	15.694	1,667
2021年1月末	19,963	2,964	19,699	2,925	-	-	15.490	1,646	15.501	1,647
2021年2月末	20,677	3,070	19,617	2,913	-	-	15.670	1,665	15.681	1,666
2021年3月末	20,690	3,072	19,564	2,905	-	-	16.232	1,725	16.244	1,726

[次へ](#)

分配の推移

2021年3月末日前1年間における分配型クラスの分配の推移は以下のとおりです。累積型クラスについては、分配は行われず、投資収益および発生利益は留保され、再投資されます。

パークレイズ・グローバルベータ1. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ1

クラスA株式(分配型)

	1株当たり分配金		
	円建(円)	米ドル建	
		米ドル	円
自 2020年4月1日 至 2021年3月31日	12.733648	-	-

2. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ2

クラスA株式(分配型)

	1株当たり分配金		
	円建(円)	米ドル建	
		米ドル	円
自 2020年4月1日 至 2021年3月31日	20.108620	0.269434	29

3. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ3

クラスA株式(分配型)

	1株当たり分配金		
	円建(円)	米ドル建	
		米ドル	円
自 2020年4月1日 至 2021年3月31日	24.017109	0.273617	29

4. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ4

クラスA株式(分配型)

	1株当たり分配金		
	円建(円)	米ドル建	
		米ドル	円
自 2020年4月1日 至 2021年3月31日	9.672352	0.115059	12

5. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ5

クラスA株式(分配型)

	1株当たり分配金		
	円建(円)	米ドル建	
		米ドル	円
自 2020年4月1日 至 2021年3月31日	-	-	-

パークレイズ・マルチマネジャー1. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ1

クラスA株式(分配型)

	1株当たり分配金		
	円建(円)	米ドル建	
		米ドル	円
自 2020年4月1日 至 2021年3月31日	13.8562	0.138019	15

2. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ2

クラスA株式(分配型)

	1株当たり分配金		
	円建(円)	米ドル建	
		米ドル	円
自 2020年4月1日 至 2021年3月31日	19.771968	0.180104	19

3. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ3

クラスA株式(分配型)

	1株当たり分配金		
	円建(円)	米ドル建	
		米ドル	円
自 2020年4月1日 至 2021年3月31日	20.372929	0.199835	21

4. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ4

クラスA株式(分配型)

	1株当たり分配金		
	円建(円)	米ドル建	
		米ドル	円
自 2020年4月1日 至 2021年3月31日	-	-	-

5. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ5

クラスA株式(分配型)

	1株当たり分配金		
	円建(円)	米ドル建	
		米ドル	円
自 2020年4月1日 至 2021年3月31日	-	-	-

自己資本利益率(収益率)の推移

2021年3月末日前1年間における収益率は以下のとおりです。

(注) 収益率(%) = $100 \times (a - b) / b$

a = 2021年3月末日現在の1株当たり純資産価格(2021年3月末日前1年間の分配金の合計額を加えた額)

b = 2020年3月末日現在の1株当たり純資産価格(分配落の額)

パークレイズ・グローバルベータ

1. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ1

計算期間	収益率(クラスA株式)			
	円建		米ドル建	
	分配型 (%)	累積型 (%)	分配型 (%)	累積型 (%)
自 2020年4月1日 至 2021年3月31日	6.85	-	-	7.65

2. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ2

計算期間	収益率(クラスA株式)			
	円建		米ドル建	
	分配型 (%)	累積型 (%)	分配型 (%)	累積型 (%)
自 2020年4月1日 至 2021年3月31日	14.49	-	15.22	15.29

3. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ3

計算期間	収益率(クラスA株式)			
	円建		米ドル建	
	分配型 (%)	累積型 (%)	分配型 (%)	累積型 (%)
自 2020年4月1日 至 2021年3月31日	21.67	-	22.59	22.72

4. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ4

計算期間	収益率(クラスA株式)			
	円建		米ドル建	
	分配型 (%)	累積型 (%)	分配型 (%)	累積型 (%)
自 2020年4月1日 至 2021年3月31日	28.15	-	29.03	29.03

5. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ5

計算期間	収益率(クラスA株式)			
	円建		米ドル建	
	分配型 (%)	累積型 (%)	分配型 (%)	累積型 (%)
自 2020年4月1日 至 2021年3月31日	-	-	-	-

パークレイズ・マルチマネジャー1. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ1

計算期間	収益率(クラスA株式)			
	円建		米ドル建	
	分配型 (%)	累積型 (%)	分配型 (%)	累積型 (%)
自 2020年4月1日 至 2021年3月31日	9.56	-	10.28	10.32

2. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ2

計算期間	収益率(クラスA株式)			
	円建		米ドル建	
	分配型 (%)	累積型 (%)	分配型 (%)	累積型 (%)
自 2020年4月1日 至 2021年3月31日	17.14	-	17.95	17.98

3. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ3

計算期間	収益率(クラスA株式)			
	円建		米ドル建	
	分配型 (%)	累積型 (%)	分配型 (%)	累積型 (%)
自 2020年4月1日 至 2021年3月31日	23.87	-	24.67	24.75

4. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ4

計算期間	収益率(クラスA株式)			
	円建		米ドル建	
	分配型 (%)	累積型 (%)	分配型 (%)	累積型 (%)
自 2020年4月1日 至 2021年3月31日	29.68	-	30.49	30.52

5. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ5

計算期間	収益率(クラスA株式)			
	円建		米ドル建	
	分配型 (%)	累積型 (%)	分配型 (%)	累積型 (%)
自 2020年4月1日 至 2021年3月31日	-	-	34.94	34.94

(3) 投資リスク

本書の日付現在、ファンドが将来にわたって営業活動を継続するとの前提に重要な疑義を生じさせるような事象または状況その他ファンドの経営に重要な影響を及ぼす事象は存在しません。

また、2021年2月26日に提出した有価証券届出書に記載した「3 投資リスク(1) リスク要因」が以下のとおり更新されました。

(注) 下線部は訂正部分を示します。

(1) リスク要因

(イ) 一般的ナリスク要因

(前略)

MiFID 2

31. MiFID 2により、投資運用会社に新たな法令上の義務が生じます。これらの法令上の義務は、投資運用会社、本投資法人ならびに/またはいずれかのファンドの法令遵守義務および負担費用の増加につながる可能性があります。MiFID 2は特に、一定のOTCデリバティブが規制された取引所で実行されることを要求し、コモディティ・ポジションの上限および該当ある場合はコモディティ・ポジションの報告要件を導入し、ダイレクト・マーケット・アクセス(以下「DMA」といいます。)サービスに関する一定の要件を課し、かつ新規株式公開の割当ておよびその他の割当てに関連する制限を課して、市場全体における価格の透明性を向上させるものです。

サステナビリティ・リスク

32. サステナビリティ・リスクは主に、気候変動から生じる気候に関連する事由(いわゆる自然界リスク)または気候変動に対する社会の反応(いわゆる移行リスク)と関連しており、これにより、サブ・ファンドの投資対象および財務状況に影響を及ぼす可能性がある不測の損失が生じることとなる可能性があります。社会的事由(例えば、不平等、包摂、労使関係、人的資本への投資、事故防止、顧客行動の変化等)またはガバナンスの欠陥(例えば、繰り返される国際協定の重大な違反、贈収賄問題、製品の品質および安全性、販売慣行等)もまた、サステナビリティ・リスクとなる可能性があります。

有価証券の貸付取引および買戻条件付取引に附随する特定リスク

前記「2. 投資方針、(4) 投資制限、5 金融派生商品、技法および商品」に記載される運用技法および金融商品は以下を含む一定のリスクが伴います。かかる利用によって追求する目的を達成できる保証はありません。

(後略)

[次へ](#)

3 資産運用会社の概況

投資運用会社

(1) 名称及び資本金の額

名称

バークレイズ・インベストメント・ソリューションズ・リミテッド

(Barclays Investment Solutions Limited) (以下「投資運用会社」といいます。)

資本金の額

2021年3月末日現在の資本金は、22,325,001ポンド(約33億円)

(2) 大株主の状況

(2021年3月末日現在)

名称	住所	所有株式数	比率(%)
バークレイズ・バンク・ユークー・ピーエルシー (Barclays Bank UK PLC)	英国 E14 5HP ロンドン、チャーチル・プレイス1番地 (1 Churchill Place, London E14 5HP, UK)	22,325,001	100%

(3) 役員 の 状況

(2021年3月末日現在)

氏名	役職名	主要略歴	
マイケル・ジェリー (Michael Jary)	取締役会長 取締役	2018年1月1日	バークレイズ・バンク・ユーケー・ピーエルシー (BARCLAYS BANK UK PLC) 取締役
		2018年3月1日	バークレイズ・インベストメント・ソリューションズ・リミテッド (BARCLAYS INVESTMENT SOLUTIONS LIMITED) 取締役
アンドリュー・ラトクリフ (Andrew Ratcliffe)	取締役	2018年1月1日	バークレイズ・バンク・ユーケー・ピーエルシー (BARCLAYS BANK UK PLC) 取締役
		2018年3月1日	バークレイズ・インベストメント・ソリューションズ・リミテッド (BARCLAYS INVESTMENT SOLUTIONS LIMITED) 取締役
ジェームズ・マック (James Mack)	取締役	2020年6月5日	バークレイズ・インベストメント・ソリューションズ・リミテッド (BARCLAYS INVESTMENT SOLUTIONS LIMITED) 取締役
キャサリン・アン・マシュー (Kathryn Ann Matthews)	取締役	2018年2月19日	バークレイズ・バンク・ユーケー・ピーエルシー (BARCLAYS BANK UK PLC) 取締役
		2018年10月25日	バークレイズ・インベストメント・ソリューションズ・リミテッド (BARCLAYS INVESTMENT SOLUTIONS LIMITED) 取締役
ダーク・リー (Dirk Klee)	取締役	2019年2月12日	バークレイズ・インベストメント・ソリューションズ・リミテッド (BARCLAYS INVESTMENT SOLUTIONS LIMITED) 取締役

(注) 2021年3月末日現在、バークレイズ・インベストメント・ソリューションズ・リミテッドの株式を保有している取締役はいません。

(4) 事業の内容及び営業の概況

2021年3月末現在、パークレイズ・インベストメント・ソリューションズ・リミテッドにより運用されている主要な投資法人(純資産総額上位5位)は以下のとおりです。

(2021年3月末現在)

	名 称	基本的性格	設立年月日	純資産総額 (ポンド)	1株当たり 純資産価格 (ポンド)
1	パークレイズ・マルチマネージャー・ファンドplc-グローバルアクセス エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド (Barclays Multi-Manager Fund plc - GlobalAccess Emerging Market Equity Fund)	オープンエンド型/ アンブレラ型/ 変動資本型投資法人	2007年8月29日	499,386,940	0.803 (クラスA/ 分配型)
2	パークレイズ・マルチマネージャー・ファンドplc-グローバルアクセス グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド (Barclays Multi-Manager Fund plc - GlobalAccess Global Corporate Bond Fund)	オープンエンド型/ アンブレラ型/ 変動資本型投資法人	2007年12月4日	420,332,453	0.717 (クラス / 分配型)
3	パークレイズ・マルチマネージャー・ファンドplc-グローバルアクセス ユーケー・オポチュニティーズ・ファンド (Barclays Multi-Manager Fund plc - GlobalAccess UK Opportunities Fund)	オープンエンド型/ アンブレラ型/ 変動資本型投資法人	2005年12月8日	399,211,941	2.240 (クラスA/ 分配型)
4	パークレイズ・マルチマネージャー・ファンドplc-グローバルアクセス エマージング・マーケット・ローカル・カレンシー・デット・ファンド (Barclays Multi-Manager Fund plc - GlobalAccess Emerging Market Local Currency Debt Fund)	オープンエンド型/ アンブレラ型/ 変動資本型投資法人	2012年11月13日	275,921,585	0.348 (クラス / 分配型)

5	パークレイズ・マルチマネージャー・ファンドplc - グローバルアクセス グローバル・ハイイールド・ボンド・ファンド (Barclays Multi-Manager Fund plc - GlobalAccess Global High Yield Bond Fund)	オープンエンド型/ アンブレラ型/ 変動資本型投資法人	2007年11月27日	265,465,493	1.100 (クラスA / 分配型)
---	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	-----------------------------------	-------------	-------------	--------------------------

副投資運用会社

(1) 名称及び資本金の額

名称

ブラックロック・インベストメント・マネジメント(UK)リミテッド

(BlackRock Investment Management (UK) Limited (以下「副投資運用会社」といいます。))

資本金の額

2019年12月末現在、94.5百万ポンド(約140億円)。

(2) 大株主の状況

副投資運用会社の大株主は以下のとおりです。

(2020年11月末現在)

名称	住所	発行済株式数に対する所有株式数の比率
ブラックロック・インク (BlackRock Inc.)	米国 NY 10055 ニューヨーク 55 イースト・フィフティ・セカンド・ストリート (55 East 52nd Street, New York, NY 10055 United States)	100%

(3) 役員の状況

副投資運用会社の役員は以下のとおりです。

(2021年1月末現在)

氏名	役職	主要略歴
レイチェル・ロード (Rachel Lord)	業務執行取締役	2017年9月27日に現職に就任。
ステイシー・マリン (Stacey Mullin)	業務執行取締役	2018年3月27日に現職に就任。
ニコラス・ジェームズ・チャリントン (Nicholas James Charrington)	取締役会長兼 非業務執行取締役	2004年3月25日に現職に就任。

ジェームズ・エドワード・フィッシュウィック (James Edward Fishwick)	業務執行取締役	2011年12月6日に現職に就任。
コリン・ロイ・トムソン (Colin Roy Thomson)	業務執行取締役	2012年2月24日に現職に就任。
クリスチャン・クローセン (Christian Clausen)	非業務執行取締役	2018年9月5日に現職に就任。
マーガレット・アン・ヤング (Margaret Anne Young)	非業務執行取締役	2014年9月9日に現職に就任。
エレノア・ジュディス・ド・フライタ (Eleanor Judith de Freitas)	非業務執行取締役	2014年4月3日に現職に就任。

(4) 事業の内容及び営業の概況

副投資運用会社により運用されている主要な投資法人については公表されていません。

ブラックロックは、強固な財務基盤を有しており、世界中の多様な機関投資家および個人投資家にサービスを提供しています。商品は、直接および金融仲介会社を通じて提供されます。ブラックロックは、幅広い能力およびグローバルな視点を活用し、顧客が投資およびリスク管理の課題に対処し、魅力的な投資機会にアクセスすることができるよう支援することを目指しています。

ブラックロックの2019年の年次報告書および四半期決算公表は、以下のリンクのブラックロックの投資家向け情報サイトにおいて参照することができます。

<http://ir.blackrock.com/>

収益源

ブラックロックの収益はすべて、投資およびリスク管理業務、アドバイザー業務、分配業務および関連業務から得られます。

ブラックロックは公開会社であるため、公に提供したものの範囲を超えて収益についてコメントすることはできません。

[次へ](#)

4 外国投資法人の経理状況

以下に掲げるファンドの中間財務書類は、ルクセンブルグの法令規則および一般に認められた会計原則に準拠して作成されたファンドの原文の中間財務書類を翻訳したものです。これは、「中間財務諸表等の用語、様式および作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)第76条第4項ただし書の規定の適用によるものです。

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います。)の監査を受けていません。

ファンドの原文の中間財務書類は、各サブ・ファンドについての基準通貨(ポンド)ならびに各クラス株式の該当取引通貨(ポンド、米ドル、ユーロ、円)で表示されています。日本文の中間財務書類には、主要な金額について円貨換算額が併記されています。換算は、便宜上、2021年2月26日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1ポンド=148.48円、1米ドル=106.25円、1ユーロ=129.15円)で行われています。なお、千円未満の金額は四捨五入されています。

(1) 資産及び負債の状況

パークレイズ・ポートフォリオ

2021年2月28日現在合算純資産計算書

注記	パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ1		パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ2		パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ3		
	2021年2月28日現在 (ポンド)	(千円)	2021年2月28日現在 (ポンド)	(千円)	2021年2月28日現在 (ポンド)	(千円)	
資産							
投資有価証券 (時価)	2(c)	7,304,093	1,084,512	57,201,576	8,493,290	164,678,475	24,451,460
先物契約にかかる 未実現利益	2(e)	-	-	-	-	-	-
為替先渡契約に かかる未実現利益	2(g)	135,532	20,124	617,508	91,688	1,255,355	186,395
現金預金		10,993	1,632	724,986	107,646	141,592	21,024
投資有価証券 売却未収金		-	-	1,104,185	163,949	-	-
ファンド株式 発行未収金		-	-	-	-	119,679	17,770
未収配当金		-	-	-	-	-	-
その他資産		37,707	5,599	69,869	10,374	155,703	23,119
資産合計		7,488,325	1,111,866	59,718,124	8,866,947	166,350,804	24,699,767
負債							
先物契約にかかる 未実現損失	2(e)	-	-	-	-	-	-
為替先渡契約に かかる未実現損失	2(g)	94,102	13,972	163,399	24,261	290,254	43,097
当座借越		-	-	-	-	-	-
投資有価証券 購入未払金		39,065	5,800	968,680	143,830	609,736	90,534
ファンド株式 買戻未払金		-	-	756,832	112,374	189,996	28,211
その他未払金 および未払費用		58,390	8,670	170,319	25,289	383,150	56,890
負債合計		191,557	28,442	2,059,230	305,754	1,473,136	218,731
期末純資産		7,296,768	1,083,424	57,658,894	8,561,193	164,877,668	24,481,036

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2021年2月28日現在合算純資産計算書(続き)

	注記	パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ4		パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ5		パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ1	
		2021年2月28日現在 (ポンド)	(千円)	2021年2月28日現在 (ポンド)	(千円)	2021年2月28日現在 (ポンド)	(千円)
資産							
投資有価証券 (時価)	2(c)	97,684,431	14,504,184	60,689,777	9,011,218	44,455,051	6,600,686
先物契約にかかる 未実現利益	2(e)	-	-	-	-	1,151	171
為替先渡契約に かかる未実現利益	2(g)	427,941	63,541	142,093	21,098	608,199	90,305
現金預金		21,808	3,238	137,091	20,355	1,207,483	179,287
投資有価証券 売却未収金		5,443,458	808,245	-	-	1,165,419	173,041
ファンド株式 発行未収金		422,000	62,659	27,500	4,083	273,643	40,631
未収配当金		-	-	-	-	-	-
その他資産		97,363	14,456	62,541	9,286	13,968	2,074
資産合計		104,097,001	15,456,323	61,059,002	9,066,041	47,724,914	7,086,195
負債							
先物契約にかかる 未実現損失	2(e)	-	-	-	-	18,937	2,812
為替先渡契約に かかる未実現損失	2(g)	182,362	27,077	146,530	21,757	205,512	30,514
当座借越		1,840	273	-	-	28,805	4,277
投資有価証券 購入未払金		1,551,603	230,382	1,376,742	204,419	1,829,291	271,613
ファンド株式 買戻未払金		-	-	2,960	440	273,643	40,631
その他未払金 および未払費用		232,884	34,579	148,665	22,074	180,045	26,733
負債合計		1,968,689	292,311	1,674,897	248,689	2,536,233	376,580
期末純資産		102,128,312	15,164,012	59,384,105	8,817,352	45,188,681	6,709,615

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2021年2月28日現在合算純資産計算書(続き)

	注記	パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ2		パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ3		パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ4	
		2021年2月28日現在 (ポンド)	(千円)	2021年2月28日現在 (ポンド)	(千円)	2021年2月28日現在 (ポンド)	(千円)
資産							
投資有価証券 (時価)	2(c)	91,605,627	13,601,603	246,864,375	36,654,422	61,710,813	9,162,822
先物契約にかかる 未実現利益	2(e)	2,302	342	547,486	81,291	256,764	38,124
為替先渡契約に かかる未実現利益	2(g)	1,096,540	162,814	1,910,827	283,720	257,625	38,252
現金預金		2,242,695	332,995	17,286,303	2,566,670	3,255,881	483,433
投資有価証券 売却未収金		2,302,002	341,801	6,194,893	919,818	1,704,601	253,099
ファンド株式 発行未収金		-	-	29,860	4,434	100,000	14,848
未収配当金		2,145	318	-	-	-	-
その他資産		2,270	337	956	142	6,221	924
資産合計		97,253,581	14,440,212	272,834,700	40,510,496	67,291,905	9,991,502
負債							
先物契約にかかる 未実現損失	2(e)	68,646	10,193	1,354,179	201,068	465,176	69,069
為替先渡契約に かかる未実現損失	2(g)	322,143	47,832	672,383	99,835	150,189	22,300
当座借越		172,252	25,576	147,891	21,959	-	-
投資有価証券 購入未払金		3,769,869	559,750	10,502,770	1,559,451	2,608,304	387,281
ファンド株式 買戻未払金		149,138	22,144	998,130	148,202	26,484	3,932
その他未払金 および未払費用		442,202	65,658	1,168,428	173,488	318,759	47,329
負債合計		4,924,250	731,153	14,843,781	2,204,005	3,568,912	529,912
期末純資産		92,329,331	13,709,059	257,990,919	38,306,492	63,722,993	9,461,590

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2021年2月28日現在合算純資産計算書(続き)

