

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	2023年4月28日
【計算期間】	第18期中（自 2022年8月1日 至 2023年1月31日）
【発行者名】	マルチ・マネージャー・アクセス (Multi Manager Access)
【代表者の役職氏名】	チェアマン・オブ・ザ・ボード・オブ・ディレクターズ アンドレアス・エバーソルド (Andreas Aebersold) メンバー・オブ・ザ・ボード・オブ・ディレクターズ ジェーン・ウィルキンソン (Jane Wilkinson)
【本店の所在の場所】	ルクセンブルグ大公国、ルクセンブルグL - 1855、J.F.ケネディ通り33A (33A avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg, Grand Duchy of Luxembourg)
【代理人の氏名又は名称】	弁護士 三 浦 健 弁護士 大 西 信 治
【代理人の住所又は所在地】	東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング 森・濱田松本法律事務所
【事務連絡者氏名】	弁護士 三 浦 健 弁護士 大 西 信 治
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング 森・濱田松本法律事務所
【電話番号】	03 (6212) 8316
【縦覧に供する場所】	該当事項なし

(注1) 米ドルの円貨換算は、特に記載がない限り、2023年2月28日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=136.33円)による。

(注2) ファンドは、ルクセンブルグ法に基づいて設立されているが、投資証券は米ドルまたは円建てのため、以下の金額表示は別段の記載がない限り米ドル貨または円貨をもって行う。

(注3) 本書の中で金額および比率を表示する場合、四捨五入してまたは切り捨てて記載してある。従って、合計の数字が一致しない場合がある。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記載してある。従って、本書の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る。

1【外国投資法人の概況】

マルチ・マネージャー・アクセスのサブ・ファンドであるグリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド（以下、マルチ・マネージャー・アクセスを「本投資法人」、グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド「ファンド」または「サブ・ファンド」ということがある。）の概況は以下のとおりである。

(1)【主要な経営指標等の推移】

（グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド）

（別段の記載がない限り金額は米ドル表示）

	2022年7月末日に 終了する 会計年度末	2023年1月末日に 終了する 中間会計年度末
(a) 営業収益 ⁽¹⁾	- 212,590,490.47	- 22,635,983.09
(b) 経常利益金額または経常損失金額	- 212,590,490.47	- 22,635,983.09
(c) 当期純利益金額または 当期純損失金額	- 212,590,490.47	- 22,635,983.09
(d) 出資総額 ⁽²⁾	2,508,527,924.69	2,391,865,041.31
(e) 発行済投資口総数 (クラスF - a c c 投資証券)	9,189,310.1930口	8,718,238.9210口
(クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券)	243,805口	249,665口
(f) 純資産額	2,508,527,924.69	2,391,865,041.31
(g) 資産総額	2,537,477,140.99	2,428,032,449.01
(h) 1口当たり純資産価格 (クラスF - a c c 投資証券)	94.81	92.54
(クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券)	9,989円	9,544円
(i) 1口当たり当期純利益金額または 当期純損失金額 (クラスF - a c c 投資証券)	- 4.85	- 2.59
(クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券)	- 2.55	- 1.03
(j) 分配総額	なし	33,171.77
(k) 1口当たり分配金額	該当事項なし	該当事項なし
(l) 自己資本比率	98.86%	98.51%
(m) 自己資本利益率 ⁽³⁾ (クラスF - a c c 投資証券)	- 5.19%	- 7.46%
(クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券)	- 0.11%	- 4.56%

