

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 令和4年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)	2021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1,090億円	1,090.098円
		クラスA(米ドル建)株式 (分配型/累積型)	約16億米ドル (約1,849億円)	15.871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1,153億円	1,153.228円
		クラスA(米ドル建)株式 (分配型/累積型)	約16億米ドル (約1,849億円)	15.656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1,303億円	1,303.204円
		クラスA(米ドル建)株式 (分配型/累積型)	約15億米ドル (約1,733億円)	15.042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1,709億円	1,709.408円
		クラスA(米ドル建)株式 (分配型/累積型)	約21億米ドル (約2,427億円)	20.650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11億米ドル (約1,271億円)	10.786米ドル(注3)

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)	2021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1,070億円	1,070.032円
		クラスA(米ドル建)株式 (分配型/累積型)	約11億米ドル (約1,271億円)	10.705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1,194億円	1,194.479円
		クラスA(米ドル建)株式 (分配型/累積型)	約11億米ドル (約1,271億円)	10.932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1,292億円	1,291.970円
		クラスA(米ドル建)株式 (分配型/累積型)	約13億米ドル (約1,502億円)	12.711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1,517億円	1,516.818円
		クラスA(米ドル建)株式 (分配型/累積型)	約17億米ドル (約1,964億円)	17.220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18億米ドル (約2,080億円)	17.620米ドル

(注1) 上限見込額は、便宜上、2021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)株式については、2021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のクラスA(円建)株式ならびにクラスA(米ドル建)株式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のクラスA(円建)株式については、2021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、2022年2月28日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1ポンド=154.58円、1米ドル=115.55円、1ユーロ=129.34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】

2022年2月28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、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(2022年2月28日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1ポンド=154.58円、1米ドル=115.55円、1ユーロ=129.34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 外国投資法人の概況	
(1) 主要な経営指標等の推移	(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	2 外国投資法人の運用状況	
(1) 投資状況	(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	1 外国投資法人の概況	
2 役員の状況	(4) 役員の状況	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	3 資産運用会社の概況	
(1) 名称、資本金の額及び事業の内容	(1) 名称及び資本金の額	
(3) 大株主の状況	(2) 大株主の状況	
(4) 役員の状況	(3) 役員の状況	
(5) 事業の内容及び営業の概況	(4) 事業の内容及び営業の概況	更新
第5 外国投資法人の経理状況	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)。

2022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4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・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))

	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)	2021年 8月31日 に終了した 年度 (第15期)	2022年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第16期中)
営業収益(注1)	327 (51)	41 (6)	52 (8)	346 (53)	191 (30)
経常利益/損失金額(注2)	402 (62)	202 (31)	117 (18)	220 (34)	247 (38)
当期純利益/損失金額	402 (62)	202 (31)	117 (18)	220 (34)	247 (38)
出資総額(注3)	13,918 (2,151)	12,282 (1,899)	7,297 (1,128)	7,216 (1,115)	6,882 (1,064)
発行済株式総数(株)					
クラスA(円建・分配型)	204,000	204,000	104,000	104,000	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)	54,015	54,014	3,621	3,621	3,621
純資産額	13,918 (2,151)	12,282 (1,899)	7,297 (1,128)	7,216 (1,115)	6,882 (1,064)
総資産額	14,367 (2,221)	13,018 (2,012)	7,488 (1,157)	7,488 (1,157)	6,921 (1,070)
1株当たり純資産額					
クラスA(円建・分配型)	1,037.590	1,064.894	1,061.061	1,099.472	1,046.917
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)	14.560 (1,682)	15.135 (1,749)	15.225 (1,759)	15.906 (1,838)	15.295 (1,767)
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	96.87%	94.35%	97.45%	96.37%	99.44%
自己資本利益率	2.89%	1.64%	1.60%	3.05%	3.59%

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))

	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)	2021年 8月31日 に終了した 年度 (第15期)	2022年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第16期中)
営業収益(注1)	2,244 (347)	1,538 (238)	1,342 (207)	4,777 (738)	2,055 (318)
経常利益/損失金額(注2)	2,511 (388)	1,004 (155)	1,121 (173)	4,356 (673)	2,242 (347)
当期純利益/損失金額	2,511 (388)	1,004 (155)	1,121 (173)	4,356 (673)	2,242 (347)
出資総額(注3)	73,889 (11,422)	66,282 (10,246)	57,659 (8,913)	55,236 (8,538)	49,796 (7,697)
発行済株式総数(株)					
クラスA(円建・分配型)	171,000	171,000	126,000	126,000	82,500
クラスA(円建・累積型)	-	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・分配型)	114,737	107,771	69,809	60,000	56,000
クラスA(米ドル建・累積型)	27,867	27,867	15,239	15,209	15,209
純資産額	73,889 (11,422)	66,282 (10,246)	57,659 (8,913)	55,236 (8,538)	49,796 (7,697)
総資産額	75,528 (11,675)	69,611 (10,760)	59,718 (9,231)	55,809 (8,627)	50,067 (7,739)
1株当たり純資産額					
クラスA(円建・分配型)	1,058.714	1,098.607	1,107.619	1,162.664	1,099.156
クラスA(円建・累積型)	-	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・分配型)	14.204 (1,641)	14.843 (1,715)	15.001 (1,733)	15.780 (1,823)	14.943 (1,727)
クラスA(米ドル建・累積型)	16.489 (1,905)	17.383 (2,009)	17.754 (2,051)	18.812 (2,174)	17.970 (2,076)
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	97.83%	95.22%	96.55%	98.97%	99.46%
自己資本利益率	3.40%	1.51%	1.94%	7.89%	4.50%

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))

	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)	2021年 8月31日 に終了した 年度 (第15期)	2022年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第16期中)
営業収益(注1)	3,936 (608)	6,661 (1,030)	6,379 (986)	21,275 (3,289)	6,870 (1,062)
経常利益/損失金額(注2)	4,469 (691)	5,603 (866)	5,864 (906)	20,255 (3,131)	7,391 (1,143)
当期純利益/損失金額	4,469 (691)	5,603 (866)	5,864 (906)	20,255 (3,131)	7,391 (1,143)
出資総額(注3)	159,162 (24,603)	166,835 (25,789)	164,878 (25,487)	184,520 (28,523)	180,019 (27,827)
発行済株式総数(株)					
クラスA(円建・分配型)	168,500	173,500	163,500	211,500	174,500
クラスA(円建・累積型)	-	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・分配型)	152,336	148,336	148,836	149,336	110,836
クラスA(米ドル建・累積型)	40,602	19,720	40,038	35,008	30,008
純資産額	159,162 (24,603)	166,835 (25,789)	164,878 (25,487)	184,520 (28,523)	180,019 (27,827)
総資産額	161,692 (24,994)	178,259 (27,555)	166,351 (25,715)	189,338 (29,268)	180,497 (27,901)
1株当たり純資産額					
クラスA(円建・分配型)	1,134.463	1,191.932	1,220.350	1,308.564	1,238.224
クラスA(円建・累積型)	-	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・分配型)	12.931 (1,494)	13.680 (1,581)	14.046 (1,623)	15.093 (1,744)	14.309 (1,653)
クラスA(米ドル建・累積型)	15.720 (1,816)	16.804 (1,942)	17.445 (2,016)	18.886 (2,182)	18.061 (2,087)
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	98.44%	93.59%	99.11%	97.46%	99.74%
自己資本利益率	2.81%	3.36%	3.56%	10.98%	4.11%

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))

	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)	2021年 8月31日 に終了した 年度 (第15期)	2022年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第16期中)
営業収益(注1)	3,214 (497)	4,297 (664)	4,569 (706)	15,672 (2,423)	4,202 (650)
経常利益/損失金額(注2)	3,512 (543)	3,702 (572)	4,272 (660)	15,071 (2,330)	4,532 (701)
当期純利益/損失金額	3,512 (543)	3,702 (572)	4,272 (660)	15,071 (2,330)	4,532 (701)
出資総額(注3)	85,970 (13,289)	92,133 (14,242)	102,128 (15,787)	111,288 (17,203)	111,311 (17,206)
発行済株式総数(株)					
クラスA(円建・分配型)	29,000	17,000	17,000	17,000	17,000
クラスA(円建・累積型)	-	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・分配型)	18,000	18,000	19,500	30,500	12,500
クラスA(米ドル建・累積型)	12,039	12,039	12,039	-	-
純資産額	85,970 (13,289)	92,133 (14,242)	102,128 (15,787)	111,288 (17,203)	111,311 (17,206)
総資産額	92,128 (14,241)	100,850 (15,589)	104,097 (16,091)	111,697 (17,266)	111,685 (17,264)
1株当たり純資産額					
クラスA(円建・分配型)	1,378.676	1,473.326	1,541.329	1,701.594	1,624.262
クラスA(円建・累積型)	-	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・分配型)	16.456 (1,901)	17.715 (2,047)	18.591 (2,148)	20.556 (2,375)	19.647 (2,270)
クラスA(米ドル建・累積型)	22.489 (2,599)	24.333 (2,812)	25.621 (2,961)	- -	- -
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	93.32%	91.36%	98.11%	99.63%	99.67%
自己資本利益率	4.09%	4.02%	4.18%	13.54%	4.07%

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))

	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)	2021年 8月31日 に終了した 年度 (第15期)	2022年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第16期中)
営業収益(注1)	2,093 (324)	2,742 (424)	3,485 (539)	11,394 (1,761)	2,433 (376)
経常利益/損失金額(注2)	2,306 (356)	2,341 (362)	3,299 (510)	11,000 (1,700)	2,649 (409)
当期純利益/損失金額	2,306 (356)	2,341 (362)	3,299 (510)	11,000 (1,700)	2,649 (409)
出資総額(注3)	51,179 (7,911)	55,221 (8,536)	59,384 (9,180)	70,158 (10,845)	68,865 (10,645)
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)	22,000	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・累積型)	9,317	9,317	-	-	-
純資産額	51,179 (7,911)	55,221 (8,536)	59,384 (9,180)	70,158 (10,845)	68,865 (10,645)
総資産額	51,615 (7,979)	57,384 (8,870)	61,059 (9,439)	70,747 (10,936)	68,999 (10,666)
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)	17.337 (2,003)	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・累積型)	22.361 (2,584)	24.426 (2,822)	-	-	-
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	99.16%	96.23%	97.26%	99.17%	99.81%
自己資本利益率	4.51%	4.24%	5.56%	15.68%	3.85%

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))

	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)	2021年 8月31日 に終了した 年度 (第15期)	2022年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第16期中)
営業収益(注1)	2,434 (376)	635 (98)	121 (19)	1,681 (260)	1,608 (249)
経常利益/損失金額(注2)	2,708 (419)	1,181 (183)	350 (54)	1,238 (191)	1,805 (279)
当期純利益/損失金額	2,708 (419)	1,181 (183)	350 (54)	1,238 (191)	1,805 (279)
出資総額(注3)	60,475 (9,348)	54,993 (8,501)	45,189 (6,985)	43,350 (6,701)	39,039 (6,035)
発行済株式総数(株)					
クラスA(円建・分配型)	14,000	4,500	4,500	4,500	4,500
クラスA(円建・累積型)	-	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・分配型)	852,324	852,973	853,701	854,181	793,917
クラスA(米ドル建・累積型)	254,542	237,705	220,362	200,793	208,513
純資産額	60,475 (9,348)	54,993 (8,501)	45,189 (6,985)	43,350 (6,701)	39,039 (6,035)
総資産額	61,397 (9,491)	55,733 (8,615)	47,725 (7,377)	43,726 (6,759)	39,542 (6,112)
1株当たり純資産額					
クラスA(円建・分配型)	1,029.147	1,039.649	1,046.091	1,080.641	1,031.120
クラスA(円建・累積型)	-	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・分配型)	10.166 (1,175)	10.342 (1,195)	10.439 (1,206)	10.801 (1,248)	10.332 (1,194)
クラスA(米ドル建・累積型)	12.654 (1,462)	12.967 (1,498)	13.176 (1,522)	13.724 (1,586)	13.239 (1,530)
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	98.50%	98.67%	94.69%	99.14%	98.73%
自己資本利益率	4.48%	2.15%	0.77%	2.86%	4.62%

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))

	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)	2021年 8月31日 に終了した 年度 (第15期)	2022年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第16期中)
営業収益(注1)	4,414 (682)	141 (22)	2,360 (365)	7,573 (1,171)	3,757 (581)
経常利益/損失金額(注2)	5,231 (809)	1,425 (220)	1,681 (260)	6,264 (968)	4,349 (672)
当期純利益/損失金額	5,231 (809)	1,425 (220)	1,681 (260)	6,264 (968)	4,349 (672)
出資総額(注3)	111,165 (17,184)	102,532 (15,849)	92,329 (14,272)	90,350 (13,966)	82,098 (12,691)
発行済株式総数(株)					
クラスA(円建・分配型)	67,000	67,000	67,000	67,000	36,000
クラスA(円建・累積型)	-	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・分配型)	182,060	179,863	156,061	154,550	156,010
クラスA(米ドル建・累積型)	1,192,991	1,092,275	995,497	919,012	902,664
純資産額	111,165 (17,184)	102,532 (15,849)	92,329 (14,272)	90,350 (13,966)	82,098 (12,691)
総資産額	112,961 (17,462)	104,951 (16,223)	97,254 (15,034)	91,272 (14,109)	83,084 (12,843)
1株当たり純資産額					
クラスA(円建・分配型)	1,103.844	1,123.062	1,152.210	1,206.760	1,143.598
クラスA(円建・累積型)	-	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・分配型)	9.978 (1,153)	10.227 (1,182)	10.516 (1,215)	11.037 (1,275)	10.478 (1,211)
クラスA(米ドル建・累積型)	12.627 (1,459)	13.055 (1,509)	13.547 (1,565)	14.308 (1,653)	13.707 (1,584)
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	98.41%	97.70%	94.94%	98.99%	98.81%
自己資本利益率	4.71%	1.39%	1.82%	6.93%	5.30%

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))

	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)	2021年 8月31日 に終了した 年度 (第15期)	2022年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第16期中)
営業収益(注1)	11,426 (1,766)	2,371 (367)	11,886 (1,837)	33,716 (5,212)	9,933 (1,535)
経常利益/損失金額(注2)	13,586 (2,100)	1,754 (271)	10,009 (1,547)	30,054 (4,646)	11,642 (1,800)
当期純利益/損失金額	13,586 (2,100)	1,754 (271)	10,009 (1,547)	30,054 (4,646)	11,642 (1,800)
出資総額(注3)	291,688 (45,089)	279,087 (43,141)	257,991 (39,880)	262,553 (40,585)	244,139 (37,739)
発行済株式総数(株)					
クラスA(円建・分配型)	217,500	217,500	148,000	121,500	117,500
クラスA(円建・累積型)	-	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・分配型)	1,207,685	1,107,847	1,102,560	1,050,079	1,066,615
クラスA(米ドル建・累積型)	1,540,946	1,454,290	1,310,236	1,121,298	1,119,357
純資産額	291,688 (45,089)	279,087 (43,141)	257,991 (39,880)	262,553 (40,585)	244,139 (37,739)
総資産額	296,894 (45,894)	283,492 (43,822)	272,835 (42,175)	264,391 (40,870)	247,615 (38,276)
1株当たり純資産額					
クラスA(円建・分配型)	1,129.375	1,163.352	1,210.961	1,298.752	1,231.215
クラスA(円建・累積型)	-	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・分配型)	10.997 (1,271)	11.396 (1,317)	11.893 (1,374)	12.773 (1,476)	12.128 (1,401)
クラスA(米ドル建・累積型)	13.668 (1,579)	14.283 (1,650)	15.041 (1,738)	16.252 (1,878)	15.558 (1,798)
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	98.25%	98.45%	94.56%	99.30%	98.60%
自己資本利益率	4.66%	0.63%	3.88%	11.45%	4.77%

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))

	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)	2021年 8月31日 に終了した 年度 (第15期)	2022年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第16期中)
営業収益(注1)	3,058 (473)	680 (105)	4,002 (619)	10,922 (1,688)	2,641 (408)
経常利益/損失金額(注2)	3,606 (557)	367 (57)	3,519 (544)	9,964 (1,540)	3,087 (477)
当期純利益/損失金額	3,606 (557)	367 (57)	3,519 (544)	9,964 (1,540)	3,087 (477)
出資総額(注3)	70,680 (10,926)	67,697 (10,465)	63,723 (9,850)	66,472 (10,275)	57,728 (8,924)
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)	401,974	388,299	303,599	303,599	268,749
クラスA(米ドル建・累積型)	258,098	225,828	204,390	164,997	139,669
純資産額	70,680 (10,926)	67,697 (10,465)	63,723 (9,850)	66,472 (10,275)	57,728 (8,924)
総資産額	71,990 (11,128)	68,760 (10,629)	67,292 (10,402)	66,822 (10,329)	58,531 (9,048)
1株当たり純資産額					
クラスA(円建・分配型)	1,228.728	1,289.810	1,372.136	1,513.316	1,441.745
クラスA(円建・累積型)	-	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・分配型)	13.824 (1,597)	14.579 (1,685)	15.551 (1,797)	17.182 (1,985)	16.387 (1,894)
クラスA(米ドル建・累積型)	14.003 (1,618)	14.767 (1,706)	15.753 (1,820)	17.403 (2,011)	16.598 (1,918)
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	98.18%	98.45%	94.70%	99.48%	98.63%
自己資本利益率	5.10%	0.54%	5.52%	14.99%	5.35%

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))

	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)	2021年 8月31日 に終了した 年度 (第15期)	2022年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第16期中)
営業収益(注1)	1,385 (214)	318 (49)	1,835 (284)	4,201 (649)	814 (126)
経常利益/損失金額(注2)	1,628 (252)	153 (24)	1,636 (253)	3,809 (589)	1,011 (156)
当期純利益/損失金額	1,628 (252)	153 (24)	1,636 (253)	3,809 (589)	1,011 (156)
出資総額(注3)	24,642 (3,809)	24,528 (3,792)	19,617 (3,032)	20,692 (3,199)	19,748 (3,053)
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)	91,289	91,289	91,154	91,154	291,154
クラスA(米ドル建・累積型)	38,688	26,845	24,786	16,922	14,569
純資産額	24,642 (3,809)	24,528 (3,792)	19,617 (3,032)	20,692 (3,199)	19,748 (3,053)
総資産額	25,313 (3,913)	25,006 (3,865)	20,677 (3,196)	20,819 (3,218)	20,064 (3,101)
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)	13.669 (1,579)	14.473 (1,672)	15.670 (1,811)	17.514 (2,024)	16.708 (1,931)
クラスA(米ドル建・累積型)	13.678 (1,580)	14.484 (1,674)	15.681 (1,812)	17.526 (2,025)	16.720 (1,932)
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	97.35%	98.09%	94.87%	99.39%	98.43%
自己資本利益率	6.61%	0.62%	8.34%	18.41%	5.12%