	注記	パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ5		リキッド・ オルタナティブ・ ストラテジーズ		合算	
		2021年2月28日現在 (ポンド)	(千円)	2021年2月28日現在 (ポンド)	(千円)	2021年2月28日現在 (ポンド)	(千円)
資産							
投資有価証券 (時価)	2(c)	18,323,699	2,720,703	251,749,060	37,379,700	1,102,266,977	163,664,601
先物契約にかかる 未実現利益	2(e)	103,226	15,327	-	-	910,929	135,255
為替先渡契約に かかる未実現利益	2(g)	23,936	3,554	1,149,956	170,745	7,625,512	1,132,236
現金預金		1,502,966	223,160	14,436,156	2,143,480	40,967,954	6,082,922
投資有価証券 売却未収金		707,408	105,036	-	-	18,621,966	2,764,990
ファンド株式 発行未収金		-	-	485,554	72,095	1,458,236	216,519
未収配当金		-	-	-	-	2,145	318
その他資産		16,127	2,395	429	64	463,154	68,769
資産合計		20,677,362	3,070,175	267,821,155	39,766,085	1,172,316,873	174,065,609
負債							
先物契約にかかる 未実現損失	2(e)	165,396	24,558	-	-	2,072,334	307,700
為替先渡契約に かかる未実現損失	2(g)	53,645	7,965	632	94	2,281,151	338,705
当座借越		-	-	-	-	350,788	52,085
投資有価証券 購入未払金		702,504	104,308	865,000	128,435	24,823,564	3,685,803
ファンド株式 買戻未払金		-	-	630,910	93,678	3,028,093	449,611
その他未払金 および未払費用		138,730	20,599	648,931	96,353	3,890,503	577,662
負債合計		1,060,275	157,430	2,145,473	318,560	36,446,433	5,411,566
期末純資産		19,617,087	2,912,745	265,675,682	39,447,525	1,135,870,440	168,654,043

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2021年2月28日現在合算純資産計算書(続き)

	パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ1		パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ2		パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ3	
	(千円)		(千円)		(千円)	
2021年2月28日現在 純資産(ポンド)	7,296,768	1,083,424	57,658,894	8,561,193	164,877,668	24,481,036
2021年2月28日現在 1株当たり純資産価格	(円)		(円)		(円)	
ポンド建クラス						
クラスA - 累積型	15.029	2,232	16.916	2,512	17.184	2,551
クラスA - 分配型	12.747	1,893	13.732	2,039	16.015	2,378
クラスC - 累積型	15.034	2,232	16.873	2,505	21.899	3,252
クラスC - 分配型	-	-	15.053	2,235	18.021	2,676
クラス - 累積型	-	-	-	-	-	-
クラス - 分配型	-	-	-	-	-	-
クラスR - 累積型	15.183	2,254	18.682	2,774	19.259	2,860
クラスR - 分配型	12.722	1,889	16.526	2,454	16.754	2,488
米ドル建クラス						
クラスA - 累積型	15.225	1,618	17.754	1,886	17.445	1,854
クラスA - 分配型	-	-	15.001	1,594	14.046	1,492
クラスC - 累積型	15.244	1,620	16.509	1,754	22.914	2,435
クラスC - 分配型	-	-	-	-	14.320	1,522
クラスR - 累積型	-	-	16.970	1,803	21.462	2,280
クラスR - 分配型	-	-	15.023	1,596	19.236	2,044
ユーロ建クラス						
クラスA - 累積型	13.811	1,784	15.257	1,970	19.351	2,499
クラスA - 分配型	-	-	10.999	1,421	14.117	1,823
クラスC - 累積型	-	-	14.943	1,930	19.864	2,565
クラスC - 分配型	-	-	-	-	17.955	2,319
クラスR - 累積型	-	-	15.586	2,013	18.497	2,389
クラスR - 分配型	-	-	-	-	16.073	2,076
クラスY - 累積型	-	-	-	-	-	-
円建クラス						
クラスA - 分配型	1,061.061		1,107.619		1,220.350	

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2021年2月28日現在合算純資産計算書(続き)

	パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ4		パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ5		パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ1	
	(千円)		(千円)		(千円)	
2021年2月28日現在 純資産(ポンド)	102,128,312	15,164,012	59,384,105	8,817,352	45,188,681	6,709,615
2021年2月28日現在 1株当たり純資産価格						
	(円)		(円)		(円)	
ボンド建クラス						
クラスA - 累積型	21.398	3,177	26.405	3,921	13.160	1,954
クラスA - 分配型	23.287	3,458	28.214	4,189	10.405	1,545
クラスC - 累積型	24.983	3,709	27.508	4,084	11.340	1,684
クラスC - 分配型	18.534	2,752	26.252	3,898	10.532	1,564
クラス - 累積型	-	-	-	-	-	-
クラス - 分配型	-	-	-	-	-	-
クラスR - 累積型	20.725	3,077	26.280	3,902	13.294	1,974
クラスR - 分配型	18.758	2,785	24.099	3,578	10.638	1,580
米ドル建クラス						
クラスA - 累積型	25.621	2,722	-	-	13.176	1,400
クラスA - 分配型	18.591	1,975	-	-	10.439	1,109
クラスC - 累積型	23.789	2,528	30.348	3,224	13.253	1,408
クラスC - 分配型	22.534	2,394	28.962	3,077	-	-
クラスR - 累積型	24.882	2,644	30.166	3,205	11.104	1,180
クラスR - 分配型	22.698	2,412	28.565	3,035	-	-
ユーロ建クラス						
クラスA - 累積型	22.442	2,898	28.045	3,622	11.929	1,541
クラスA - 分配型	15.342	1,981	-	-	9.492	1,226
クラスC - 累積型	18.364	2,372	26.312	3,398	12.081	1,560
クラスC - 分配型	-	-	23.656	3,055	11.234	1,451
クラスR - 累積型	23.334	3,014	21.041	2,717	12.200	1,576
クラスR - 分配型	16.545	2,137	-	-	-	-
クラスY - 累積型	-	-	-	-	-	-
円建クラス						
クラスA - 分配型	1,541.329		-		1,046.091	

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2021年2月28日現在合算純資産計算書(続き)

	パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ2		パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ3		パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ4	
	(千円)		(千円)		(千円)	
2021年2月28日現在 純資産(ポンド)	92,329,331	13,709,059	257,990,919	38,306,492	63,722,993	9,461,590
2021年2月28日現在 1株当たり純資産価格	(円)		(円)		(円)	
ポンド建クラス						
クラスA - 累積型	13.651	2,027	15.251	2,264	15.868	2,356
クラスA - 分配型	10.566	1,569	12.016	1,784	15.731	2,336
クラスC - 累積型	14.221	2,112	16.386	2,433	-	-
クラスC - 分配型	11.198	1,663	12.917	1,918	16.277	2,417
クラス - 累積型	-	-	-	-	17.703	2,629
クラス - 分配型	-	-	13.889	2,062	16.347	2,427
クラスR - 累積型	14.885	2,210	16.537	2,455	17.311	2,570
クラスR - 分配型	11.518	1,710	13.389	1,988	16.294	2,419
米ドル建クラス						
クラスA - 累積型	13.547	1,439	15.041	1,598	15.753	1,674
クラスA - 分配型	10.516	1,117	11.893	1,264	15.551	1,652
クラスC - 累積型	14.039	1,492	15.745	1,673	-	-
クラスC - 分配型	12.831	1,363	14.462	1,537	-	-
クラスR - 累積型	12.423	1,320	16.198	1,721	16.709	1,775
クラスR - 分配型	11.479	1,220	13.272	1,410	16.260	1,728
ユーロ建クラス						
クラスA - 累積型	11.734	1,515	12.916	1,668	13.560	1,751
クラスA - 分配型	9.131	1,179	10.107	1,305	13.410	1,732
クラスC - 累積型	12.194	1,575	13.682	1,767	14.630	1,889
クラスC - 分配型	9.506	1,228	10.913	1,409	14.073	1,818
クラスR - 累積型	12.680	1,638	13.909	1,796	14.284	1,845
クラスR - 分配型	9.967	1,287	11.298	1,459	14.037	1,813
クラスY - 累積型	-	-	12.835	1,658	13.148	1,698
円建クラス						
クラスA - 分配型	1,152.210		1,210.961		1,372.136	

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2021年2月28日現在合算純資産計算書(続き)

	パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ5		リキッド・ オルタナティブ・ ストラテジーズ	
	(千円)		(千円)	
2021年2月28日現在 純資産(ポンド)	19,617,087	2,912,745	265,675,682	39,447,525
2021年2月28日現在 1株当たり純資産価格				
	(円)		(円)	
ポンド建クラス				
クラスA - 累積型	16.017	2,378	-	-
クラスA - 分配型	15.891	2,359	-	-
クラスC - 累積型	16.810	2,496	-	-
クラスC - 分配型	16.901	2,509	-	-
クラス - 累積型	-	-	-	-
クラス - 分配型	-	-	-	-
クラスR - 累積型	17.185	2,552	11.308	1,679
クラスR - 分配型	16.802	2,495	-	-
米ドル建クラス				
クラスA - 累積型	15.681	1,666	11.262	1,197
クラスA - 分配型	15.670	1,665	-	-
クラスC - 累積型	-	-	-	-
クラスC - 分配型	-	-	-	-
クラスR - 累積型	17.115	1,818	11.827	1,257
クラスR - 分配型	16.386	1,741	-	-
ユーロ建クラス				
クラスA - 累積型	13.381	1,728	9.982	1,289
クラスA - 分配型	13.211	1,706	-	-
クラスC - 累積型	13.853	1,789	-	-
クラスC - 分配型	13.697	1,769	-	-
クラスR - 累積型	14.309	1,848	10.428	1,347
クラスR - 分配型	14.090	1,820	-	-
クラスY - 累積型	13.160	1,700	-	-
円建クラス				
クラスA - 分配型	-	-	-	-

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2021年2月28日現在合算純資産計算書(続き)

	パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ 1	パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ 2	パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ 3	パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ 4
2021年2月28日現在 発行済株式数				
ボンド建クラス				
クラスA - 累積型	17,698	204,589	289,435	52,679
クラスA - 分配型	30,936	22,668	39,856	21,628
クラスC - 累積型	7,330	31,712	218,945	63,099
クラスC - 分配型	-	13,626	247,256	37,909
クラス - 累積型	-	-	-	-
クラス - 分配型	-	-	-	-
クラスR - 累積型	67,046	954,560	3,817,868	2,559,031
クラスR - 分配型	101,558	1,128,701	2,969,912	1,419,669
米ドル建クラス				
クラスA - 累積型	3,621	15,239	40,038	12,039
クラスA - 分配型	-	69,809	148,836	19,500
クラスC - 累積型	229,148	20,678	10,002	43,002
クラスC - 分配型	-	-	1,815	90,741
クラスR - 累積型	-	232,235	500,075	265,523
クラスR - 分配型	-	145,275	269,136	114,360
ユーロ建クラス				
クラスA - 累積型	78,198	158,343	64,640	13,622
クラスA - 分配型	-	11,496	3,623	2,911
クラスC - 累積型	-	197,571	48,680	73,245
クラスC - 分配型	-	-	28,869	-
クラスR - 累積型	-	393,668	559,144	175,203
クラスR - 分配型	-	-	31,115	278,137
クラスY - 累積型	-	-	-	-
円建クラス				
クラスA - 分配型	104,000	126,000	163,500	17,000

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2021年2月28日現在合算純資産計算書(続き)

	パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ 5	パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ 1	パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ 2	パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ 3
2021年2月28日現在 発行済株式数				
ボンド建クラス				
クラスA - 累積型	15,145	157,788	246,513	393,981
クラスA - 分配型	14,922	326,729	220,177	2,591,830
クラスC - 累積型	9,643	38,868	73,823	234,176
クラスC - 分配型	28,047	82,127	123,991	671,538
クラス - 累積型	-	-	-	-
クラス - 分配型	-	-	-	71,313
クラスR - 累積型	945,918	161,088	1,001,581	3,071,929
クラスR - 分配型	686,588	330,116	952,364	2,372,870
米ドル建クラス				
クラスA - 累積型	-	220,362	995,497	1,310,236
クラスA - 分配型	-	853,701	156,061	1,102,560
クラスC - 累積型	11,446	91,653	97,842	212,215
クラスC - 分配型	220	-	20,408	388,954
クラスR - 累積型	7,603	2,949	24,314	316,307
クラスR - 分配型	247,569	-	190,454	908,103
ユーロ建クラス				
クラスA - 累積型	9,059	1,870,124	3,432,356	5,730,491
クラスA - 分配型	-	94,410	394,666	532,411
クラスC - 累積型	6,274	14,893	174,823	95,184
クラスC - 分配型	102,117	261,677	107,488	179,715
クラスR - 累積型	450,008	49,540	195,119	70,100
クラスR - 分配型	-	-	121,712	226,092
クラスY - 累積型	-	-	-	589,045
円建クラス				
クラスA - 分配型	-	4,500	67,000	148,000

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2021年2月28日現在合算純資産計算書(続き)

	パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ 4	パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ 5	リキッド・ オルタナティブ・ ストラテジーズ
2021年2月28日現在 発行済株式数			
ボンド建クラス			
クラスA - 累積型	71,760	22,245	-
クラスA - 分配型	446,719	81,580	-
クラスC - 累積型	-	2,424	-
クラスC - 分配型	262,305	37,024	-
クラス - 累積型	55,560	-	-
クラス - 分配型	17,653	-	-
クラスR - 累積型	648,409	317,665	19,909,091
クラスR - 分配型	814,191	117,129	-
米ドル建クラス			
クラスA - 累積型	204,390	24,786	622,215
クラスA - 分配型	303,599	91,154	-
クラスC - 累積型	-	-	-
クラスC - 分配型	-	-	-
クラスR - 累積型	17,129	12,519	2,882,104
クラスR - 分配型	114,105	78,667	-
ユーロ建クラス			
クラスA - 累積型	1,172,480	161,376	620,653
クラスA - 分配型	97,165	7,655	-
クラスC - 累積型	30	11,876	-
クラスC - 分配型	12	37,952	-
クラスR - 累積型	8,023	12,529	637,705
クラスR - 分配型	50,043	3,237	-
クラスY - 累積型	142,620	415,205	-
円建クラス			
クラスA - 分配型	113,000	-	-

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

パークレイズ・ポートフォリオ

2021年2月28日に終了した期間の合算損益計算書

	注記	パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ1		パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ2		パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ3	
		(ポンド)	(千円)	(ポンド)	(千円)	(ポンド)	(千円)
		2021年2月28日に 終了した期間		2021年2月28日に 終了した期間		2021年2月28日に 終了した期間	
収益							
受取配当金(純額)	2(d)	68,399	10,156	533,734	79,249	1,645,154	244,272
銀行利息	2(d)	-	-	-	-	413	61
収益合計		68,399	10,156	533,734	79,249	1,645,567	244,334
費用							
管理報酬	3(a)	24,141	3,584	145,976	21,675	370,316	54,985
管理事務代行報酬							
および保管銀行報酬	5(a)	22,607	3,357	33,002	4,900	50,006	7,425
ルクセンブルグ税	4	2,520	374	14,922	2,216	42,729	6,344
専門家報酬		6,972	1,035	6,972	1,035	6,972	1,035
取締役報酬		361	54	2,160	321	7,311	1,086
為替ヘッジ							
運用会社報酬	5(c)	-	-	-	-	-	-
当座借越利息		149	22	280	42	77	11
税務・法務報酬		815	121	3,091	459	5,952	884
公告手数料		1,517	225	4,318	641	14,580	2,165
一般費用		6,185	918	10,189	1,513	16,958	2,518
費用合計		65,267	9,691	220,910	32,801	514,901	76,453
費用の免除/返還	5(b)	(38,774)	(5,757)	(75,493)	(11,209)	(175,517)	(26,061)
投資収益(純額)		41,906	6,222	388,317	57,657	1,306,183	193,942
投資有価証券、 先物契約および 為替先渡契約に かかる実現利益 (純額)		154,271	22,906	2,467,096	366,314	3,970,031	589,470
投資有価証券に かかる未実現 評価(損)/益の 変動(純額)		(343,686)	(51,030)	(1,981,029)	(294,143)	238,933	35,477
先物契約にかかる 未実現評価(損)の 変動(純額)		-	-	-	-	-	-
為替先渡契約に かかる未実現 評価益の変動(純額)		30,277	4,496	246,430	36,590	348,799	51,790
運用による 資産の変動(純額)		(117,232)	(17,407)	1,120,814	166,418	5,863,946	870,679

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2021年2月28日に終了した期間の合算損益計算書(続き)

	注記	パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ4		パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ5		パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ1	
		(ポンド)	(千円)	(ポンド)	(千円)	(ポンド)	(千円)
		2021年2月28日に 終了した期間		2021年2月28日に 終了した期間		2021年2月28日に 終了した期間	
収益							
受取配当金(純額)	2(d)	861,415	127,903	433,343	64,343	337,519	50,115
銀行利息	2(d)	-	-	24	4	-	-
収益合計		861,415	127,903	433,367	64,346	337,519	50,115
費用							
管理報酬	3(a)	197,495	29,324	114,681	17,028	146,306	21,724
管理事務代行報酬							
および保管銀行報酬	5(a)	35,603	5,286	27,277	4,050	33,471	4,970
ルクセンブルグ税	4	24,442	3,629	14,630	2,172	12,629	1,875
専門家報酬		6,972	1,035	6,972	1,035	6,972	1,035
取締役報酬		4,486	666	2,579	383	1,777	264
為替ヘッジ							
運用会社報酬	5(c)	-	-	-	-	7,572	1,124
当座借越利息		105	16	41	6	2,780	413
税務・法務報酬		3,328	494	2,176	323	2,871	426
公告手数料		9,746	1,447	5,924	880	4,691	697
一般費用		15,312	2,274	11,651	1,730	10,393	1,543
費用合計		297,489	44,171	185,931	27,607	229,462	34,071
費用の免除/返還	5(b)	(109,633)	(16,278)	(67,019)	(9,951)	(13,461)	(1,999)
投資収益(純額)		673,559	100,010	314,455	46,690	121,518	18,043
投資有価証券、 先物契約および 為替先渡契約に かかる実現利益 /(損失)(純額)		1,334,876	198,202	749,624	111,304	(6,703)	(995)
投資有価証券に かかる未実現 評価益/(損)の 変動(純額)		2,133,929	316,846	2,163,954	321,304	(1,027,319)	(152,536)
先物契約にかかる 未実現評価(損)の 変動(純額)		-	-	-	-	(4,428)	(657)
為替先渡契約に かかる未実現 評価益の変動(純額)		129,324	19,202	71,458	10,610	566,489	84,112
運用による 資産の変動(純額)		4,271,688	634,260	3,299,491	489,908	(350,443)	(52,034)

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2021年2月28日に終了した期間の合算損益計算書(続き)

	注記	パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ2		パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ3		パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ4	
		(ポンド)	(千円)	(ポンド)	(千円)	(ポンド)	(千円)
		2021年2月28日に 終了した期間		2021年2月28日に 終了した期間		2021年2月28日に 終了した期間	
収益							
受取配当金(純額)	2(d)	852,225	126,538	2,341,038	347,597	531,822	78,965
銀行利息	2(d)	-	-	-	-	-	-
収益合計		852,225	126,538	2,341,038	347,597	531,822	78,965
費用							
管理報酬	3(a)	561,428	83,361	1,634,144	242,638	391,891	58,188
管理事務代行報酬							
および保管銀行報酬	5(a)	43,396	6,443	71,284	10,584	34,166	5,073
ルクセンブルグ税	4	24,612	3,654	68,412	10,158	16,516	2,452
専門家報酬		6,972	1,035	6,972	1,035	6,972	1,035
取締役報酬		3,598	534	10,421	1,547	2,595	385
為替ヘッジ							
運用会社報酬	5(c)	12,531	1,861	27,159	4,033	5,708	848
当座借越利息		1,671	248	9,902	1,470	2,661	395
税務・法務報酬		5,069	753	12,421	1,844	3,235	480
公告手数料		6,912	1,026	18,679	2,773	5,435	807
一般費用		12,708	1,887	18,297	2,717	14,424	2,142
費用合計		678,897	100,803	1,877,691	278,800	483,603	71,805
費用の免除/返還	5(b)	-	-	-	-	(5,989)	(889)
投資収益(純額)		173,328	25,736	463,347	68,798	54,208	8,049
投資有価証券、 先物契約および 為替先渡契約に かかる実現利益 (純額)		1,109,637	164,759	3,480,371	516,765	477,975	70,970
投資有価証券に かかる未実現 評価(損)/益の 変動(純額)		(315,329)	(46,820)	6,093,818	904,810	3,570,231	530,108
先物契約にかかる 未実現評価(損)の 変動(純額)		(41,364)	(6,142)	(1,453,749)	(215,853)	(874,100)	(129,786)
為替先渡契約に かかる未実現 評価益の変動(純額)		754,341	112,005	1,424,857	211,563	290,488	43,132
運用による 資産の変動(純額)		1,680,613	249,537	10,008,644	1,486,083	3,518,802	522,472

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2021年2月28日に終了した期間の合算損益計算書（続き）