(1) 営業収益には投資収益および実現および未実現利益（損失）が含まれる。以下同じ。

(2) サブ・ファンドは変動資本を有する会社型投資信託であり、純資産総額を記載している。以下同じ。

- (3) 自己資本利益率は、当該会計年度の1口当たり純資産価格の前年度に対する増減の比率であるが、当該会計年度に初めて当該投資証券が発行された場合には、当初募集価格に対する増減の比率で表すものとする。以下同じ。
- (4) 「主要な経営指標等の推移(e) 発行済投資口総数、(h) 1口当たり純資産価格、(i) 1口当たり当期純利益金額または当期純損失金額、(k) 1口当たり分配金額および(m) 自己資本利益率」は、日本で販売しているクラスのみ記載している。以下同じ。
- (注1) サブ・ファンドは2022年3月10日に設立され、サブ・ファンドのクラスF - a c c 投資証券は2022年3月10日に運用を開始し、クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券は2022年5月13日に運用を開始した。
- (注2) 名称の一部に「F」を含むクラスの投資証券は、年次財務報告書が作成された後に、取締役会の提案を経て、定時投資主総会により、分配がなされるか否か、またその額が決定される。以下同じ。
- (注3) 各取引に使用された1口当たりの純資産価格は、純資産価格の調整の結果、上記および財務書類に記載の価格と異なる場合がある(財務書類に対する注記1参照)。以下同じ。

(2) 【外国投資法人の出資総額】

2023年2月末日現在のサブ・ファンドの出資総額および各クラス投資証券の発行済投資証券総数は以下のとおりである。

なお、発行可能投資口総口数には制限がない。

(グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド)

	出資総額		発行済投資証券総数 (口)	
	米ドル	百万円		
2022年7月末日に終了する 会計年度末	2,508,527,925	341,988	クラスF - a c c 投資証券	9,189,310.1930
			クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券	243,805
2023年2月末日現在	2,306,806,528	314,487	クラスF - a c c 投資証券	8,736,374.6860
			クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券	241,055

(注) 米ドルの円貨換算は、特に記載がない限り、2023年2月28日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売相場(1米ドル=136.33円)による。以下、同じ。

(3) 【主要な投資主の状況】

1993年4月5日付ルクセンブルグ法第41条により課されるルクセンブルグ銀行機密規定(改訂済)により、当該サブ・ファンドの主要な投資主に関する情報は公開できない。

(4) 【役員 の 状況】

(2023年2月末日現在)

氏 名	役 職 名	略 歴	所有株式
アンドレアス・ エバーソルド (Andreas Aebersold)	チェアマン・ オブ・ザ・ ボード・オブ・ ディレクターズ	ユービーエス・スイス・エイ・ジー、 エグゼクティブ・ディレクター	該当なし
マデュ・ラマチャンドラン (Madhu Ramachandran)	メンバー・オブ・ ザ・ボード・オブ・ ディレクターズ	UBSヨーロッパSE ルクセンブルグ 支店 エグゼクティブ・ディレクター	該当なし
クリスティアン・シェーン (Christian Schön)	メンバー・オブ・ ザ・ボード・オブ・ ディレクターズ	UBSヨーロッパSE ルクセンブルグ 支店 エグゼクティブ・ディレクター	該当なし
ジェーン・ウィルキンソン (Jane Wilkinson)	インディペンデント・ ディレクター	インディペンデント・ディレクター リップル・エフェクト・サール・エ ス、ルクセンブルグ 創設パートナー	該当なし
トーマス・ウベール (Thomas Huber)	メンバー・オブ・ ザ・ボード・オブ・ ディレクターズ	ユービーエス・スイス・エイ・ジー、 マネージング・ディレクター	該当なし

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

(5) 【その他】

a. 定款の変更

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

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

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

b. 事業譲渡または事業譲受

投資法人、サブ・ファンドおよび投資証券クラスの解散および合併

本投資法人、サブ・ファンドおよび投資証券クラスの解散

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

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

サブ・ファンドもしくは投資証券クラスの純資産総額がサブ・ファンドの投資証券クラスを経済的に合理的に管理できない水準(1,000万ユーロまたはサブ・ファンドについての他の通貨建ての相当する金額と見積もられている。)未滿に落ち込んだ場合、または政治もしくは経済の状況の変化がある場合、取締役会は、一もしくは複数のサブ・ファンドの投資証券クラスの清算を要求することができる。

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

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

サブ・ファンド同士またはサブ・ファンドとその他のUCIの合併

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

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

投資主総会

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

c. 出資の状況その他の重要事項

該当事項なし。

d. 訴訟事件その他の重要事項

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

2【外国投資法人の運用状況】

(1)【投資状況】

資産別および地域別の投資状況

(グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド)

(2023年2月末日現在)