(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		2022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
2022年3月末日	6,737,164.00	1,041,431

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		2022年3月末日
クラスA(円建)株式	分配型	82,500.00株
	累積型	0株
クラスA(米ドル建)株式	分配型	56,000.00株
	累積型	15,209.31株

	純資産総額(サブ・ファンド)	
	ポンド	千円
2022年3月末日	50,157,130.61	7,753,289

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		2022年3月末日
クラスA(円建)株式	分配型	174,500.00株
	累積型	0株
クラスA(米ドル建)株式	分配型	110,835.74株
	累積型	30,007.56株

	純資産総額(サブ・ファンド)	
	ポンド	千円
2022年3月末日	183,265,763.58	28,329,222

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		2022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	12,500.00株
	累積型	0株

	純資産総額(サブ・ファンド)	
	ポンド	千円
2022年3月末日	114,384,592.78	17,681,570

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		2022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
2022年3月末日	70,829,024.25	10,948,751

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		2022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	777,263.80株
	累積型	210,164.18株

	純資産総額(サブ・ファンド)	
	ポンド	千円
2022年3月末日	38,684,926.68	5,979,916

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		2022年3月末日
クラスA(円建)株式	分配型	36,000.00株
	累積型	0株
クラスA(米ドル建)株式	分配型	156,113.80株
	累積型	902,663.59株

	純資産総額(サブ・ファンド)	
	ポンド	千円
2022年3月末日	81,152,756.56	12,544,593

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		2022年3月末日
クラスA(円建)株式	分配型	117,500.00株
	累積型	0株
クラスA(米ドル建)株式	分配型	1,058,912.84株
	累積型	1,119,644.46株

	純資産総額(サブ・ファンド)	
	ポンド	千円
2022年3月末日	244,706,833.36	37,826,782

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		2022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	268,749.01株
	累積型	139,657.68株

	純資産総額(サブ・ファンド)	
	ポンド	千円
2022年3月末日	58,394,733.60	9,026,658

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		2022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	291,154.16株
	累積型	14,568.60株

	純資産総額(サブ・ファンド)	
	ポンド	千円
2022年3月末日	20,064,294.66	3,101,539

(3) 主要な投資主の状況

2022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	227,671.631	231,292.385	98.43
2	個人	スペイン	3,620.754		1.57

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	82,500.000	82,500.000	100.00
全米ドル建クラス					
1	法人	ルクセンブルグ	116,464.478	341,241.530	34.13
2	法人	ルクセンブルグ	85,669.752		25.11
3	法人	日本	56,000.000		16.41
4	法人	英国	28,810.180		8.44
5	法人	ルクセンブルグ	20,678.206		6.06

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	174,500.000	174,500.000	100.00
全米ドル建クラス					
1	法人	ルクセンブルグ	391,883.311	1,014,322.942	38.63
2	法人	英国	227,108.381		22.39
3	法人	ルクセンブルグ	121,146.961		11.94
4	法人	日本	101,000.000		9.96
5	法人	英国	74,375.248		7.33

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	189,792.561	521,504.531	36.39
2	法人	英国	114,359.652		21.93
3	法人	ルクセンブルグ	90,740.932		17.40
4	法人	ルクセンブルグ	67,015.262		12.85
5	法人	ルクセンブルグ	43,002.293		8.25

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	296,131.027	70.46
2	法人	英国	38,913.021		13.14
3	法人	ルクセンブルグ	38,171.581		12.89
4	法人	ルクセンブルグ	7,369.799		2.49
5	法人	英国	3,020.214		1.02

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	550,000.000	1,081,999.971	50.83
2	法人	ルクセンブルグ	148,144.795		13.69
3	法人	スペイン	108,372.173		10.02
4	法人	ルクセンブルグ	100,078.689		9.25
5	法人	スイス	87,102.367		8.05

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	36,000.000	36,000.000	100.00
全米ドル建クラス					
1	法人	ルクセンブルグ	848,551.065	1,262,063.531	67.24
2	法人	ルクセンブルグ	129,129.684		10.23
3	法人	スペイン	54,112.525		4.29
4	法人	ルクセンブルグ	44,288.521		3.51
5	法人	ルクセンブルグ	30,971.305		2.45

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	117,500.000	117,500.000	100.00
全米ドル建クラス					
1	法人	ルクセンブルグ	973,319.767	3,811,109.130	25.54
2	法人	ルクセンブルグ	841,718.486		22.09
3	法人	ルクセンブルグ	510,874.814		13.40
4	法人	ルクセンブルグ	291,757.822		7.66
5	法人	ルクセンブルグ	180,872.694		4.75

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	112,328.672	541,478.228	20.74
2	法人	ルクセンブルグ	108,948.566		20.12
3	法人	ルクセンブルグ	99,572.253		18.39
4	法人	日本	58,000.000		10.71
5	個人	南アフリカ	38,351.620		7.08

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	日本	237,000.000	316,195.988	74.95
2	法人	ルクセンブルグ	30,198.807		9.55
3	個人	英国	23,612.134		7.47
4	法人	ルクセンブルグ	14,568.599		4.61
5	法人	ルクセンブルグ	10,473.223		3.31

(4) 役員の状況

ファンドの取締役は、以下のとおりです。

(2022年5月末日現在)

氏名	役職名	主要略歴
フローレンス・ステイナー (Florence Stainier)	取締役	ルクセンブルグのアーレント・アンド・メーデルナッハ法律事務所の投資管理業務のパートナー弁護士。リエージュ大学(ベルギー)で法学の修士号を取得し、HECリエージュ(ベルギー)で税務の修士号を取得。2004年にルクセンブルグの弁護士資格を取得。特にMiFID、流通、イスラム金融およびUCITSに関連するルクセンブルグファンド協会(ALFI)の複数のワーキンググループのメンバーである。ルクセンブルグコンプライアンスオフィサー協会(ALCO)のメンバーでもある。
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・ユーカー・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

(2022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	6,577,923.04	95.78
	ルクセンブルグ	193,265.42	2.81
	小 計	6,771,188.46	98.59
その他資産 (現金およびデリバティブポジション)		96,715.79	1.41
資 産 総 額		6,867,904.25	100.00
負 債 総 額		130,740.25	1.90
純 資 産 総 額		6,737,164.00 (約1,041百万円)	98.10

2. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ2

(2022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	48,476,556.00	95.67
	ルクセンブルグ	1,601,445.61	3.16
	小 計	50,078,001.61	98.83
その他資産 (現金およびデリバティブポジション)		593,305.56	1.17
資 産 総 額		50,671,307.17	100.00
負 債 総 額		514,176.56	1.01
純 資 産 総 額		50,157,130.61 (約7,753百万円)	98.99

3. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ3

(2022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	177,155,456.37	95.64
	ルクセンブルグ	5,771,116.82	3.12
	小 計	182,926,573.19	98.75
その他資産 (現金およびデリバティブポジション)		2,306,198.17	1.25
資 産 総 額		185,232,771.36	100.00
負 債 総 額		1,967,007.78	1.06
純 資 産 総 額		183,265,763.58 (約28,329百万円)	98.94

4. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ4

(2022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	111,180,534.04	96.60
	ルクセンブルグ	2,975,190.42	2.58
	小 計	114,155,724.46	99.18
その他資産 (現金およびデリバティブポジション)		940,884.47	0.82
資 産 総 額		115,096,608.93	100.00
負 債 総 額		712,016.15	0.62
純 資 産 総 額		114,384,592.78 (約17,682百万円)	99.38

5. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ5

(2022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	69,775,718.31	97.80
	ルクセンブルグ	926,690.44	1.30
	小 計	70,702,408.75	99.10
その他資産 (現金およびデリバティブポジション)		639,904.58	0.90
資 産 総 額		71,342,313.33	100.00
負 債 総 額		513,289.08	0.72
純 資 産 総 額		70,829,024.25 (約10,949百万円)	99.28

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

(2022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	38,030,321.41	96.66
	英国	0.01	0.00
	小 計	38,030,321.42	96.66
その他資産 (現金およびデリバティブポジション)		1,315,079.64	3.34
資 産 総 額		39,345,401.06	100.00
負 債 総 額		660,474.38	1.68
純 資 産 総 額		38,684,926.68 (約5,980百万円)	98.32

2. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ2

(2022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	76,602,010.74	91.54
	英国	3,818,277.87	4.56
	小 計	80,420,288.61	96.11
その他資産 (現金およびデリバティブポジション)		3,258,484.11	3.89
資 産 総 額		83,678,772.72	100.00
負 債 総 額		2,526,016.16	3.02
純 資 産 総 額		81,152,756.56 (約12,545百万円)	96.98

3. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ3

(2022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	228,250,599.63	88.46
	小 計	228,250,599.63	88.46
その他資産 (現金およびデリバティブポジション)		29,769,031.84	11.54
資 産 総 額		258,019,631.47	100.00
負 債 総 額		13,312,798.11	5.16
純 資 産 総 額		244,706,833.36 (約37,827百万円)	94.84

4. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ4

(2022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	52,163,309.21	85.68
	ルクセンブルグ	1,836,746.31	3.02
	米国	1,699,868.04	2.79
	小 計	55,699,923.56	91.49
その他資産 (現金およびデリバティブポジション)		5,178,858.59	8.51
資 産 総 額		60,878,782.15	100.00
負 債 総 額		2,484,048.55	4.08
純 資 産 総 額		58,394,733.60 (約9,027百万円)	95.92

5. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ5

(2022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	17,028,504.51	80.59
	ルクセンブルグ	930,094.23	4.40
	米国	904,931.73	4.28
	小 計	18,863,530.47	89.27
その他資産 (現金およびデリバティブポジション)		2,267,488.16	10.73
資 産 総 額		21,131,018.63	100.00
負 債 総 額		1,066,723.97	5.05
純 資 産 総 額		20,064,294.66 (約3,102百万円)	94.95

[次へ](#)

(2) 運用実績

純資産等の推移

2022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。

2022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4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・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
2021年4月末	7,501	1,160	7,435	1,149	1,077.138	-	-	-	15.502	1,791
2021年5月末	7,394	1,143	7,260	1,122	1,076.882	-	-	-	15.521	1,793
2021年6月末	7,527	1,164	7,426	1,148	1,088.883	-	-	-	15.710	1,815
2021年7月末	7,340	1,135	7,274	1,124	1,094.155	-	-	-	15.810	1,827
2021年8月末	7,488	1,157	7,216	1,115	1,099.472	-	-	-	15.906	1,838
2021年9月末	7,290	1,127	7,191	1,112	1,085.212	-	-	-	15.724	1,817
2021年10月末	11,438	1,768	7,020	1,085	1,085.659	-	-	-	15.790	1,825
2021年11月末	7,338	1,134	7,190	1,111	1,090.098	-	-	-	15.871	1,834
2021年12月末	7,239	1,119	7,095	1,097	1,088.961	-	-	-	15.878	1,835
2022年1月末	7,089	1,096	6,998	1,082	1,065.601	-	-	-	15.553	1,797
2022年2月末	6,921	1,070	6,882	1,064	1,046.917	-	-	-	15.295	1,767
2022年3月末	6,868	1,062	6,737	1,041	1,041.707	-	-	-	15.256	1,763

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
2021年4月末	56,460	8,728	53,218	8,226	1,134.861	-	15.386	1,778	18.271	2,111
2021年5月末	54,032	8,352	53,262	8,233	1,133.197	-	15.368	1,776	18.250	2,109
2021年6月末	54,926	8,490	54,069	8,358	1,147.660	-	15.568	1,799	18.560	2,145
2021年7月末	54,815	8,473	54,316	8,396	1,149.762	-	15.602	1,803	18.601	2,149
2021年8月末	55,809	8,627	55,236	8,538	1,162.664	-	15.780	1,823	18.812	2,174
2021年9月末	55,106	8,518	54,596	8,439	1,140.391	-	15.479	1,789	18.545	2,143
2021年10月末	81,484	12,596	54,528	8,429	1,147.528	-	15.579	1,800	18.668	2,157
2021年11月末	54,248	8,386	53,420	8,258	1,153.228	-	15.656	1,809	18.756	2,167
2021年12月末	53,691	8,300	53,356	8,248	1,151.271	-	15.648	1,808	18.816	2,174
2022年1月末	51,797	8,007	51,578	7,973	1,122.446	-	15.258	1,763	18.348	2,120
2022年2月末	50,067	7,739	49,796	7,697	1,099.156	-	14.943	1,727	17.969	2,076
2022年3月末	50,671	7,833	50,157	7,753	1,095.717	-	14.919	1,724	18.025	2,083

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
2021年4月末	174,238	26,934	169,898	26,263	1,266.954	-	14.602	1,687	18.205	2,104
2021年5月末	170,524	26,360	168,801	26,093	1,262.033	-	14.548	1,681	18.138	2,096
2021年6月末	177,276	27,403	175,178	27,079	1,286.450	-	14.832	1,714	18.559	2,144
2021年7月末	178,426	27,581	176,569	27,294	1,284.133	-	14.809	1,711	18.530	2,141
2021年8月末	189,338	29,268	184,520	28,523	1,308.564	-	15.093	1,744	18.886	2,182
2021年9月末	181,289	28,024	179,848	27,801	1,281.057	-	14.781	1,708	18.584	2,147
2021年10月末	242,941	37,554	182,434	28,201	1,296.065	-	14.965	1,729	18.816	2,174
2021年11月末	186,862	28,885	184,472	28,516	1,303.204	-	15.042	1,738	18.912	2,185
2021年12月末	185,640	28,696	184,803	28,567	1,307.953	-	15.113	1,746	19.075	2,204
2022年1月末	184,631	28,540	183,072	28,299	1,269.603	-	14.669	1,695	18.516	2,140
2022年2月末	180,497	27,901	180,019	27,827	1,238.224	-	14.309	1,653	18.061	2,087
2022年3月末	185,233	28,633	183,266	28,329	1,248.559	-	14.448	1,669	18.318	2,117

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
2021年4月末	100,638	15,557	99,554	15,389	1,628.961	-	19.665	2,272	27.175	3,140
2021年5月末	100,932	15,602	100,296	15,504	1,618.683	-	19.547	2,259	-	-
2021年6月末	111,362	17,214	105,224	16,266	1,667.318	-	20.134	2,326	-	-
2021年7月末	107,182	16,568	106,680	16,491	1,657.444	-	20.019	2,313	-	-
2021年8月末	111,697	17,266	111,288	17,203	1,701.594	-	20.556	2,375	-	-
2021年9月末	111,856	17,291	110,833	17,133	1,667.762	-	20.154	2,329	-	-
2021年10月末	130,829	20,224	111,885	17,295	1,698.172	-	20.522	2,371	-	-
2021年11月末	115,256	17,816	113,578	17,557	1,709.408	-	20.650	2,386	-	-
2021年12月末	115,512	17,856	114,967	17,772	1,730.059	-	20.920	2,417	-	-
2022年1月末	113,921	17,610	113,687	17,574	1,669.915	-	20.195	2,334	-	-
2022年2月末	111,685	17,264	111,311	17,206	1,624.262	-	19.647	2,270	-	-
2022年3月末	115,097	17,792	114,385	17,682	1,662.084	-	20.109	2,324	-	-

(注) 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(米ドル建)株式(累積型)は2021年5月17日付で、運用が停止され、2022年3月末日現在、運用されていない。

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
2021年4月末	65,384	10,107	65,273	10,090	-	-	-	-	-	-
2021年5月末	65,808	10,173	65,428	10,114	-	-	-	-	-	-
2021年6月末	76,839	11,878	68,868	10,646	-	-	-	-	-	-
2021年7月末	68,458	10,582	68,305	10,559	-	-	-	-	-	-
2021年8月末	70,747	10,936	70,158	10,845	-	-	-	-	-	-
2021年9月末	71,002	10,975	70,766	10,939	-	-	-	-	-	-
2021年10月末	77,403	11,965	72,148	11,153	-	-	-	-	-	-
2021年11月末	73,390	11,345	72,110	11,147	-	-	-	-	-	-
2021年12月末	73,682	11,390	73,223	11,319	-	-	-	-	-	-
2022年1月末	70,383	10,880	70,263	10,861	-	-	-	-	-	-
2022年2月末	68,999	10,666	68,865	10,645	-	-	-	-	-	-
2022年3月末	71,342	11,028	70,829	10,949	-	-	-	-	-	-

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
2021年4月末	45,163	6,981	45,008	6,957	1,065.781	-	10.641	1,230	13.457	1,555
2021年5月末	43,853	6,779	43,267	6,688	1,064.198	-	10.628	1,228	13.455	1,555
2021年6月末	43,983	6,799	43,341	6,700	1,072.666	-	10.715	1,238	13.577	1,569
2021年7月末	44,117	6,820	43,084	6,660	1,077.112	-	10.763	1,244	13.658	1,578
2021年8月末	43,726	6,759	43,350	6,701	1,080.641	-	10.801	1,248	13.724	1,586
2021年9月末	62,955	9,732	42,736	6,606	1,066.338	-	10.662	1,232	13.571	1,568
2021年10月末	42,233	6,528	41,916	6,479	1,066.861	-	10.674	1,233	13.604	1,572
2021年11月末	43,905	6,787	42,449	6,562	1,070.032	-	10.705	1,237	13.660	1,578
2021年12月末	42,055	6,501	41,390	6,398	1,070.554	-	10.721	1,239	13.705	1,584
2022年1月末	40,460	6,254	40,178	6,211	1,046.591	-	10.484	1,211	13.418	1,550
2022年2月末	39,542	6,112	39,039	6,035	1,031.120	-	10.332	1,194	13.239	1,530
2022年3月末	39,345	6,082	38,685	5,980	1,021.138	-	10.243	1,184	13.141	1,518

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
2021年4月末	91,812	14,192	91,194	14,097	1,184.395	-	10.821	1,250	13.988	1,616
2021年5月末	89,527	13,839	88,814	13,729	1,181.198	-	10.795	1,247	13.954	1,612
2021年6月末	90,866	14,046	89,649	13,858	1,192.131	-	10.897	1,259	14.128	1,632
2021年7月末	91,667	14,170	89,280	13,801	1,194.988	-	10.927	1,263	14.166	1,637
2021年8月末	91,272	14,109	90,350	13,966	1,206.760	-	11.037	1,275	14.308	1,653
2021年9月末	128,112	19,804	88,722	13,715	1,182.921	-	10.822	1,250	14.092	1,628
2021年10月末	88,516	13,683	87,950	13,595	1,188.380	-	10.878	1,257	14.166	1,637
2021年11月末	90,589	14,003	88,388	13,663	1,194.479	-	10.932	1,263	14.234	1,645
2021年12月末	88,491	13,679	87,252	13,487	1,195.574	-	10.950	1,265	14.323	1,655
2022年1月末	84,333	13,036	83,738	12,944	1,163.547	-	10.659	1,232	13.942	1,611
2022年2月末	83,084	12,843	82,098	12,691	1,143.598	-	10.478	1,211	13.707	1,584
2022年3月末	83,679	12,935	81,153	12,545	1,133.097	-	10.393	1,201	13.643	1,576