	注記	パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ5		リキッド・ オルタナティブ・ ストラテジーズ		合算	
		2021年2月28日に 終了した期間 (ポンド)	(千円)	2021年2月28日に 終了した期間 (ポンド)	(千円)	2021年2月28日に 終了した期間 (ポンド)	(千円)
収益							
受取配当金（純額）	2(d)	151,710	22,526	-	-	7,756,359	1,151,664
銀行利息	2(d)	-	-	-	-	437	65
収益合計		151,710	22,526	-	-	7,756,796	1,151,729
費用							
管理報酬	3(a)	141,134	20,956	880,958	130,805	4,608,470	684,266
管理事務代行報酬							
および保管銀行報酬	5(a)	26,645	3,956	82,590	12,263	460,047	68,308
ルクセンブルグ税	4	5,359	796	31,912	4,738	258,683	38,409
専門家報酬		6,972	1,035	6,972	1,035	76,692	11,387
取締役報酬		663	98	8,383	1,245	44,334	6,583
為替ヘッジ							
運用会社報酬	5(c)	2,219	329	-	-	55,189	8,194
当座借越利息		1,316	195	601	89	19,583	2,908
税務・法務報酬		1,369	203	15,400	2,287	55,727	8,274
公告手数料		1,993	296	6,477	962	80,272	11,919
一般費用		11,524	1,711	(27,129)	(4,028)	100,512	14,924
費用合計		199,194	29,576	1,006,164	149,395	5,759,509	855,172
費用の免除 / 返還	5(b)	(23,383)	(3,472)	-	-	(509,269)	(75,616)
投資（損失） /							
収益（純額）		(24,101)	(3,579)	(1,006,164)	(149,395)	2,506,556	372,173
投資有価証券、 先物契約および 為替先渡契約に かかる実現利益 （純額）		1,054,831	156,621	6,741,088	1,000,917	21,533,097	3,197,234
投資有価証券に かかる未実現 評価益 / (損) の 変動（純額）		911,034	135,270	(2,200,372)	(326,711)	9,244,164	1,372,573
先物契約にかかる 未実現評価（損）の 変動（純額）		(397,101)	(58,962)	-	-	(2,770,742)	(411,400)
為替先渡契約に かかる未実現 評価益の変動（純額）		90,906	13,498	871,415	129,388	4,824,784	716,384
運用による 資産の変動（純額）		1,635,569	242,849	4,405,967	654,198	35,337,859	5,246,965

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

パークレイズ・ポートフォリオ

2021年2月28日に終了した期間の合算純資産額変動計算書

	パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ1		パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ2		パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ3	
	2021年2月28日に 終了した期間 (ポンド)	(千円)	2021年2月28日に 終了した期間 (ポンド)	(千円)	2021年2月28日に 終了した期間 (ポンド)	(千円)
期首純資産	12,282,416	1,823,693	66,282,337	9,841,601	166,835,125	24,771,679
投資収益(純額)	41,906	6,222	388,317	57,657	1,306,183	193,942
投資有価証券、 先物契約および 為替先渡契約に かかる実現利益 (純額)	154,271	22,906	2,467,096	366,314	3,970,031	589,470
当期利益(純額)	12,478,593	1,852,821	69,137,750	10,265,573	172,111,339	25,555,092
ファンド株式 申込手取金	197,231	29,285	2,402,295	356,693	16,539,943	2,455,851
ファンド株式 買戻支払金	(5,046,962)	(749,373)	(11,916,916)	(1,769,424)	(23,661,641)	(3,513,280)
ファンド株式の 取引による手取金 (純額)	(4,849,731)	(720,088)	(9,514,621)	(1,412,731)	(7,121,698)	(1,057,430)
投資有価証券に かかる未実現評価 (損)/益の変動 (純額)	(343,686)	(51,030)	(1,981,029)	(294,143)	238,933	35,477
先物契約にかかる 未実現評価(損)の 変動(純額)	-	-	-	-	-	-
為替先渡契約に かかる未実現 評価益の変動(純額)	30,277	4,496	246,430	36,590	348,799	51,790
分配金	(18,685)	(2,774)	(229,636)	(34,096)	(699,705)	(103,892)
期末純資産	7,296,768	1,083,424	57,658,894	8,561,193	164,877,668	24,481,036

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2021年2月28日に終了した期間の合算純資産額変動計算書(続き)

	パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ4		パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ5		パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ1	
	2021年2月28日に 終了した期間 (ポンド)	(千円)	2021年2月28日に 終了した期間 (ポンド)	(千円)	2021年2月28日に 終了した期間 (ポンド)	(千円)
期首純資産	92,132,642	13,679,855	55,220,617	8,199,157	54,993,296	8,165,405
投資収益(純額)	673,559	100,010	314,455	46,690	121,518	18,043
投資有価証券、 先物契約および 為替先渡契約に かかる実現利益 /(損失)(純額)	1,334,876	198,202	749,624	111,304	(6,703)	(995)
当期利益(純額)	94,141,077	13,978,067	56,284,696	8,357,152	55,108,111	8,182,452
ファンド株式 申込手取金	13,736,232	2,039,556	4,158,038	617,385	808,638	120,067
ファンド株式 買戻支払金	(7,757,765)	(1,151,873)	(3,166,670)	(470,187)	(10,143,674)	(1,506,133)
ファンド株式の 取引による手取金 (純額)	5,978,467	887,683	991,368	147,198	(9,335,036)	(1,386,066)
投資有価証券に かかる未実現 評価益/(損)の 変動(純額)	2,133,929	316,846	2,163,954	321,304	(1,027,319)	(152,536)
先物契約にかかる 未実現評価(損)の 変動(純額)	-	-	-	-	(4,428)	(657)
為替先渡契約に かかる未実現 評価益の変動(純額)	129,324	19,202	71,458	10,610	566,489	84,112
分配金	(254,485)	(37,786)	(127,371)	(18,912)	(119,136)	(17,689)
期末純資産	102,128,312	15,164,012	59,384,105	8,817,352	45,188,681	6,709,615

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2021年2月28日に終了した期間の合算純資産額変動計算書(続き)

	パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ2		パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ3		パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ4	
	2021年2月28日に 終了した期間 (ポンド)	(千円)	2021年2月28日に 終了した期間 (ポンド)	(千円)	2021年2月28日に 終了した期間 (ポンド)	(千円)
期首純資産	102,531,838	15,223,927	279,086,792	41,438,807	67,696,501	10,051,576
投資収益(純額)	173,328	25,736	463,347	68,798	54,208	8,049
投資有価証券、 先物契約および 為替先渡契約に かかる実現利益 (純額)	1,109,637	164,759	3,480,371	516,765	477,975	70,970
当期利益(純額)	103,814,803	15,414,422	283,030,510	42,024,370	68,228,684	10,130,595
ファンド株式 申込手取金	2,124,871	315,501	3,611,371	536,216	673,242	99,963
ファンド株式 買戻支払金	(13,792,979)	(2,047,982)	(33,749,698)	(5,011,155)	(8,127,267)	(1,206,737)
ファンド株式の 取引による手取金 (純額)	(11,668,108)	(1,732,481)	(30,138,327)	(4,474,939)	(7,454,025)	(1,106,774)
投資有価証券に かかる未実現 評価(損)/益の 変動(純額)	(315,329)	(46,820)	6,093,818	904,810	3,570,231	530,108
先物契約にかかる 未実現評価(損)の 変動(純額)	(41,364)	(6,142)	(1,453,749)	(215,853)	(874,100)	(129,786)
為替先渡契約に かかる未実現 評価益の変動(純額)	754,341	112,005	1,424,857	211,563	290,488	43,132
分配金	(215,012)	(31,925)	(966,190)	(143,460)	(38,285)	(5,685)
期末純資産	92,329,331	13,709,059	257,990,919	38,306,492	63,722,993	9,461,590

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2021年2月28日に終了した期間の合算純資産額変動計算書(続き)

	パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ5		リキッド・ オルタナティブ・ ストラテジーズ		合算	
	2021年2月28日に 終了した期間		2021年2月28日に 終了した期間		2021年2月28日に 終了した期間	
	(ポンド)	(千円)	(ポンド)	(千円)	(ポンド)	(千円)
期首純資産	24,527,568	3,641,853	373,805,586	55,502,653	1,295,394,718	192,340,208
投資(損失)/ 収益(純額)	(24,101)	(3,579)	(1,006,164)	(149,395)	2,506,556	372,173
投資有価証券、 先物契約および 為替先渡契約に かかる実現利益 (純額)	1,054,831	156,621	6,741,088	1,000,917	21,533,097	3,197,234
当期利益(純額)	25,558,298	3,794,896	379,540,510	56,354,175	1,319,434,371	195,909,615
ファンド株式 申込手取金	164,055	24,359	42,471,482	6,306,166	86,887,398	12,901,041
ファンド株式 買戻支払金	(6,708,373)	(996,059)	(155,007,353)	(23,015,492)	(279,079,298)	(41,437,694)
ファンド株式の 取引による手取金 (純額)	(6,544,318)	(971,700)	(112,535,871)	(16,709,326)	(192,191,900)	(28,536,653)
投資有価証券に かかる未実現 評価益/(損)の 変動(純額)	911,034	135,270	(2,200,372)	(326,711)	9,244,164	1,372,573
先物契約にかかる 未実現評価(損)の 変動(純額)	(397,101)	(58,962)	-	-	(2,770,742)	(411,400)
為替先渡契約に かかる未実現 評価益の変動(純額)	90,906	13,498	871,415	129,388	4,824,784	716,384
分配金	(1,732)	(257)	-	-	(2,670,237)	(396,477)
期末純資産	19,617,087	2,912,745	265,675,682	39,447,525	1,135,870,440	168,654,043

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

パークレイズ・ポートフォリオ

2021年2月28日に終了した期間の合算発行済株式数計算書

	クラス通貨	期首発行済株式数	期中発行数	期中買戻数	期末発行済株式数
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ1					
ボンド建クラス					
クラスA - 累積型	ボンド	31,906	99	(14,307)	17,698
クラスA - 分配型	ボンド	30,863	73	-	30,936
クラスC - 累積型	ボンド	8,720	-	(1,390)	7,330
クラスR - 累積型	ボンド	65,113	12,624	(10,691)	67,046
クラスR - 分配型	ボンド	109,901	-	(8,343)	101,558
米ドル建クラス					
クラスA - 累積型	米ドル	54,014	-	(50,393)	3,621
クラスC - 累積型	米ドル	490,616	-	(261,468)	229,148
ユーロ建クラス					
クラスA - 累積型	ユーロ	94,689	-	(16,491)	78,198
円建クラス					
クラスA - 分配型	円	204,000	-	(100,000)	104,000

添付の注記は本財務書類と不可分です。

2021年2月28日に終了した期間の合算発行済株式数計算書(続き)

	クラス通貨	期首発行済株式数	期中発行数	期中買戻数	期末発行済株式数
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ2					
ボンド建クラス					
クラスA - 累積型	ボンド	240,055	-	(35,466)	204,589
クラスA - 分配型	ボンド	29,885	446	(7,663)	22,668
クラスC - 累積型	ボンド	73,941	-	(42,229)	31,712
クラスC - 分配型	ボンド	32,172	-	(18,546)	13,626
クラスR - 累積型	ボンド	995,633	38,871	(79,944)	954,560
クラスR - 分配型	ボンド	1,140,221	5,017	(16,537)	1,128,701
米ドル建クラス					
クラスA - 累積型	米ドル	27,867	-	(12,628)	15,239
クラスA - 分配型	米ドル	107,771	19,038	(57,000)	69,809
クラスC - 累積型	米ドル	20,678	-	-	20,678
クラスR - 累積型	米ドル	651,989	92,267	(512,021)	232,235
クラスR - 分配型	米ドル	145,275	-	-	145,275
ユーロ建クラス					
クラスA - 累積型	ユーロ	165,893	-	(7,550)	158,343
クラスA - 分配型	ユーロ	14,387	131	(3,022)	11,496
クラスC - 累積型	ユーロ	233,593	-	(36,022)	197,571
クラスR - 累積型	ユーロ	379,841	13,827	-	393,668
円建クラス					
クラスA - 分配型	円	171,000	-	(45,000)	126,000

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2021年2月28日に終了した期間の合算発行済株式数計算書(続き)

	クラス通貨	期首発行済株式数	期中発行数	期中買戻数	期末発行済株式数
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ3					
ボンド建クラス					
クラスA - 累積型	ボンド	350,286	-	(60,851)	289,435
クラスA - 分配型	ボンド	39,665	191	-	39,856
クラスC - 累積型	ボンド	295,900	-	(76,955)	218,945
クラスC - 分配型	ボンド	245,706	1,550	-	247,256
クラスR - 累積型	ボンド	3,932,320	379,088	(493,540)	3,817,868
クラスR - 分配型	ボンド	3,104,922	421,459	(556,469)	2,969,912
米ドル建クラス					
クラスA - 累積型	米ドル	19,720	35,008	(14,690)	40,038
クラスA - 分配型	米ドル	148,336	500	-	148,836
クラスC - 累積型	米ドル	10,002	-	-	10,002
クラスC - 分配型	米ドル	1,815	-	-	1,815
クラスR - 累積型	米ドル	455,672	63,858	(19,455)	500,075
クラスR - 分配型	米ドル	304,087	5,059	(40,010)	269,136
ユーロ建クラス					
クラスA - 累積型	ユーロ	101,558	-	(36,918)	64,640
クラスA - 分配型	ユーロ	3,623	-	-	3,623
クラスC - 累積型	ユーロ	48,680	-	-	48,680
クラスC - 分配型	ユーロ	28,560	309	-	28,869
クラスR - 累積型	ユーロ	530,489	28,871	(216)	559,144
クラスR - 分配型	ユーロ	31,115	-	-	31,115
円建クラス					
クラスA - 分配型	円	173,500	8,000	(18,000)	163,500

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2021年2月28日に終了した期間の合算発行済株式数計算書(続き)

	クラス通貨	期首発行済株式数	期中発行数	期中買戻数	期末発行済株式数
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ4					
ボンド建クラス					
クラスA - 累積型	ボンド	71,203	158	(18,682)	52,679
クラスA - 分配型	ボンド	21,628	-	-	21,628
クラスC - 累積型	ボンド	63,099	-	-	63,099
クラスC - 分配型	ボンド	37,728	181	-	37,909
クラスR - 累積型	ボンド	2,425,254	415,676	(281,899)	2,559,031
クラスR - 分配型	ボンド	1,404,955	189,590	(174,876)	1,419,669
米ドル建クラス					
クラスA - 累積型	米ドル	12,039	-	-	12,039
クラスA - 分配型	米ドル	18,000	1,500	-	19,500
クラスC - 累積型	米ドル	43,002	-	-	43,002
クラスC - 分配型	米ドル	90,741	-	-	90,741
クラスR - 累積型	米ドル	205,188	72,620	(12,285)	265,523
クラスR - 分配型	米ドル	114,360	-	-	114,360
ユーロ建クラス					
クラスA - 累積型	ユーロ	22,495	-	(8,873)	13,622
クラスA - 分配型	ユーロ	2,911	-	-	2,911
クラスC - 累積型	ユーロ	73,245	-	-	73,245
クラスR - 累積型	ユーロ	228,888	6,172	(59,857)	175,203
クラスR - 分配型	ユーロ	347,969	-	(69,832)	278,137
円建クラス					
クラスA - 分配型	円	17,000	-	-	17,000

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2021年2月28日に終了した期間の合算発行済株式数計算書(続き)

	クラス通貨	期首発行済株式数	期中発行数	期中買戻数	期末発行済株式数
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ5					
ボンド建クラス					
クラスA - 累積型	ポンド	15,031	114	-	15,145
クラスA - 分配型	ポンド	14,894	28	-	14,922
クラスC - 累積型	ポンド	9,643	-	-	9,643
クラスC - 分配型	ポンド	28,047	-	-	28,047
クラスR - 累積型	ポンド	949,111	76,784	(79,976)	945,919
クラスR - 分配型	ポンド	612,111	89,172	(14,695)	686,588
米ドル建クラス					
クラスA - 累積型	米ドル	9,317	-	(9,317)	-
クラスC - 累積型	米ドル	11,446	-	-	11,446
クラスC - 分配型	米ドル	219	1	-	220
クラスR - 累積型	米ドル	7,603	-	-	7,603
クラスR - 分配型	米ドル	247,569	-	-	247,569
ユーロ建クラス					
クラスA - 累積型	ユーロ	14,402	-	(5,343)	9,059
クラスC - 累積型	ユーロ	6,274	-	-	6,274
クラスC - 分配型	ユーロ	102,117	-	-	102,117
クラスR - 累積型	ユーロ	466,610	5,654	(22,256)	450,008

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2021年2月28日に終了した期間の合算発行済株式数計算書(続き)

	クラス通貨	期首発行済株式数	期中発行数	期中買戻数	期末発行済株式数
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ1					
ボンド建クラス					
クラスA - 累積型	ポンド	200,120	3,352	(45,684)	157,788
クラスA - 分配型	ポンド	324,937	2,669	(877)	326,729
クラスC - 累積型	ポンド	311,348	-	(272,480)	38,868
クラスC - 分配型	ポンド	82,313	287	(473)	82,127
クラスR - 累積型	ポンド	140,623	20,465	-	161,088
クラスR - 分配型	ポンド	344,548	-	(14,432)	330,116
米ドル建クラス					
クラスA - 累積型	米ドル	237,705	3,981	(21,324)	220,362
クラスA - 分配型	米ドル	852,973	728	-	853,701
クラスC - 累積型	米ドル	376,818	-	(285,165)	91,653
クラスR - 累積型	米ドル	2,949	-	-	2,949
ユーロ建クラス					
クラスA - 累積型	ユーロ	2,001,049	25,966	(156,891)	1,870,124
クラスA - 分配型	ユーロ	119,299	10,510	(35,399)	94,410
クラスC - 累積型	ユーロ	46,999	-	(32,106)	14,893
クラスC - 分配型	ユーロ	257,278	4,399	-	261,677
クラスR - 累積型	ユーロ	133,194	-	(83,654)	49,540
円建クラス					
クラスA - 分配型	円	4,500	-	-	4,500

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2021年2月28日に終了した期間の合算発行済株式数計算書(続き)

	クラス通貨	期首発行済株式数	期中発行数	期中買戻数	期末発行済株式数
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ2					
ボンド建クラス					
クラスA - 累積型	ボンド	437,197	15,277	(205,961)	246,513
クラスA - 分配型	ボンド	252,396	6,114	(38,333)	220,177
クラスC - 累積型	ボンド	275,250	6,850	(208,277)	73,823
クラスC - 分配型	ボンド	123,713	278	-	123,991
クラスR - 累積型	ボンド	993,042	79,541	(71,002)	1,001,581
クラスR - 分配型	ボンド	978,966	4,202	(30,804)	952,364
米ドル建クラス					
クラスA - 累積型	米ドル	1,092,275	3,610	(100,388)	995,497
クラスA - 分配型	米ドル	179,863	6,157	(29,959)	156,061
クラスC - 累積型	米ドル	99,842	-	(2,000)	97,842
クラスC - 分配型	米ドル	21,508	-	(1,100)	20,408
クラスR - 累積型	米ドル	24,314	-	-	24,314
クラスR - 分配型	米ドル	190,454	-	-	190,454
ユーロ建クラス					
クラスA - 累積型	ユーロ	3,730,997	35,031	(333,672)	3,432,356
クラスA - 分配型	ユーロ	427,295	855	(33,484)	394,666
クラスC - 累積型	ユーロ	285,349	-	(110,526)	174,823
クラスC - 分配型	ユーロ	102,265	5,223	-	107,488
クラスR - 累積型	ユーロ	195,319	-	(200)	195,119
クラスR - 分配型	ユーロ	123,952	-	(2,240)	121,712
円建クラス					
クラスA - 分配型	円	67,000	-	-	67,000

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2021年2月28日に終了した期間の合算発行済株式数計算書(続き)

	クラス通貨	期首発行済株式数	期中発行数	期中買戻数	期末発行済株式数
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ3					
ボンド建クラス					
クラスA - 累積型	ボンド	662,995	2,673	(271,687)	393,981
クラスA - 分配型	ボンド	2,627,952	24,651	(60,773)	2,591,830
クラスC - 累積型	ボンド	482,243	1,803	(249,870)	234,176
クラスC - 分配型	ボンド	701,245	4,168	(33,875)	671,538
クラスI - 分配型	ボンド	71,313	-	-	71,313
クラスR - 累積型	ボンド	3,172,112	116,510	(216,693)	3,071,929
クラスR - 分配型	ボンド	2,674,498	17,486	(319,114)	2,372,870
米ドル建クラス					
クラスA - 累積型	米ドル	1,454,290	3,407	(147,461)	1,310,236
クラスA - 分配型	米ドル	1,107,847	11,835	(17,122)	1,102,560
クラスC - 累積型	米ドル	349,875	-	(137,660)	212,215
クラスC - 分配型	米ドル	385,871	3,083	-	388,954
クラスR - 累積型	米ドル	360,013	6,111	(49,817)	316,307
クラスR - 分配型	米ドル	910,232	-	(2,129)	908,103
ユーロ建クラス					
クラスA - 累積型	ユーロ	6,252,405	44,200	(566,114)	5,730,491
クラスA - 分配型	ユーロ	569,922	10,413	(47,924)	532,411
クラスC - 累積型	ユーロ	239,924	-	(144,740)	95,184
クラスC - 分配型	ユーロ	178,576	1,139	-	179,715
クラスR - 累積型	ユーロ	121,707	7,115	(58,722)	70,100
クラスR - 分配型	ユーロ	226,092	-	-	226,092
クラスY - 累積型	ユーロ	809,366	5,850	(226,171)	589,045
円建クラス					
クラスA - 分配型	円	217,500	-	(69,500)	148,000

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2021年2月28日に終了した期間の合算発行済株式数計算書(続き)