資産の種類	国・地域名	時価合計(米ドル)	投資比率 (%)
債券	米国	395,075,733.87	16.68
	フランス	306,627,717.34	12.95
	オランダ	257,207,386.17	10.86
	ドイツ	197,674,642.33	8.35
	国際機関	151,183,673.25	6.38
	スペイン	145,508,628.80	6.15
	イタリア	113,540,667.27	4.80
	イギリス	105,853,306.64	4.47
	チリ	43,618,908.59	1.84
	日本	42,108,781.70	1.78
	ルクセンブルグ	40,226,028.33	1.70
	ベルギー	39,358,311.44	1.66
	スウェーデン	36,939,325.59	1.56
	アイルランド	34,256,253.47	1.45
	デンマーク	32,571,132.34	1.38
	韓国	27,522,790.02	1.16
	インドネシア	24,222,921.46	1.02
	メキシコ	21,922,462.48	0.93
	ケイマン諸島	21,341,425.44	0.90
	オーストラリア	20,373,568.88	0.86
	オーストリア	16,284,579.83	0.69
	カナダ	16,140,391.54	0.68
	フィンランド	15,819,507.99	0.67
	ポルトガル	14,165,099.35	0.60
	香港	13,179,715.76	0.56
	ペルー	12,607,080.38	0.53
	インド	10,241,723.13	0.43
	ノルウェー	10,153,759.67	0.43
	フィリピン	6,882,260.00	0.29
	中国	5,837,658.00	0.25
モーリシャス	5,258,367.81	0.22	
イスラエル	4,594,555.95	0.19	
アラブ首長国連邦	4,231,500.00	0.18	
多国籍	4,151,556.25	0.18	
ジャージー	4,088,774.42	0.17	

	トルコ	3,474,000.00	0.15
	シンガポール	3,267,400.00	0.14
	エクアドル	3,038,475.00	0.13
	ウルグアイ	2,967,000.00	0.13
	ハンガリー	2,868,122.24	0.12
	英領ヴァージン諸島	2,862,208.48	0.12
	グアテマラ	2,383,281.25	0.10
	スロベニア	1,930,808.87	0.08
	アンドラ	1,672,998.14	0.07
	ポーランド	1,564,343.54	0.07
	リトアニア	1,372,320.14	0.06
	ルーマニア	875,442.75	0.04
	コロンビア	466,875.00	0.02
	ガーンジー	330,477.52	0.01
	小計	2,229,843,948.42	94.17
モーゲージ 担保証券/ 資産担保証券/ その他割引債	米国	863,833.37	0.04
従来型 オプション	米国	- 90,306.80	0.00
	イギリス	- 0.01	0.00
	小計	- 90,306.81	0.00
	2,230,617,474.98	94.20	
ポートフォリオ合計		137,233,141.83	5.80
現金・その他資産(負債控除後)		2,367,850,616.81	100.00
資産総額		61,044,089.21	2.58
負債総額		2,306,806,527.60 (約314,487百万円)	97.42

(注) 投資比率とは、サブ・ファンドの資産総額に対する当該資産の時価の比率をいう。以下同じ。

（２）【運用実績】

【純資産等の推移】

2023年2月末日および同日前1年以内における各月末の総資産および純資産の推移は次のとおりである。

（グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド）

	資産総額		純資産総額		1口当たり純資産価格		
					（クラスF - a c c 投資証券）		（クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券）
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円	円
2022年3月末日	2,853,508	389,019	2,789,267	380,261	98.78	13,467	-
4月末日	2,750,483	374,973	2,585,898	352,535	95.16	12,973	-
5月末日	2,661,924	362,900	2,599,883	354,442	94.49	12,882	9,992
6月末日	2,538,453	346,067	2,457,736	335,063	91.57	12,484	9,666
7月末日	2,537,477	345,934	2,508,528	341,988	94.81	12,925	9,989
8月末日	2,477,251	337,724	2,385,723	325,246	91.83	12,519	9,649
9月末日	2,365,466	322,484	2,217,951	302,373	88.05	12,004	9,222
10月末日	2,205,909	300,732	2,163,927	295,008	87.63	11,947	9,146
11月末日	2,428,032	331,014	2,314,171	315,491	90.75	12,372	9,438
12月末日	2,360,010	321,740	2,329,912	317,637	90.14	12,289	9,336
2023年1月末日	2,428,032	331,014	2,391,865	326,083	92.54	12,616	9,544
2月末日	2,367,851	322,809	2,306,807	314,487	90.89	12,391	9,338