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
2021年4月末	265,243	41,001	264,321	40,859	1,264.995	-	12.431	1,436	15.776	1,823
2021年5月末	260,149	40,214	256,478	39,646	1,256.990	-	12.355	1,428	15.678	1,812
2021年6月末	261,833	40,474	259,628	40,133	1,275.602	-	12.541	1,449	15.957	1,844
2021年7月末	264,220	40,843	257,923	39,870	1,276.645	-	12.553	1,450	15.972	1,846
2021年8月末	264,391	40,870	262,553	40,585	1,298.752	-	12.773	1,476	16.252	1,878
2021年9月末	321,333	49,672	256,736	39,686	1,269.602	-	12.487	1,443	15.956	1,844
2021年10月末	258,803	40,006	256,041	39,579	1,282.238	-	12.618	1,458	16.123	1,863
2021年11月末	279,427	43,194	259,943	40,182	1,291.970	-	12.711	1,469	16.242	1,877
2021年12月末	261,969	40,495	258,358	39,937	1,298.201	-	12.785	1,477	16.401	1,895
2022年1月末	251,029	38,804	249,731	38,603	1,257.151	-	12.382	1,431	15.884	1,835
2022年2月末	247,615	38,276	244,139	37,739	1,231.215	-	12.128	1,401	15.558	1,798
2022年3月末	258,020	39,885	244,707	37,827	1,230.427	-	12.133	1,402	15.613	1,804

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
2021年4月末	66,469	10,275	65,909	10,188	1,460.864	-	16.571	1,915	16.787	1,940
2021年5月末	64,987	10,046	64,499	9,970	1,446.151	-	16.409	1,896	16.620	1,920
2021年6月末	65,892	10,186	65,518	10,128	1,479.752	-	16.794	1,941	17.010	1,966
2021年7月末	66,503	10,280	64,851	10,025	1,476.902	-	16.765	1,937	16.981	1,962
2021年8月末	66,822	10,329	66,472	10,275	1,513.316	-	17.182	1,985	17.403	2,011
2021年9月末	69,839	10,796	64,162	9,918	1,480.198	-	16.808	1,942	17.024	1,967
2021年10月末	63,585	9,829	63,038	9,744	1,503.343	-	17.071	1,973	17.290	1,998
2021年11月末	66,996	10,356	63,999	9,893	1,516.818	-	17.220	1,990	17.441	2,015
2021年12月末	63,768	9,857	62,648	9,684	1,535.148	-	17.438	2,015	17.662	2,041
2022年1月末	60,291	9,320	60,045	9,282	1,478.280	-	16.796	1,941	17.012	1,966
2022年2月末	58,531	9,048	57,728	8,924	1,441.745	-	16.387	1,894	16.598	1,918
2022年3月末	60,879	9,411	58,395	9,027	1,456.300	-	16.556	1,913	16.768	1,938

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
2021年4月末	20,685	3,197	20,570	3,180	-	-	16.851	1,947	16.863	1,949
2021年5月末	20,131	3,112	19,945	3,083	-	-	16.639	1,923	16.651	1,924
2021年6月末	20,553	3,177	20,432	3,158	-	-	17.068	1,972	17.080	1,974
2021年7月末	20,591	3,183	20,167	3,117	-	-	17.017	1,966	17.029	1,968
2021年8月末	20,819	3,218	20,692	3,199	-	-	17.514	2,024	17.526	2,025
2021年9月末	21,924	3,389	21,433	3,313	-	-	17.101	1,976	17.114	1,978
2021年10月末	21,902	3,386	20,836	3,221	-	-	17.436	2,015	17.449	2,016
2021年11月末	22,358	3,456	21,152	3,270	-	-	17.620	2,036	17.633	2,037
2021年12月末	21,570	3,334	21,243	3,284	-	-	17.866	2,064	17.879	2,066
2022年1月末	20,441	3,160	20,336	3,144	-	-	17.155	1,982	17.168	1,984
2022年2月末	20,064	3,101	19,748	3,053	-	-	16.708	1,931	16.720	1,932
2022年3月末	21,131	3,266	20,064	3,101	-	-	16.966	1,960	16.978	1,962

[次へ](#)

分配の推移

2022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 2021年4月1日 至 2022年3月31日	16.046061	-	-

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 2021年4月1日 至 2022年3月31日	20.102227	0.270457	31

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 2021年4月1日 至 2022年3月31日	21.708594	0.248012	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 2021年4月1日 至 2022年3月31日	4.304411	0.049220	6

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 2021年4月1日 至 2022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 2021年4月1日 至 2022年3月31日	16.540251	0.162867	19

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 2021年4月1日 至 2022年3月31日	18.693717	0.168330	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 2021年4月1日 至 2022年3月31日	18.328682	0.177376	20

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 2021年4月1日 至 2022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 2021年4月1日 至 2022年3月31日	-	-	-

自己資本利益率(収益率)の推移

2022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 = 2022年3月末日現在の1株当たり純資産価格(2022年3月末日前1年間の分配金の合計額を加えた額)

b = 2021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 2021年4月1日 至 2022年3月31日	-0.55	-	-	-0.22

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 2021年4月1日 至 2022年3月31日	0.14	-	0.61	0.54

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 2021年4月1日 至 2022年3月31日	2.81	-	3.26	3.24

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 2021年4月1日 至 2022年3月31日	5.56	-	5.83	-

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 2021年4月1日 至 2022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 2021年4月1日 至 2022年3月31日	- 1.26	-	- 0.76	- 0.82

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 2021年4月1日 至 2022年3月31日	- 0.73	-	- 0.34	- 0.40

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 2021年4月1日 至 2022年3月31日	1.48	-	1.83	1.77

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 2021年4月1日 至 2022年3月31日	3.12	-	3.42	3.39

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 2021年4月1日 至 2022年3月31日	-	-	4.52	4.52

(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。

[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

2022年3月末日現在の資本金は、22,325,001ポンド(約35億円)

(2) 大株主の状況

(2022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

(2022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
ニコラ・エガース (Nicola Eggers)	取締役	2022年3月17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) 2022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

2022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。

(2022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	469,554,765	0.687 (クラス / 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・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	464,964,236	0.672 (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 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	430,437,254	0.669 (クラス / 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 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	2004年10月1日	303,987,871	3.142 (クラス / 分配型)
5	パークレイズ・ポートフォリオ-バ ークレイズ・リキッド・オルタナティブ・ストラテジーズ (Barclays Portfolios SICAV - Barclays Liquid Alternative Strategies)	オープンエンド型/ アンブレラ型/ 変動資本型投資法人	2016年6月10日	262,532,191	11.737 (クラスR / 累積型)

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

2020年12月末現在、94.5百万ポンド(約146億円)。

(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。

(2021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) 役員状況

副投資運用会社の役員は以下のとおりです。

(2022年1月31日現在)

氏名	役職	主要略歴
ステイシー・マリ (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。

デビー・クラーク (Debbie Clarke)	非業務執行取締役	2021年7月21日に現職に就任。
ステファン・コーヘン (Stephen Cohen)	業務執行取締役	2021年4月15日に現職に就任。
マティウ・ダンカン (Matthieu Duncan)	非業務執行取締役	2021年7月21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。

2022年1月31日現在。変更される可能性があります。

(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の情報は提供されていません。

ブラックロックは、10兆100億ドルの資産をグローバルに運用しています。

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2020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

ブラックロックは、その収益の大部分を投資アドバイザーおよび管理事務代行報酬から得ています。ブラックロックは、また、主に高格付けの銀行およびブローカーディーラーに対し、顧客に代わって証券貸付を行うことにより収益を得ています。一定の個別勘定および投資ファンドに関する投資アドバイザー契約では、運用資産に基づく基本報酬に加え、投資の相対的および/または絶対的パフォーマンスに基づく成功報酬が定められています。ブラックロックは、投資運用テクノロジー・システム、リスク管理サービス、ウェルス・マネジメントおよびデジタル販売ツールを、すべて報酬方式で提供します。販売報酬およびサービス報酬は、投資商品の販売および投資ポートフォリオに対するサービスを支援することにより稼得されます。

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、2022年2月28日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1ポンド=154.58円、1米ドル=115.55円、1ユーロ=129.34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

2022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		
	2022年2月28日現在 (ボンド)	(千円)	2022年2月28日現在 (ボンド)	(千円)	2022年2月28日現在 (ボンド)	(千円)	
資産							
投資有価証券 (時価)	2(c)	6,845,580	1,058,190	49,702,350	7,682,989	179,340,200	27,722,408
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)	25,809	3,990	41,832	6,466	138,975	21,483
現金預金		13,459	2,080	62,282	9,628	523,787	80,967
投資有価証券 売却未収金		-	-	187,762	29,024	-	-
ファンド株式 発行未収金		-	-	-	-	317,238	49,039
未収配当金		768	119	11,292	1,746	51,777	8,004
その他資産		35,119	5,429	61,670	9,533	125,143	19,345
資産合計		6,920,735	1,069,807	50,067,188	7,739,386	180,497,120	27,901,245
負債							
為替先渡契約に かかる未実現損失	2(g)	3,186	492	22,672	3,505	62,528	9,666
当座借越		-	-	139,399	21,548	-	-
ファンド株式 買戻未払金		-	-	-	-	123,397	19,075
その他未払金 および未払費用		35,359	5,466	109,192	16,879	292,043	45,144
負債合計		38,545	5,958	271,263	41,932	477,968	73,884
期末純資産		6,882,190	1,063,849	49,795,925	7,697,454	180,019,152	27,827,361

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2022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	
		2022年2月28日現在 (ポンド)	(千円)	2022年2月28日現在 (ポンド)	(千円)	2022年2月28日現在 (ポンド)	(千円)
資産							
投資有価証券							
(時価)	2(c)	111,072,174	17,169,537	68,552,886	10,596,905	37,570,932	5,807,715
先物契約にかかる 未実現利益	2(e)	-	-	-	-	43,755	6,764
為替先渡契約に かかる未実現利益	2(g)	72,097	11,145	48,454	7,490	106,506	16,464
現金預金		397,253	61,407	320,036	49,471	1,044,839	161,511
投資有価証券 売却未収金		22,565	3,488	-	-	765,098	118,269
ファンド株式 発行未収金		-	-	-	-	-	-
未収配当金		41,525	6,419	29,867	4,617	-	-
その他資産		79,081	12,224	47,853	7,397	11,203	1,732
資産合計		111,684,695	17,264,220	68,999,096	10,665,880	39,542,333	6,112,454
負債							
為替先渡契約に かかる未実現損失	2(g)	15,292	2,364	10,547	1,630	334,282	51,673
当座借越		-	-	-	-	58,492	9,042
ファンド株式 買戻未払金		171,553	26,519	-	-	-	-
その他未払金 および未払費用		186,572	28,840	123,910	19,154	111,045	17,165
負債合計		373,417	57,723	134,457	20,784	503,819	77,880
期末純資産		111,311,278	17,206,497	68,864,639	10,645,096	39,038,514	6,034,573

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2022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	
		2022年2月28日現在 (ポンド)	(千円)	2022年2月28日現在 (ポンド)	(千円)	2022年2月28日現在 (ポンド)	(千円)
資産							
投資有価証券							
(時価)	2(c)	79,334,012	12,263,452	219,833,992	33,981,938	54,155,178	8,371,307
先物契約にかかる 未実現利益	2(e)	148,128	22,898	695,333	107,485	231,354	35,763
為替先渡契約に かかる未実現利益	2(g)	142,588	22,041	486,324	75,176	102,023	15,771
現金預金		1,925,465	297,638	21,472,835	3,319,271	2,673,115	413,210
投資有価証券 売却未収金		1,531,558	236,748	5,126,978	792,528	1,365,531	211,084
ファンド株式							
発行未収金		-	-	-	-	-	-
未収配当金		2,159	334	-	-	-	-
その他資産		-	-	26	4	3,522	544
資産合計		83,083,910	12,843,111	247,615,488	38,276,402	58,530,723	9,047,679
負債							
先物契約にかかる 未実現損失	2(e)	-	-	1,292,215	199,751	380,063	58,750
為替先渡契約に かかる未実現損失	2(g)	654,678	101,200	1,177,216	181,974	177,004	27,361
当座借越		12,378	1,913	85,679	13,244	-	-
ファンド株式							
買戻未払金		6,582	1,017	35,999	5,565	7,525	1,163
その他未払金							
および未払費用		312,519	48,309	885,712	136,913	238,246	36,828
負債合計		986,157	152,440	3,476,821	537,447	802,838	124,103
期末純資産		82,097,753	12,690,671	244,138,667	37,738,955	57,727,885	8,923,576

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2022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		リクイッド・ オルタナティブ・ ストラテジーズ		合算	
		2022年2月28日現在 (ポンド)	(千円)	2022年2月28日現在 (ポンド)	(千円)	2022年2月28日現在 (ポンド)	(千円)
資産							
投資有価証券 (時価)	2(c)	18,117,257	2,800,566	256,964,653	39,721,596	1,081,489,214	167,176,603
先物契約にかかる 未実現利益	2(e)	83,681	12,935	-	-	1,202,251	185,844
為替先渡契約に かかる未実現利益	2(g)	48,195	7,450	-	-	1,212,803	187,475
現金預金		1,388,534	214,640	7,217,052	1,115,612	37,038,657	5,725,436
投資有価証券 売却未収金		404,712	62,560	-	-	9,404,204	1,453,702
ファンド株式 発行未収金		-	-	-	-	317,238	49,039
未収配当金		-	-	-	-	137,388	21,237
その他資産		21,909	3,387	-	-	385,526	59,595
資産合計		20,064,288	3,101,538	264,181,705	40,837,208	1,131,187,281	174,858,930
負債							
先物契約にかかる 未実現損失	2(e)	152,025	23,500	-	-	1,824,303	282,001
為替先渡契約に かかる未実現損失	2(g)	54,361	8,403	437,875	67,687	2,949,641	455,956
当座借越		-	-	-	-	295,948	45,748
ファンド株式 買戻未払金		-	-	431,317	66,673	776,373	120,012
その他未払金 および未払費用		110,169	17,030	444,962	68,782	2,849,729	440,511
負債合計		316,555	48,933	1,314,154	203,142	8,695,994	1,344,227
期末純資産		19,747,733	3,052,605	262,867,551	40,634,066	1,122,491,287	173,514,703

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2022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)	
2022年2月28日現在 純資産(ポンド)	6,882,190	1,063,849	49,795,925	7,697,454	180,019,152	27,827,361
2022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	15.094	2,333	17.130	2,648	17.786	2,749
クラスA - 分配型	12.619	1,951	13.681	2,115	16.311	2,521
クラスC - 累積型	-	-	17.173	2,655	22.781	3,521
クラスC - 分配型	-	-	15.074	2,330	18.447	2,852
クラスI - 累積型	-	-	-	-	-	-
クラスI - 分配型	-	-	-	-	-	-
クラスR - 累積型	15.279	2,362	19.091	2,951	20.115	3,109
クラスR - 分配型	12.620	1,951	16.615	2,568	17.219	2,662
米ドル建クラス						
クラスA - 累積型	15.295	1,767	17.970	2,076	18.061	2,087
クラスA - 分配型	-	-	14.943	1,727	14.309	1,653
クラスC - 累積型	15.326	1,771	16.793	1,940	23.839	2,755
クラスC - 分配型	-	-	-	-	14.661	1,694
クラスR - 累積型	-	-	17.339	2,004	22.418	2,590
クラスR - 分配型	-	-	15.099	1,745	19.778	2,285
ユーロ建クラス						
クラスA - 累積型	13.763	1,780	15.326	1,982	19.870	2,570
クラスA - 分配型	-	-	10.867	1,406	-	-
クラスC - 累積型	-	-	15.086	1,951	20.499	2,651
クラスC - 分配型	-	-	-	-	18.230	2,358
クラスR - 累積型	-	-	15.801	2,044	19.167	2,479
クラスR - 分配型	-	-	-	-	16.386	2,119
クラスY - 累積型	-	-	-	-	-	-
円建クラス						
クラスA - 分配型	1,046.917		1,099.156		1,238.224	

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2022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)	
2022年2月28日現在 純資産(ポンド)	111,311,278	17,206,497	68,864,639	10,645,096	39,038,514	6,034,573
2022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	22.707	3,510	28.452	4,398	13.223	2,044
クラスA - 分配型	24.618	3,805	30.369	4,694	10.297	1,592
クラスC - 累積型	26.646	4,119	29.790	4,605	11.406	1,763
クラスC - 分配型	19.596	3,029	28.270	4,370	10.434	1,613
クラスI - 累積型	-	-	-	-	-	-
クラスI - 分配型	-	-	-	-	-	-
クラスR - 累積型	22.193	3,431	28.575	4,417	13.377	2,068
クラスR - 分配型	19.836	3,066	25.955	4,012	10.543	1,630
米ドル建クラス						
クラスA - 累積型	-	-	-	-	13.239	1,530
クラスA - 分配型	19.647	2,270	-	-	10.332	1,194
クラスC - 累積型	25.367	2,931	32.868	3,798	13.329	1,540
クラスC - 分配型	23.816	2,752	-	-	-	-
クラスR - 累積型	26.639	3,078	32.806	3,791	11.173	1,291
クラスR - 分配型	23.992	2,772	30.765	3,555	-	-
ユーロ建クラス						
クラスA - 累積型	-	-	-	-	11.892	1,538
クラスA - 分配型	16.080	2,080	-	-	9.317	1,205
クラスC - 累積型	19.423	2,512	28.267	3,656	12.058	1,560
クラスC - 分配型	-	-	25.264	3,268	11.038	1,428
クラスR - 累積型	24.780	3,205	22.697	2,936	12.180	1,575
クラスR - 分配型	17.361	2,245	-	-	-	-
クラスY - 累積型	-	-	-	-	-	-
円建クラス						
クラスA - 分配型	1,624.262		-		1,031.120	