	クラス通貨	期首発行済株式数	期中発行数	期中買戻数	期末発行済株式数
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ4					
ボンド建クラス					
クラスA - 累積型	ボンド	128,362	-	(56,602)	71,760
クラスA - 分配型	ボンド	459,905	296	(13,482)	446,719
クラスC - 分配型	ボンド	269,669	129	(7,493)	262,305
クラスI - 累積型	ボンド	55,560	-	-	55,560
クラスI - 分配型	ボンド	17,653	-	-	17,653
クラスR - 累積型	ボンド	722,813	26,451	(100,855)	648,409
クラスR - 分配型	ボンド	848,041	217	(34,067)	814,191
米ドル建クラス					
クラスA - 累積型	米ドル	225,828	1,907	(23,345)	204,390
クラスA - 分配型	米ドル	388,299	-	(84,700)	303,599
クラスR - 累積型	米ドル	17,129	-	-	17,129
クラスR - 分配型	米ドル	115,194	-	(1,089)	114,105
ユーロ建クラス					
クラスA - 累積型	ユーロ	1,325,854	6,538	(159,912)	1,172,480
クラスA - 分配型	ユーロ	97,165	-	-	97,165
クラスC - 累積型	ユーロ	43,155	-	(43,125)	30
クラスC - 分配型	ユーロ	12	-	-	12
クラスR - 累積型	ユーロ	8,023	-	-	8,023
クラスR - 分配型	ユーロ	50,043	-	-	50,043
クラスY - 累積型	ユーロ	208,916	9,767	(76,063)	142,620
円建クラス					
クラスA - 分配型	円	113,000	-	-	113,000

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2021年2月28日に終了した期間の合算発行済株式数計算書(続き)

	クラス通貨	期首発行済株式数	期中発行数	期中買戻数	期末発行済株式数
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ5					
ボンド建クラス					
クラスA - 累積型	ボンド	24,782	-	(2,537)	22,245
クラスA - 分配型	ボンド	83,535	-	(1,955)	81,580
クラスC - 累積型	ボンド	2,424	-	-	2,424
クラスC - 分配型	ボンド	37,024	-	-	37,024
クラスR - 累積型	ボンド	532,538	9,243	(224,116)	317,665
クラスR - 分配型	ボンド	135,120	-	(17,991)	117,129
米ドル建クラス					
クラスA - 累積型	米ドル	26,845	-	(26,845)	-
クラスA - 分配型	米ドル	91,289	378	(513)	91,154
クラスR - 累積型	米ドル	12,519	-	-	12,519
クラスR - 分配型	米ドル	78,667	-	-	78,667
ユーロ建クラス					
クラスA - 累積型	ユーロ	178,279	692	(17,595)	161,376
クラスA - 分配型	ユーロ	7,655	-	-	7,655
クラスC - 累積型	ユーロ	35,435	-	(23,559)	11,876
クラスC - 分配型	ユーロ	37,952	-	-	37,952
クラスR - 累積型	ユーロ	56,003	-	(43,474)	12,529
クラスR - 分配型	ユーロ	3,237	-	-	3,237
クラスY - 累積型	ユーロ	537,693	164	(122,652)	415,205

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2021年2月28日に終了した期間の合算発行済株式数計算書(続き)

	クラス通貨	期首発行済株式数	期中発行数	期中買戻数	期末発行済株式数
リキッド・オルタナティブ・ストラテジーズ					
ボンド建クラス					
クラスR - 累積型	ボンド	30,048,459	3,382,272	(13,521,640)	19,909,091
米ドル建クラス					
クラスA - 累積型	米ドル	622,215	-	-	622,215
クラスR - 累積型	米ドル	2,838,933	259,287	(216,116)	2,882,104
ユーロ建クラス					
クラスA - 累積型	ユーロ	630,236	-	(9,583)	620,653
クラスR - 累積型	ユーロ	492,725	230,395	(85,415)	637,705

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

財務諸表に対する注記

2021年2月28日に終了した期間

1. ファンドの概要

パークレイズ・ポートフォリオ(以下「ファンド」といいます。)は、商業会社に関する1915年8月10日法(改正済)の規定に基づき、2006年10月13日に変動資本を有する投資法人として設立され、投資信託/投資法人に関する2010年12月17日法(改正済)のパートに従って、投資信託/投資法人の公式リストに登録されているオープンエンド型の投資法人です。

ファンドは、個別の資産および負債を有する複数のサブ・ファンド(以下、それぞれを「サブ・ファンド」といいます。)から構成される、変動株式資本を有するアンブレラ型投資法人であり、各サブ・ファンドは、特定の投資目的を有する異なる資産ポートフォリオに関係しています。各サブ・ファンドの資産は、ファンドの帳簿上、ファンドの他の資産から分離されています。

2021年2月28日現在、ファンドはポンド建の11のサブ・ファンドを運用しています。

円建の株式を提供しないリキッド・オルタナティブ・ストラテジーズを除き、各サブ・ファンドは、ポンド建、米ドル建、ユーロ建および円建の株式クラスを提供しています。

ファンドは、管理会社契約に基づき、2019年3月28日付で、ファンドロック・マネジメント・カンパニー・エス・エイ(以下「ファンドロック」といいます。)をファンドの管理会社(以下「管理会社」といいます。)に任命しました。2019年3月27日までは、パークレイズ・アセット・マネジメント・リミテッド(以下「BAML」といいます。)がファンドの管理会社を務めていました。ファンドロックは、取締役会の全般的な監督に従い、ファンドに対するポートフォリオ管理およびリスク管理業務、管理業務ならびに販売業務の提供、ならびに、より一般的には、管理会社契約に詳細に規定されるファンドの日々の業務運営に責任を負います。

ファンドロックは、ルクセンブルグ大公国の法律に基づき設立され、ルクセンブルグ金融監督委員会(以下「CSSF」といいます。)により同法第15章に定められた管理会社として認可されています。したがって、ファンドロックはルクセンブルグの法律および規制を遵守する義務があります。CSSF規則およびファンドの事前の承認に基づき、管理会社はその義務および権限の全部または一部をいずれかの者または事業体に委託することができます。その機能の履行のため、ファンドに対する管理会社の責任は、委託による影響を受けません。管理会社による投資運用機能、販売機能および管理機能の委託に関する詳細な情報は、英文目論見書の該当箇所を参照してください。

管理会社は、管理会社とパークレイズ・インベストメント・ソリューションズ・リミテッドのウェルス・マネジメント部門との間の投資運用契約(随時行われる変更を含みます。)に基づき、同部門を投資運用会社に任命しています。

2. 重要な会計方針の要約

(a) 財務書類の表示

本財務書類は、投資信託/投資法人に関するルクセンブルグの法令規則およびルクセンブルグで一般に認められた会計原則(ルクセンブルグGAAP)に準拠して作成されています。

(b) 通貨の取扱い

ファンドの報告通貨はポンド(GBP)であり、ファンドの合算財務書類はポンド表示です。しかし、ファンドは、ポンド以外の通貨建ての資産に投資する場合があります。各サブ・ファンドの原資産の通貨エクスポージャーは、為替変動に対する保護の手段として、該当サブ・ファンドの基準通貨にヘッジすることができます。

外国通貨による取引は、取引日における実勢為替レートで換算されます。

サブ・ファンドの報告通貨以外の通貨で表示されるサブ・ファンドのすべての資産および負債は、2021年2月28日の中央ヨーロッパ時間午後11時現在における入手可能な直近の為替レートにより該当サブ・ファンドの報告通貨に換算されています。

これらの科目の換算より生じる為替差益または差損は、運用実績の決定の際に考慮されます。

ポンド	2021年2月28日現在
ユーロ	1.15184
香港ドル	10.84556
日本円	148.95366
スイスフラン	1.26570
米ドル	1.39810

(c) 投資有価証券の評価

英文目論見書に従い、本財務書類の目的上、2021年2月28日現在の評価が使用されています。

公設証券取引所への上場が認められている有価証券またはその他規制された市場で取引されている有価証券は、2021年2月28日の中央ヨーロッパ時間午後11時現在における入手可能な直近の市場価格の仲値で評価されています。

オープンエンド型の投資信託/投資法人により発行される受益証券/株式への投資の評価額は、その入手可能な直近の1口/1株当たりの純資産価格とします。

上場取引投資信託/投資法人により発行される受益証券/株式への投資の評価額は、証券取引所において入手可能な直近の1口/1株当たりの価格とします。

有価証券が複数の規制された市場に上場されている場合、当該有価証券の評価は、当該有価証券の主要市場である取引所または当該有価証券の評価に最も公正な基準を提供する取引所より入手した価格を用いて決定されます。

2021年2月28日現在サブ・ファンドのポートフォリオで保有される有価証券が証券取引所または規制された市場で値付または取引されていない場合、または規制された市場で値付または取引されているが、上記に従い決定された価格が入手できないかまたは当該有価証券の公正市場価額を表示していない場合には、その価格は、慎重かつ誠実に決定されるその推定換金価格を基に決定されます。

満期90日以内の流動性商品は、概ね時価に等しい償却原価法を用いて評価されます。

(d) 収益の取扱い

サブ・ファンドの資産には、投資先ファンドからの収益が含まれます。この収益は、関連する源泉税を控除した上で、配当落ち日に認識されます。

預金利息は発生主義で認識されます。

(e) 先物契約

ファンドの投資戦略の一環として、ファンドは、先物契約を締結することができます。先物契約の締結の際に差入れられる当初証拠金は、合算純資産計算書の現金預金に含まれます。先物契約は、2021年2月28日現在における反対売買決済コストで評価され、合算純資産計算書および投資明細表に記載されます。未決済の先物契約にかかる未実現利益または損失は、取引日の契約価格と、当該日の中央ヨーロッパ時間午後11時現在の時価の差額として毎日計算されます。投資明細表に開示されるように、約定額は、欧州証券市場監督局(ESMA)により公表されるガイドラインに従い計算され、各金融商品の原資産に対する同等ポジションの市場価値を表しています。

(f) 投資有価証券にかかる実現利益または損失(純額)

売却された投資有価証券にかかる実現利益または損失(純額)は、平均原価法で決定されます。

(g) 為替先渡契約

為替先渡契約は、満期までの残存期間について、2021年2月28日の中央ヨーロッパ時間午後11時現在の適用先渡レートで評価され、合算純資産計算書および投資明細表に表示されます。

為替先渡契約から生じる利益または損失は、当該契約の決済時点までは未実現利益または損失として表示され、かかる決済時点で当該利益または損失が実現されたものとして報告されます。

(h) 証券貸付取引

ファンドは、英文目論見書に記載される条件および制限に従ってのみ、有価証券の貸付取引を行うことができます。

ファンドにより貸し付けられた有価証券に支払われる収益は、当該有価証券の該当借主によりファンドに対し支払われます。

2021年2月28日現在、各サブ・ファンドに貸付有価証券はありません。また各サブ・ファンドは、当会計報告期間中に有価証券の貸付は行っておりません。

(i) 合算財務書類

ファンドの財務書類は英ポンドで表示され、サブ・ファンドの財務書類は各サブ・ファンドの通貨で表示されています。合算純資産計算書、合算損益計算書及び合算純資産変動計算書は、各サブ・ファンドの純資産計算書、損益計算書及び純資産変動計算書の合計を、会計期間末時点の為替レートを用いてファンドの通貨に換算(該当する場合)したものです。

(j) 分配金

ファンドは、以下の表に基づき、分配型株式を保有する各サブ・ファンドの株主に対し、通常、該当期間終了後2ヶ月以内に、分配金の支払いを宣言し、支払いを行います。

サブ・ファンド	分配金支払の頻度	該当期間末
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 1	毎月	毎月末
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 2	四半期毎	2月末、5月末 8月末、11月末
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 3	四半期毎	2月末、5月末 8月末、11月末
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 4	半期毎	2月末、8月末
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 5	半期毎	2月末、8月末
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 1	毎月	毎月末
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 2	四半期毎	2月末、5月末 8月末、11月末
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 3	四半期毎	2月末、5月末 8月末、11月末
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 4	半期毎	2月末、8月末
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 5	半期毎	2月末、8月末
リキッド・オルタナティブ・ストラテジーズ	年毎	8月末

分配金は、分配落ちの日にサブ・ファンドにより計上されます。

支払日から5年に亘り株主により請求のなかった分配金は、その権利を喪失し、該当サブ・ファンドに帰属します。

3. 管理会社

(a) 管理報酬

管理報酬

ファンドロック・マネジメント・カンパニー・エス・エイが管理会社に任命されました。義務および責任を遂行するための対価として、管理会社は、各サブ・ファンドの各クラスの純資産価額の0.016%（年率）の管理会社報酬を受領する権利を有します。これは毎月計算され、四半期毎に支払われます。

さらに、管理会社は、ファンドの資産から同社が提供する業務に関連するすべての合理的な実費（通常の商業レートによるものとし、付加価値税（もしあれば）が含まれます。）の払戻しを受ける権利を有するものとします。

管理会社に支払われた報酬は、2021年2月28日に終了した会計期間における合算損益計算書の「管理報酬」の項目に記載されています。

投資運用報酬および主販売会社報酬

2021年2月28日に終了した会計期間における合算損益計算書の「管理報酬」の項目には、義務および責任を遂行するための対価として、投資運用会社および主販売会社に支払われる報酬も含まれています。投資運用会社および主販売会社はそれぞれ、自己の報酬の一部を副投資運用会社および副販売会社に対して支払うことができます。

各サブ・ファンドの各クラスで設定されている現行の「管理報酬」の料率は、以下の表に記載されている通りです。かかる報酬は、該当するクラスの日々の純資産価額に基づき毎日発生し、四半期毎に後払いされます。

サブ・ファンド	管理報酬の料率				
	クラスA	クラスC	クラスI	クラスR	クラスY

パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 1	0.55%	0.45%	0.50%まで	0.30%	-
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 2	1.10%	0.70%	0.50%まで	0.35%	-
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 3	1.25%	0.75%	0.50%まで	0.35%	-
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 4	1.25%	0.75%	0.50%まで	0.35%	-
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 5	1.25%	0.75%	0.50%まで	0.35%	-
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 1	0.60%	0.50%	0.35%まで	0.45%	-
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 2	1.35%	0.95%	0.40%まで	0.75%	-
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 3	1.50%	1.00%	0.50%まで	0.75%	2.00%まで
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 4	1.50%	1.00%	0.50%まで	0.75%	2.00%まで
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 5	1.50%	1.00%	0.50%まで	0.75%	2.00%まで
リキッド・オルタナティブ・ストラテジーズ	1.00%まで	-	-	0.50%	-

(b) 投資先ファンドの管理報酬

各サブ・ファンドが投資する投資先ファンドについて、投資先ファンドの投資運用会社は、最大で下記の年率による管理報酬を受領することができます。

	管理報酬の年率 (%)
AKO UCITS Fund ICAV - AKO Global UCITS Fund	1.50
Barclays Capital Emerging Markets Local Bond UCITS ETF †	0.55
Barclays UK Equity Income Fund †	0.75
BlackRock Strategic Funds - BlackRock Global Event Driven Accumulating Fund	0.50
BlackRock Strategic Funds - BlackRock Global Event Driven Income Fund	1.00
DB Platinum IV Systematic Alpha Fund	0.95
GlobalAccess Asia Pacific (ex-Japan) Fund*	0.75
GlobalAccess Emerging Market Debt Fund*	0.70
GlobalAccess Emerging Market Equity Fund*	0.94
GlobalAccess Emerging Market Local Currency Debt Fund*	0.75
GlobalAccess Europe (ex-UK) Alpha Fund*	0.75
GlobalAccess Global Corporate Bond Fund*	0.55
GlobalAccess Global Government Bond Fund*	0.45
GlobalAccess Global High Yield Bond Fund*	0.70
GlobalAccess Global Short Duration Bond Fund*	0.55
GlobalAccess Japan Fund*	0.80
GlobalAccess UK Opportunities Fund*	0.73
GlobalAccess US Equity Fund*	0.50
GlobalAccess US Small & Mid Cap Equity Fund*	0.90
Institutional Cash Series Plc - Institutional Sterling Liquidity Fund	0.13
iShares \$ Corporate Bond UCITS ETF	0.20
iShares \$ Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF USD (Dist)	0.07
iShares € Government Bond 1-3yr UCITS ETF	0.20

管理報酬の年率

(%)

iShares Core £ Corporate Bond UCITS ETF	0.20
iShares Core € Corporate Bond UCITS ETF	0.20
iShares Core EURO STOXX 50 UCITS ETF	0.10
iShares Core FTSE 100 UCITS ETF	0.07
iShares Core MSCI EM IMI UCITS ETF	0.18
iShares Core MSCI Japan IMI UCITS ETF	0.15
iShares Core MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF	0.20
iShares Core S&P 500 UCITS ETF	0.07
iShares Emerging Markets Government Bond Index Fund	0.20
iShares Emerging Markets Index Fund	0.00
iShares Euro Government Bond Index Fund	0.03
iShares Euro Investment Grade Corporate Bond Index Fund	0.12
iShares Europe ex-UK Index Fund	0.00
iShares Global Corp Bond UCITS ETF	0.20
iShares Global Government Bond UCITS ETF	0.20
iShares Global High Yield Corp Bond UCITS ETF	0.50
iShares Global Inflation Linked Government Bond UCITS ETF	0.20
iShares J.P. Morgan \$ EM Bond UCITS ETF	0.50
iShares Japan Index Fund	0.30
iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF	0.50
iShares North America Index Fund	0.30
iShares Pacific Index Fund	0.00
iShares UK Credit Bond Index Fund	0.15
iShares UK Index Fund	0.30
iShares US Corporate Bond Index Fund	0.03
iShares US Index Fund	0.00
iShares World ex-Euro Government Bond Index Fund	0.03
Janus Henderson Horizon Pan European Absolute Return Fund	1.00
Kepler Liquid Strategies ICAV - KLS Arete Macro Fund	1.50
Lyxor Dimension IRL - Lyxor/Tiedemann Arbitrage Strategy Fund	1.40
Man Funds VI plc - Man GLG Alpha Select Alternative Fund	0.75
PIMCO GIS Global Real Return Fund	0.49
Principal Global Investors	
- Finisterre Unconstrained Emerging Markets Fixed Income Fund	0.55
Royal London Cash Plus Fund	0.11
Schroder Absolute UK Dynamic Fund	1.00
Schroder GAIA Egerton Equity Fund	1.25
Schroder GAIA Two Sigma Diversified Fund	1.40
U Access IRL Trend Macro Fund	1.50
Veritas Global Real Return Fund	0.85

† これらのファンドはパークレイズ・マルチマネジャー・ファンド(UKシリーズ2)の一部を構成します。

* これらのファンドはパークレイズ・マルチマネジャー・ファンド・ピーエルシーの一部を構成します。

4. 税金

現行法令の下では、ファンドの収益またはキャピタル・ゲインに対してルクセンブルグの税金は課税されません。ただし、ファンドには、各サブ・ファンドの純資産価額に対して、各暦四半期末で計算され支払われる、年率0.05%の料率による年次税 (taxe d'abonnement) が課税されます。ただし、すでに当該税金の対象となっている他のルクセンブルグの投資信託 / 投資法人への各サブ・ファンドの投資には課税されず、支払われません。

各サブ・ファンドの機関投資家向のクラス株式については、年次税の年率は0.01%に軽減されます。

各サブ・ファンドが受領する配当収益および利息収益は、発行国において回収不能な源泉税の対象となる場合があります。

5. サブ・ファンドの費用

(a) 管理事務代行報酬および保管銀行報酬

当会計期間中、ノーザン・トラスト・グローバル・サービスズ SEは、ファンドと本社との間の管理事務代行契約に従い、管理事務代行会社、登録・名義書換代行会社、所在地事務代行会社として行いました。

当会計期間中、ノーザン・トラスト・グローバル・サービスズ SEは、ファンドと本社との間の保管および支払代行契約に従い、その資産の保管銀行兼支払代行会社として行いました。

管理事務代行会社および保管銀行は、各サブ・ファンドの純資産価額の年率0.25%を上限とする総額の年次報酬を受領する権利を有します。管理事務代行会社は、通常の商業的レートにより、一定の立替払費用、名義書換代行報酬、財務書類の作成費用および登録報酬を受領する権利を有します。保管銀行は、通常の商業的レートにより、副保管報酬、取引手数料および立替払費用の弁済をファンドから受ける権利を有します。

管理事務代行会社および保管銀行の報酬は、各サブ・ファンドの日々の純資産価額に基づき毎日発生し、各サブ・ファンドの資産の中から毎月後払いされます。

(b) 費用の上限

以下のファンドは、サブ・ファンドのすべての管理事務費用（管理料、代行手数料、登録料、および保管料）として16bpsの上限を設けています。上限は日々計算されます。

パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 1
 パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 2
 パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 3
 パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 4
 パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 5

以下のサブ・ファンドの各クラスで、費用の上限が設けられています。かかる費用の上限は以下の通りです。

ファンド	クラスA (%)	クラスC (%)	クラスR (%)
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 1	0.65	0.55	0.45
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 2	1.35	0.85	0.45
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 3	1.35	0.85	0.45
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 4	1.35	0.85	0.45
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 5	1.35	0.85	0.45

上限は損益計算書の「費用の免除 / 返還」系列項目に開示されています。

(c) 為替ヘッジ運用会社報酬

当会計期間中、投資運用会社は、ファンドおよびサブ・ファンドに為替ヘッジ業務を提供しました。

為替ヘッジ運用会社は、為替ヘッジ付株式クラスに関して締結したすべての為替先渡契約の毎月の純通貨価額の0.10%を上限とする報酬を受領する権利を有します。為替ヘッジ付株式クラスによって負担される、為替ヘッジ運用会社の報酬を含むすべての費用ならびに為替ヘッジ取引の結果為替ヘッジ付株式クラスに発生した利益 / 損失は、該当するクラスに発生し、当該クラスに帰属 / 請求されます。

6. リサーチ費用

2018年1月3日に施行された、欧州連合（EU）の金融商品市場指令2004 / 39 / ECの改正版（以下「MiFID 2指令」といいます。）における市場に係る指令2014 / 65 / EUの実施の一環として、ブローカーへの売買手数料の使用に関する改訂ルールが導入されました。これに従って、投資運用会社は今後、投資リサーチの費用をブローカーへの売買手数料から支払うことはありません。