（注）サブ・ファンドは2022年3月10日に設立され、サブ・ファンドのクラスF - a c c 投資証券は2022年3月10日に運用を開始し、クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券は2022年5月13日に運用を開始した。

各サブ・ファンドのクラスF - a c c 投資証券およびクラスF - a c c 円ヘッジ投資証券は、ルクセンブルグ証券取引所に上場されている。同取引所での実質的な取引実績はない。

【分配の推移】

（グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド）

クラスF - a c c 投資証券

クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券

該当事項なし。

【自己資本利益率（収益率）の推移】

2023年2月末日までの1年間における自己資本利益率（収益率）は次のとおりである。

（グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド）

収益率（％）（注）	
（クラスF - a c c 投資証券）	（クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券）
- 9.11	- 6.62

（注）収益率（％）＝ $100 \times (a - b) / b$

a = 2023年2月末日現在の1口当たり純資産価格（当該期間の分配金の合計金額を加えた額）。

b = 当初発行価格（クラスF - a c c投資証券は100米ドル、クラスF - a c c円ヘッジ投資証券は10,000円）。

（3）【投資リスク】

当中間計算期間において、2023年1月31日提出の有価証券報告書「第一部 ファンド情報 第1
ファンドの状況 3 投資リスク」に記載される投資リスクについて、重要な変更はない。

本投資法人が将来にわたり営業活動を継続するにあたり重要な疑義を生じさせるような事象または
状況、その他本投資法人の経営に重要な影響を及ぼす事象は、半期報告書提出日現在、存在しな
い。

3【資産運用会社の概況】

(1)【名称及び資本金の額】

UBSファンド・マネジメント(ルクセンブルグ)エス・エイ(「管理会社」)

資本金(株主資本)の額

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

(注)ユーロの円貨換算は、便宜上、2023年2月28日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1ユーロ=144.61円)による。

ユービーエス・スイス・エイ・ジー(「投資運用会社」)

資本金(株主資本)の額

2023年2月末日現在の株主資本総額は、10,000,000スイスフラン(約15億円)

(注)スイスフランの円貨換算は、便宜上、2023年2月28日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1スイスフラン=145.68円)による。

(2)【大株主の状況】

UBSファンド・マネジメント(ルクセンブルグ)エス・エイ

(2023年2月末日現在)

名称	住所	所有株式数 (株)	比率 (%)
UBSアセット・ マネジメント・エイ・ジー (UBS Asset Management AG)	バーンホフ・シュトラセ45、 CH-8001 チューリッヒ、スイス	6,500	100

ユービーエス・スイス・エイ・ジー

(2023年2月末日現在)

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

(3) 【役員の状況】

UBSファンド・マネジメント(ルクセンブルグ) エス・エイ

(2023年2月末日現在)

氏名	役職名	就任	略歴	所有株式
マイケル・ケール (Michael Kehl)	チェアマン	2022年1月1日	UBSアセット・マネジメント・スイス・エイ・ジー、チューリッヒ、スイス ヘッド・オブ・プロダクト	該当なし
フランチェスカ・ジリ・プリム (Francesca Gigli Prym)	ディレクター/ ボード・メンバー	2019年12月5日	UBSファンド・マネジメント(ルクセンブルグ) エス・エイ、ルクセンブルグ、チーフ・エグゼクティブ・オフィサー	該当なし
ウジェーヌ・デル・シオッポ (Eugène Del Cioppo)	ディレクター/ ボード・メンバー	2022年9月2日	UBSファンド・マネジメント(スイス) エイ・ジー、バーゼル、スイス チーフ・エグゼクティブ・オフィサー	該当なし
アン・シャルロット・ローヤー (Ann-Charlotte Lawyer)	インディペンデント・ディレクター/ ボード・メンバー	2022年1月1日	ルクセンブルグ大公国、 インディペンデント・ディレクター	該当なし
ミリアム・ウエベル (Miriam Uebel)	インディペンデント・ディレクター/ ボード・メンバー	2022年3月8日	UBSアセット・マネジメント(ドイツ) ゲーエムベーハー、 フランクフルト、ドイツ インスティテューショナル・クライアント・カバレッジ	該当なし