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2022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)	
2022年2月28日現在 純資産(ポンド)	82,097,753	12,690,671	244,138,667	37,738,955	57,727,885	8,923,576
2022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	13.819	2,136	15.795	2,442	16.707	2,583
クラスA - 分配型	10.530	1,628	12.262	1,895	16.561	2,560
クラスC - 累積型	14.457	2,235	17.057	2,637	-	-
クラスC - 分配型	11.205	1,732	13.248	2,048	17.195	2,658
クラスI - 累積型	-	-	-	-	18.832	2,911
クラスI - 分配型	-	-	14.323	2,214	17.273	2,670
クラスR - 累積型	15.158	2,343	17.254	2,667	18.363	2,839
クラスR - 分配型	11.549	1,785	13.767	2,128	17.214	2,661
米ドル建クラス						
クラスA - 累積型	13.707	1,584	15.558	1,798	16.598	1,918
クラスA - 分配型	10.478	1,211	12.128	1,401	16.387	1,894
クラスC - 累積型	14.261	1,648	16.374	1,892	-	-
クラスC - 分配型	12.836	1,483	14.821	1,713	-	-
クラスR - 累積型	12.645	1,461	16.888	1,951	17.778	2,054
クラスR - 分配型	11.507	1,330	13.638	1,576	17.202	1,988
ユーロ建クラス						
クラスA - 累積型	11.785	1,524	13.266	1,716	14.160	1,831
クラスA - 分配型	9.026	1,167	10.227	1,323	14.003	1,811
クラスC - 累積型	12.297	1,590	14.127	1,827	-	-
クラスC - 分配型	9.434	1,220	11.099	1,436	14.771	1,910
クラスR - 累積型	12.813	1,657	14.395	1,862	15.029	1,944
クラスR - 分配型	9.912	1,282	11.519	1,490	14.715	1,903
クラスY - 累積型	-	-	13.117	1,697	13.661	1,767
円建クラス						
クラスA - 分配型	1,143.598		1,231.215		1,441.745	

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2022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)	
2022年2月28日現在 純資産(ポンド)	19,747,733	3,052,605	262,867,551	40,634,066
2022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	17.075	2,639	-	-
クラスA - 分配型	16.942	2,619	-	-
クラスC - 累積型	-	-	-	-
クラスC - 分配型	18.109	2,799	-	-
クラスI - 累積型	-	-	-	-
クラスI - 分配型	-	-	-	-
クラスR - 累積型	18.460	2,854	11.782	1,821
クラスR - 分配型	18.033	2,788	-	-
米ドル建クラス				
クラスA - 累積型	16.720	1,932	11.680	1,350
クラスA - 分配型	16.708	1,931	-	-
クラスC - 累積型	-	-	-	-
クラスC - 分配型	-	-	-	-
クラスR - 累積型	18.388	2,125	12.334	1,425
クラスR - 分配型	-	-	-	-
ユーロ建クラス				
クラスA - 累積型	14.153	1,831	10.274	1,329
クラスA - 分配型	13.974	1,807	-	-
クラスC - 累積型	14.726	1,905	-	-
クラスC - 分配型	14.561	1,883	-	-
クラスR - 累積型	15.251	1,973	10.789	1,395
クラスR - 分配型	15.006	1,941	-	-
クラスY - 累積型	13.849	1,791	-	-
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。

2022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
2022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	12,190	21,028	79,161	45,739
クラスA - 分配型	20,498	20,908	37,067	19,720
クラスC - 累積型	-	31,712	177,697	35,022
クラスC - 分配型	-	594	233,053	38,189
クラス - 累積型	-	-	-	-
クラス - 分配型	-	-	-	-
クラスR - 累積型	57,043	1,062,578	4,339,359	2,744,394
クラスR - 分配型	104,682	1,038,255	3,085,907	1,489,181
米ドル建クラス				
クラスA - 累積型	3,621	15,209	30,008	-
クラスA - 分配型	-	56,000	110,836	12,500
クラスC - 累積型	227,672	20,678	10,002	43,002
クラスC - 分配型	-	-	1,815	90,741
クラスR - 累積型	-	104,079	618,992	252,927
クラスR - 分配型	-	145,275	245,745	118,453
ユーロ建クラス				
クラスA - 累積型	78,168	130,949	53,840	-
クラスA - 分配型	-	11,685	-	2,911
クラスC - 累積型	-	197,541	48,680	73,245
クラスC - 分配型	-	-	29,338	-
クラスR - 累積型	-	160,714	583,545	109,793
クラスR - 分配型	-	-	40,027	290,904
クラスY - 累積型	-	-	-	-
円建クラス				
クラスA - 分配型	104,000	82,500	174,500	17,000

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2022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
2022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	15,070	110,639	161,422	176,078
クラスA - 分配型	14,938	318,107	223,831	2,497,834
クラスC - 累積型	9,643	10,416	46,353	81,215
クラスC - 分配型	28,047	82,435	124,482	639,397
クラス - 累積型	-	-	-	-
クラス - 分配型	-	-	-	67,615
クラスR - 累積型	1,102,968	148,162	982,626	3,146,625
クラスR - 分配型	679,187	327,914	851,080	2,159,010
米ドル建クラス				
クラスA - 累積型	-	208,513	902,664	1,119,357
クラスA - 分配型	-	793,917	156,010	1,066,615
クラスC - 累積型	10,390	91,623	37,407	173,057
クラスC - 分配型	-	-	20,408	281,255
クラスR - 累積型	38,172	2,949	16,342	335,758
クラスR - 分配型	247,569	-	129,130	846,766
ユーロ建クラス				
クラスA - 累積型	-	1,541,885	3,109,896	5,398,798
クラスA - 分配型	-	64,095	376,602	455,925
クラスC - 累積型	6,274	14,643	143,888	94,602
クラスC - 分配型	102,117	245,596	107,487	166,921
クラスR - 累積型	451,781	47,114	122,016	70,100
クラスR - 分配型	-	-	120,229	221,289
クラスY - 累積型	-	-	-	434,689
円建クラス				
クラスA - 分配型	-	4,500	36,000	117,500

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2022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
2022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	24,370	15,743	-
クラスA - 分配型	435,502	81,580	-
クラスC - 累積型	-	-	-
クラスC - 分配型	211,622	37,024	-
クラス - 累積型	8,776	-	-
クラス - 分配型	17,653	-	-
クラスR - 累積型	575,902	320,928	21,226,560
クラスR - 分配型	705,496	67,223	-
米ドル建クラス			
クラスA - 累積型	139,669	14,569	622,215
クラスA - 分配型	268,749	291,154	-
クラスC - 累積型	-	-	-
クラスC - 分配型	-	-	-
クラスR - 累積型	24,123	10,473	172,426
クラスR - 分配型	109,942	-	-
ユーロ建クラス			
クラスA - 累積型	1,052,646	115,288	518,233
クラスA - 分配型	84,552	7,798	-
クラスC - 累積型	-	11,876	-
クラスC - 分配型	12	37,952	-
クラスR - 累積型	8,023	10,725	145,389
クラスR - 分配型	50,043	3,237	-
クラスY - 累積型	113,671	353,262	-
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

2022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)
		2022年2月28日に 終了した期間		2022年2月28日に 終了した期間		2022年2月28日に 終了した期間	
収益							
受取配当金(純額)	2(d)	52,727	8,151	455,478	70,408	1,534,728	237,238
収益合計		52,727	8,151	455,478	70,408	1,534,728	237,238
費用							
管理報酬	3(a)	15,223	2,353	115,055	17,785	367,238	56,768
管理事務代行報酬							
および保管銀行報酬	5(a)	20,877	3,227	28,600	4,421	48,155	7,444
ルクセンブルグ税	4	1,736	268	13,181	2,038	45,393	7,017
専門家報酬		5,427	839	5,426	839	5,426	839
為替ヘッジ							
運用会社報酬	5(c)	-	-	-	-	-	-
当座借越利息		18	3	113	17	528	82
税務・法務報酬		57	9	435	67	1,477	228
公告手数料		934	144	2,750	425	10,305	1,593
一般費用		11,979	1,852	22,188	3,430	42,476	6,566
費用合計		56,251	8,695	187,748	29,022	520,998	80,536
費用の免除/返還	5(b)	(41,939)	(6,483)	(75,057)	(11,602)	(155,998)	(24,114)
投資収益(純額)		38,415	5,938	342,787	52,988	1,169,728	180,817
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(損失) /利益(純額)		(13,036)	(2,015)	110,745	17,119	(798,066)	(123,365)
投資有価証券に かかる未実現 評価損の変動(純額)		(306,138)	(47,323)	(2,868,907)	(443,476)	(8,185,520)	(1,265,318)
先物契約にかかる 未実現評価益の 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)		33,356	5,156	173,078	26,754	422,621	65,329
運用による 資産の変動(純額)		(247,403)	(38,244)	(2,242,297)	(346,614)	(7,391,237)	(1,142,537)

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2022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	
		2022年2月28日に 終了した期間 (ポンド)	(千円)	2022年2月28日に 終了した期間 (ポンド)	(千円)	2022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)	858,433	132,697	454,099	70,195	326,694	50,500
収益合計		858,433	132,697	454,099	70,195	326,694	50,500
費用							
管理報酬	3(a)	216,847	33,520	135,725	20,980	116,914	18,073
管理事務代行報酬							
および保管銀行報酬	5(a)	35,417	5,475	25,519	3,945	32,443	5,015
ルクセンブルグ税	4	28,006	4,329	17,712	2,738	10,326	1,596
専門家報酬		5,427	839	5,426	839	5,427	839
為替ヘッジ							
運用会社報酬	5(c)	-	-	-	-	8,863	1,370
当座借越利息		103	16	73	11	431	67
税務・法務報酬		918	142	583	90	335	52
公告手数料		7,061	1,091	4,322	668	2,166	335
一般費用		35,607	5,504	26,788	4,141	19,496	3,014
費用合計		329,386	50,916	216,148	33,412	196,401	30,360
費用の免除/返還	5(b)	(97,556)	(15,080)	(58,674)	(9,070)	(12,934)	(1,999)
投資収益(純額)		626,603	96,860	296,625	45,852	143,227	22,140
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(損失) /利益(純額)		(9,138)	(1,413)	767,793	118,685	(386,510)	(59,747)
投資有価証券に かかる未実現 評価損の変動(純額)		(5,260,363)	(813,147)	(3,676,784)	(568,357)	(1,267,798)	(195,976)
先物契約にかかる 未実現評価益の 変動(純額)		-	-	-	-	23,878	3,691
為替先渡契約に かかる未実現 評価益/(損)の 変動(純額)		111,175	17,185	(36,830)	(5,693)	(317,323)	(49,052)
運用による 資産の変動(純額)		(4,531,723)	(700,514)	(2,649,196)	(409,513)	(1,804,526)	(278,944)

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2022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	
		2022年2月28日に 終了した期間 (ポンド)	(千円)	2022年2月28日に 終了した期間 (ポンド)	(千円)	2022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)	715,079	110,537	1,880,343	290,663	374,183	57,841
銀行利息	2(d)	-	-	-	-	-	-
収益合計		715,079	110,537	1,880,343	290,663	374,183	57,841
費用							
管理報酬	3(a)	483,053	74,670	1,476,803	228,284	355,226	54,911
管理事務代行報酬							
および保管銀行報酬	5(a)	36,729	5,678	66,270	10,244	34,365	5,312
ルクセンブルグ税	4	21,544	3,330	63,249	9,777	15,340	2,371
専門家報酬		5,426	839	5,426	839	5,426	839
為替ヘッジ							
運用会社報酬	5(c)	16,074	2,485	36,352	5,619	7,503	1,160
当座借越利息		754	117	4,335	670	1,442	223
税務・法務報酬		705	109	2,060	318	-	-
公告手数料		3,910	604	11,476	1,774	2,871	444
一般費用		23,892	3,693	42,375	6,550	23,616	3,651
費用合計		592,087	91,525	1,708,346	264,076	445,789	68,910
費用の免除 / 返還	5(b)	1,873	290	-	-	(3,327)	(514)
投資収益 / (損失)							
（純額）		121,119	18,723	171,997	26,587	(68,279)	(10,555)
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（損失） / 利益（純額）		(461,548)	(71,346)	2,373,805	366,943	1,611,743	249,143
投資有価証券に かかる未実現 評価損の変動（純額）		(3,426,155)	(529,615)	(10,763,337)	(1,663,797)	(3,732,443)	(576,961)
先物契約にかかる 未実現評価益 / （損）の変動（純額）		92,077	14,233	(2,204,617)	(340,790)	(617,913)	(95,517)
為替先渡契約に かかる未実現 評価損の変動（純額）		(674,649)	(104,287)	(1,219,596)	(188,525)	(280,113)	(43,300)
運用による 資産の変動（純額）		(4,349,156)	(672,293)	(11,641,748)	(1,799,581)	(3,087,005)	(477,189)

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2022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		リクィッド・ オルタナティブ・ ストラテジーズ		合算	
		2022年2月28日に 終了した期間 (ポンド)	(千円)	2022年2月28日に 終了した期間 (ポンド)	(千円)	2022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)	89,212	13,790	-	-	6,740,976	1,042,020
銀行利息	2(d)	-	-	36	6	36	6
収益合計		89,212	13,790	36	6	6,741,012	1,042,026
費用							
管理報酬	3(a)	133,518	20,639	658,145	101,736	4,073,747	629,720
管理事務代行報酬							
および保管銀行報酬	5(a)	28,999	4,483	59,267	9,161	416,641	64,404
ルクセンブルグ税	4	5,331	824	27,710	4,283	249,528	38,572
専門家報酬		5,426	839	5,365	829	59,628	9,217
為替ヘッジ							
運用会社報酬	5(c)	3,259	504	-	-	72,051	11,138
当座借越利息		553	85	248	38	8,598	1,329
税務・法務報酬		172	27	1,956	302	8,698	1,345
公告手数料		1,654	256	16,436	2,541	63,885	9,875
一般費用		18,743	2,897	23,930	3,699	291,090	44,997
費用合計		197,655	30,554	793,057	122,591	5,243,866	810,597
費用の免除 / 返還	5(b)	(25,800)	(3,988)	-	-	(469,412)	(72,562)
投資（損失） / 収益（純額）		(82,643)	(12,775)	(793,021)	(122,585)	1,966,558	303,991
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）		701,080	108,373	1,831,464	283,108	5,728,332	885,486
投資有価証券に かかる未実現 評価損の変動（純額）		(1,268,483)	(196,082)	(796,330)	(123,097)	(41,552,258)	(6,423,148)
先物契約にかかる 未実現評価損の 変動（純額）		(247,820)	(38,308)	-	-	(2,954,395)	(456,690)
為替先渡契約に かかる未実現 評価益（損） / 益の変動（純額）		(113,516)	(17,547)	2,288	354	(1,899,509)	(293,626)
運用による 資産の変動（純額）		(1,011,382)	(156,339)	244,401	37,780	(38,711,272)	(5,983,988)

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

2022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	
	2022年2月28日に 終了した期間 (ポンド)	(千円)	2022年2月28日に 終了した期間 (ポンド)	(千円)	2022年2月28日に 終了した期間 (ポンド)	(千円)
期首純資産	7,215,710	1,115,404	55,236,474	8,538,454	184,519,795	28,523,070
投資収益(純額)	38,415	5,938	342,787	52,988	1,169,728	180,817
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(損失) /利益(純額)	(13,036)	(2,015)	110,745	17,119	(798,066)	(123,365)
当期利益(純額)	7,241,089	1,119,328	55,690,006	8,608,561	184,891,457	28,580,521
ファンド株式 申込手取金	62,375	9,642	584,283	90,318	14,380,615	2,222,955
ファンド株式 買戻支払金	(128,868)	(19,920)	(3,576,587)	(552,869)	(10,872,501)	(1,680,671)
ファンド株式の 取引による手取金 (純額)	(66,493)	(10,278)	(2,992,304)	(462,550)	3,508,114	542,284
投資有価証券に かかる未実現 評価損の変動(純額)	(306,138)	(47,323)	(2,868,907)	(443,476)	(8,185,520)	(1,265,318)
先物契約にかかる 未実現評価益の 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)	33,356	5,156	173,078	26,754	422,621	65,329
分配金	(19,624)	(3,033)	(205,948)	(31,835)	(617,520)	(95,456)
期末純資産	6,882,190	1,063,849	49,795,925	7,697,454	180,019,152	27,827,361

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2022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	
	2022年2月28日に 終了した期間 (ポンド)	(千円)	2022年2月28日に 終了した期間 (ポンド)	(千円)	2022年2月28日に 終了した期間 (ポンド)	(千円)
期首純資産	111,287,940	17,202,890	70,157,927	10,845,012	43,350,091	6,701,057
投資収益(純額)	626,603	96,860	296,625	45,852	143,227	22,140
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(損失) /利益(純額)	(9,138)	(1,413)	767,793	118,685	(386,510)	(59,747)
当期利益(純額)	111,905,405	17,298,338	71,222,345	11,009,550	43,106,808	6,663,450
ファンド株式 申込手取金	7,526,757	1,163,486	3,490,451	539,554	238,606	36,884
ファンド株式 買戻支払金	(2,754,248)	(425,752)	(2,029,224)	(313,677)	(2,597,938)	(401,589)
ファンド株式の 取引による手取金 (純額)	4,772,509	737,734	1,461,227	225,876	(2,359,332)	(364,706)
投資有価証券に かかる未実現 評価損の変動(純額)	(5,260,363)	(813,147)	(3,676,784)	(568,357)	(1,267,798)	(195,976)
先物契約にかかる 未実現評価益の 変動(純額)	-	-	-	-	23,878	3,691
為替先渡契約に かかる未実現 評価益/(損)の 変動(純額)	111,175	17,185	(36,830)	(5,693)	(317,323)	(49,052)
分配金	(217,448)	(33,613)	(105,319)	(16,280)	(147,719)	(22,834)
期末純資産	111,311,278	17,206,497	68,864,639	10,645,096	39,038,514	6,034,573

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2022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	
	2022年2月28日に 終了した期間 (ポンド)	(千円)	2022年2月28日に 終了した期間 (ポンド)	(千円)	2022年2月28日に 終了した期間 (ポンド)	(千円)
期首純資産	90,349,989	13,966,301	262,553,105	40,585,459	66,471,732	10,275,200
投資収益/(損失) (純額)	121,119	18,723	171,997	26,587	(68,279)	(10,555)
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(損失) /利益(純額)	(461,548)	(71,346)	2,373,805	366,943	1,611,743	249,143
当期利益(純額)	90,009,560	13,913,678	265,098,907	40,978,989	68,015,196	10,513,789
ファンド株式 申込手取金	736,661	113,873	4,071,278	629,338	501,878	77,580
ファンド株式 買戻支払金	(4,425,414)	(684,080)	(9,942,810)	(1,536,960)	(6,137,333)	(948,709)
ファンド株式の 取引による手取金 (純額)	(3,688,753)	(570,207)	(5,871,532)	(907,621)	(5,635,455)	(871,129)
投資有価証券に かかる未実現 評価損の変動(純額)	(3,426,155)	(529,615)	(10,763,337)	(1,663,797)	(3,732,443)	(576,961)
先物契約にかかる 未実現評価益/ (損)の変動(純額)	92,077	14,233	(2,204,617)	(340,790)	(617,913)	(95,517)
為替先渡契約に かかる未実現 評価損の変動(純額)	(674,649)	(104,287)	(1,219,596)	(188,525)	(280,113)	(43,300)
分配金	(214,327)	(33,131)	(901,158)	(139,301)	(21,387)	(3,306)
期末純資産	82,097,753	12,690,671	244,138,667	37,738,955	57,727,885	8,923,576