投資運用会社は、ファンドへのサービス提供に関連して第三者から受領したすべてのリサーチ（FCA規則に定義される）について、自身の資金から直接支払いを行います。

2020年9月1日から2021年2月28日までにファンドにおいて生じたリサーチ費用は、すべて投資運用会社により支払われています。

7. 関連当事者取引

管理会社、投資運用会社および副投資運用会社ならびにそれらの各関係者は、投資運用会社、副投資運用会社またはそれらの関係者が取り決めを結んだその他の者により、またはかかるその他の者を通じて取引を行うことができます。かかる取引（もしあれば）は通常の業務の一部として、通常の商業的条件で行われています。

8. 希薄化

有価証券の評価は、注記2(c)に記載される方法により評価されます。かかる評価の際にサブ・ファンドの資産の売買にかかる実際の費用が考慮される場合には、原投資対象の売買に係る取引手数料およびスプレッドにより差異が生じます。これらの費用はサブ・ファンドの評価に悪影響を与えるもので、「希薄化」と呼ばれています。

希薄化の影響を緩和するために、取締役会は、その裁量により、1株当たり純資産価格の希薄化調整を行うことができます。調整が必要となるか否かは、当該評価日における当該サブ・ファンドの申込みおよび買戻しの量によります。取締役会は、希薄化調整を行わなければ既存株主（申込みの場合）または残存株主（買戻しの場合）が悪影響を受けると判断した場合には、その裁量により、希薄化調整を行うことができます。希薄化調整は、サブ・ファンドが正味申込超過ポジションにある場合は、税金、手数料およびスプレッドを賄うために適切であると取締役会が判断する数値を1株当たり純資産価格に加算し、サブ・ファンドが正味買戻超過ポジションにある場合には、税金、手数料およびスプレッドを賄うために適切であると取締役会が判断する数値を1株当たり純資産価格から差し引きます。希薄化調整が行われた場合、該当サブ・ファンドが正味申込超過ポジションにある場合には価格が当該調整額分増加し、該当サブ・ファンドが正味買戻超過ポジションにある場合には価格が当該調整額分減少します。これは、日々の申込みと買戻しの数量に従って、毎日行われます。取締役会は、希薄化調整の規模に関して定期的な見直しを行います。適用される基準は0.5%です。2021年2月28日現在、すべてのファンドにおいて適用可能な最大スウィング・ファクターは0.15%です。

2021年2月28日現在の合算純資産計算書につきましては、スウィング・プライシング調整は適用を除外しています。

2021年2月28日現在の1株当たりの資産価格はスウィング・プライシング調整（適用できる場合）されています。2021年2月28日時点では、スウィング・プライシング調整はパークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ2およびパークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ4に対してのみ適用されています。当会計期間において、すべてのファンドにスウィング・プライシング調整が適用されています。

9. 投資ポートフォリオの変動

投資ポートフォリオのすべての売買を記載した投資明細表がファンドの登記上の事務所に保管されています。当該明細表は、閲覧が可能であり、かつ写しを入手することができます。

[次へ](#)

10. 分配

当会計期間についての分配金は以下の通りです。

	クラスA - 分配型	クラスC - 分配型	クラスI - 分配型	クラスR - 分配型	クラスY - 分配型
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 1					
ボンド建クラス					
2020年9月15日支払	0.008626	該当なし	該当なし	0.008595	該当なし
2020年10月15日支払	0.054566	該当なし	該当なし	0.054395	該当なし
2020年11月16日支払	0.009982	該当なし	該当なし	0.009951	該当なし
2020年12月15日支払	0.006819	該当なし	該当なし	0.006797	該当なし
2021年1月18日支払	0.005585	該当なし	該当なし	0.005570	該当なし
2021年2月15日支払	0.004785	該当なし	該当なし	0.004774	該当なし
米ドル建クラス					
2020年9月15日支払	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし
2020年10月15日支払	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし
2020年11月16日支払	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし
2020年12月15日支払	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし
2021年1月18日支払	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし
2021年2月15日支払	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし
ユーロ建クラス					
2020年9月15日支払	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし
2020年10月15日支払	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし
2020年11月16日支払	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし
2020年12月15日支払	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし
2021年1月18日支払	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし
2021年2月15日支払	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし
円建クラス					
2020年9月15日支払	0.735314	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし
2020年10月15日支払	4.535271	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし
2020年11月16日支払	0.813779	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし
2020年12月15日支払	0.573240	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし
2021年1月18日支払	0.472164	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし
2021年2月15日支払	0.406163	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 2					
ボンド建クラス					
2020年9月15日支払	0.063956	0.069893	該当なし	0.076533	該当なし
2020年12月15日支払	0.070919	0.077566	該当なし	0.085001	該当なし
米ドル建クラス					
2020年9月15日支払	0.073741	該当なし	該当なし	0.073402	該当なし
2020年12月15日支払	0.079720	該当なし	該当なし	0.079501	該当なし
ユーロ建クラス					
2020年9月15日支払	0.052395	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし
2020年12月15日支払	0.057766	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし
円建クラス					
2020年9月15日支払	5.437245	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし
2020年12月15日支払	5.886674	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 3					
ボンド建クラス					
2020年9月15日支払	0.077646	0.087081	該当なし	0.080745	該当なし
2020年12月15日支払	0.092199	0.103510	該当なし	0.096056	該当なし
米ドル建クラス					
2020年9月15日支払	0.072451	0.073722	該当なし	0.098626	該当なし

	クラスA - 分配型	クラスC - 分配型	クラスI - 分配型	クラスR - 分配型	クラスY - 分配型
2020年12月15日支払 ユーロ建クラス	0.083105	0.084679	該当なし+	0.113336	該当なし+
2020年9月15日支払	0.070056	0.088797	該当なし+	0.079278	該当なし+
2020年12月15日支払 円建クラス	0.082568	0.104786	該当なし+	0.093626	該当なし+
2020年9月15日支払	6.277077	該当なし+	該当なし+	該当なし+	該当なし+
2020年12月15日支払	7.218360	該当なし+	該当なし+	該当なし+	該当なし+
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 4					
2020年9月15日支払 米ドル建クラス	0.075650	0.101080	該当なし+	0.135318	該当なし+
2020年9月15日支払 ユーロ建クラス	0.061482	0.126922	該当なし+	0.169973	該当なし+
2020年9月15日支払 円建クラス	0.047997	該当なし+	該当なし+	0.110933	該当なし+
2020年9月15日支払	5.128764	該当なし+	該当なし+	該当なし+	該当なし+
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 5					
2020年9月15日支払 米ドル建クラス	0.051327	0.104437	該当なし+	0.137405	該当なし+
2020年9月15日支払 ユーロ建クラス	該当なし+	0.114639	該当なし+	0.169856	該当なし+
2020年9月15日支払 円建クラス	該当なし+	0.091151	該当なし+	該当なし+	該当なし+
2020年9月15日支払	該当なし+	該当なし+	該当なし+	該当なし+	該当なし+
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 1					
2020年9月15日支払 米ドル建クラス	0.011642	0.011776	該当なし+	0.011890	該当なし+
2020年10月15日支払	0.009724	0.009837	該当なし+	0.009934	該当なし+
2020年11月16日支払	0.010876	0.011003	該当なし+	0.011111	該当なし+
2020年12月15日支払	0.021173	0.021422	該当なし+	0.021633	該当なし+
2021年1月18日支払	0.007190	0.007275	該当なし+	0.007348	該当なし+
2021年2月15日支払	0.007815	0.007908	該当なし+	0.007987	該当なし+
2020年9月15日支払 ユーロ建クラス	0.012329	該当なし+	該当なし+	該当なし+	該当なし+
2020年10月15日支払	0.009488	該当なし+	該当なし+	該当なし+	該当なし+
2020年11月16日支払	0.010608	該当なし+	該当なし+	該当なし+	該当なし+
2020年12月15日支払	0.021403	該当なし+	該当なし+	該当なし+	該当なし+
2021年1月18日支払	0.007346	該当なし+	該当なし+	該当なし+	該当なし+
2021年2月15日支払	0.008037	該当なし+	該当なし+	該当なし+	該当なし+
2020年9月15日支払 円建クラス	0.010767	0.012733	該当なし+	該当なし+	該当なし+
2020年10月15日支払	0.008793	0.010401	該当なし+	該当なし+	該当なし+
2020年11月16日支払	0.009885	0.011693	該当なし+	該当なし+	該当なし+
2020年12月15日支払	0.019318	0.022853	該当なし+	該当なし+	該当なし+
2021年1月18日支払	0.006512	0.007707	該当なし+	該当なし+	該当なし+
2021年2月15日支払	0.007229	0.008555	該当なし+	該当なし+	該当なし+
2020年9月15日支払 ユーロ建クラス	1.220666	該当なし+	該当なし+	該当なし+	該当なし+
2020年10月15日支払	0.955680	該当なし+	該当なし+	該当なし+	該当なし+
2020年11月16日支払	1.060778	該当なし+	該当なし+	該当なし+	該当なし+
2020年12月15日支払	2.138888	該当なし+	該当なし+	該当なし+	該当なし+

	クラスA - 分配型	クラスC - 分配型	クラスI - 分配型	クラスR - 分配型	クラスY - 分配型
2021年1月18日支払	0.730180	該当なし+	該当なし+	該当なし+	該当なし+
2021年2月15日支払	0.809889	該当なし+	該当なし+	該当なし+	該当なし+
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 2					
ボンド建クラス					
2020年9月15日支払	0.041126	0.043459	該当なし+	0.044636	該当なし+
2020年12月15日支払	0.052057	0.055072	該当なし+	0.056595	該当なし+
米ドル建クラス					
2020年9月15日支払	0.044057	0.053603	該当なし+	0.047876	該当なし+
2020年12月15日支払	0.052275	0.063675	該当なし+	0.056906	該当なし+
ユーロ建クラス					
2020年9月15日支払	0.036078	0.037446	該当なし+	0.039209	該当なし+
2020年12月15日支払	0.045136	0.046903	該当なし+	0.049136	該当なし+
円建クラス					
2020年9月15日支払	4.750208	該当なし+	該当なし+	該当なし+	該当なし+
2020年12月15日支払	5.693597	該当なし+	該当なし+	該当なし+	該当なし+
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 3					
ボンド建クラス					
2020年9月15日支払	0.047000	0.050335	0.053910	0.052079	該当なし+
2020年12月15日支払	0.057685	0.061866	0.066361	0.064053	該当なし+
米ドル建クラス					
2020年9月15日支払	0.050103	0.060696	該当なし+	0.055611	該当なし+
2020年12月15日支払	0.057491	0.069746	該当なし+	0.063945	該当なし+
ユーロ建クラス					
2020年9月15日支払	0.040106	0.043141	該当なし+	0.044583	該当なし+
2020年12月15日支払	0.048646	0.052402	該当なし+	0.054190	該当なし+
円建クラス					
2020年9月15日支払	5.013636	該当なし+	該当なし+	該当なし+	該当なし+
2020年12月15日支払	5.816188	該当なし+	該当なし+	該当なし+	該当なし+
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 4					
ボンド建クラス					
2020年9月15日支払	該当なし+	0.016449	0.054931	0.034190	該当なし+
米ドル建クラス					
2020年9月15日支払	該当なし+	該当なし+	該当なし+	0.032086	該当なし+
ユーロ建クラス					
2020年9月15日支払	該当なし+	0.057363	該当なし+	0.025515	該当なし+
円建クラス					
2020年9月15日支払	該当なし+	該当なし+	該当なし+	該当なし+	該当なし+
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 5					
ボンド建クラス					
2020年9月15日支払	- *	該当なし+	該当なし+	0.009897	該当なし+
米ドル建クラス					
2020年9月15日支払	- *	該当なし+	- *	0.006511	該当なし+
ユーロ建クラス					
2020年9月15日支払	- *	該当なし+	該当なし+	0.004880	該当なし+
円建クラス					
2020年9月15日支払	該当なし+	該当なし+	該当なし+	該当なし+	該当なし+
リキッド・オルタナティブ・ストラテジーズ					
ボンド建クラス					
2020年9月15日支払	該当なし+	該当なし+	該当なし+	該当なし+	該当なし+

	クラスA - 分配型	クラスC - 分配型	クラスI - 分配型	クラスR - 分配型	クラスY - 分配型
米ドル建クラス 2020年9月15日支払	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
ユーロ建クラス 2020年9月15日支払	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†

* 費用が収益を上回ったため、当該株式クラスについては分配金はありませんでした。

† 支払日において、当該株式クラスにおいて株式は発行されていません。

累積型株式については分配金はありますが、投資収益および発生利益は留保され、再投資されます。

[次へ](#)

11. 為替取引

本注記2（b）に記載のとおり、ファンドの報告通貨はポンドであり、すべてのサブ・ファンドはポンドを報告通貨として使用しています。ファンドまたは各サブ・ファンドは、報告通貨以外の通貨建の資産に投資することがあります。

各サブ・ファンドの原資産の通貨エクスポージャーは、為替変動に対する保護の一手段として、当該サブ・ファンドの報告通貨にヘッジされます。

ファンドは、各サブ・ファンド内に、同じ特徴を有するが当該サブ・ファンドの報告通貨以外の異なる通貨で表示される複数のクラスを設けることができます。報告通貨以外の通貨で表示されるファンド株式は、報告通貨に対してヘッジされます。

ファンドの一定のサブ・ファンドは、一定の株式クラスの通貨をヘッジする目的で為替取引を行うことがあります。これらの為替取引による損益は、各該当株式クラスに割当てられます。

2021年2月28日現在で保有する為替先渡契約は、各サブ・ファンドの投資明細表に記載されており、当該契約に附随する損益は、合算純資産計算書および合算純資産額変動計算書に含まれています。

12. 取引費用および仲介手数料

2020年9月1日から2021年2月28日までに発生した各サブ・ファンドの取引費用は、譲渡可能な有価証券、デリバティブまたはその他適格資産の購入または売却に関係します。取引費用には、手数料費用、決済手数料、仲介手数料および預託取引手数料を含みます。手数料費用、決済手数料および仲介手数料は、当期間の合算損益計算書の投資にかかる実現利益（純額）の一部に含まれています。預託取引手数料は、当会計期間の合算損益計算書の管理事務代行報酬および保管銀行報酬の一部に含まれています。2021年2月28日に終了した会計期間中に発生した取引費用は、以下の通りです。

サブ・ファンド	取引費用（ポンド）
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ1	995
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ2	6,313
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ3	9,295
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ4	3,500
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ5	2,732
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ1	2,689
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ2	5,022
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ3	12,840
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ4	6,844
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ5	2,686
リキッド・オルタナティブ・ストラテジーズ	4

13. 世界全体のエクスポージャー

ファンドおよび投資マネジャーは、各サブ・ファンドのポジションのリスクおよびそれらが当該サブ・ファンドのリスクプロファイル全般に寄与する割合を常に監視し測定することを可能にするリスク管理プロセスを採用します。ファンドおよび投資マネジャーは、適用ある場合、店頭デリバティブ商品の正確かつ独立した価格評価のための手続きを採用します。

投資マネジャーは、各サブ・ファンドの世界全体のエクスポージャーの決定に関して、コミットメント法を適用します。

14. 当期間における重要事象

取締役の意見では、2021年2月28日に終了した会計期間において、当期末に財務諸表の修正または開示を必要とする重要な事象はありませんでした。

15. 後発事象

2020年3月24日に発行されたファンドの目論見書に代わって、2021年3月3日に新しい目論見書が発行されました。

当期末以降、取締役の意見において、2021年2月28日に終了した会計期間の財務書類に対する修正または当該財務書類における開示が要求される重大な事象は生じていません。

[次へ](#)

(2) 投資有価証券明細表等

パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 1

2021年2月28日現在の投資明細表(ボンド表示)

すべての保有有価証券は別途記載のない限り投資信託/投資法人の受益証券/株式です。

投 資	保有	時価 (ボンド)	純資産に 対する割合 (%)
投資信託/投資法人 100.10%			
iShares \$ Corporate Bond UCITS ETF	6,672	602,638	8.26
iShares \$ Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF USD (Dist)	10,900	1,048,753	14.37
iShares € Government Bond 1-3yr UCITS ETF	6,616	824,543	11.30
iShares Core £ Corporate Bond UCITS ETF	394	60,311	0.83
iShares Core € Corporate Bond UCITS ETF	2,606	303,847	4.16
iShares Core EURO STOXX 50 UCITS ETF	244	25,511	0.35
iShares Core FTSE 100 UCITS ETF	166	1,059	0.01
iShares Core MSCI EM IMI UCITS ETF	71	1,887	0.03
iShares Core MSCI Japan IMI UCITS ETF	613	22,296	0.30
iShares Core MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF	226	27,925	0.38
iShares Core S&P 500 UCITS ETF	32	8,821	0.12
iShares Emerging Markets Government Bond Index Fund	5,649	431,229	5.91
iShares Emerging Markets Index Fund	18,445	275,547	3.78
iShares Euro Government Bond Index Fund	29,125	253,738	3.48
iShares Euro Investment Grade Corporate Bond Index Fund	11,591	108,602	1.49
iShares Europe ex-UK Index Fund	7,706	122,074	1.67
iShares Global Government Bond UCITS ETF	4	332	0.00
iShares Global High Yield Corporate Bond UCITS ETF	7,731	550,071	7.54
iShares Global Inflation Linked Government Bond UCITS ETF	132,349	655,895	8.99
iShares Japan Index Fund	4,606	55,535	0.76
iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF	7,902	320,852	4.40
iShares North America Index Fund	29,694	689,978	9.46
iShares Pacific Index Fund	525	6,995	0.10
iShares UK Credit Bond Index Fund	3,415	42,990	0.59
iShares UK Index Fund	3,856	38,563	0.53
iShares US Corporate Bond Index Fund	44,783	337,013	4.62
iShares World ex-Euro Government Bond Index Fund	69,379	487,088	6.67
投資信託/投資法人合計		7,304,093	100.10
投資有価証券合計(取得原価 7,263,253 ボンド)		7,304,093	100.10

為替先渡契約にかかる未実現利益 1.86%

Sold Australian Dollar for Sterling - Maturing 03/03/2021	AUD\$54,762		
	£30,597	272	0.01
Sold Canadian Dollars for Sterling - Maturing 03/03/2021	CAD\$46,843		
	£26,701	237	-
Sold Danish Kroner for Sterling - Maturing 03/03/2021	DKK47,186		
	£5,615	106	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 03/03/2021	€2,824,397		
	£2,499,874	47,794	0.66
Sold Hong Kong Dollar for Sterling - Maturing 03/03/2021	HKD\$36,635		
	£3,440	62	-
Sold Japanese Yen for Sterling - Maturing 03/03/2021	¥30,415,348		
	£211,587	7,394	0.10
Sold New Zealand Dollar for Sterling - Maturing 03/03/2021	NZD\$718		
	£377	3	-

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
Sold Norwegian Krone for Sterling - Maturing 03/03/2021	NOK26,614		
	£2,266	55	-
Sold Singapore Dollar for Sterling - Maturing 03/03/2021	SGD\$2,321		
	£1,273	25	-
Sold Swedish Krona for Sterling - Maturing 03/03/2021	SEK49,879		
	£4,361	114	-
Sold Swiss Franc for Sterling - Maturing 03/03/2021	CHF4,165		
	£3,412	121	-
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 03/03/2021	\$6,100,278		
	£4,441,781	78,519	1.08
Sold Euro for Sterling - Maturing 07/04/2021	€1,200,000		
	£1,042,470	5	-
Sold Japanese Yen for Sterling - Maturing 07/04/2021	¥23,548,611		
	£158,126	6	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 07/04/2021	£24,840		
	\$34,737	-	-
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 07/04/2021	\$6,984,711		
	£4,995,592	819	0.01
為替先渡契約にかかる未実現利益合計		135,532	1.86
為替先渡契約にかかる未実現損失 (1.29%)			
Sold Sterling for Australian Dollar - Maturing 03/03/2021	£8,343		
	\$14,992	(41)	-
Sold Sterling for Canadian Dollars - Maturing 03/03/2021	£7,416		
	CAD\$12,968	(90)	-
Sold Sterling for Danish Krone - Maturing 03/03/2021	£1,225		
	DKK10,413	(9)	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 03/03/2021	£725,941		
	€823,905	(10,645)	(0.15)
Sold Sterling for Hong Kong Dollar - Maturing 03/03/2021	£803		
	\$8,498	(20)	-
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 03/03/2021	£56,957		
	¥8,215,822	(1,800)	(0.02)
Sold Sterling for Swedish Krona - Maturing 03/03/2021	£805		
	SEK9,315	(11)	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 03/03/2021	£1,271,636		
	\$1,735,566	(30,261)	(0.41)
Sold Sterling for Euro - Maturing 18/03/2021	£961,946		
	€1,098,743	(7,817)	(0.11)
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 18/03/2021	£772,487		
	¥112,280,617	(18,645)	(0.26)
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 18/03/2021	£2,602,892		
	\$3,604,792	(24,756)	(0.34)
Sold Australian Dollar for Sterling - Maturing 07/04/2021	AUD\$41,798		
	£23,144	-	-
Sold Canadian Dollars for Sterling - Maturing 07/04/2021	CAD\$33,875		
	£19,135	(1)	-
Sold Danish Kroner for Sterling - Maturing 07/04/2021	DKK44,386		
	£5,184	-	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 07/04/2021	€800,492		
	£695,401	(3)	-
Sold Hong Kong Dollar for Sterling - Maturing 07/04/2021	HKD\$28,138		
	£2,594	-	-
Sold New Zealand Dollar for Sterling - Maturing 07/04/2021	NZD\$718		
	£373	-	-