ユービーエス・スイス・エイ・ジー

(2023年2月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有ユービーエス・グループ・エイ・ジー株式 (2021年12月31日現在)
マーカス・ロナー (Markus Ronner)	チェアマン	2022年4月5日就任	非公開
ロジャー・フォン・メントレン (Roger von Mentlen)	ディレクター/ ボード・メンバー	2020年4月24日就任	非公開

バーバラ・ランバート (Barbara Lambert)	ディレクター/ ボード・メンバー	2022年4月5日就任	非公開
ダニエル・ジェイ・クリティン (Daniel J. Crittin)	ディレクター/ ボード・メンバー	2016年4月25日就任	非公開
クリスチャン・エッケハート・ブルーム (Christian Eckehard Bluhm)	ディレクター/ ボード・メンバー	2016年4月25日就任	非公開
ガブリエラ・フーバー (Gabriela Huber)	ヴァイス・ チェアマン	2015年6月12日就任	非公開

（４）【事業の内容及び営業の概況】

UBSファンド・マネジメント（ルクセンブルグ）エス・エイ

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

2023年2月末日現在、管理会社は以下のとおり、441本の投資信託／投資法人の管理・運用を行っている。

国別（設立国）	種類別（基本的性格）	本数	純資産額の合計（通貨別）
ルクセンブルグ	オープン・エンド型 投資信託／投資法人	403	466,253,095.64オーストラリア・ドル
			2,858,492,639.23カナダ・ドル
			13,732,504,469.69スイス・フラン
			5,427,007,368.01中国元
			485,019,908.93デンマーク・クローネ
			54,588,939,711.56ユーロ
			2,012,079,494.26英ポンド
			309,713,095.51香港ドル
			461,587,916,627.03日本円
			30,438,500.52シンガポール・ドル
			114,702,487,834.31米ドル
アイルランド	オープン・エンド型 投資信託／投資法人	38	1,057,958,740.71オーストラリア・ドル
			191,591,624.68スイス・フラン
			510,788,416.88ユーロ
			975,470,948.51英ポンド
			19,428,534,373日本円
			18,500,696,777.26米ドル

ユービーエス・スイス・エイ・ジー

ユービーエス・スイス・エイ・ジーは、管理会社との間で、投資運用契約を締結している。

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

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

8	UBS(Lux)Strategy Fund - Balanced Sustainable(USD)	契約型投資信託	1994年7月1日	649,679,680
9	UBS(Lux)Strategy Fund - Yield Sustainable(EUR)	契約型投資信託	1991年9月10日	617,813,599
10	Global Opportunities Access - Corporate Bonds	変動資本を有する 投資法人	2015年2月18日	609,247,424

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

4【外国投資法人の経理状況】

- a . ファンドの日本語の中間財務書類は、ルクセンブルグにおける法令に準拠して作成された原文の中間財務書類を翻訳したものである。これは「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第4項ただし書の規定の適用によるものである。
- b . ファンドの原文の中間財務書類は、マルチ・マネージャー・アクセスおよび全てのサブ・ファンドにつき一括して作成されている。日本語の作成にあたっては、関係するサブ・ファンドに関連する部分のみを翻訳している。なお、サブ・ファンドには下記のクラス投資証券以外のクラス投資証券も存在するが、本書においては下記のクラス投資証券に関する部分を抜粋して日本語に記載している。
- グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド
 - クラスF - a c c 投資証券
 - クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券
- c . ファンドの原文の中間財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。）の監査を受けていない。
- d . ファンドの原文の中間財務書類は、米ドルで表示されている。日本語の中間財務書類には、主要な金額について円貨換算が併記されている。日本円による金額は、2023年2月28日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル = 136.33円）で換算されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