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2022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		リクィッド・ オルタナティブ・ ストラテジーズ		合算	
	2022年2月28日に 終了した期間		2022年2月28日に 終了した期間		2022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	20,692,447	3,198,638	249,016,653	38,492,994	1,160,851,863	179,444,481
投資(損失)/ 収益(純額)	(82,643)	(12,775)	(793,021)	(122,585)	1,966,558	303,991
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)	701,080	108,373	1,831,464	283,108	5,728,332	885,486
当期利益(純額)	21,310,884	3,294,236	250,055,096	38,653,517	1,168,546,753	180,633,957
ファンド株式 申込手取金	2,626,373	405,985	26,455,503	4,089,492	60,674,780	9,379,107
ファンド株式 買戻支払金	(2,559,703)	(395,679)	(12,849,006)	(1,986,199)	(57,873,632)	(8,946,106)
ファンド株式の 取引による手取金 (純額)	66,670	10,306	13,606,497	2,103,292	2,801,148	433,001
投資有価証券に かかる未実現 評価損の変動(純額)	(1,268,483)	(196,082)	(796,330)	(123,097)	(41,552,258)	(6,423,148)
先物契約にかかる 未実現評価損の 変動(純額)	(247,820)	(38,308)	-	-	(2,954,395)	(456,690)
為替先渡契約に かかる未実現 評価(損)/益の 変動(純額)	(113,516)	(17,547)	2,288	354	(1,899,509)	(293,626)
分配金	(2)	(0)	-	-	(2,450,452)	(378,791)
期末純資産	19,747,733	3,052,605	262,867,551	40,634,066	1,122,491,287	173,514,703

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

2022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	12,093	97	-	12,190
クラスA - 分配型	ボンド	20,411	87	-	20,498
クラスC - 累積型	ボンド	7,330	-	(7,330)	-
クラスR - 累積型	ボンド	56,033	1,264	(254)	57,043
クラスR - 分配型	ボンド	101,558	3,124	-	104,682
米ドル建クラス					
クラスA - 累積型	米ドル	3,621	-	-	3,621
クラスC - 累積型	米ドル	228,615	-	(943)	227,672
ユーロ建クラス					
クラスA - 累積型	ユーロ	78,168	-	-	78,168
円建クラス					
クラスA - 分配型	円	104,000	-	-	104,000

添付の注記は本財務書類と不可分です。

2022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	ポンド	21,058	-	(30)	21,028
クラスA - 分配型	ポンド	20,511	397	-	20,908
クラスC - 累積型	ポンド	31,712	-	-	31,712
クラスC - 分配型	ポンド	10,626	-	(10,032)	594
クラスR - 累積型	ポンド	1,086,714	11,684	(35,820)	1,062,578
クラスR - 分配型	ポンド	1,122,553	20,128	(104,426)	1,038,255
米ドル建クラス					
クラスA - 累積型	米ドル	15,209	-	-	15,209
クラスA - 分配型	米ドル	60,000	-	(4,000)	56,000
クラスC - 累積型	米ドル	20,678	-	-	20,678
クラスR - 累積型	米ドル	114,739	-	(10,660)	104,079
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	154,779	-	(23,830)	130,949
クラスA - 分配型	ユーロ	11,581	104	-	11,685
クラスC - 累積型	ユーロ	197,541	-	-	197,541
クラスR - 累積型	ユーロ	166,974	-	(6,260)	160,714
円建クラス					
クラスA - 分配型	円	126,000	-	(43,500)	82,500

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2022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	ポンド	79,161	-	-	79,161
クラスA - 分配型	ポンド	39,988	162	(3,083)	37,067
クラスC - 累積型	ポンド	177,697	-	-	177,697
クラスC - 分配型	ポンド	233,053	-	-	233,053
クラスR - 累積型	ポンド	4,151,860	425,380	(237,881)	4,339,359
クラスR - 分配型	ポンド	3,149,488	120,000	(183,581)	3,085,907
米ドル建クラス					
クラスA - 累積型	米ドル	35,008	-	(5,000)	30,008
クラスA - 分配型	米ドル	149,336	-	(38,500)	110,836
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	527,832	183,691	(92,531)	618,992
クラスR - 分配型	米ドル	254,424	-	(8,679)	245,745
ユーロ建クラス					
クラスA - 累積型	ユーロ	59,014	-	(5,174)	53,840
クラスC - 累積型	ユーロ	48,680	-	-	48,680
クラスC - 分配型	ユーロ	29,080	258	-	29,338
クラスR - 累積型	ユーロ	564,137	20,195	(787)	583,545
クラスR - 分配型	ユーロ	40,027	-	-	40,027
円建クラス					
クラスA - 分配型	円	211,500	-	(37,000)	174,500

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2022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	ポンド	45,600	139	-	45,739
クラスA - 分配型	ポンド	19,720	-	-	19,720
クラスC - 累積型	ポンド	34,952	70	-	35,022
クラスC - 分配型	ポンド	38,070	119	-	38,189
クラスR - 累積型	ポンド	2,520,189	298,631	(74,426)	2,744,394
クラスR - 分配型	ポンド	1,486,842	19,319	(16,980)	1,489,181
米ドル建クラス					
クラスA - 分配型	米ドル	30,500	-	(18,000)	12,500
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	271,057	3,557	(21,687)	252,927
クラスR - 分配型	米ドル	114,360	4,093	-	118,453
ユーロ建クラス					
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	105,909	3,884	-	109,793
クラスR - 分配型	ユーロ	290,904	-	-	290,904
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。

2022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	14,969	101	-	15,070
クラスA - 分配型	ポンド	14,938	-	-	14,938
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	1,042,338	107,960	(47,330)	1,102,968
クラスR - 分配型	ポンド	681,739	9,433	(11,985)	679,187
米ドル建クラス					
クラスC - 累積型	米ドル	13,057	-	(2,667)	10,390
クラスR - 累積型	米ドル	45,774	-	(7,602)	38,172
クラスR - 分配型	米ドル	247,569	-	-	247,569
ユーロ建クラス					
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	450,008	2,680	(907)	451,781

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2022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	111,080	275	(716)	110,639
クラスA - 分配型	ポンド	327,972	1,688	(11,553)	318,107
クラスC - 累積型	ポンド	10,416	-	-	10,416
クラスC - 分配型	ポンド	82,424	378	(367)	82,435
クラスR - 累積型	ポンド	177,451	-	(29,289)	148,162
クラスR - 分配型	ポンド	328,399	-	(485)	327,914
米ドル建クラス					
クラスA - 累積型	米ドル	200,793	8,945	(1,225)	208,513
クラスA - 分配型	米ドル	854,181	762	(61,026)	793,917
クラスC - 累積型	米ドル	91,623	-	-	91,623
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	1,660,816	10,262	(129,193)	1,541,885
クラスA - 分配型	ユーロ	88,510	1,510	(25,925)	64,095
クラスC - 累積型	ユーロ	14,693	-	(50)	14,643
クラスC - 分配型	ユーロ	245,596	-	-	245,596
クラスR - 累積型	ユーロ	49,540	-	(2,426)	47,114
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。

2022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	ポンド	161,313	2,545	(2,436)	161,422
クラスA - 分配型	ポンド	218,756	5,075	-	223,831
クラスC - 累積型	ポンド	46,353	-	-	46,353
クラスC - 分配型	ポンド	124,190	292	-	124,482
クラスR - 累積型	ポンド	1,003,591	5,298	(26,263)	982,626
クラスR - 分配型	ポンド	929,282	5,880	(84,082)	851,080
米ドル建クラス					
クラスA - 累積型	米ドル	919,012	-	(16,348)	902,664
クラスA - 分配型	米ドル	154,550	1,460	-	156,010
クラスC - 累積型	米ドル	37,407	-	-	37,407
クラスC - 分配型	米ドル	20,408	-	-	20,408
クラスR - 累積型	米ドル	16,342	-	-	16,342
クラスR - 分配型	米ドル	190,454	-	(61,324)	129,130
ユーロ建クラス					
クラスA - 累積型	ユーロ	3,235,622	45,259	(170,985)	3,109,896
クラスA - 分配型	ユーロ	387,532	555	(11,485)	376,602
クラスC - 累積型	ユーロ	155,657	-	(11,769)	143,888
クラスC - 分配型	ユーロ	107,487	-	-	107,487
クラスR - 累積型	ユーロ	122,016	-	-	122,016
クラスR - 分配型	ユーロ	121,200	-	(971)	120,229
円建クラス					
クラスA - 分配型	円	67,000	-	(31,000)	36,000

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2022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	200,603	5,067	(29,592)	176,078
クラスA - 分配型	ボンド	2,515,835	21,334	(39,335)	2,497,834
クラスC - 累積型	ボンド	81,215	-	-	81,215
クラスC - 分配型	ボンド	640,654	3,798	(5,055)	639,397
クラスI - 分配型	ボンド	71,313	-	(3,698)	67,615
クラスR - 累積型	ボンド	3,172,386	56,391	(82,152)	3,146,625
クラスR - 分配型	ボンド	2,279,471	12,543	(133,004)	2,159,010
米ドル建クラス					
クラスA - 累積型	米ドル	1,121,298	3,187	(5,128)	1,119,357
クラスA - 分配型	米ドル	1,050,079	16,567	(31)	1,066,615
クラスC - 累積型	米ドル	173,057	-	-	173,057
クラスC - 分配型	米ドル	391,094	2,412	(112,251)	281,255
クラスR - 累積型	米ドル	339,253	8,278	(11,773)	335,758
クラスR - 分配型	米ドル	893,545	-	(46,779)	846,766
ユーロ建クラス					
クラスA - 累積型	ユーロ	5,459,457	163,083	(223,742)	5,398,798
クラスA - 分配型	ユーロ	484,368	10,270	(38,713)	455,925
クラスC - 累積型	ユーロ	94,602	-	-	94,602
クラスC - 分配型	ユーロ	180,526	1,112	(14,717)	166,921
クラスR - 累積型	ユーロ	70,100	-	-	70,100
クラスR - 分配型	ユーロ	221,850	-	(561)	221,289
クラスY - 累積型	ユーロ	452,946	12,038	(30,295)	434,689
円建クラス					
クラスA - 分配型	円	121,500	-	(4,000)	117,500

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2022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	ポンド	23,795	1,171	(596)	24,370
クラスA - 分配型	ポンド	441,628	260	(6,386)	435,502
クラスC - 分配型	ポンド	259,998	9	(48,385)	211,622
クラスI - 累積型	ポンド	55,560	-	(46,784)	8,776
クラスI - 分配型	ポンド	17,653	-	-	17,653
クラスR - 累積型	ポンド	654,954	6,600	(85,652)	575,902
クラスR - 分配型	ポンド	762,657	-	(57,161)	705,496
米ドル建クラス					
クラスA - 累積型	米ドル	164,997	203	(25,531)	139,669
クラスA - 分配型	米ドル	303,599	-	(34,850)	268,749
クラスR - 累積型	米ドル	16,410	14,787	(7,074)	24,123
クラスR - 分配型	米ドル	109,942	-	-	109,942
ユーロ建クラス					
クラスA - 累積型	ユーロ	1,076,737	11,855	(35,946)	1,052,646
クラスA - 分配型	ユーロ	90,641	329	(6,418)	84,552
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	129,601	-	(15,930)	113,671
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。

2022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	ポンド	15,743	-	-	15,743
クラスA - 分配型	ポンド	81,580	-	-	81,580
クラスC - 累積型	ポンド	2,424	-	(2,424)	-
クラスC - 分配型	ポンド	37,024	-	-	37,024
クラスR - 累積型	ポンド	325,178	5,415	(9,665)	320,928
クラスR - 分配型	ポンド	114,773	-	(47,550)	67,223
米ドル建クラス					
クラスA - 累積型	米ドル	16,922	-	(2,353)	14,569
クラスA - 分配型	米ドル	91,154	200,000	-	291,154
クラスR - 累積型	米ドル	10,733	-	(260)	10,473
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	121,279	590	(6,581)	115,288
クラスA - 分配型	ユーロ	7,798	-	-	7,798
クラスC - 累積型	ユーロ	11,876	-	-	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	11,092	-	(367)	10,725
クラスR - 分配型	ユーロ	3,237	-	-	3,237
クラスY - 累積型	ユーロ	375,150	961	(22,849)	353,262

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2022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	ポンド	19,978,177	2,210,311	(961,928)	21,226,560
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	171,616	24,165	(23,355)	172,426
ユーロ建クラス					
クラスA - 累積型	ユーロ	537,210	-	(18,977)	518,233
クラスR - 累積型	ユーロ	251,288	19,147	(125,046)	145,389

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

2022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。

2022年2月28日現在、ファンドは債券建の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、債券建、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、2022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	2022年2月28日現在
ユーロ	1.19458
香港ドル	10.48403
日本円	154.53606
スイスフラン	1.23099
米ドル	1.34175

(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、2022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、2022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。

2022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、2022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、2022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。

2022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します。

管理会社に支払われた報酬は、2022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

2022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
BlackRock Strategic Funds	
- BlackRock Global Event Driven Accumulating Fund	0.50
Brandes US Value Fund F1 USD Inc	0.15
DB Platinum IV Systematic Alpha Fund	0.95
Findlay Park American USD	0.91
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

管理報酬の年率

(%)

iShares \$ High Yield Corp Bond UCITS ETF GBP Hedged (Dist)	0.50
iShares \$ Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF USD (Dist)	0.07
iShares € Government Bond 1-3yr UCITS ETF	0.20
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 MSCI World UCITS ETF	0.00
iShares Core MSCI World UCITS ETF	0.00
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 North America Index Fund	0.30
iShares Pacific Index Fund	0.00
iShares S&P 500 Swaps UCITS ETF	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 USD High Yield Bond UCITS ETF	0.00
iShares World ex-Euro Government Bond Index Fund	0.03
Janus Henderson Global Multi-Strategy Fund	0.50
Janus Henderson Horizon Pan European Absolute Return Fund	1.00
Kepler Liquid Strategies ICAV - KLS Athos Event	0.75
Kepler Liquid Strategies ICAV - KLS Arete Macro Fund	1.50
Lazard Rathmore Alternative Fund S Acc GBP Hedged	1.00
Loomis Sayles US Growth Equity Fund	0.00
Lyxor Dimension IRL - Lyxor/Tiedemann Arbitrage Strategy Fund	1.40
Man AHL Trend Alternative Fund	0.00
Man Funds VI plc - Man GLG Alpha Select Alternative Fund	0.75
Natixis International Funds (Lux) I	
- Loomis Sayles U.S. Growth Equity Fund	0.35
Northill Global Funds ICAV- Securis Catastrophe Bond Fund	0.00
PIMCO GIS Global Real Return Fund	0.49

管理報酬の年率

(%)

Principal Global Investors	
- Finisterre Unconstrained Emerging Markets Fixed Income Fund	0.55
Royal London Cash Plus Fund	0.11
Schroder GAIA Two Sigma Diversified Fund	1.40
U Access IRL Trend Macro Fund	1.50
Variety Capital ICAV - Variety CKC Credit Opportunity Fund	0.00
Veritas Global Real Return Fund	0.85
Vulcan Value Equity USD II Inc	0.75
Xtrackers II Global Government Bond UCITS ETF 2D - GBP Hedged	0.15

* 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せん。

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 S E は、ファンドと同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 S E は、ファンドと同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。

2021年9月1日から2022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実行されています。

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。2022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。

2022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。

2022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。2022年2月28日時点では、スウィング・プライシング調整は、当ファンドには適用されませんでした。当会計年度において、以下のファンドにはスウィング・プライシング調整が適用されました - 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、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4、パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ5およびリキッド・オルタナティブ・ストラテジーズ。