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
Sold Norwegian Krone for Sterling - Maturing 07/04/2021	NOK26,614		
	£2,210	-	-
Sold Singapore Dollar for Sterling - Maturing 07/04/2021	SGD\$2,321		
	£1,248	-	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 07/04/2021	£86,484		
	€99,550	(3)	-
Sold Swedish Krona for Sterling - Maturing 07/04/2021	SEK57,777		
	£4,920	-	-
Sold Swiss Franc for Sterling - Maturing 07/04/2021	CHF9,340		
	£7,385	-	-
為替先渡契約にかかる未実現損失合計		(94,102)	(1.29)
為替先渡契約にかかる未実現利益(純額)合計		41,430	0.57
ポートフォリオ合計 §		7,345,523	100.67
その他純負債		(48,755)	(0.67)
純資産合計		7,296,768	100.00

これらの未決済の為替先渡契約の相手方はバンク・オブ・アメリカ、パークレイズ・バンク・ユークー・ピーエルシー、BNPパリバ、シティバンク、ゴールドマン・サックス・インターナショナル、JPモルガン・チェース銀行、モルガン・スタンレー、ロイヤル・バンク・オブ・カナダ、スタンダードチャータード銀行およびノーザン・トラスト・カンパニーです。

§ デリバティブ資産および負債を含みます。

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 2

2021年2月28日現在の投資明細表(債券表示)

すべての保有有価証券は別途記載のない限り投資信託/投資法人の受益証券/株式です。

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
投資信託/投資法人	99.20%		
iShares \$ Corporate Bond UCITS ETF	27,447	2,479,109	4.30
iShares \$ Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF USD (Dist)	51,731	4,977,345	8.63
iShares € Government Bond 1-3yr UCITS ETF	31,181	3,886,044	6.74
iShares Core £ Corporate Bond UCITS ETF	1,603	245,378	0.43
iShares Core € Corporate Bond UCITS ETF	10,571	1,232,526	2.14
iShares Core EURO STOXX 50 UCITS ETF	825	86,256	0.15
iShares Core FTSE 100 UCITS ETF	1,250	7,972	0.01
iShares Core MSCI EM IMI UCITS ETF	177	4,705	0.01
iShares Core MSCI Japan IMI UCITS ETF	14,799	538,275	0.93
iShares Core MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF	3,054	377,363	0.65
iShares Core S&P 500 UCITS ETF	2,863	789,159	1.37
iShares Emerging Markets Government Bond Index Fund	48,180	3,677,652	6.38
iShares Emerging Markets Index Fund	297,705	4,447,378	7.71
iShares Euro Government Bond Index Fund	146,273	1,274,315	2.21
iShares Euro Investment Grade Corporate Bond Index Fund	138,908	1,301,546	2.26
iShares Europe ex-UK Index Fund	126,672	2,006,736	3.48
iShares Global Government Bond UCITS ETF	3,187	264,558	0.46
iShares Global High Yield Corporate Bond UCITS ETF	66,603	4,738,890	8.22
iShares Global Inflation Linked Government Bond UCITS ETF	756,604	3,749,578	6.50
iShares Japan Index Fund	46,657	562,542	0.98
iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF	69,207	2,810,074	4.87
iShares North America Index Fund	427,987	9,944,854	17.25
iShares Pacific Index Fund	8,969	119,473	0.21
iShares UK Credit Bond Index Fund	40,532	510,261	0.88
iShares UK Index Fund	55,533	555,395	0.96
iShares US Corporate Bond Index Fund	534,717	4,023,979	6.98
iShares World ex-Euro Government Bond Index Fund	368,939	2,590,213	4.49
投資信託/投資法人合計		57,201,576	99.20
投資有価証券合計(取得原価 54,003,396 ポンド)		57,201,576	99.20

為替先渡契約にかかる未実現利益 1.07%

Sold Australian Dollar for Sterling - Maturing 03/03/2021	AUD\$232,698		
	£130,014	1,157	-
Sold Canadian Dollars for Sterling - Maturing 03/03/2021	CAD\$225,255		
	£128,400	1,137	-
Sold Danish Kroner for Sterling - Maturing 03/03/2021	DKK213,645		
	£25,423	479	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 03/03/2021	€11,904,692		
	£10,536,331	200,937	0.35
Sold Hong Kong Dollar for Sterling - Maturing 03/03/2021	HKD\$201,973		
	£18,967	344	-
Sold Japanese Yen for Sterling - Maturing 03/03/2021	¥132,323,524		
	£919,947	31,593	0.06
Sold New Zealand Dollar for Sterling - Maturing 03/03/2021	NZD\$3,879		
	£2,036	18	-
Sold Norwegian Krone for Sterling - Maturing 03/03/2021	NOK169,464		
	£14,426	351	-
Sold Singapore Dollar for Sterling - Maturing 03/03/2021	SGD\$12,661		

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
	£6,946	136	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 03/03/2021	£192,142		
	€222,856	1,337	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 03/03/2021	£247,933		
	\$349,753	2,230	0.01
Sold Swedish Krona for Sterling - Maturing 03/03/2021	SEK223,062		
	£19,502	509	-
Sold Swiss Franc for Sterling - Maturing 03/03/2021	CHF39,537		
	£32,388	1,151	-
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 03/03/2021	\$29,336,883		
	£21,359,074	375,681	0.65
Sold Sterling for Euro - Maturing 18/03/2021	£104,211		
	€120,375	321	-
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 18/03/2021	\$320		
	£230	1	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 07/04/2021	€7,030,000		
	£6,107,137	29	-
Sold Japanese Yen for Sterling - Maturing 07/04/2021	¥138,836,446		
	£932,268	37	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 07/04/2021	£475,685		
	\$665,201	-	-
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 07/04/2021	\$28,990,278		
	£20,731,034	60	-
為替先渡契約にかかる未実現利益合計		617,508	1.07
為替先渡契約にかかる未実現損失 (0.28%)			
Sold Euro for Sterling - Maturing 03/03/2021	€71,824		
	£62,141	(215)	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 03/03/2021	£33,487		
	€37,833	(642)	-
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 03/03/2021	£16,016		
	¥2,374,527	(75)	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 03/03/2021	£29,009		
	\$40,366	(136)	-
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 03/03/2021	\$62,261		
	£44,418	(115)	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 18/03/2021	€63,698		
	£55,041	(273)	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 18/03/2021	£10,315,562		
	€11,782,521	(83,821)	(0.15)
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 18/03/2021	£977,578		
	¥142,090,502	(23,596)	(0.04)
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 18/03/2021	£5,712,753		
	\$7,913,014	(53,389)	(0.09)
Sold Australian Dollar for Sterling - Maturing 07/04/2021	AUD\$246,984		
	£136,756	(2)	-
Sold Canadian Dollars for Sterling - Maturing 07/04/2021	CAD\$225,255		
	£127,243	(3)	-
Sold Danish Kroner for Sterling - Maturing 07/04/2021	DKK288,293		
	£33,668	(2)	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 07/04/2021	€4,685,826		
	£4,070,657	(18)	-
Sold Hong Kong Dollar for Sterling - Maturing 07/04/2021	HKD\$201,973		
	£18,620	-	-
Sold New Zealand Dollar for Sterling - Maturing 07/04/2021	NZD\$3,879		

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
	£2,017	-	-
Sold Norwegian Krone for Sterling - Maturing 07/04/2021	NOK169,465		
	£14,071	-	-
Sold Singapore Dollar for Sterling - Maturing 07/04/2021	SGD\$12,661		
	£6,808	-	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 07/04/2021	£1,270,089		
	€1,461,857	(144)	-
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 07/04/2021	£38,271		
	¥5,696,242	(23)	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 07/04/2021	£1,132,226		
	\$1,581,990	(943)	-
Sold Swedish Krona for Sterling - Maturing 07/04/2021	SEK416,268		
	£35,451	(1)	-
Sold Swiss Franc for Sterling - Maturing 07/04/2021	CHF81,563		
	£64,491	(1)	-
為替先渡契約にかかる未実現損失合計		(163,399)	(0.28)
為替先渡契約にかかる未実現利益(純額)合計		454,109	0.79
ポートフォリオ合計 §		57,655,685	99.99
その他純資産		3,209	0.01
純資産合計		57,658,894	100.00

これらの未決済の為替先渡契約の相手方はバンク・オブ・アメリカ、パークレイズ・バンク・ユークー・ピーエルシー、BNPパリバ、シティバンク、ゴールドマン・サックス・インターナショナル、JPモルガン・チェース銀行、HSBC銀行、モルガン・スタンレー、ロイヤル・バンク・オブ・カナダ、スタンダードチャータード銀行、ステート・ストリートおよびノーザン・トラスト・カンパニーです。

§ デリバティブ資産および負債を含みます。

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 3

2021年2月28日現在の投資明細表(ポンド表示)

すべての保有有価証券は別途記載のない限り投資信託/投資法人の受益証券/株式です。

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
投資信託/投資法人 99.88%			
iShares \$ Corporate Bond UCITS ETF	34,249	3,093,490	1.88
iShares \$ Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF USD (Dist)	78,410	7,544,289	4.58
iShares € Government Bond 1-3yr UCITS ETF	47,515	5,921,728	3.59
iShares Core £ Corporate Bond UCITS ETF	2,033	311,200	0.19
iShares Core € Corporate Bond UCITS ETF	13,403	1,562,723	0.95
iShares Core EURO STOXX 50 UCITS ETF	38,872	4,064,172	2.47
iShares Core FTSE 100 UCITS ETF	122,775	782,998	0.47
iShares Core MSCI EM IMI UCITS ETF	22,770	605,279	0.37
iShares Core MSCI Japan IMI UCITS ETF	31,037	1,128,890	0.68
iShares Core MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF	11,287	1,394,662	0.85
iShares Core S&P 500 UCITS ETF	10,494	2,892,572	1.75
iShares Emerging Markets Government Bond Index Fund	137,326	10,482,359	6.36
iShares Emerging Markets Index Fund	1,279,148	19,109,055	11.59
iShares Euro Government Bond Index Fund	161,765	1,409,281	0.85
iShares Euro Investment Grade Corporate Bond Index Fund	358,607	3,360,100	2.04
iShares Europe ex-UK Index Fund	373,676	5,919,788	3.59
iShares Global Government Bond UCITS ETF	7,481	621,010	0.38
iShares Global High Yield Corporate Bond UCITS ETF	200,035	14,232,750	8.63
iShares Global Inflation Linked Government Bond UCITS ETF	1,344,664	6,663,886	4.04
iShares Japan Index Fund	337,609	4,070,532	2.47
iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF	204,502	8,303,579	5.04
iShares North America Index Fund	1,353,675	31,454,465	19.08
iShares Pacific Index Fund	74,079	986,762	0.60
iShares UK Credit Bond Index Fund	112,991	1,422,444	0.86
iShares UK Index Fund	188,486	1,885,078	1.14
iShares US Corporate Bond Index Fund	1,350,173	10,160,636	6.16
iShares US Index Fund	916,674	12,371,256	7.50
iShares World ex-Euro Government Bond Index Fund	416,410	2,923,491	1.77
投資信託/投資法人合計		164,678,475	99.88
投資有価証券合計(取得原価 146,944,542 ポンド)		164,678,475	99.88

為替先渡契約にかかる未実現利益 0.76%

Sold Australian Dollar for Sterling - Maturing 03/03/2021	AUD\$361,985		
	£202,250	1,800	-
Sold Canadian Dollars for Sterling - Maturing 03/03/2021	CAD\$416,872		
	£237,626	2,104	-
Sold Danish Kroner for Sterling - Maturing 03/03/2021	DKK283,769		
	£33,767	636	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 03/03/2021	€22,548,233		
	£19,957,825	381,938	0.23
Sold Hong Kong Dollar for Sterling - Maturing 03/03/2021	HKD\$452,079		
	£42,453	770	-
Sold Japanese Yen for Sterling - Maturing 03/03/2021	¥190,301,100		
	£1,323,849	46,262	0.03
Sold New Zealand Dollar for Sterling - Maturing 03/03/2021	NZD\$9,033		
	£4,740	42	-
Sold Norwegian Krone for Sterling - Maturing 03/03/2021	NOK232,879		
	£19,824	483	-
Sold Singapore Dollar for Sterling - Maturing 03/03/2021	SGD\$28,365		

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
	£15,562	304	-
Sold Swedish Krona for Sterling - Maturing 03/03/2021	SEK319,792		
	£27,959	730	-
Sold Swiss Franc for Sterling - Maturing 03/03/2021	CHF69,775		
	£57,158	2,031	-
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 03/03/2021	\$63,555,228		
	£46,276,001	817,717	0.50
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 18/03/2021	\$109,960		
	£78,943	300	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 07/04/2021	€13,030,000		
	£11,319,487	55	-
Sold Japanese Yen for Sterling - Maturing 07/04/2021	¥215,172,974		
	£1,444,856	55	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 07/04/2021	£1,764,283		
	\$2,467,183	1	-
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 07/04/2021	\$61,661,179		
	£44,094,093	127	-
為替先渡契約にかかる未実現利益合計		1,255,355	0.76
為替先渡契約にかかる未実現損失 (0.18%)			
Sold Sterling for Euro - Maturing 03/03/2021	£727,666		
	€829,108	(7,853)	(0.01)
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 03/03/2021	£25,251		
	¥3,642,582	(796)	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 03/03/2021	£1,371,672		
	\$1,894,048	(16,942)	(0.01)
Sold Sterling for Euro - Maturing 18/03/2021	£12,105,338		
	€13,826,818	(98,364)	(0.06)
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 18/03/2021	£1,394,321		
	¥202,663,969	(33,655)	(0.02)
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 18/03/2021	£13,933,585		
	\$19,296,874	(132,519)	(0.08)
Sold Australian Dollar for Sterling - Maturing 07/04/2021	AUD\$431,190		
	£238,751	(4)	-
Sold Canadian Dollars for Sterling - Maturing 07/04/2021	CAD\$416,872		
	£235,485	(6)	-
Sold Danish Kroner for Sterling - Maturing 07/04/2021	DKK430,087		
	£50,227	(2)	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 07/04/2021	€8,689,126		
	£7,548,391	(33)	-
Sold Hong Kong Dollar for Sterling - Maturing 07/04/2021	HKD\$699,004		
	£64,439	(2)	-
Sold New Zealand Dollar for Sterling - Maturing 07/04/2021	NZD\$9,033		
	£4,697	-	-
Sold Norwegian Krone for Sterling - Maturing 07/04/2021	NOK232,879		
	£19,336	(1)	-
Sold Singapore Dollar for Sterling - Maturing 07/04/2021	SGD\$28,365		
	£15,252	(1)	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 07/04/2021	£2,375,013		
	€2,733,834	(74)	-
Sold Swedish Krona for Sterling - Maturing 07/04/2021	SEK680,416		
	£57,947	(1)	-
Sold Swiss Franc for Sterling - Maturing 07/04/2021	CHF151,960		
	£120,154	(1)	-
為替先渡契約にかかる未実現損失合計		(290,254)	(0.18)
為替先渡契約にかかる未実現利益(純額)合計		965,101	0.58

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
ポートフォリオ合計 §		165,643,576	100.46
その他純負債		(765,908)	(0.46)
純資産合計		164,877,668	100.00

これらの未決済の為替先渡契約の相手方はバンク・オブ・アメリカ、パークレイズ・バンク・ユークー・ピーエルシー、BNYメロン、シティバンク、ゴールドマン・サックス・インターナショナル、JPモルガン・チェース銀行、モルガン・スタンレー、ロイヤル・バンク・オブ・カナダ、スタンダードチャータード銀行、ノーザン・トラスト・カンパニーおよびスイス・ユニオン銀行です。

§ デリバティブ資産および負債を含みます。

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 4

2021年2月28日現在の投資明細表(ボンド表示)

すべての保有有価証券は別途記載のない限り投資信託/投資法人の受益証券/株式です。

投 資	保有	時価 (ボンド)	純資産に 対する割合 (%)
投資信託/投資法人 95.65%			
iShares \$ Corporate Bond UCITS ETF	10,705	966,913	0.95
iShares \$ Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF USD (Dist)	11,102	1,068,189	1.05
iShares € Government Bond 1-3yr UCITS ETF	6,692	834,015	0.82
iShares Core £ Corporate Bond UCITS ETF	492	75,313	0.07
iShares Core € Corporate Bond UCITS ETF	4,102	478,273	0.47
iShares Core EURO STOXX 50 UCITS ETF	19,848	2,075,162	2.03
iShares Core FTSE 100 UCITS ETF	102,689	654,899	0.64
iShares Core MSCI EM IMI UCITS ETF	13,879	368,936	0.36
iShares Core MSCI Japan IMI UCITS ETF	21,273	773,750	0.76
iShares Core MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF	9,257	1,143,828	1.12
iShares Core S&P 500 UCITS ETF	17,582	4,846,313	4.74
iShares Emerging Markets Government Bond Index Fund	78,925	6,024,495	5.90
iShares Emerging Markets Index Fund	1,025,868	15,325,324	15.01
iShares Euro Investment Grade Corporate Bond Index Fund	114,579	1,073,589	1.05
iShares Europe ex-UK Index Fund	356,348	5,645,272	5.53
iShares Global High Yield Corporate Bond UCITS ETF	96,138	6,840,344	6.70
iShares Global Inflation Linked Government Bond UCITS ETF	191,025	946,682	0.93
iShares Japan Index Fund	277,337	3,343,832	3.27
iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF	97,809	3,971,427	3.89
iShares North America Index Fund	809,773	18,816,179	18.42
iShares Pacific Index Fund	53,459	712,104	0.70
iShares UK Credit Bond Index Fund	34,043	428,571	0.42
iShares UK Index Fund	144,015	1,440,317	1.41
iShares US Corporate Bond Index Fund	428,013	3,220,981	3.15
iShares US Index Fund	1,230,731	16,609,723	16.26
投資信託/投資法人合計		97,684,431	95.65
投資有価証券合計(取得原価 83,588,194 ボンド)		97,684,431	95.65

為替先渡契約にかかる未実現利益 0.42%

Sold Australian Dollar for Sterling - Maturing 03/03/2021	AUD\$112,050		
	£62,605	557	-
Sold Canadian Dollars for Sterling - Maturing 03/03/2021	CAD\$102,069		
	£58,181	515	-
Sold Danish Kroner for Sterling - Maturing 03/03/2021	DKK114,827		
	£13,664	258	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 03/03/2021	€6,692,402		
	£5,921,747	111,549	0.11
Sold Hong Kong Dollar for Sterling - Maturing 03/03/2021	HKD\$253,590		
	£23,814	432	-
Sold Japanese Yen for Sterling - Maturing 03/03/2021	¥29,743,970		
	£206,917	7,231	0.01
Sold New Zealand Dollar for Sterling - Maturing 03/03/2021	NZD\$4,882		
	£2,562	23	-
Sold Norwegian Krone for Sterling - Maturing 03/03/2021	NOK105,226		
	£8,958	218	-
Sold Singapore Dollar for Sterling - Maturing 03/03/2021	SGD\$15,921		
	£8,735	171	-
Sold Swedish Krona for Sterling - Maturing 03/03/2021	SEK154,017		

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
	£13,466	351	-
Sold Swiss Franc for Sterling - Maturing 03/03/2021	CHF46,254		
	£37,890	1,346	-
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 03/03/2021	\$24,001,050		
	£17,472,118	305,214	0.30
Sold Euro for Sterling - Maturing 07/04/2021	€3,915,000		
	£3,401,058	16	-
Sold Japanese Yen for Sterling - Maturing 07/04/2021	¥49,747,545		
	£334,046	11	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 07/04/2021	£738,127		
	\$1,032,201	1	-
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 07/04/2021	\$23,456,888		
	£16,774,090	48	-
為替先渡契約にかかる未実現利益合計		427,941	0.42
為替先渡契約にかかる未実現損失 (0.18%)			
Sold Sterling for Euro - Maturing 03/03/2021	£148,852		
	€168,175	(2,846)	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 03/03/2021	£396,131		
	\$544,163	(6,915)	(0.01)
Sold Sterling for Euro - Maturing 18/03/2021	£9,339,751		
	€10,668,454	(75,447)	(0.07)
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 18/03/2021	£185,525		
	¥26,965,991	(4,478)	(0.01)
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 18/03/2021	£9,604,315		
	\$13,301,189	(91,345)	(0.09)
Sold Australian Dollar for Sterling - Maturing 07/04/2021	AUD\$156,345		
	£86,569	(2)	-
Sold Canadian Dollars for Sterling - Maturing 07/04/2021	CAD\$102,069		
	£57,657	(1)	-
Sold Danish Kroner for Sterling - Maturing 07/04/2021	DKK114,827		
	£13,410	(1)	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 07/04/2021	€2,609,227		
	£2,266,679	(10)	-
Sold Hong Kong Dollar for Sterling - Maturing 07/04/2021	HKD\$434,038		
	£40,013	(2)	-
Sold New Zealand Dollar for Sterling - Maturing 07/04/2021	NZD\$4,882		
	£2,538	-	-
Sold Norwegian Krone for Sterling - Maturing 07/04/2021	NOK105,226		
	£8,737	-	-
Sold Singapore Dollar for Sterling - Maturing 07/04/2021	SGD\$15,921		
	£8,561	-	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 07/04/2021	£1,766,653		
	€2,033,485	(122)	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 07/04/2021	£1,426,449		
	\$1,993,086	(1,191)	-
Sold Swedish Krona for Sterling - Maturing 07/04/2021	SEK359,113		
	£30,583	(1)	-
Sold Swiss Franc for Sterling - Maturing 07/04/2021	CHF102,151		
	£80,770	(1)	-
為替先渡契約にかかる未実現損失合計		(182,362)	(0.18)
為替先渡契約にかかる未実現利益(純額)合計		245,579	0.24
ポートフォリオ合計\$		97,930,010	95.89
その他純負債		4,198,302	4.11