（１）【資産及び負債の状況】

マルチ・マネージャー・アクセス - グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド
 純資産計算書

	2023年1月31日現在	
	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	2,516,050,843.88	343,013,212
投資有価証券、未実現評価（損）益	(200,784,404.83)	(27,372,938)
投資有価証券合計（注１）	2,315,266,439.05	315,640,274
現金預金、要求払預金および預託金勘定	65,493,680.31 *	8,928,753
その他の流動資産（委託証拠金）	5,460,859.07	744,479
投資有価証券売却未収金（注１）	8,912,751.17	1,215,075
発行未収金	528,724.18	72,081
有価証券に係る未収利息	17,215,366.37	2,346,971
前払費用	35,146.83	4,792
その他の未収金	764,118.28	104,172
金融先物に係る未実現利益（注１）	11,157,234.98	1,521,066
スワップに係る未実現利益（注１）	3,198,128.77	436,001
資産合計	2,428,032,449.01	331,013,664
負 債		
先渡為替契約に係る未実現損失（注１）	(14,910,033.68)	(2,032,685)
当座借越	(1,844,135.70)	(251,411)
投資有価証券購入未払金（注１）	(15,723,017.79)	(2,143,519)
買戻未払金	(2,431,886.72)	(331,539)
報酬引当金（注２）	(1,120,773.79)	(152,795)
年次税引当金（注３）	(78,843.62)	(10,749)
その他の手数料および報酬に係る引当金（注２）	(58,716.40)	(8,005)
引当金合計	(1,258,333.81)	(171,549)
負債合計	(36,167,407.70)	(4,930,703)
期末現在純資産	2,391,865,041.31	326,082,961

* 2023年1月31日現在、10,860.50米ドルの現金が取引相手方であるバンク・オブ・アメリカに対する担保、120,000.00米ドルの現金が取引相手方であるバンク・オブ・アメリカ・セキュリティーズ・ヨーロッパに対する担保、7,743.785.00米ドルの現金が取引相手方であるシティバンクに対する担保、3,334,173.50米ドルの現金が取引相手方であるゴールドマン・サックスに対する担保、6,168,764.00米ドルの現金が取引相手方であるJPモルガンに対する担保、110,000.00米ドルの現金が取引相手方であるモルガン・スタンレーに対する担保および8,090,000.00米ドルの現金が取引相手方であるステート・ストリートに対する担保となっている。

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド

運用計算書

自2022年8月1日 至2023年1月31日

	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	946,396.58	129,022
有価証券に係る利息	23,915,594.72	3,260,413
スワップに係る受取利息（注1）	975,540.91	132,995
貸付有価証券に係る純収益（注7）	224,339.59	30,584
収益合計	<u>26,061,871.80</u>	<u>3,553,015</u>
費 用		
スワップに係る支払利息（注1）	(476,529.73)	(64,965)
定率報酬（注2）	(6,708,971.30)	(914,634)
年次税（注3）	(114,756.62)	(15,645)
その他の手数料および報酬（注2）	(65,280.61)	(8,900)
当座借越に係る利息	(382,263.68)	(52,114)
費用合計	<u>(7,747,801.94)</u>	<u>(1,056,258)</u>
投資純（損）益	<u>18,314,069.86</u>	<u>2,496,757</u>
実現（損）益（注1）		
無オプション市場価格証券に係る実現（損）益	(67,580,052.22)	(9,213,189)
オプションに係る実現（損）益	26,760.00	3,648
利回り評価有価証券および短期金融商品に係る 実現（損）益	(1,802,983.40)	(245,801)
金融先物に係る実現（損）益	(3,746,260.26)	(510,728)
先渡為替契約に係る実現（損）益	54,299,419.77	7,402,640
スワップに係る実現（損）益	(4,744,484.82)	(646,816)
外国為替に係る実現（損）益	1,815,719.56	247,537
実現（損）益合計	<u>(21,731,881.37)</u>	<u>(2,962,707)</u>
当期実現純（損）益	<u>(3,417,811.51)</u>	<u>(465,950)</u>
未実現評価（損）益の変動（注1）		
無オプション市場価格証券に係る未実現評価（損）益	32,297,613.44	4,403,134
オプションに係る未実現評価（損）益	67,022.46	9,137
利回り評価有価証券および短期金融商品に係る 未実現評価（損）益	2,023,329.12	275,840
金融先物に係る未実現評価（損）益	25,967,982.81	3,540,215
先渡為替契約に係る未実現評価（損）益	(81,933,216.68)	(11,169,955)
スワップに係る未実現評価（損）益	2,359,097.27	321,616
未実現評価（損）益の変動合計	<u>(19,218,171.58)</u>	<u>(2,620,013)</u>
運用の結果による純資産の純増（減）	<u>(22,635,983.09)</u>	<u>(3,085,964)</u>