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					
2021年9月15日支払	0.019702	該当なし	該当なし	0.019675	該当なし
2021年10月15日支払	0.045184	該当なし	該当なし	0.045133	該当なし
2021年11月16日支払	0.015847	該当なし	該当なし	0.015830	該当なし
2021年12月15日支払	0.006809	該当なし	該当なし	0.006801	該当なし
2022年1月18日支払	0.011844	該当なし	該当なし	0.011835	該当なし
2022年2月15日支払	0.010305	該当なし	該当なし	0.010301	該当なし
米ドル建クラス					
2021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
2021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
2021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
2021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
2022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
2022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					
2021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
2021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
2021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
2021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
2022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
2022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					
2021年9月15日支払	1.618792	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし
2021年10月15日支払	3.723275	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし
2021年11月16日支払	1.352741	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし
2021年12月15日支払	0.550732	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし
2022年1月18日支払	1.012873	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし
2022年2月15日支払	0.857001	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					
2021年9月15日支払	0.075317	0.082705	該当なし	0.090930	該当なし
2021年12月15日支払	0.054039	0.059401	該当なし	0.065353	該当なし
米ドル建クラス					
2021年9月15日支払	0.080924	該当なし	該当なし	0.081300	該当なし
2021年12月15日支払	0.057026	該当なし	該当なし	0.057386	該当なし
ユーロ建クラス					
2021年9月15日支払	0.059693	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし
2021年12月15日支払	0.043274	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし
円建クラス					
2021年9月15日支払	5.938666	該当なし	該当なし	該当なし	該当なし
2021年12月15日支払	4.342368	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					
2021年9月15日支払	0.084037	0.094725	該当なし	0.088182	該当なし
2021年12月15日支払	0.067549	0.076212	該当なし	0.071005	該当なし
米ドル建クラス					
2021年9月15日支払	0.072332	0.073992	該当なし	0.099370	該当なし
2021年12月15日支払	0.057202	0.058590	該当なし	0.078732	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
ユーロ建クラス					
2021年9月15日支払	該当なし+	0.093487	該当なし+	0.083796	該当なし+
2021年12月15日支払	0.082568	0.075980	該当なし+	0.068161	該当なし+
円建クラス					
2021年9月15日支払	6.244832	該当なし+	該当なし+	該当なし+	該当なし+
2021年12月15日支払	5.124704	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					
ボンド建クラス					
2021年9月15日支払	0.031070	0.074652	該当なし+	0.115898	該当なし+
米ドル建クラス					
2021年9月15日支払	0.023327	0.088173	該当なし+	0.136993	該当なし+
ユーロ建クラス					
2021年9月15日支払	0.020496	該当なし+	該当なし+	0.094812	該当なし+
円建クラス					
2021年9月15日支払	1.966000	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					
ボンド建クラス					
2021年9月15日支払	該当なし+	0.063810	該当なし+	0.110869	該当なし+
米ドル建クラス					
2021年9月15日支払	該当なし+	該当なし+	該当なし+	0.127501	該当なし+
ユーロ建クラス					
2021年9月15日支払	該当なし+	0.057992	該当なし+	該当なし+	該当なし+
円建クラス					
2021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					
ボンド建クラス					
2021年9月15日支払	0.018755	0.018991	該当なし+	0.019183	該当なし+
2021年10月15日支払	0.013909	0.014087	該当なし+	0.014230	該当なし+
2021年11月16日支払	0.014324	0.014507	該当なし+	0.014655	該当なし+
2021年12月15日支払	0.018984	0.019229	該当なし+	0.019425	該当なし+
2022年1月18日支払	0.011776	0.011930	該当なし+	0.012052	該当なし+
2022年2月15日支払	0.012219	0.012378	該当なし+	0.012506	該当なし+
米ドル建クラス					
2021年9月15日支払	0.018405	該当なし+	該当なし+	該当なし+	該当なし+
2021年10月15日支払	0.013720	該当なし+	該当なし+	該当なし+	該当なし+
2021年11月16日支払	0.014392	該当なし+	該当なし+	該当なし+	該当なし+
2021年12月15日支払	0.018393	該当なし+	該当なし+	該当なし+	該当なし+
2022年1月18日支払	0.011994	該当なし+	該当なし+	該当なし+	該当なし+
2022年2月15日支払	0.012390	該当なし+	該当なし+	該当なし+	該当なし+
ユーロ建クラス					
2021年9月15日支払	0.017055	0.020190	該当なし+	該当なし+	該当なし+
2021年10月15日支払	0.012635	0.014961	該当なし+	該当なし+	該当なし+
2021年11月16日支払	0.013267	0.015710	該当なし+	該当なし+	該当なし+
2021年12月15日支払	0.017295	0.020480	該当なし+	該当なし+	該当なし+
2022年1月18日支払	0.010801	0.012794	該当なし+	該当なし+	該当なし+
2022年2月15日支払	0.011290	0.013373	該当なし+	該当なし+	該当なし+
円建クラス					
2021年9月15日支払	1.837555	該当なし+	該当なし+	該当なし+	該当なし+
2021年10月15日支払	1.388860	該当なし+	該当なし+	該当なし+	該当なし+
2021年11月16日支払	1.483778	該当なし+	該当なし+	該当なし+	該当なし+
2021年12月15日支払	1.870000	該当なし+	該当なし+	該当なし+	該当なし+
2022年1月18日支払	1.215207	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
2022年2月15日支払	1.261778	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					
2021年9月15日支払	0.051511	0.054661	該当なし†	0.056258	該当なし†
2021年12月15日支払	0.049549	0.052628	該当なし†	0.054193	該当なし†
米ドル建クラス					
2021年9月15日支払	0.050041	0.061124	該当なし†	0.054713	該当なし†
2021年12月15日支払	0.047639	0.058246	該当なし†	0.052165	該当なし†
ユーロ建クラス					
2021年9月15日支払	0.044487	0.046361	該当なし†	0.048641	該当なし†
2021年12月15日支払	0.042954	0.044810	該当なし†	0.047038	該当なし†
円建クラス					
2021年9月15日支払	5.466238	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
2021年12月15日支払	5.355104	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					
2021年9月15日支払	0.055360	0.059597	0.064187	0.061826	該当なし†
2021年12月15日支払	0.053626	0.057803	0.062336	0.060000	該当なし†
米ドル建クラス					
2021年9月15日支払	0.053399	0.065019	該当なし†	0.059731	該当なし†
2021年12月15日支払	0.051211	0.062439	該当なし†	0.057388	該当なし†
ユーロ建クラス					
2021年9月15日支払	0.046554	0.050331	該当なし†	0.052152	該当なし†
2021年12月15日支払	0.045245	0.048981	該当なし†	0.050778	該当なし†
円建クラス					
2021年9月15日支払	5.427810	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
2021年12月15日支払	5.356329	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					
2021年9月15日支払	該当なし†	0.001316	0.048732	0.023885	該当なし†
米ドル建クラス					
2021年9月15日支払	該当なし†	該当なし†	該当なし†	0.016154	該当なし†
ユーロ建クラス					
2021年9月15日支払	該当なし†	0.053416	該当なし†	0.015807	該当なし†
円建クラス					
2021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					
2021年9月15日支払	- *	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
米ドル建クラス					
2021年9月15日支払	- *	該当なし†	- *	該当なし†	該当なし†
ユーロ建クラス					
2021年9月15日支払	- *	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
円建クラス					
2021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					
2021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†
米ドル建クラス					
2021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
ユーロ建クラス 2021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。

2022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

2021年9月1日から2022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。2022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	156
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ2	1,059
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ3	2,903
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ4	1,506
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ5	503
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ1	1,075
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ2	2,103
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ3	6,920
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ4	1,608
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ5	520
リキッド・オルタナティブ・ストラテジーズ	-

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

2020年1月以降、世界の金融市場は新型コロナウイルス(COVID-19)の感染拡大に伴って大きなボラティリティに見舞われ、その後もボラティリティの高い状態が続いています。新型コロナウイルスは世界経済に悪影響を及ぼしており、そうした影響は今後も続く可能性があり、それら全てが当社の業績を圧迫する可能性があります。当社は、新型コロナウイルスの潜在的影響に対処する上で十分な準備金を保有しています。業務運営に関して当社は、自らの頑強性や関連する全てのサードパーティ・サービス・プロバイダーの頑強性を評価し、業務運営全体にわたる新型コロナウイルスの影響を抑えるための事業継続計画が存在していることを確認しています。今のところ、業務運営上においていかなる障害も確認されていません。

世界の金融市場ではパンデミックの発生以降において、ボラティリティや不透明感が高まっていることを取締役会は認識しています。新型コロナウイルスのパンデミックは前例のない出来事であり、世界経済と市場への最終的な影響は、パンデミックの規模と期間に大きく左右されます。取締役会は引き続きこうした状況を監視していきます。

2022年2月、ロシア連邦がドネツク人民共和国およびルハンスク人民共和国の「独立」を正式に承認したことから、多くの国(米国、英国および欧州連合など)がロシア連邦の特定の団体や個人に対して制裁を課しました。ロシア連邦が2022年2月24日にウクライナへの軍事侵攻を開始したことを受け、追加制裁措置が発動されました。この制裁には、米国、英国および欧州連合の証券取引所におけるロシアの証券の取引停止なども含まれており、ロシア経済、ロシア・ルーブルの外国為替レートおよびロシア資産の評価に大きな影響を及ぼしました。2022年2月28日現在、パークレイズ・ポートフォリオはロシアの証券を一切保有していませんでした。投資マネジャーおよび管理会社は、ロシアの状況を継続的に監視するとともに、必要に応じて、資産の評価に対して公正価値への調整を行います。

取締役の意見では、2022年2月28日に終了した会計期間において、財務諸表の修正または開示を必要とするその他の重要な事象はありませんでした。

15. 後発事象

当会計期間末以降、取締役の意見において、2022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

2022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 99.47%			
iShares \$ Corporate Bond UCITS ETF	4,920	435,787	6.33
iShares \$ Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF USD (Dist)	9,712	951,560	13.83
iShares € Government Bond 1-3yr UCITS ETF	6,240	743,547	10.80
iShares Core £ Corporate Bond UCITS ETF	413	58,735	0.85
iShares Core € Corporate Bond UCITS ETF	3,521	377,234	5.48
iShares Core EURO STOXX 50 UCITS ETF	87	9,697	0.14
iShares Core FTSE 100 UCITS ETF	1,512	11,035	0.16
iShares Core MSCI EM IMI UCITS ETF	211	5,272	0.08
iShares Core MSCI Japan IMI UCITS ETF	177	6,359	0.09
iShares Core MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF	132	16,652	0.24
iShares Emerging Markets Government Bond Index Fund	2,761	195,679	2.84
iShares Emerging Markets Index Fund	18,989	257,980	3.75
iShares Euro Government Bond Index Fund	37,839	300,149	4.36
iShares Euro Investment Grade Corporate Bond Index Fund	12,507	107,268	1.56
iShares Europe ex-UK Index Fund	8,746	147,393	2.14
iShares Global Government Bond UCITS ETF	1,383	111,782	1.63
iShares Global High Yield Corporate Bond UCITS ETF	5,446	371,826	5.40
iShares Global Inflation Linked Government Bond UCITS ETF	116,093	610,614	8.87
iShares Japan Index Fund	6,782	79,469	1.16
iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF	5,601	201,464	2.93
iShares North America Index Fund	25,540	699,233	10.16
iShares Pacific Index Fund	1,656	21,800	0.32
iShares S&P 500 Swap UCITS ETF	13,111	67,384	0.98
iShares UK Credit Bond Index Fund	3,107	36,514	0.53
iShares UK Index Fund	3,035	35,435	0.52
iShares US Corporate Bond Index Fund	48,375	355,133	5.16
iShares World ex-Euro Government Bond Index Fund	91,198	630,579	9.16
投資信託/投資法人合計		6,845,580	99.47
投資有価証券合計(取得原価 6,914,121 ボンド)		6,845,580	99.47

為替先渡契約にかかる未実現利益 0.38%

Sold Euro for Sterling - Maturing 03/03/2022	€14,745		
	£12,377	34	-
Sold Japanese Yen for Sterling - Maturing 03/03/2022	¥28,354,503		
	£183,491	10	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 03/03/2022	£11,404		
	€13,638	12	-
Sold Swedish Krona for Sterling - Maturing 03/03/2022	SEK29,003		
	£2,317	27	-
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 03/03/2022	\$3,397,302		
	£2,532,676	683	0.01
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 18/03/2022	£708,337		
	¥110,553,431	7,169	0.11
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 18/03/2022	£2,660,896		

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
	\$3,594,618	17,841	0.26
Sold Euro for Sterling - Maturing 05/04/2022	€625,000		
	£523,714	3	-
Sold Japanese Yen for Sterling - Maturing 05/04/2022	¥27,404,503		
	£177,430	29	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 05/04/2022	£54,822		
	\$73,578	1	-
為替先渡契約にかかる未実現利益合計		25,809	0.38
為替先渡契約にかかる未実現損失 (0.05%)			
Sold Australian Dollar for Sterling - Maturing 03/03/2022	AUD\$23,677		
	£12,437	(368)	(0.01)
Sold Canadian Dollars for Sterling - Maturing 03/03/2022	CAD\$36,363		
	£21,315	(53)	-
Sold Danish Kroner for Sterling - Maturing 03/03/2022	DKK36,081		
	£4,055	(6)	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 03/03/2022	€2,091,902		
	£1,749,217	(1,948)	(0.03)
Sold Japanese Yen for Sterling - Maturing 03/03/2022	¥125,591		
	£803	(10)	-
Sold Norwegian Krone for Sterling - Maturing 03/03/2022	NOK26,614		
	£2,224	(31)	-
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 03/03/2022	£6,961		
	¥1,075,591	-	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 03/03/2022	£42,463		
	\$56,959	(12)	-
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 03/03/2022	\$21,446		
	£15,876	(107)	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 18/03/2022	£914,710		
	€1,091,995	(191)	-
Sold Australian Dollar for Sterling - Maturing 05/04/2022	AUD\$23,677		
	£12,806	(1)	-
Sold Canadian Dollars for Sterling - Maturing 05/04/2022	CAD\$36,363		
	£21,363	(2)	-
Sold Danish Kroner for Sterling - Maturing 05/04/2022	DKK36,081		
	£4,064	-	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 05/04/2022	€1,468,009		
	£1,230,024	(77)	-
Sold Norwegian Krone for Sterling - Maturing 05/04/2022	NOK26,614		
	£2,254	-	-
Sold Sterling for Australian Dollar - Maturing 05/04/2022	£832		
	AUD\$1,538	-	-
Sold Sterling for Canadian Dollars - Maturing 05/04/2022	£981		
	CAD\$1,670	-	-
Sold Sterling for Danish Krone - Maturing 05/04/2022	£738		
	DKK6,551	-	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 05/04/2022	£25,039		
	€29,879	(2)	-
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 05/04/2022	£2,567		
	¥396,441	-	-
Sold Swedish Krona for Sterling - Maturing 05/04/2022	SEK29,003		
	£2,292	-	-
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 05/04/2022	\$3,361,789		
	£2,504,476	(378)	(0.01)
為替先渡契約にかかる未実現損失合計		(3,186)	(0.05)

投 資	保有	時価 (ボンド)	純資産に 対する割合 (%)
為替先渡契約にかかる未実現利益(純額)合計		22,623	0.33
ポートフォリオ合計 §		6,868,203	99.80
その他純負債		13,987	0.20
純資産合計		6,882,190	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、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・グローバルベータ・ポートフォリオ 2

2022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 99.81%			
iShares \$ Corporate Bond UCITS ETF	19,286	1,708,249	3.43
iShares \$ Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF USD (Dist)	43,626	4,274,380	8.58
iShares € Government Bond 1-3yr UCITS ETF	28,401	3,384,212	6.80
iShares Core £ Corporate Bond UCITS ETF	1,572	223,561	0.45
iShares Core € Corporate Bond UCITS ETF	13,948	1,494,365	3.00
iShares Core EURO STOXX 50 UCITS ETF	1,612	179,667	0.36
iShares Core FTSE 100 UCITS ETF	15,639	114,143	0.23
iShares Core MSCI EM IMI UCITS ETF	3,679	91,918	0.18
iShares Core MSCI Japan IMI UCITS ETF	9,324	335,000	0.67
iShares Core MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF	2,264	285,610	0.57
iShares Emerging Markets Government Bond Index Fund	22,877	1,621,444	3.26
iShares Emerging Markets Index Fund	278,966	3,790,041	7.61
iShares Euro Government Bond Index Fund	203,770	1,616,336	3.25
iShares Euro Investment Grade Corporate Bond Index Fund	128,287	1,100,232	2.21
iShares Europe ex-UK Index Fund	104,270	1,757,200	3.53
iShares Global Government Bond UCITS ETF	13,242	1,070,290	2.15
iShares Global High Yield Corporate Bond UCITS ETF	47,634	3,252,211	6.53
iShares Global Inflation Linked Government Bond UCITS ETF	657,057	3,455,923	6.94
iShares Japan Index Fund	63,237	740,992	1.49
iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF	48,031	1,727,641	3.47
iShares North America Index Fund	314,778	8,617,947	17.31
iShares Pacific Index Fund	15,336	201,857	0.41
iShares S&P 500 Swap UCITS ETF	146,578	753,338	1.51
iShares UK Credit Bond Index Fund	29,383	345,316	0.69
iShares UK Index Fund	39,657	463,064	0.93
iShares US Corporate Bond Index Fund	497,314	3,650,942	7.33
iShares World ex-Euro Government Bond Index Fund	498,447	3,446,471	6.92
投資信託/投資法人合計		49,702,350	99.81
投資有価証券合計(取得原価 47,617,767 ボンド)		49,702,350	99.81

為替先渡契約にかかる未実現利益 0.08%

Sold Euro for Sterling - Maturing 03/03/2022	€71,137		
	£59,585	36	-
Sold Japanese Yen for Sterling - Maturing 03/03/2022	¥170,133,712		
	£1,100,990	58	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 03/03/2022	£68,895		
	€82,390	75	-
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 03/03/2022	£7,849		
	¥1,224,364	74	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 03/03/2022	£152,138		
	\$205,933	1,343	-
Sold Swedish Krona for Sterling - Maturing 03/03/2022	SEK160,816		
	£12,847	148	-
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 03/03/2022	\$20,951,079		
	£15,618,953	4,213	0.01
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 18/03/2022	£784,066		

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
	¥122,372,753	7,935	0.02
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 18/03/2022	£4,139,250		
	\$5,591,734	27,754	0.05
Sold Euro for Sterling - Maturing 05/04/2022	€3,415,000		
	£2,861,575	16	-
Sold Japanese Yen for Sterling - Maturing 05/04/2022	¥162,769,516		
	£1,053,847	175	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 05/04/2022	£416,222		
	\$558,623	5	-
為替先渡契約にかかる未実現利益合計		41,832	0.08
為替先渡契約にかかる未実現損失 (0.04%)			
Sold Australian Dollar for Sterling - Maturing 03/03/2022	AUD\$129,407		
	£67,975	(2,011)	(0.01)
Sold Canadian Dollars for Sterling - Maturing 03/03/2022	CAD\$230,152		
	£134,907	(333)	-
Sold Danish Kroner for Sterling - Maturing 03/03/2022	DKK203,645		
	£22,886	(31)	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 03/03/2022	€11,557,288		
	£9,664,028	(10,760)	(0.02)
Sold Norwegian Krone for Sterling - Maturing 03/03/2022	NOK169,464		
	£14,162	(201)	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 03/03/2022	£139,261		
	€164,735	(1,359)	-
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 03/03/2022	£39,733		
	¥6,139,832	(3)	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 03/03/2022	£291,435		
	\$390,923	(82)	-
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 03/03/2022	\$122,680		
	£90,375	(1,058)	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 18/03/2022	€229,842		
	£192,029	(459)	-
Sold Japanese Yen for Sterling - Maturing 18/03/2022	¥32,140,180		
	£207,160	(852)	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 18/03/2022	£6,578,725		
	€7,853,778	(1,377)	-
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 18/03/2022	\$157,595		
	£116,225	(1,215)	-
Sold Australian Dollar for Sterling - Maturing 05/04/2022	AUD\$129,407		
	£69,995	(6)	-
Sold Canadian Dollars for Sterling - Maturing 05/04/2022	CAD\$230,152		
	£135,212	(10)	-
Sold Danish Kroner for Sterling - Maturing 05/04/2022	DKK203,645		
	£22,939	(2)	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 05/04/2022	€7,966,300		
	£6,674,849	(418)	-
Sold Norwegian Krone for Sterling - Maturing 05/04/2022	NOK169,464		
	£14,354	(1)	-
Sold Sterling for Canadian Dollars - Maturing 05/04/2022	£6,120		
	CAD\$10,416	-	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 05/04/2022	£173,604		
	€207,101	(66)	-
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 05/04/2022	£15,410		
	¥2,380,265	(1)	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 05/04/2022	£159,025		

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
	\$213,259	(127)	-
Sold Swedish Krona for Sterling - Maturing 05/04/2022	SEK160,816		
	£12,706	(1)	-
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 05/04/2022	\$20,476,902		
	£15,254,950	(2,299)	(0.01)
為替先渡契約にかかる未実現損失合計		(22,672)	(0.04)
為替先渡契約にかかる未実現利益(純額)合計		19,160	0.04
ポートフォリオ合計 §		49,721,510	99.85
その他純資産		74,415	0.15
純資産合計		49,795,925	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、ゴールドマン・サックス・インターナショナル、HSBC銀行、JPモルガン・チェース銀行、モルガン・スタンレー、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 3