投 資	保有	時価 (ボンド)	純資産に 対する割合 (%)
純資産合計		102,128,312	100.00

これらの未決済の為替先渡契約の相手方はバンク・オブ・アメリカ、パークレイズ・バンク・ユークー・ピーエルシー、シティバンク、ゴールドマン・サックス・インターナショナル、モルガン・スタンレー、スタンダードチャータード銀行およびノーザン・トラスト・カンパニーです。

§ デリバティブ資産および負債を含みます。

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 5

2021年2月28日現在の投資明細表(ボンド表示)

すべての保有有価証券は別途記載のない限り投資信託/投資法人の受益証券/株式です。

投 資	保有	時価 (ボンド)	純資産に 対する割合 (%)
投資信託/投資法人 102.20%			
iShares \$ Corporate Bond UCITS ETF	4,085	368,971	0.62
iShares \$ Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF USD (Dist)	7,017	675,147	1.14
iShares € Government Bond 1-3yr UCITS ETF	4,309	537,025	0.90
iShares Core £ Corporate Bond UCITS ETF	245	37,503	0.06
iShares Core € Corporate Bond UCITS ETF	1,615	188,301	0.32
iShares Core EURO STOXX 50 UCITS ETF	8,353	873,329	1.47
iShares Core FTSE 100 UCITS ETF	44,225	282,045	0.48
iShares Core MSCI EM IMI UCITS ETF	32,520	864,456	1.46
iShares Core MSCI Japan IMI UCITS ETF	13,175	479,206	0.81
iShares Core MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF	4,536	560,484	0.94
iShares Core S&P 500 UCITS ETF	24,995	6,889,637	11.60
iShares Emerging Markets Government Bond Index Fund	33,837	2,582,838	4.35
iShares Emerging Markets Index Fund	715,620	10,690,562	18.00
iShares Europe ex-UK Index Fund	317,009	5,022,064	8.46
iShares Global High Yield Corporate Bond UCITS ETF	29,704	2,113,478	3.56
iShares Japan Index Fund	219,234	2,643,290	4.45
iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF	30,485	1,237,810	2.08
iShares North America Index Fund	473,091	10,992,904	18.51
iShares Pacific Index Fund	64,568	860,079	1.45
iShares UK Index Fund	130,883	1,308,982	2.20
iShares US Index Fund	850,758	11,481,666	19.34
投資信託/投資法人合計		60,689,777	102.20
投資有価証券合計(取得原価 49,022,878 ボンド)		60,689,777	102.20

為替先渡契約にかかる未実現利益 0.24%

Sold Australian Dollar for Sterling - Maturing 03/03/2021	AUD\$63,867		
	£35,684	318	-
Sold Canadian Dollars for Sterling - Maturing 03/03/2021	CAD\$46,152		
	£26,308	233	-
Sold Danish Kroner for Sterling - Maturing 03/03/2021	DKK71,167		
	£8,468	160	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 03/03/2021	€2,001,713		
	£1,771,213	33,369	0.06
Sold Hong Kong Dollar for Sterling - Maturing 03/03/2021	HKD\$143,894		
	£13,513	245	-
Sold Japanese Yen for Sterling - Maturing 03/03/2021	¥16,817,131		
	£116,990	4,088	0.01
Sold New Zealand Dollar for Sterling - Maturing 03/03/2021	NZD\$3,531		
	£1,853	17	-
Sold Norwegian Krone for Sterling - Maturing 03/03/2021	NOK65,766		
	£5,598	136	-
Sold Singapore Dollar for Sterling - Maturing 03/03/2021	SGD\$9,600		
	£5,267	103	-
Sold Swedish Krona for Sterling - Maturing 03/03/2021	SEK116,372		
	£10,174	265	-
Sold Swiss Franc for Sterling - Maturing 03/03/2021	CHF34,768		

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
	£28,481	1,012	-
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 03/03/2021	\$7,938,896		
	£5,780,466	102,120	0.17
Sold Euro for Sterling - Maturing 07/04/2021	€1,200,000		
	£1,042,470	5	-
Sold Japanese Yen for Sterling - Maturing 07/04/2021	¥25,322,257		
	£170,035	6	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 07/04/2021	£534,199		
	\$747,026	-	-
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 07/04/2021	\$7,938,896		
	£5,677,128	16	-
為替先渡契約にかかる未実現利益合計		142,093	0.24
為替先渡契約にかかる未実現損失 (0.25%)			
Sold Euro for Sterling - Maturing 18/03/2021	€473,869		
	£411,427	(73)	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 18/03/2021	£11,247,634		
	€12,847,033	(91,489)	(0.16)
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 18/03/2021	£5,770,540		
	\$7,991,689	(54,909)	(0.09)
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 18/03/2021	\$295,778		
	£211,512	(28)	-
Sold Australian Dollar for Sterling - Maturing 07/04/2021	AUD\$79,894		
	£44,237	(1)	-
Sold Canadian Dollars for Sterling - Maturing 07/04/2021	CAD\$46,152		
	£26,071	(1)	-
Sold Danish Kroner for Sterling - Maturing 07/04/2021	DKK71,167		
	£8,311	-	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 07/04/2021	€801,713		
	£696,462	(3)	-
Sold Hong Kong Dollar for Sterling - Maturing 07/04/2021	HKD\$221,798		
	£20,447	(1)	-
Sold New Zealand Dollar for Sterling - Maturing 07/04/2021	NZD\$3,531		
	£1,836	-	-
Sold Norwegian Krone for Sterling - Maturing 07/04/2021	NOK65,766		
	£5,461	-	-
Sold Singapore Dollar for Sterling - Maturing 07/04/2021	SGD\$9,600		
	£5,162	-	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 07/04/2021	£776,195		
	€893,463	(24)	-
Sold Swedish Krona for Sterling - Maturing 07/04/2021	SEK230,080		
	£19,594	-	-
Sold Swiss Franc for Sterling - Maturing 07/04/2021	CHF65,447		
	£51,748	(1)	-
為替先渡契約にかかる未実現損失合計		(146,530)	(0.25)
為替先渡契約にかかる未実現損失(純額)合計		(4,437)	(0.01)
ポートフォリオ合計\$		60,685,340	102.19
その他純資産		(1,301,235)	(2.19)
純資産合計		59,384,105	100.00

投 資	保有	時価 (ボンド)	純資産に 対する割合 (%)
-----	----	-------------	----------------------

これらの未決済の為替先渡契約の相手方はバンク・オブ・アメリカ、シティバンク、ゴールドマン・サックス・インターナショナル、JPモルガン・チェース銀行、モルガン・スタンレーおよびノーザン・トラスト・カンパニーです。

§ デリバティブ資産および負債を含みます。

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 1

2021年2月28日現在の投資明細表(ボンド表示)

すべての保有有価証券は別途記載のない限り投資信託/投資法人の受益証券/株式です。

投 資	保有	時価 (ボンド)	純資産に 対する割合 (%)
投資信託/投資法人 98.38%			
Barclays Capital Emerging Markets Local Bond UCITS ETF †	9,350	462,144	1.02
GlobalAccess Asia Pacific (ex-Japan) Fund*	273,100	914,604	2.02
GlobalAccess Emerging Market Debt Fund*	1,472,923	1,337,967	2.96
GlobalAccess Emerging Market Equity Fund*	1,151,060	1,170,496	2.59
GlobalAccess Emerging Market Local Currency Debt Fund*	3,507,328	1,572,917	3.48
GlobalAccess Europe (ex-UK) Alpha Fund*	475,143	994,439	2.20
GlobalAccess Global Corporate Bond Fund*	6,547,400	5,857,570	12.96
GlobalAccess Global Government Bond Fund*	6,229,350	5,921,598	13.10
GlobalAccess Global High Yield Bond Fund*	1,891,050	1,585,230	3.51
GlobalAccess Global Short Duration Bond Fund*	3,678,369	4,563,693	10.10
GlobalAccess Japan Fund*	400,800	531,873	1.18
GlobalAccess UK Opportunities Fund*	97,850	276,247	0.61
GlobalAccess US Equity Fund*	130,750	4,137,361	9.16
GlobalAccess US Small & Mid Cap Equity Fund*	436,350	892,748	1.98
Institutional Cash Series Plc - Institutional Sterling Liquidity Fund	6,218,205	6,218,205	13.76
iShares Core MSCI World UCITS ETF	263,000	1,785,454	3.95
iShares Global Corp Bond UCITS ETF	171,400	915,225	2.03
iShares J.P. Morgan \$ EM Bond UCITS ETF	284,000	1,345,280	2.98
Pimco GIS Global Real Return Institutional GBP (Dist)	400,000	3,972,000	8.79
投資信託/投資法人合計		44,455,051	98.38
投資有価証券合計(取得原価 43,840,320 ボンド)		44,455,051	98.38
先物契約にかかる未実現利益 0.00%#			
US 10 Year Note Future Expiry June 2021	(1)	1,151	-
先物契約にかかる未実現利益合計		1,151	0.00
先物契約にかかる未実現損失 (0.04%)#			
Russel 2000 Emini Index Future Expiry March 2021	(8)	(18,937)	(0.04)
先物契約にかかる未実現損失合計		(18,937)	(0.04)
先物契約にかかる未実現損失(純額)合計		(17,786)	(0.04)
為替先渡契約にかかる未実現利益 1.35%			
Sold Euro for Sterling - Maturing 05/03/2021	€290,293		
	£255,972	3,946	0.01
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 05/03/2021	£1,961,085		
	\$2,762,621	14,897	0.04
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 05/03/2021	\$32,681,364		
	£23,964,143	588,589	1.30
Sold Euro for Sterling - Maturing 16/03/2021	€87,566		
	£76,805	767	-
為替先渡契約にかかる未実現利益合計		608,199	1.35
為替先渡契約にかかる未実現損失 (0.46%)			
Sold Sterling for Euro - Maturing 05/03/2021	£252,109		
	€290,292	(83)	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 05/03/2021	£1,481,107		

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
	\$2,029,954	(29,170)	(0.07)
Sold Euro for Sterling - Maturing 16/03/2021	€170,762		
	£147,548	(733)	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 16/03/2021	£24,195,408		
	€27,702,111	(140,311)	(0.31)
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 16/03/2021	£32,732		
	¥4,799,445	(509)	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 16/03/2021	£9,550,332		
	\$13,304,718	(34,706)	(0.08)
為替先渡契約にかかる未実現損失合計		(205,512)	(0.46)
為替先渡契約にかかる未実現利益(純額)合計		402,687	0.89
ポートフォリオ合計 §		44,839,952	99.23
その他純資産		348,729	0.77
純資産合計		45,188,681	100.00

これらの未決済の先物契約の相手方はゴールドマン・サックス・インターナショナルです。

これらの未決済の為替先渡契約の相手方はパークレイズ・バンク・ユーカー・ピーエルシーおよびスイス・ユニオン銀行です。

† このファンドはパークレイズ・マルチマネジャー・ファンド(UKシリーズ2)の一部を構成します。

* これらのファンドはパークレイズ・マルチマネジャー・ファンド・ピーエルシーの一部を構成します。

先物契約の約定の絶対額は742,125ポンドで、証拠金額137,124ポンドは、合算純資産計算書の現金預金および当座借越の各残高に開示されています。

§ デリバティブ資産および負債を含みます。

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 2

2021年2月28日現在の投資明細表(債券表示)

すべての保有有価証券は別途記載のない限り投資信託/投資法人の受益証券/株式です。

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
投資信託/投資法人 99.21%			
Barclays Capital Emerging Markets Local Bond UCITS ETF †	18,650	921,818	1.00
GlobalAccess Asia Pacific (ex-Japan) Fund*	994,920	3,331,959	3.61
GlobalAccess Emerging Market Debt Fund*	3,486,462	3,167,017	3.43
GlobalAccess Emerging Market Equity Fund*	4,858,640	4,940,679	5.35
GlobalAccess Emerging Market Local Currency Debt Fund*	8,452,189	3,790,517	4.11
GlobalAccess Europe (ex-UK) Alpha Fund*	1,655,541	3,464,925	3.75
GlobalAccess Global Corporate Bond Fund*	10,497,072	9,391,106	10.17
GlobalAccess Global Government Bond Fund*	10,033,850	9,538,143	10.33
GlobalAccess Global High Yield Bond Fund*	5,003,550	4,194,378	4.54
GlobalAccess Global Short Duration Bond Fund*	7,496,638	9,300,956	10.07
GlobalAccess Japan Fund*	1,399,000	1,856,512	2.01
GlobalAccess UK Opportunities Fund*	344,380	972,241	1.05
GlobalAccess US Equity Fund*	486,225	15,385,761	16.66
GlobalAccess US Small & Mid Cap Equity Fund*	1,522,450	3,114,850	3.37
iShares Core MSCI World UCITS ETF	542,000	3,679,530	3.99
iShares Global Corp Bond UCITS ETF	360,650	1,925,763	2.09
iShares J.P. Morgan \$ EM Bond UCITS ETF	600,000	2,842,140	3.08
Pimco GIS Global Real Return Institutional GBP (Dist)	640,000	6,355,200	6.88
Royal London Cash Plus Fund	3,416,297	3,432,132	3.72
投資信託/投資法人合計		91,605,627	99.21
投資有価証券合計(取得原価 87,003,275 ポンド)		91,605,627	99.21
先物契約にかかる未実現利益 0.00%#			
US 10 Year Note Future Expiry June 2021	(2)	2,302	-
先物契約にかかる未実現利益合計		2,302	0.00
先物契約にかかる未実現損失 (0.07%)#			
Russel 2000 Emini Index Future Expiry March 2021	(29)	(68,646)	(0.07)
先物契約にかかる未実現損失合計		(68,646)	(0.07)
先物契約にかかる未実現損失(純額)合計		(66,344)	(0.07)
為替先渡契約にかかる未実現利益 1.19%			
Sold Euro for Sterling - Maturing 05/03/2021	€593,823		
	£523,617	8,072	0.01
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 05/03/2021	£3,960,654		
	\$5,579,341	30,005	0.03
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 05/03/2021	\$58,762,115		
	£43,088,279	1,058,301	1.15
Sold Euro for Sterling - Maturing 16/03/2021	€32,438		
	£28,329	162	-
為替先渡契約にかかる未実現利益合計		1,096,540	1.19
為替先渡契約にかかる未実現損失 (0.35%)			
Sold Sterling for Euro - Maturing 05/03/2021	£515,714		
	€593,823	(170)	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 05/03/2021	£108,581		
	\$151,516	(208)	-

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
Sold Euro for Sterling - Maturing 16/03/2021	€294,676		
	£254,973	(908)	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 16/03/2021	£45,013,856		
	€51,539,357	(259,713)	(0.28)
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 16/03/2021	£531,293		
	¥77,903,594	(8,261)	(0.01)
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 16/03/2021	£14,106,884		
	\$19,652,419	(51,339)	(0.06)
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 16/03/2021	\$260,942		
	£185,084	(1,544)	-
為替先渡契約にかかる未実現損失合計		(322,143)	(0.35)
為替先渡契約にかかる未実現利益(純額)合計		774,397	0.84
ポートフォリオ合計 §		92,313,680	99.98
その他純資産		15,651	0.02
純資産合計		92,329,331	100.00

これらの未決済の先物契約の相手方はゴールドマン・サックス・インターナショナルです。

これらの未決済の為替先渡契約の相手方はパークレイズ・バンク・ユーケー・ピーエルシーおよびスイス・ユニオン銀行です。

† このファンドはパークレイズ・マルチマネジャー・ファンド(UKシリーズ2)の一部を構成します。

* これらのファンドはパークレイズ・マルチマネジャー・ファンド・ピーエルシーの一部を構成します。

先物契約の絶対約定額は2,470,694ポンドで、証拠金額396,759ポンドは、合算純資産計算書の現金預金および当座借越の各残高に開示されています。

§ デリバティブ資産および負債を含みます。

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 3

2021年2月28日現在の投資明細表(債券表示)

すべての保有有価証券は別途記載のない限り投資信託/投資法人の受益証券/株式です。

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
投資信託/投資法人 95.68%			
Barclays Capital Emerging Markets Local Bond UCITS ETF †	52,350	2,587,515	1.00
GlobalAccess Asia Pacific (ex-Japan) Fund*	4,380,093	14,668,809	5.69
GlobalAccess Emerging Market Debt Fund*	9,776,366	8,880,612	3.44
GlobalAccess Emerging Market Equity Fund*	18,907,858	19,227,118	7.45
GlobalAccess Emerging Market Local Currency Debt Fund*	23,700,818	10,629,005	4.12
GlobalAccess Europe (ex-UK) Alpha Fund*	7,614,974	15,937,577	6.18
GlobalAccess Global Corporate Bond Fund*	17,660,889	15,800,147	6.12
GlobalAccess Global Government Bond Fund*	16,562,800	15,744,540	6.10
GlobalAccess Global High Yield Bond Fund*	13,955,834	11,698,904	4.54
GlobalAccess Global Short Duration Bond Fund*	17,265,710	21,421,286	8.30
GlobalAccess Japan Fund*	6,426,300	8,527,880	3.31
GlobalAccess UK Opportunities Fund*	1,580,197	4,461,156	1.73
GlobalAccess US Equity Fund*	1,549,250	49,023,373	19.00
GlobalAccess US Small & Mid Cap Equity Fund*	7,008,750	14,339,523	5.56
iShares Core MSCI World UCITS ETF	1,510,000	10,251,088	3.97
iShares Global Corp Bond UCITS ETF	1,011,250	5,399,772	2.09
iShares J.P. Morgan \$ EM Bond UCITS ETF	1,655,000	7,839,570	3.04
Pimco GIS Global Real Return Institutional GBP (Dist)	1,050,000	10,426,500	4.04
投資信託/投資法人合計		246,864,375	95.68
投資有価証券合計(取得原価 221,293,605 ポンド)		246,864,375	95.68
先物契約にかかる未実現利益 0.21%#			
S&P 500 Emini Index Future Expiry March 2021	155	523,313	0.20
US 10 Year Note Future Expiry June 2021	(21)	24,173	0.01
先物契約にかかる未実現利益合計		547,486	0.21
先物契約にかかる未実現損失 (0.52%)#			
Russel 2000 Emini Index Future Expiry March 2021	(131)	(1,354,179)	(0.52)
先物契約にかかる未実現損失合計		(1,354,179)	(0.52)
先物契約にかかる未実現損失(純額)合計		(806,693)	(0.31)
為替先渡契約にかかる未実現利益 0.74%			
Sold Euro for Sterling - Maturing 05/03/2021	€1,242,911		
	£1,095,964	16,896	0.01
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 05/03/2021	£9,710,598		
	\$13,681,836	75,423	0.03
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 05/03/2021	\$100,334,154		
	£73,571,655	1,807,009	0.70
Sold Euro for Sterling - Maturing 16/03/2021	€512,079		
	£448,467	3,804	-
Sold Japanese Yen for Sterling - Maturing 16/03/2021	¥4,987,536		
	£33,697	211	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 16/03/2021	£649		
	€750	2	-
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 16/03/2021	\$1,602,076		
	£1,153,297	7,482	-
為替先渡契約にかかる未実現利益合計		1,910,827	0.74

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
為替先渡契約にかかる未実現損失 (0.26%)			
Sold Sterling for Euro - Maturing 05/03/2021	£1,079,423		
	€1,242,911	(355)	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 16/03/2021	€567,359		
	£490,975	(1,690)	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 16/03/2021	£84,632,145		
	€96,900,971	(488,295)	(0.19)
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 16/03/2021	£1,282,946		
	¥188,118,598	(19,948)	(0.01)
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 16/03/2021	£44,462,127		
	\$61,940,926	(161,551)	(0.06)
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 16/03/2021	\$112,973		
	£80,255	(544)	-
為替先渡契約にかかる未実現損失合計		(672,383)	(0.26)
為替先渡契約にかかる未実現利益(純額)合計		1,238,444	0.48
ポートフォリオ合計 §		247,296,126	95.85
その他純資産		10,694,793	4.15
純資産合計		257,990,919	100.00

これらの未決済の先物契約の相手方はゴールドマン・サックス・インターナショナルです。

これらの未決済の為替先渡契約の相手方はパークレイズ・バンク・ユーケー・ピーエルシーおよびスイス・ユニオン銀行です。

† これらのファンドはパークレイズ・マルチマネジャー・ファンド(UKシリーズ2)の一部を構成します。

* これらのファンドはパークレイズ・マルチマネジャー・ファンド・ピーエルシーの一部を構成します。

先物契約の絶対約定額は33,411,882ポンドで、証拠金額2,166,397ポンドは、合算純資産計算書の現金預金および当座借越の各残高に開示されています。

§ デリバティブ資産および負債を含みます。

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 4

2021年2月28日現在の投資明細表(債券表示)