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド

純資産変動計算書

	自2022年8月1日 至2023年1月31日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	2,508,527,924.69	341,987,612
発行額	136,672,255.96	18,632,529
買戻額	(230,665,984.48)	(31,446,694)
純発行（買戻）合計	(93,993,728.52)	(12,814,165)
支払分配金	(33,171.77)	(4,522)
投資純（損）益	18,314,069.86	2,496,757
実現（損）益合計	(21,731,881.37)	(2,962,707)
未実現評価（損）益の変動合計	(19,218,171.58)	(2,620,013)
運用の結果による純資産の純増（減）	(22,635,983.09)	(3,085,964)
期末現在純資産	2,391,865,041.31	326,082,961

発行済投資証券数の変動表

	自2022年8月1日 至2023年1月31日	
	(口)	
クラスF - a c c		
期首現在発行済投資証券数	9,189,310.1930	
期中発行投資証券数	399,151.6410	
期中買戻投資証券数	(870,222.9130)	
期末現在発行済投資証券数	<u>8,718,238.9210</u>	
クラスF - a c c円ヘッジ		
期首現在発行済投資証券数	243,805.0000	
期中発行投資証券数	10,730.0000	
期中買戻投資証券数	(4,870.0000)	
期末現在発行済投資証券数	<u>249,665.0000</u>	

最重要数値

日付	ISIN	2023年1月31日	2022年7月31日
純資産額（米ドル）		2,391,865,041.31	2,508,527,924.69
クラスF - a c c ¹	LU2421069035		
発行済投資証券数（口）		8,718,238.9210	9,189,310.1930
1口当たり純資産価格（米ドル）		92.54	94.81
1口当たり発行・買戻価格（米ドル） ²		92.54	94.81
クラスF - a c c円ヘッジ ⁵	LU2442822453		
発行済投資証券数（口）		249,665.0000	243,805.0000
1口当たり純資産価格（日本円）		9,544	9,989
1口当たり発行・買戻価格（日本円） ²		9,544	9,989