2022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 99.63%			
iShares \$ Corporate Bond UCITS ETF	42,338	3,750,069	2.08
iShares \$ Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF USD (Dist)	78,176	7,659,512	4.26
iShares € Government Bond 1-3yr UCITS ETF	50,208	5,982,695	3.32
iShares Core £ Corporate Bond UCITS ETF	3,305	470,019	0.26
iShares Core € Corporate Bond UCITS ETF	30,428	3,260,004	1.81
iShares Core EURO STOXX 50 UCITS ETF	28,768	3,206,372	1.78
iShares Core FTSE 100 UCITS ETF	81,424	594,281	0.33
iShares Core MSCI EM IMI UCITS ETF	128,568	3,212,220	1.78
iShares Core MSCI Japan IMI UCITS ETF	28,451	1,022,210	0.57
iShares Core MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF	11,505	1,451,387	0.81
iShares Emerging Markets Government Bond Index Fund	82,441	5,843,184	3.25
iShares Emerging Markets Index Fund	1,279,148	17,378,567	9.65
iShares Euro Government Bond Index Fund	367,502	2,915,089	1.62
iShares Euro Investment Grade Corporate Bond Index Fund	358,053	3,070,786	1.71
iShares Europe ex-UK Index Fund	458,717	7,730,520	4.29
iShares Global Government Bond UCITS ETF	68,729	5,555,049	3.09
iShares Global High Yield Corporate Bond UCITS ETF	170,400	11,634,060	6.46
iShares Global Inflation Linked Government Bond UCITS ETF	1,383,877	7,278,778	4.04
iShares Japan Index Fund	426,905	5,002,380	2.78
iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF	173,755	6,249,846	3.47
iShares North America Index Fund	1,213,471	33,222,231	18.45
iShares Pacific Index Fund	98,240	1,293,102	0.72
iShares S&P 500 Swap UCITS ETF	916,304	4,709,344	2.62
iShares UK Credit Bond Index Fund	82,630	971,098	0.54
iShares UK Index Fund	218,405	2,550,276	1.42
iShares US Corporate Bond Index Fund	1,377,215	10,110,584	5.62
iShares US Index Fund	1,043,595	16,987,004	9.44
iShares World ex-Euro Government Bond Index Fund	900,949	6,229,533	3.46
投資信託/投資法人合計		179,340,200	99.63
投資有価証券合計(取得原価 159,759,269 ポンド)		179,340,200	99.63

為替先渡契約にかかる未実現利益 0.08%

Sold Euro for Sterling - Maturing 03/03/2022	€850,606		
	£713,727	1,671	-
Sold Japanese Yen for Sterling - Maturing 03/03/2022	¥406,931,900		
	£2,633,387	138	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 03/03/2022	£283,935		
	€339,550	308	-
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 03/03/2022	£42,745		
	¥6,673,327	438	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 03/03/2022	£336,861		
	\$455,669	2,747	-
Sold Swedish Krona for Sterling - Maturing 03/03/2022	SEK461,545		
	£36,871	425	-
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 03/03/2022	\$51,274,184		
	£38,224,718	10,310	0.01
Sold Sterling for Euro - Maturing 18/03/2022	£125,342		

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
	€150,000	280	-
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 18/03/2022	£1,418,111		
	¥221,330,991	14,352	0.01
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 18/03/2022	£16,081,229		
	\$21,724,212	107,826	0.06
Sold Euro for Sterling - Maturing 05/04/2022	€8,010,000		
	£6,711,923	38	-
Sold Japanese Yen for Sterling - Maturing 05/04/2022	¥403,379,560		
	£2,611,670	433	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 05/04/2022	£766,621		
	\$1,028,902	9	-
為替先渡契約にかかる未実現利益合計		138,975	0.08
為替先渡契約にかかる未実現損失 (0.04%)			
Sold Australian Dollar for Sterling - Maturing 03/03/2022	AUD\$267,573		
	£140,552	(4,157)	-
Sold Canadian Dollars for Sterling - Maturing 03/03/2022	CAD\$565,606		
	£331,538	(817)	-
Sold Danish Kroner for Sterling - Maturing 03/03/2022	DKK430,087		
	£48,335	(67)	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 03/03/2022	€26,501,734		
	£22,160,346	(24,674)	(0.02)
Sold Japanese Yen for Sterling - Maturing 03/03/2022	¥18,315,881		
	£116,764	(1,758)	-
Sold Norwegian Krone for Sterling - Maturing 03/03/2022	NOK232,879		
	£19,462	(276)	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 03/03/2022	£274,349		
	€324,570	(2,647)	-
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 03/03/2022	£98,332		
	¥15,194,894	(6)	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 03/03/2022	£883,557		
	\$1,185,179	(249)	-
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 03/03/2022	\$1,243,442		
	£914,674	(12,057)	(0.01)
Sold Euro for Sterling - Maturing 18/03/2022	€427,627		
	£357,273	(853)	-
Sold Japanese Yen for Sterling - Maturing 18/03/2022	¥6,482,447		
	£41,563	(392)	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 18/03/2022	£12,261,178		
	€14,637,573	(2,567)	-
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 18/03/2022	\$716,024		
	£528,341	(5,246)	-
Sold Australian Dollar for Sterling - Maturing 05/04/2022	AUD\$267,573		
	£144,729	(12)	-
Sold Canadian Dollars for Sterling - Maturing 05/04/2022	CAD\$565,606		
	£332,286	(26)	-
Sold Danish Kroner for Sterling - Maturing 05/04/2022	DKK430,087		
	£48,446	(4)	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 05/04/2022	€18,678,221		
	£15,650,215	(981)	-
Sold Norwegian Krone for Sterling - Maturing 05/04/2022	NOK232,879		
	£19,726	(2)	-
Sold Sterling for Australian Dollar - Maturing 05/04/2022	£26,433		
	AUD\$48,864	-	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 05/04/2022	£328,488		

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
	€391,994	(21)	-
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 05/04/2022	£32,545		
	¥5,027,053	(3)	-
Sold Swedish Krona for Sterling - Maturing 05/04/2022	SEK461,545		
	£36,466	(2)	-
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 05/04/2022	\$50,876,778		
	£37,902,349	(5,711)	(0.01)
為替先渡契約にかかる未実現損失合計		(62,528)	(0.04)
為替先渡契約にかかる未実現利益(純額)合計		76,447	0.04
ポートフォリオ合計 §		179,416,647	99.67
その他純負債		602,505	0.33
純資産合計		180,019,152	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、BNYメロン、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 4

2022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 99.79%			
iShares \$ Corporate Bond UCITS ETF	15,354	1,359,974	1.22
iShares \$ Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF USD (Dist)	9,729	953,226	0.86
iShares € Government Bond 1-3yr UCITS ETF	6,388	761,183	0.68
iShares Core £ Corporate Bond UCITS ETF	1,225	174,213	0.16
iShares Core € Corporate Bond UCITS ETF	11,030	1,181,735	1.06
iShares Core EURO STOXX 50 UCITS ETF	21,082	2,349,720	2.11
iShares Core FTSE 100 UCITS ETF	106,693	778,710	0.70
iShares Core MSCI EM IMI UCITS ETF	178,901	4,469,770	4.02
iShares Core MSCI Japan IMI UCITS ETF	41,967	1,507,824	1.35
iShares Core MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF	11,097	1,399,917	1.26
iShares Emerging Markets Government Bond Index Fund	42,501	3,012,343	2.71
iShares Emerging Markets Index Fund	1,025,868	13,937,485	12.52
iShares Euro Government Bond Index Fund	127,380	1,010,403	0.91
iShares Euro Investment Grade Corporate Bond Index Fund	98,664	846,176	0.76
iShares Europe ex-UK Index Fund	419,256	7,065,501	6.35
iShares Global Government Bond UCITS ETF	24,302	1,964,219	1.76
iShares Global High Yield Corporate Bond UCITS ETF	83,047	5,670,034	5.09
iShares Global Inflation Linked Government Bond UCITS ETF	348,427	1,832,621	1.65
iShares Japan Index Fund	321,329	3,765,263	3.38
iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF	78,888	2,837,546	2.55
iShares North America Index Fund	724,505	19,835,392	17.82
iShares Pacific Index Fund	73,683	969,864	0.87
iShares S&P 500 Swap UCITS ETF	1,094,878	5,627,125	5.06
iShares UK Credit Bond Index Fund	22,868	268,751	0.24
iShares UK Index Fund	166,510	1,944,313	1.75
iShares US Corporate Bond Index Fund	385,479	2,829,927	2.54
iShares US Index Fund	1,268,276	20,644,230	18.55
iShares World ex-Euro Government Bond Index Fund	300,056	2,074,709	1.86
投資信託/投資法人合計		111,072,174	99.79
投資有価証券合計(取得原価 93,654,960 ポンド)		111,072,174	99.79

為替先渡契約にかかる未実現利益 0.06%

Sold Euro for Sterling - Maturing 03/03/2022	€170,969		
	£143,207	86	-
Sold Japanese Yen for Sterling - Maturing 03/03/2022	¥142,196,828		
	£920,201	48	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 03/03/2022	£133,108		
	€159,264	214	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 03/03/2022	£77,794		
	\$105,500	835	-
Sold Swedish Krona for Sterling - Maturing 03/03/2022	SEK202,538		
	£16,180	187	-
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 03/03/2022	\$16,308,425		
	£12,157,871	3,279	-
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 18/03/2022	£178,666		
	¥27,885,165	1,808	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 18/03/2022	£9,765,238		

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
	\$13,191,908	65,477	0.06
Sold Euro for Sterling - Maturing 05/04/2022	€2,520,000		
	£2,111,616	12	-
Sold Japanese Yen for Sterling - Maturing 05/04/2022	¥136,024,364		
	£880,686	146	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 05/04/2022	£406,637		
	\$545,758	5	-
為替先渡契約にかかる未実現利益合計		72,097	0.06
為替先渡契約にかかる未実現損失 (0.01%)			
Sold Australian Dollar for Sterling - Maturing 03/03/2022	AUD\$77,900		
	£40,920	(1,210)	-
Sold Canadian Dollars for Sterling - Maturing 03/03/2022	CAD\$221,369		
	£129,759	(320)	-
Sold Danish Kroner for Sterling - Maturing 03/03/2022	DKK114,827		
	£12,905	(18)	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 03/03/2022	€8,391,058		
	£7,016,475	(7,812)	(0.01)
Sold Norwegian Krone for Sterling - Maturing 03/03/2022	NOK105,226		
	£8,794	(125)	-
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 03/03/2022	£39,945		
	¥6,172,464	(3)	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 03/03/2022	£248,925		
	\$333,901	(70)	-
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 03/03/2022	\$227,493		
	£167,588	(1,962)	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 18/03/2022	£7,818,075		
	€9,333,332	(1,636)	-
Sold Australian Dollar for Sterling - Maturing 05/04/2022	AUD\$77,900		
	£42,136	(3)	-
Sold Canadian Dollars for Sterling - Maturing 05/04/2022	CAD\$221,369		
	£130,051	(10)	-
Sold Danish Kroner for Sterling - Maturing 05/04/2022	DKK114,827		
	£12,935	(1)	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 05/04/2022	€5,882,763		
	£4,929,083	(309)	-
Sold Norwegian Krone for Sterling - Maturing 05/04/2022	NOK105,226		
	£8,913	(1)	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 05/04/2022	£99,493		
	€118,728	(6)	-
Sold Swedish Krona for Sterling - Maturing 05/04/2022	SEK202,538		
	£16,002	(1)	-
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 05/04/2022	\$16,080,288		
	£11,979,546	(1,805)	-
為替先渡契約にかかる未実現損失合計		(15,292)	(0.01)
為替先渡契約にかかる未実現利益(純額)合計		56,805	0.05
ポートフォリオ合計\$		111,128,979	99.84
その他純負債		182,299	0.16
純資産合計		111,311,278	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、ゴールドマン・サックス・インターナショナル、HSBC銀行、モルガン・スタンレー、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 5

2022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 99.55%			
iShares \$ Corporate Bond UCITS ETF	7,897	699,473	1.02
iShares \$ Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF USD (Dist)	6,135	601,094	0.87
iShares € Government Bond 1-3yr UCITS ETF	3,872	461,381	0.67
iShares Core £ Corporate Bond UCITS ETF	674	95,853	0.14
iShares Core € Corporate Bond UCITS ETF	5,638	604,046	0.88
iShares Core EURO STOXX 50 UCITS ETF	7,870	877,160	1.27
iShares Core FTSE 100 UCITS ETF	34,297	250,320	0.36
iShares Core MSCI EM IMI UCITS ETF	133,523	3,336,019	4.85
iShares Core MSCI Japan IMI UCITS ETF	20,503	736,648	1.07
iShares Core MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF	5,915	746,193	1.08
iShares Emerging Markets Government Bond Index Fund	13,238	938,263	1.36
iShares Emerging Markets Index Fund	737,865	10,024,660	14.56
iShares Euro Government Bond Index Fund	86,316	684,671	1.00
iShares Europe ex-UK Index Fund	351,352	5,921,152	8.60
iShares Global Government Bond UCITS ETF	2,073	167,551	0.24
iShares Global High Yield Corporate Bond UCITS ETF	15,466	1,055,941	1.53
iShares Global Inflation Linked Government Bond UCITS ETF	106,235	558,764	0.81
iShares Japan Index Fund	264,488	3,099,207	4.50
iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF	10,898	391,993	0.57
iShares North America Index Fund	458,514	12,553,132	18.23
iShares Pacific Index Fund	71,891	946,282	1.37
iShares S&P 500 Swap UCITS ETF	1,618,513	8,318,348	12.08
iShares UK Index Fund	143,384	1,674,276	2.43
iShares US Index Fund	761,724	12,398,885	18.01
iShares World ex-Euro Government Bond Index Fund	204,150	1,411,574	2.05
投資信託/投資法人合計		68,552,886	99.55
投資有価証券合計(取得原価 54,643,048 ボンド)		68,552,886	99.55

為替先渡契約にかかる未実現利益 0.07%

Sold Euro for Sterling - Maturing 03/03/2022	€17,619		
	£14,758	9	-
Sold Japanese Yen for Sterling - Maturing 03/03/2022	¥59,801,656		
	£386,996	20	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 03/03/2022	£27,306		
	€32,655	30	-
Sold Swedish Krona for Sterling - Maturing 03/03/2022	SEK131,947		
	£10,541	122	-
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 03/03/2022	\$3,825,920		
	£2,852,210	769	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 18/03/2022	€629		
	£527	-	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 18/03/2022	£7,074,605		
	\$9,557,119	47,436	0.07
Sold Euro for Sterling - Maturing 05/04/2022	€830,000		
	£695,493	4	-
Sold Japanese Yen for Sterling - Maturing 05/04/2022	¥58,381,933		

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
	£377,992	63	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 05/04/2022	£76,501		
	\$102,674	1	-
為替先渡契約にかかる未実現利益合計		48,454	0.07
為替先渡契約にかかる未実現損失 (0.02%)			
Sold Australian Dollar for Sterling - Maturing 03/03/2022	AUD\$53,001		
	£27,841	(823)	-
Sold Canadian Dollars for Sterling - Maturing 03/03/2022	CAD\$73,331		
	£42,984	(106)	-
Sold Danish Kroner for Sterling - Maturing 03/03/2022	DKK71,167		
	£7,998	(11)	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 03/03/2022	€2,784,704		
	£2,328,527	(2,593)	(0.01)
Sold Japanese Yen for Sterling - Maturing 03/03/2022	¥1,393,255		
	£8,885	(131)	-
Sold Norwegian Krone for Sterling - Maturing 03/03/2022	NOK65,766		
	£5,496	(78)	-
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 03/03/2022	£18,204		
	¥2,812,978	(1)	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 03/03/2022	£57,536		
	\$77,178	(16)	-
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 03/03/2022	\$49,350		
	£36,355	(426)	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 18/03/2022	€407,324		
	£340,225	(898)	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 18/03/2022	£11,319,830		
	€13,513,779	(2,370)	-
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 18/03/2022	\$282,942		
	£208,294	(2,557)	(0.01)
Sold Australian Dollar for Sterling - Maturing 05/04/2022	AUD\$53,001		
	£28,668	(2)	-
Sold Canadian Dollars for Sterling - Maturing 05/04/2022	CAD\$73,331		
	£43,081	(3)	-
Sold Danish Kroner for Sterling - Maturing 05/04/2022	DKK71,167		
	£8,017	(1)	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 05/04/2022	€1,939,668		
	£1,625,220	(102)	-
Sold Norwegian Krone for Sterling - Maturing 05/04/2022	NOK65,766		
	£5,571	(1)	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 05/04/2022	£15,125		
	€18,050	(1)	-
Sold Swedish Krona for Sterling - Maturing 05/04/2022	SEK131,947		
	£10,425	(1)	-
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 05/04/2022	\$3,798,093		
	£2,829,516	(426)	-
為替先渡契約にかかる未実現損失合計		(10,547)	(0.02)
為替先渡契約にかかる未実現利益(純額)合計		37,907	0.05
ポートフォリオ合計\$		68,590,793	99.60
その他純資産		273,846	0.40
純資産合計		68,864,639	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、ゴールドマン・サックス・インターナショナル、HSBC銀行、モルガン・スタンレー、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・マルチマネジャー・ポートフォリオ 1

2022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 96.24%			
GlobalAccess Asia Pacific (ex-Japan) Fund*	263,100	831,610	2.13
GlobalAccess Emerging Market Debt Fund*	1,413,923	1,193,944	3.06
GlobalAccess Emerging Market Equity Fund*	1,062,060	994,400	2.55
GlobalAccess Emerging Market Local Currency Debt Fund*	2,882,328	1,209,428	3.10
GlobalAccess Europe (ex-UK) Alpha Fund*	354,183	778,909	2.00
GlobalAccess Global Corporate Bond Fund*	5,872,760	5,165,919	13.23
GlobalAccess Global Government Bond Fund*	5,547,960	5,294,852	13.56
GlobalAccess Global High Yield Bond Fund*	1,681,150	1,425,861	3.65
GlobalAccess Global Short Duration Bond Fund*	3,300,839	4,145,765	10.62
GlobalAccess Japan Fund*	343,300	434,099	1.11
GlobalAccess UK Opportunities Fund*	71,850	225,678	0.58
GlobalAccess US Equity Fund*	96,570	3,621,377	9.28
GlobalAccess US Small & Mid Cap Equity Fund*	343,850	779,639	2.00
Institutional Cash Series Plc			
- Institutional Sterling Liquidity Fund	5,611,205	5,611,205	14.37
iShares Core MSCI World UCITS ETF	27,350	206,312	0.53
iShares Core MSCI World UCITS ETF (Acc)	9,339	573,955	1.47
iShares Global Corp Bond UCITS ETF	160,400	809,042	2.07
iShares USD High Yield Bond UCITS ETF	165,200	766,941	1.96
Pimco GIS Global Real Return Institutional GBP (Dist)	340,330	3,501,996	8.97
投資信託/投資法人合計		37,570,932	96.24
投資有価証券合計(取得原価 36,640,506 ボンド)		37,570,932	96.24