すべての保有有価証券は別途記載のない限り投資信託/投資法人の受益証券/株式です。

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
投資信託/投資法人 96.84%			
Barclays Capital Emerging Markets Local Bond UCITS ETF †	12,600	622,783	0.98
GlobalAccess Asia Pacific (ex-Japan) Fund*	1,491,050	4,993,485	7.84
GlobalAccess Emerging Market Debt Fund*	1,978,138	1,796,893	2.82
GlobalAccess Emerging Market Equity Fund*	6,703,537	6,816,727	10.70
GlobalAccess Emerging Market Local Currency Debt Fund*	4,567,238	2,048,250	3.21
GlobalAccess Europe (ex-UK) Alpha Fund*	2,601,340	5,444,413	8.54
GlobalAccess Global Corporate Bond Fund*	2,892,800	2,588,016	4.06
GlobalAccess Global Government Bond Fund*	1,627,800	1,547,381	2.43
GlobalAccess Global High Yield Bond Fund*	2,303,550	1,931,021	3.03
GlobalAccess Japan Fund*	2,107,040	2,796,102	4.39
GlobalAccess UK Opportunities Fund*	541,627	1,529,102	2.40
GlobalAccess US Equity Fund*	382,228	12,094,965	18.98
GlobalAccess US Small & Mid Cap Equity Fund*	2,395,150	4,900,347	7.69
iShares Core MSCI World UCITS ETF	375,000	2,545,800	3.99
iShares Core S&P 500 UCITS ETF USD (Dist)	222,680	6,054,822	9.50
iShares Global Corp Bond UCITS ETF	254,000	1,356,284	2.13
iShares J.P. Morgan \$ EM Bond UCITS ETF	422,000	1,998,972	3.14
Pimco GIS Global Real Return Institutional GBP (Dist)	65,000	645,450	1.01
投資信託/投資法人合計		61,710,813	96.84
投資有価証券合計(取得原価 53,633,063 ポンド)		61,710,813	96.84
先物契約にかかる未実現利益 0.40%#			
S&P 500 Emini Index Future Expiry March 2021	43	238,346	0.37
US 10 Year Note Future Expiry June 2021	(16)	18,418	0.03
先物契約にかかる未実現利益合計		256,764	0.40
先物契約にかかる未実現損失 (0.73%)#			
Russel 2000 Emini Index Future Expiry March 2021	(45)	(465,176)	(0.73)
先物契約にかかる未実現損失合計		(465,176)	(0.73)
先物契約にかかる未実現損失(純額)合計		(208,412)	(0.33)
為替先渡契約にかかる未実現利益 0.40%			
Sold Euro for Sterling - Maturing 05/03/2021	€341,044		
	£300,723	4,636	0.01
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 05/03/2021	£3,451,174		
	\$4,864,866	28,452	0.04
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 05/03/2021	\$12,443,404		
	£9,123,882	223,659	0.35
Sold Euro for Sterling - Maturing 16/03/2021	€563,471		
	£490,168	878	-
為替先渡契約にかかる未実現利益合計		257,625	0.40
為替先渡契約にかかる未実現損失 (0.23%)			
Sold Sterling for Euro - Maturing 05/03/2021	£296,184		
	€341,044	(98)	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 16/03/2021	€8,771		

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
	£7,593	(23)	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 16/03/2021	£18,326,737		
	€20,983,406	(105,819)	(0.16)
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 16/03/2021	£1,085,057		
	¥159,102,040	(16,872)	(0.03)
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 16/03/2021	£7,470,675		
	\$10,407,518	(27,147)	(0.04)
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 16/03/2021	\$64,927		
	£46,206	(230)	-
為替先渡契約にかかる未実現損失合計		(150,189)	(0.23)
為替先渡契約にかかる未実現利益(純額)合計		107,436	0.17
ポートフォリオ合計 §		61,609,837	96.68
その他純資産		2,113,156	3.32
純資産合計		63,722,993	100.00

これらの未決済の先物契約の相手方はゴールドマン・サックス・インターナショナルです。

これらの未決済の為替先渡契約の相手方はパークレイズ・バンク・ユーカー・ピーエルシーおよびスイス・ユニオン銀行です。

† これらのファンドはパークレイズ・マルチマネジャー・ファンド(UKシリーズ2)の一部を構成します。

* これらのファンドはパークレイズ・マルチマネジャー・ファンド・ピーエルシーの一部を構成します。

先物契約の絶対約定額は10,915,871ポンドで、証拠金額737,665ポンドは、合算純資産計算書の現金預金および当座借越の各残高に開示されています。

§ デリバティブ資産および負債を含みます。

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 5

2021年2月28日現在の投資明細表(ボンド表示)

すべての保有有価証券は別途記載のない限り投資信託/投資法人の受益証券/株式です。

投資	保有	時価 (ボンド)	純資産に 対する割合 (%)
投資信託/投資法人 93.41%			
GlobalAccess Asia Pacific (ex-Japan) Fund*	540,800	1,811,124	9.23
GlobalAccess Emerging Market Debt Fund*	303,716	275,888	1.41
GlobalAccess Emerging Market Equity Fund*	2,439,083	2,480,267	12.64
GlobalAccess Emerging Market Local Currency Debt Fund*	920,395	412,766	2.10
GlobalAccess Europe (ex-UK) Alpha Fund*	939,106	1,965,479	10.02
GlobalAccess Global Corporate Bond Fund*	222,100	198,700	1.01
GlobalAccess Global Government Bond Fund*	249,900	237,554	1.21
GlobalAccess Japan Fund*	801,920	1,064,170	5.42
GlobalAccess UK Opportunities Fund*	195,023	550,582	2.81
GlobalAccess US Equity Fund*	118,690	3,755,742	19.15
GlobalAccess US Small & Mid Cap Equity Fund*	864,750	1,769,232	9.02
iShares Core MSCI World UCITS ETF	101,000	685,669	3.50
iShares Core S&P 500 UCITS ETF USD (Dist)	92,423	2,513,045	12.81
iShares J.P. Morgan \$ EM Bond UCITS ETF	127,400	603,481	3.08
投資信託/投資法人合計		18,323,699	93.41
投資有価証券合計(取得原価 15,478,449 ボンド)		18,323,699	93.41
先物契約にかかる未実現利益 0.52%#			
S&P 500 Emini Index Future Expiry March 2021	18	99,773	0.51
US 10 Year Note Future Expiry June 2021	(3)	3,453	0.01
先物契約にかかる未実現利益合計		103,226	0.52
先物契約にかかる未実現損失 (0.84%)#			
Russel 2000 Emini Index Future Expiry March 2021	(16)	(165,396)	(0.84)
先物契約にかかる未実現損失合計		(165,396)	(0.84)
先物契約にかかる未実現損失(純額)合計		(62,170)	(0.32)
為替先渡契約にかかる未実現利益 0.12%			
Sold Euro for Sterling - Maturing 05/03/2021	€133,181		
	£117,436	1,810	0.01
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 05/03/2021	£1,040,642		
	\$1,466,507	8,287	0.04
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 05/03/2021	\$767,018		
	£562,428	13,814	0.07
Sold Euro for Sterling - Maturing 16/03/2021	€2,468		
	£2,168	25	-
為替先渡契約にかかる未実現利益合計		23,936	0.12
為替先渡契約にかかる未実現損失 (0.27%)			
Sold Sterling for Euro - Maturing 05/03/2021	£115,663		
	€133,182	(38)	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 16/03/2021	€9,219		
	£7,978	(26)	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 16/03/2021	£7,747,561		
	€8,870,697	(44,701)	(0.23)
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 16/03/2021	£2,443,734		

投資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
	\$3,404,406	(8,880)	(0.04)
為替先渡契約にかかる未実現損失合計		(53,645)	(0.27)
為替先渡契約にかかる未実現損失(純額)合計		(29,709)	(0.15)
ポートフォリオ合計 §		18,231,820	92.94
その他純資産		1,385,267	7.06
純資産合計		19,617,087	100.00

これらの未決済の先物契約の相手方はゴールドマン・サックス・インターナショナルです。

これらの未決済の為替先渡契約の相手方はパークレイズ・バンク・ユーカー・ピーエルシーおよびスイス・ユニオン銀行です。

* これらのファンドはパークレイズ・マルチマネジャー・ファンド・ピーエルシーの一部を構成します。

先物契約の絶対約定額は3,995,277ポンドで、証拠金額274,836ポンドは、合算純資産計算書の現金預金および当座借越の各残高に開示されています。

§ デリバティブ資産および負債を含みます。

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

[次へ](#)

5 販売及び買戻しの実績

2021年3月末日前1年間における販売および買戻しの実績ならびに2021年3月末日における発行済株式数は以下のとおりです。

(注1) 販売株数および買戻株数には乗換数を含みます。

(注2) ()内の数は本邦内における販売・買戻しおよび発行済株式数ですが、本邦内において販売会社に外国証券取引口座約款に基づき保管を委託している株式以外の口数は含まれません。

(注3) 販売、買戻しおよび発行済株数については、小数点以下を四捨五入して整数で表示しています。よって合計額が一致しないことがあります。

パークレイズ・グローバルベータ

1. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ1

計算期間	クラスA株式					
	販売株数	買戻株数	発行済株数	販売株数	買戻株数	発行済株数
自 2020年4月1日 至 2021年3月31日	円建・分配型			円建・累積型		
	0 (0)	100,000 (100,000)	104,000 (104,000)	-		
	米ドル建・分配型			米ドル建・累積型		
	-			0 (0)	50,394 (0)	3,621 (0)

2. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ2

計算期間	クラスA株式					
	販売株数	買戻株数	発行済株数	販売株数	買戻株数	発行済株数
自 2020年4月1日 至 2021年3月31日	円建・分配型			円建・累積型		
	0 (0)	45,000 (45,000)	126,000 (126,000)	-		
	米ドル建・分配型			米ドル建・累積型		
	24,568 (24,500)	64,000 (64,000)	75,322 (71,500)	0 (0)	12,628 (0)	15,239 (0)

3. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ3

計算期間	クラスA株式					
	販売株数	買戻株数	発行済株数	販売株数	買戻株数	発行済株数
自 2020年4月1日 至 2021年3月31日	円建・分配型			円建・累積型		
	38,000 (38,000)	23,000 (23,000)	183,500 (183,500)	-		
	米ドル建・分配型			米ドル建・累積型		
	500 (500)	0 (0)	148,836 (139,000)	35,008 (0)	35,572 (0)	40,038 (0)

4. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ4

計算期間	クラスA株式					
	販売株数	買戻株数	発行済株数	販売株数	買戻株数	発行済株数
自 2020年4月1日 至 2021年3月31日	円建・分配型			円建・累積型		
	0 (0)	0 (0)	17,000 (17,000)	-		
	米ドル建・分配型			米ドル建・累積型		
	12,500 (12,500)	0 (0)	30,500 (30,500)	0 (0)	0 (0)	12,039 (0)

5. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ5

計算期間	クラスA株式					
	販売株数	買戻株数	発行済株数	販売株数	買戻株数	発行済株数
自 2020年4月1日 至 2021年3月31日	円建・分配型			円建・累積型		
	-			-		
	米ドル建・分配型			米ドル建・累積型		
	0 (0)	22,000 (22,000)	0 (0)	0 (0)	9,317 (0)	0 (0)

パークレイズ・マルチマネジャー

1. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ1

計算期間	クラスA株式					
	販売株数	買戻株数	発行済株数	販売株数	買戻株数	発行済株数
自 2020年4月1日 至 2021年3月31日	円建・分配型			円建・累積型		
	0 (0)	9,500 (9,500)	4,500 (4,500)	-		
	米ドル建・分配型			米ドル建・累積型		
	1,206 (0)	0 (0)	853,668 (600,000)	3,981 (0)	33,912 (0)	220,362 (0)

2. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ2

計算期間	クラスA株式					
	販売株数	買戻株数	発行済株数	販売株数	買戻株数	発行済株数
自 2020年4月1日 至 2021年3月31日	円建・分配型			円建・累積型		
	0 (0)	0 (0)	67,000 (67,000)	-		
	米ドル建・分配型			米ドル建・累積型		
	6,490 (0)	34,303 (0)	154,469 (20,000)	3,610 (0)	184,767 (0)	974,581 (0)

3. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ3

計算期間	クラスA株式					
	販売株数	買戻株数	発行済株数	販売株数	買戻株数	発行済株数
自 2020年4月1日 至 2021年3月31日	円建・分配型			円建・累積型		
	0 (0)	69,500 (69,500)	148,000 (148,000)	-		
	米ドル建・分配型			米ドル建・累積型		
	18,924 (0)	89,697 (57,000)	1,105,558 (140,000)	4,636 (0)	204,451 (0)	1,300,148 (0)

4. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ4

計算期間	クラスA株式					
	販売株数	買戻株数	発行済株数	販売株数	買戻株数	発行済株数
自 2020年4月1日 至 2021年3月31日	円建・分配型			円建・累積型		
	0 (0)	0 (0)	113,000 (113,000)	-		
	米ドル建・分配型			米ドル建・累積型		
	0 (0)	98,375 (94,000)	303,599 (58,000)	10,404 (0)	65,815 (0)	192,783 (0)

5. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ5

計算期間	クラスA株式					
	販売株数	買戻株数	発行済株数	販売株数	買戻株数	発行済株数
自 2020年4月1日 至 2021年3月31日	円建・分配型			円建・累積型		
	-			-		
	米ドル建・分配型			米ドル建・累積型		
	378 (0)	513 (0)	91,154 (37,000)	375 (0)	12,628 (0)	25,161 (0)

[次へ](#)

(2) その他の訂正

(注) 下線または傍線部は訂正部分を示します。

第二部 ファンド情報

第1 ファンドの状況

2 投資方針

(2) 投資対象

<訂正前>

(前略)

為替ヘッジ

(中略)

為替ヘッジ取引の結果、当該為替ヘッジ付クラスによって実現されたすべての利益 / 損失ならびに当該取引のコストはすべて当該クラスに計上されます。各為替ヘッジ付クラスの取引通貨は、各為替ヘッジ付クラスにおけるヘッジの名目金額の合計額が当該為替ヘッジ付クラスの純資産総額の105%を超えない場合に限って、当該サブ・ファンドの基準通貨にヘッジされるものとします。当該取引はすべて該当する為替ヘッジ付クラスに明示的に帰属し、その他の為替ヘッジ付クラスの為替エクスポージャー金額を合算または相殺することはできません。為替ヘッジ運用会社は、アンダーヘッジまたはオーバーヘッジのポジションはとらない方針ですが、為替ヘッジ運用会社の管理を超える市場の変動や要因により、時にアンダーヘッジおよびオーバーヘッジのポジションが発生する可能性があります。為替ヘッジ運用会社は、ヘッジの上限を該当する為替ヘッジ付クラスの取引通貨エクスポージャー相当額とし、ヘッジが当該為替ヘッジ付クラスの純資産総額の95%を下回らないこと、または105%を超えないことを確保するために、かつこれらの限度額に近付いている場合にヘッジを適切に増減するために継続的なモニタリングを行います。

<訂正後>

(前略)

為替ヘッジ

(中略)

為替ヘッジ取引の結果、当該為替ヘッジ付クラスによって実現されたすべての利益 / 損失ならびに当該取引のコストはすべて当該クラスに計上されます。各為替ヘッジ付クラスの取引通貨は、各為替ヘッジ付クラスにおけるヘッジの名目金額の合計額が当該為替ヘッジ付クラスの純資産総額の105%を超えない場合に限って、当該サブ・ファンドの基準通貨にヘッジされるものとします。当該取引はすべて該当する為替ヘッジ付クラスに明示的に帰属し、その他の為替ヘッジ付クラスの為替エクスポージャー金額を合算または相殺することはできません。為替ヘッジ運用会社は、アンダーヘッジまたはオーバーヘッジのポジションはとらない方針ですが、為替ヘッジ運用会社の管理を超える市場の変動や要因により、時にアンダーヘッジおよびオーバーヘッジのポジションが発生する可能性があります。為替ヘッジ運用会社は、ヘッジの上限を該当する為替ヘッジ付クラスの取引通貨エクスポージャー相当額とし、ヘッジが当該為替ヘッジ付クラスの純資産総額の95%を下回らないこと、または105%を超えないことを確保するために、かつこれらの限度額に近付いている場合にヘッジを適切に増減するために継続的なモニタリングを行います。

持続可能なファイナンス

ファンドは、金融サービスセクターにおけるサステナビリティ関連開示に関するEU規則 (EU) 2019 / 2088 (以下「SFDR」といいます。) に従い、サステナビリティ・リスクが投資判断に組み入れられる方

法およびサステナビリティ・リスクがサブ・ファンドのリターンに及ぼす可能性がある影響に関する評価の結果を開示する義務を負っています。

関連する投資方針に明記されない限り、サブ・ファンドは、サステナビリティ要因を促進しておらず、ポートフォリオとサステナビリティ要因を最大限一致させていないため、SFDR第6条の範囲に該当すると考えられます。ただし、サブ・ファンドは引き続き、サステナビリティ・リスクにさらされま

す。かかるサステナビリティ・リスクは、潜在的もしくは実際の重大なリスクおよび/または長期のリスク調整済リターンを最大化する機会を示す限り、投資に関する意思決定およびリスク監視に包含されます。

サステナビリティ・リスクが発生後の影響は非常に大きいものであり、特定のリスク、地域および資産クラスに応じて異なります。サステナビリティ・リスクは通常、以下のテーマの周辺で発生します。

- ・ コーポレート・ガバナンスにおける不正行為(例えば、取締役会の構成、役員報酬)
- ・ 株主の権利(例えば、取締役の選任、資本変更)
- ・ 規則の変更(例えば、温室効果ガス排出規制、ガバナンス・コード)
- ・ 自然界における脅威(例えば、異常気象、気候変動、水不足)
- ・ ブランドおよび評判に関する問題(例えば、不十分な健康および安全に関する記録、サイバーセキュリティ侵害)
- ・ サプライチェーンマネジメント(例えば、死亡数の増加、休業災害率、労使関係)
- ・ 労働慣行(例えば、健康、安全および人権に係る規定の遵守)

通常、サステナビリティ・リスクが資産に関して発生した場合、資産の価値にマイナスの影響が及ぶか、または、資産の価値がすべて失われます。したがってこれは、サブ・ファンドが投資する会社にとって、その評判に対する損害によるものである可能性があり、かかる会社の製品もしくはサービスに対する需要が結果的に下落し、主要な人員を失い、潜在的な事業機会から除外され、事業遂行のコストが増加し、および/または資本コストが増加する結果となります。会社はまた、罰金およびその他の規制上の制裁の影響を被る可能性もあります。かかる会社の運営チームの時間および資源は、その事業の促進に充てられるのではなく、サステナビリティ・リスクに係る事由への対処(事業慣行の変更ならびに調査および訴訟の対応を含みます。)に充てられる可能性があります。サステナビリティ・リスクに係る事由により、資産の損失および/または物的損失(不動産およびインフラに対する損害を含みます。)が生じる可能性もあります。関連するサブ・ファンドがエクスポージャーを有する、会社が保有する資産の有用性および価値にも、サステナビリティ・リスクに係る事由により悪影響が及ぶ可能性があります。

サステナビリティ・リスクに係る事由が生じ、特定の投資に影響が及ぶか、または、経済セクター、地理的もしくは政治的な地域もしくは国に広範な影響が及ぶ可能性があります。例えば、セクターの、および地理的なサステナビリティ・リスクに係る事由により、サブ・ファンドのソブリン債券エクスポージャーの投資価値に影響が及ぶ可能性があります。

特に、各サブ・ファンドが、個別の戦略ならびに特定のセクター、発行体および資産クラスに対するエクスポージャーから生じる様々なサステナビリティ・リスクにさらされることが予想されています。これにかかわらず、サブ・ファンドが高度に分散化されていること、また、サブ・ファンドのリスクが分散されていることに鑑み、また、関連するサブ・ファンドの英文目論見書の別紙でその他言及される場合を除いて、各サブ・ファンドがさらされる可能性があるサステナビリティ・リスクが、各サブ・ファンドそれぞれのリターンに重大な影響を及ぼすことは想定されていません。関連性があると判断される場合には、サブ・ファンドのサステナビリティ・リスクに関する追加情報および詳細が関連する英文目論見書の別紙に記載されます。

英文目論見書の日付現在、管理会社は、SFDR第4条に規定される、サステナビリティ・リスクに関する投資判断の主要な悪影響を考慮しているか否かに関して、引き続き自らの義務を見直し、検討しています。特に、管理会社は、レベル2の規制技術基準(以下「RTS」といいます。)に関する追加の協議お

よび/または指針ならびに2022年中に発効が予定されるRTSの最終化につき待機しています。第4条および第7条に関する決定および開示は、SFDRの期限を考慮して行われ、同様に、すべての開示は、英文目論見書(将来の改訂版)に記載されるか、および/または要求に応じてwww.barclaysinvestments.comにおいて公表されます。

定 義

<訂正前>

(前略)

「副投資運用会社」

投資運用会社の任命によって、パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ1、パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ2、パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ3、パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ4およびパークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ5の投資運用を再委託されたブラックロック・インベストメント・マネジメント(UK)リミテッドおよび/または投資運用会社に任命されたその他の者をいいます。

「UCI」

指令第1条(2)項(a)および(b)の意味に該当するその他の投資信託/投資法人をいいます。

(後略)

<訂正後>

(前略)

「副投資運用会社」

投資運用会社の任命によって、パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ1、パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ2、パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ3、パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ4およびパークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ5の投資運用を再委託されたブラックロック・インベストメント・マネジメント(UK)リミテッドおよび/または投資運用会社に任命されたその他の者をいいます。

「サステナビリティ要因」

環境、社会および従業員に関する事項、人権の尊重、腐敗防止および贈収賄防止に関する事項

「サステナビリティ・リスク」

発生した場合に、サブ・ファンドが投資する投資対象の価値に実際の、または潜在的かつ重大な悪影響が及ぶ可能性がある、環境、社会またはガバナンスに関する一切の事由または状況

「UCI」

指令第1条(2)項(a)および(b)の意味に該当するその他の投資信託/投資法人をいいます。

(後略)