先物契約にかかる未実現利益 0.11%#

	通貨	元本	償還日	未実現利益 (ボンド)	純資産に 対する割合 (%)
Russel 2000 Emini Index Future Expiry					
March 2022	USD	(7)	18-Mar-22	34,457	0.09
US 10 Year Note Future Expiry March 2022	USD	12	21-Jun-22	9,298	0.02
先物契約にかかる未実現利益合計				43,755	0.11
先物契約にかかる未実現利益(純額)合計				43,755	0.11

為替先渡契約にかかる未実現利益 0.27%

Sold Sterling for US Dollars - Maturing 07/03/2022		£409,999			
		\$555,353		3,892	0.01
Sold Euro for Sterling - Maturing 15/03/2022		€727,487			
		£610,269		1,073	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 15/03/2022		£26,592			
		€31,840		71	-
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 15/03/2022		£30,307			
		¥4,760,212		500	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 15/03/2022		£9,329,018			
		\$12,653,852		100,970	0.26
為替先渡契約にかかる未実現利益合計				106,506	0.27

為替先渡契約にかかる未実現損失 (0.85%)

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 07/03/2022	\$23,555,965		
	£17,380,461	(175,248)	(0.45)
Sold Euro for Sterling - Maturing 15/03/2022	€97,372		
	£81,330	(209)	-
Sold Japanese Yen for Sterling - Maturing 15/03/2022	¥101,844		
	£647	(13)	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 15/03/2022	£19,630,190		
	€23,256,204	(155,478)	(0.39)
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 15/03/2022	\$388,920		
	£286,500	(3,334)	(0.01)
為替先渡契約にかかる未実現損失合計		(334,282)	(0.85)
為替先渡契約にかかる未実現損失(純額)合計		(227,776)	(0.58)
ポートフォリオ合計 §		37,386,911	95.77
その他純資産		1,651,603	4.23
純資産合計		39,038,514	100.00

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。

先物契約の約定の絶対額は1,673,058ポンドで、証拠金額114,309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

2022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 96.63%			
GlobalAccess Asia Pacific (ex-Japan) Fund*	930,120	2,939,935	3.58
GlobalAccess Emerging Market Debt Fund*	3,323,462	2,806,396	3.42
GlobalAccess Emerging Market Equity Fund*	4,685,640	4,387,131	5.34
GlobalAccess Emerging Market Local Currency Debt Fund*	7,362,189	3,089,184	3.76
GlobalAccess Europe (ex-UK) Alpha Fund*	1,307,841	2,876,169	3.50
GlobalAccess Global Corporate Bond Fund*	9,459,372	8,320,849	10.14
GlobalAccess Global Government Bond Fund*	8,936,850	8,529,135	10.39
GlobalAccess Global High Yield Bond Fund*	4,381,550	3,716,194	4.53
GlobalAccess Global Short Duration Bond Fund*	7,496,638	9,415,575	11.47
GlobalAccess Japan Fund*	1,278,500	1,616,648	1.97
GlobalAccess UK Opportunities Fund*	303,880	954,475	1.16
GlobalAccess US Equity Fund*	361,555	13,558,322	16.51
GlobalAccess US Small & Mid Cap Equity Fund*	1,322,450	2,998,498	3.65
iShares Core MSCI World UCITS ETF	57,200	431,483	0.53
iShares Core MSCI World UCITS ETF (Acc)	21,450	1,318,271	1.61
iShares Global Corp Bond UCITS ETF	332,650	1,677,853	2.04
iShares USD High Yield Bond UCITS ETF	365,200	1,695,441	2.07
Pimco GIS Global Real Return Institutional GBP (Dist)	566,600	5,830,314	7.10
Royal London Cash Plus Fund	3,166,297	3,172,139	3.86
投資信託/投資法人合計		79,334,012	96.63
投資有価証券合計(取得原価 73,841,057 ポンド)		79,334,012	96.63

先物契約にかかる未実現利益 0.18%#

	通貨	元本	償還日	未実現利益 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
Russel 2000 Emini Index Future Expiry March 2022	USD	(26)	18-Mar-22	127,983	0.16
US 10 Year Note Future Expiry March 2022	USD	26	21-Jun-22	20,145	0.02
先物契約にかかる未実現利益合計				148,128	0.18
先物契約にかかる未実現利益(純額)合計				148,128	0.18

為替先渡契約にかかる未実現利益 0.18%

Sold Euro for Sterling - Maturing 15/03/2022		€1,246,336			
		£1,047,090		3,410	0.01
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 15/03/2022		£268,491			
		¥42,170,892		4,431	0.01
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 15/03/2022		£12,449,850			
		\$16,886,939		134,747	0.16
為替先渡契約にかかる未実現利益合計				142,588	0.18

為替先渡契約にかかる未実現損失 (0.80%)

Sold US Dollars for Sterling - Maturing 07/03/2022		\$45,442,182			
		£33,528,920		(338,073)	(0.41)
Sold Euro for Sterling - Maturing 15/03/2022		€79,112			

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
	£66,031	(217)	-
Sold Japanese Yen for Sterling - Maturing 15/03/2022	¥938,634		
	£5,999	(76)	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 15/03/2022	£39,656,191		
	€46,981,362	(314,067)	(0.38)
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 15/03/2022	\$368,507		
	£272,377	(2,245)	(0.01)
為替先渡契約にかかる未実現損失合計		(654,678)	(0.80)
為替先渡契約にかかる未実現損失(純額)合計		(512,090)	(0.62)
ポートフォリオ合計 §		78,970,050	96.19
その他純資産		3,127,703	3.81
純資産合計		82,097,753	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・ユークー・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4,450,326ポンドで、証拠金額294,204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

2022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 90.05%			
GlobalAccess Asia Pacific (ex-Japan) Fund*	4,480,093	14,160,733	5.80
GlobalAccess Emerging Market Debt Fund*	9,776,366	8,255,354	3.38
GlobalAccess Emerging Market Equity Fund*	19,632,358	18,381,637	7.53
GlobalAccess Emerging Market Local Currency Debt Fund*	21,260,818	8,921,066	3.65
GlobalAccess Europe (ex-UK) Alpha Fund*	6,590,274	14,493,155	5.94
GlobalAccess Global Corporate Bond Fund*	17,240,889	15,165,788	6.21
GlobalAccess Global Government Bond Fund*	15,997,800	15,267,952	6.25
GlobalAccess Global High Yield Bond Fund*	13,155,834	11,158,069	4.57
GlobalAccess Global Short Duration Bond Fund*	14,316,455	17,981,083	7.37
GlobalAccess Japan Fund*	6,001,800	7,589,206	3.11
GlobalAccess UK Opportunities Fund*	1,320,197	4,146,686	1.70
GlobalAccess US Equity Fund*	1,218,700	45,701,280	18.72
GlobalAccess US Small & Mid Cap Equity Fund*	6,080,992	13,787,923	5.65
iShares Core MSCI World UCITS ETF	165,000	1,244,661	0.51
iShares Core MSCI World UCITS ETF (Acc)	62,000	3,810,388	1.56
iShares Global Corp Bond UCITS ETF	958,250	4,833,317	1.98
iShares USD High Yield Bond UCITS ETF	1,056,100	4,902,944	2.01
Pimco GIS Global Real Return Institutional GBP (Dist)	975,000	10,032,750	4.11
投資信託/投資法人合計		219,833,992	90.05
投資有価証券合計(取得原価 191,196,869 ポンド)		219,833,992	90.05
先物契約にかかる未実現利益 0.28%#			
Russel 2000 Emini Index Future Expiry March 2022	(131)	644,839	0.26
S&P 500 Emini Index Future Expiry March 2022	5	4,006	-
US 10 Year Note Future Expiry March 2022	60	46,488	0.02
先物契約にかかる未実現利益合計		695,333	0.28
先物契約にかかる未実現損失 (0.53%)#			
S&P 500 Emini Index Future Expiry March 2022	119	(1,292,215)	(0.53)
先物契約にかかる未実現損失合計		(1,292,215)	(0.53)
先物契約にかかる未実現損失(純額)合計		(596,882)	(0.25)
為替先渡契約にかかる未実現利益 0.20%			
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 07/03/2022	£2,147,329		
	\$2,914,000	24,407	0.01
Sold Euro for Sterling - Maturing 15/03/2022	€497,019		
	£417,460	1,257	-
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 15/03/2022	£938,491		
	¥147,405,529	15,490	0.01
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 15/03/2022	£41,131,273		
	\$55,790,335	445,170	0.18
為替先渡契約にかかる未実現利益合計		486,324	0.20
為替先渡契約にかかる未実現損失 (0.48%)			
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 07/03/2022	\$73,954,358		
	£54,566,257	(550,193)	(0.22)
Sold Euro for Sterling - Maturing 15/03/2022	€2,047,370		
	£1,708,057	(6,407)	-

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
Sold Japanese Yen for Sterling - Maturing 15/03/2022	¥3,158,004		
	£20,222	(216)	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 15/03/2022	£76,796,974		
	€90,983,882	(607,204)	(0.25)
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 15/03/2022	\$1,380,940		
	£1,015,918	(13,196)	(0.01)
為替先渡契約にかかる未実現損失合計		(1,177,216)	(0.48)
為替先渡契約にかかる未実現損失(純額)合計		(690,892)	(0.28)
ポートフォリオ合計 §		218,546,218	89.52
その他純資産		25,592,449	10.48
純資産合計		244,138,667	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バークレイズ・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バークレイズ・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35,863,107ポンドで、証拠金額2,022,989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

2022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 93.81%			
Brandes Investment Funds - Brandes U.S. Value Fund	134,100	1,170,346	2.03
Findlay Park American Fund	12,595	1,636,810	2.84
GlobalAccess Asia Pacific (ex-Japan) Fund*	1,507,050	4,763,502	8.25
GlobalAccess Emerging Market Debt Fund*	1,884,138	1,591,003	2.76
GlobalAccess Emerging Market Equity Fund*	6,697,537	6,270,856	10.86
GlobalAccess Emerging Market Local Currency Debt Fund*	3,897,238	1,635,286	2.83
GlobalAccess Europe (ex-UK) Alpha Fund*	2,141,890	4,710,389	8.16
GlobalAccess Global Corporate Bond Fund*	2,727,800	2,399,484	4.16
GlobalAccess Global Government Bond Fund*	1,487,800	1,419,924	2.46
GlobalAccess Global High Yield Bond Fund*	2,150,550	1,823,981	3.16
GlobalAccess Japan Fund*	2,055,040	2,598,575	4.50
GlobalAccess UK Opportunities Fund*	423,127	1,329,025	2.30
GlobalAccess US Equity Fund*	291,698	10,938,697	18.95
GlobalAccess US Small & Mid Cap Equity Fund*	2,136,650	4,844,599	8.39
iShares Core MSCI World UCITS ETF	40,400	304,753	0.53
iShares Core MSCI World UCITS ETF (Acc)	15,150	931,087	1.61
iShares Global Corp Bond UCITS ETF	236,000	1,190,360	2.06
iShares USD High Yield Bond UCITS ETF	252,750	1,173,392	2.03
Loomis Sayles US Growth Equity Fund	13,790	1,751,101	3.03
Pimco GIS Global Real Return Institutional GBP (Dist)	95,300	980,637	1.70
Vulcan Value Equity Fund	7,340	691,371	1.20
投資信託/投資法人合計		54,155,178	93.81
投資有価証券合計(取得原価 45,924,920 ポンド)		54,155,178	93.81
先物契約にかかる未実現利益 0.40%#			
Russel 2000 Emini Index Future Expiry March 2022	(47)	231,354	0.40
先物契約にかかる未実現利益合計		231,354	0.40
先物契約にかかる未実現損失 (0.66%)#			
S&P 500 Emini Index Future Expiry March 2022	35	(380,063)	(0.66)
先物契約にかかる未実現損失合計		(380,063)	(0.66)
先物契約にかかる未実現損失(純額)合計		(148,709)	(0.26)
為替先渡契約にかかる未実現利益 0.18%			
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 07/03/2022	£762,842		
	\$1,033,164	7,150	0.01
Sold Euro for Sterling - Maturing 15/03/2022	€708,469		
	£594,723	1,452	0.01
Sold Japanese Yen for Sterling - Maturing 15/03/2022	¥3,970,860		
	£25,861	163	-
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 15/03/2022	£1,067,572		
	¥167,679,848	17,620	0.03
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 15/03/2022	£6,858,890		
	\$9,303,378	74,235	0.13
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 15/03/2022	\$219,209		

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
	£164,764	1,403	-
為替先渡契約にかかる未実現利益合計		102,023	0.18
為替先渡契約にかかる未実現損失 (0.31%)			
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 07/03/2022	\$6,174,414		
	£4,555,711	(45,935)	(0.08)
Sold Euro for Sterling - Maturing 15/03/2022	€456,816		
	£382,307	(230)	-
Sold Japanese Yen for Sterling - Maturing 15/03/2022	¥3,502,359		
	£22,385	(282)	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 15/03/2022	£16,343,290		
	€19,362,238	(129,380)	(0.23)
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 15/03/2022	\$193,206		
	£142,805	(1,177)	-
為替先渡契約にかかる未実現損失合計		(177,004)	(0.31)
為替先渡契約にかかる未実現損失(純額)合計		(74,981)	(0.13)
ポートフォリオ合計 §		53,931,488	93.42
その他純資産		3,796,397	6.58
純資産合計		57,727,885	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9,277,864ポンドで、証拠金額601,844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

2022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 91.75%			
Brandes Investment Funds - Brandes U.S. Value Fund	68,720	599,747	3.04
Findlay Park American Fund	6,705	871,363	4.41
GlobalAccess Asia Pacific (ex-Japan) Fund*	600,342	1,897,567	9.61
GlobalAccess Emerging Market Debt Fund*	328,416	277,321	1.41
GlobalAccess Emerging Market Equity Fund*	2,762,881	2,586,866	13.10
GlobalAccess Emerging Market Local Currency Debt Fund*	311,795	130,830	0.66
GlobalAccess Europe (ex-UK) Alpha Fund*	848,746	1,866,539	9.45
GlobalAccess Global Corporate Bond Fund*	238,500	209,794	1.06
GlobalAccess Global Government Bond Fund*	270,120	257,797	1.31
GlobalAccess Japan Fund*	808,470	1,022,301	5.18
GlobalAccess UK Opportunities Fund*	170,021	534,030	2.70
GlobalAccess US Equity Fund*	100,277	3,760,390	19.04
GlobalAccess US Small & Mid Cap Equity Fund*	792,247	1,796,326	9.10
iShares Core MSCI World UCITS ETF	14,500	109,379	0.55
iShares Core MSCI World UCITS ETF (Acc)	4,907	301,574	1.53
iShares Global Corp Bond UCITS ETF	39,170	197,569	1.00
iShares USD High Yield Bond UCITS ETF	66,080	306,776	1.55
Loomis Sayles US Growth Equity Fund	6,983	886,725	4.49
Pimco GIS Global Real Return Institutional GBP (Dist)	17,230	177,297	0.90
Vulcan Value Equity Fund	3,472	327,066	1.66
投資信託/投資法人合計		18,117,257	91.75
投資有価証券合計(取得原価 15,302,979 ポンド)		18,117,257	91.75
先物契約にかかる未実現利益 0.42%#			
Russel 2000 Emini Index Future Expiry March 2022	(17)	83,681	0.42
先物契約にかかる未実現利益合計		83,681	0.42
先物契約にかかる未実現損失 (0.77%)#			
S&P 500 Emini Index Future Expiry March 2022	14	(152,025)	(0.77)
先物契約にかかる未実現損失合計		(152,025)	(0.77)
先物契約にかかる未実現損失(純額)合計		(68,344)	(0.35)
為替先渡契約にかかる未実現利益 0.24%			
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 07/03/2022	£404,904		
	\$548,519	3,894	0.02
Sold Euro for Sterling - Maturing 15/03/2022	€184,177		
	£154,663	434	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 15/03/2022	£4,053,027		
	\$5,497,514	43,867	0.22
為替先渡契約にかかる未実現利益合計		48,195	0.24
為替先渡契約にかかる未実現損失 (0.27%)			
Sold Euro for Sterling - Maturing 15/03/2022	€167,638		
	£140,086	(294)	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 15/03/2022	£6,608,565		

投資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
	€7,829,274	(52,342)	(0.26)
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 15/03/2022	\$261,515		
	£193,163	(1,725)	(0.01)
為替先渡契約にかかる未実現損失合計		(54,361)	(0.27)
為替先渡契約にかかる未実現損失(純額)合計		(6,166)	(0.03)
ポートフォリオ合計 §		18,042,747	91.37
その他純資産		1,704,986	8.63
純資産合計		19,747,733	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3,574,008ポンドで、証拠金額275,529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

2022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2022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 2021年4月1日 至 2022年3月31日	円建・分配型			円建・累積型		
	0 (0)	0 (0)	104,000 (104,000)	-		
	米ドル建・分配型			米ドル建・累積型		
	-			0 (0)	0 (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 2021年4月1日 至 2022年3月31日	円建・分配型			円建・累積型		
	0 (0)	43,500 (43,500)	82,500 (82,500)	-		
	米ドル建・分配型			米ドル建・累積型		
	0 (0)	19,322 (15,500)	56,000 (56,000)	0 (0)	30 (0)	15,209 (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 2021年4月1日 至 2022年3月31日	円建・分配型			円建・累積型		
	38,000 (38,000)	47,000 (47,000)	174,500 (174,500)	-		
	米ドル建・分配型			米ドル建・累積型		
	500 (500)	38,500 (38,500)	110,836 (101,000)	0 (0)	10,030 (0)	30,008 (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 2021年4月1日 至 2022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		
	0 (0)	18,000 (18,000)	12,500 (12,500)	0 (0)	12,039 (0)	0 (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 2021年4月1日 至 2022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		
	-			-		

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 2021年4月1日 至 2022年3月31日	円建・分配型			円建・累積型		
	0 (0)	0 (0)	4,500 (4,500)	-		
	米ドル建・分配型			米ドル建・累積型		
	1,391 (0)	77,795 (50,000)	777,264 (550,000)	10,596 (0)	20,794 (0)	210,164 (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 2021年4月1日 至 2022年3月31日	円建・分配型			円建・累積型		
	0 (0)	31,000 (31,000)	36,000 (36,000)	-		
	米ドル建・分配型			米ドル建・累積型		
	1,645 (0)	0 (0)	156,114 (20,000)	720 (0)	72,637 (0)	902,664 (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 2021年4月1日 至 2022年3月31日	円建・分配型			円建・累積型		
	0 (0)	30,500 (30,500)	117,500 (117,500)	-		
	米ドル建・分配型			米ドル建・累積型		
	22,310 (0)	68,955 (50,000)	1,058,913 (90,000)	10,072 (0)	190,575 (0)	1,119,644 (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 2021年4月1日 至 2022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)	34,850 (0)	268,749 (58,000)	1,135 (0)	54,260 (0)	139,658 (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 2021年4月1日 至 2022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		
	200,000 (200,000)	0 (0)	291,154 (237,000)	0 (0)	10,592 (0)	14,569 (0)