¹ 初回純資産価格計算日：2022年3月11日

² 注記1を参照

⁵ 初回純資産価格計算日：2022年5月16日

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド

組入証券の構造

地域別分類	純資産割合%	業種別分類	純資産割合%
米国	18.35	銀行および金融機関	28.13
フランス	13.81	金融および持株会社	14.98
オランダ	10.87	国債および中央政府債	9.30
ドイツ	8.97	エネルギー・水道	9.07
スペイン	6.30	国際機関	6.67
イタリア	4.92	不動産	5.58
イギリス	4.66	公的、非営利機関	3.54
国際機関	3.83	通信	2.75
ルクセンブルグ	2.67	保険	2.59
ベルギー	1.97	交通・運輸	1.99
チリ	1.89	インターネット、ソフトウェア・ITサービス	1.12
日本	1.75	電気装置・部品	1.05
スウェーデン	1.65	自動車	1.00
アイルランド	1.49	州、連邦州	0.97
デンマーク	1.27	食品・清涼飲料	0.96
韓国	1.09	医薬品・化粧品・医療品	0.87
インドネシア	1.04	林業、紙・パルプ製品	0.68
メキシコ	0.97	各種サービス	0.68
オーストラリア	0.95	モーゲージおよび貸付機関	0.67
カナダ	0.70	電子工学・半導体	0.48
オーストリア	0.64	その他消費財	0.44
フィンランド	0.64	繊維・衣服・革製品	0.42
ポルトガル	0.61	化学	0.36
香港	0.56	石油	0.30
ペルー	0.55	機械工学・産業機器	0.29
ケイマン諸島	0.55	宿泊・仕出し・レジャー	0.26
ノルウェー	0.44	コンピュータ・ハードウェア、ネットワーク装置プロバイダー	0.21
インド	0.44	建築業・資材	0.20
フィリピン	0.41	ヘルスケア、社会事業	0.17
イスラエル	0.31	小売り・百貨店	0.17
中国	0.25	投資信託	0.17
モーリシャス	0.23	各種貿易会社	0.16
多国籍	0.18	市および地方自治体	0.16
ジャージー	0.18	環境サービスおよびリサイクル	0.15
エクアドル	0.18	グラフィックデザイン・出版・メディア	0.09
スイス	0.15	鉱業・石炭・鋼鉄	0.07
シンガポール	0.14	非分類会社	0.05
パラグアイ	0.13	ゴム・タイヤ	0.05
ハンガリー	0.13	合計	96.80
ウルグアイ	0.13		
トーゴ	0.12		
英領ヴァージン諸島	0.12		
パナマ	0.11		
グアテマラ	0.10		
スロベニア	0.08		
アンドラ	0.07		
ポーランド	0.07		
リトアニア	0.06		
ルーマニア	0.04		
コロンビア	0.02		
ガーンジー	0.01		
合計	96.80		

マルチ・マネージャー・アクセス

財務書類に対する注記

2023年1月31日現在

注1 - 重要な会計方針の要約

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

a) 純資産価格の計算

あらゆるサブ・ファンドまたは投資証券クラスの純資産価額ならびに投資証券1口当たり発行価格および買戻価格は、当該サブ・ファンドまたは投資証券クラスの基準通貨で表示され、サブ・ファンドに関連して別段の記載がない限り、各投資証券クラスに帰属するサブ・ファンドの純資産全体をサブ・ファンドの当該投資証券クラスの流通している投資証券口数で除することにより毎営業日に計算される。

この場合の「営業日」とは、ルクセンブルグの通常の銀行の営業日(すなわち、銀行が通常の営業時間に営業を行っている各日)をいい、ルクセンブルグにおける個々の法定外休業日およびサブ・ファンドが投資する主要各国の取引所の休業日またはサブ・ファンドの投資対象の50%以上を適切に評価できない日を除く。

あるサブ・ファンドの各投資証券クラスに帰属する純資産価額の割合は、当該投資証券クラスに課される手数料を織り込んだ上で、各投資証券クラスの流通投資証券口数と当該サブ・ファンドの流通投資証券の総口数との比率に従って算定され、投資証券が発行または買い戻される毎に変動する。

b) 評価原則

- 現金(手元現金または預金のいずれか)、手形、要求払約束手形および売掛金、前払費用、配当金ならびに宣言済または前述のとおり発生済で未受領の利息は、その総額として評価されるが、このような価額が全額支払われるか受領される可能性が低い場合はこの限りではなく、このような場合、その評価額は、その公正価値を反映するために適切とみなされる減額分を考慮して決定される。
- 証券取引所に上場している有価証券、派生商品およびその他の投資対象は、最新の市場価格で評価される。当該有価証券、派生商品またはその他の資産が複数の証券取引所に上場している場合は、当該投資対象の主要市場である証券取引所の最新価格を適用する。
証券取引所では通常取引されないが、証券トレーダー間で流通市場が存在し、市場に従い価格が決定される有価証券、派生商品およびその他の資産の場合、本投資法人はかかる有価証券、派生商品およびその他の投資対象を当該価格を基準に評価することができる。有価証券、派生商品およびその他の投資対象が証券取引所には上場していないが、公認かつ公開の、定期的に運営される、規制を受ける別の市場で売買されている場合、かかる市場の入手可能な最新価格で評価する。
- 証券取引所に上場されず、別の規制ある市場でも取引されず、適切な価格を入手できない有価証券およびその他の投資対象は、予想売却価格に基づいて本投資法人が誠実に選定するその他の原則に従い、本投資法人が評価する。
- 証券取引所に上場していない派生商品(「店頭派生商品」)の評価は独立した価格ソースに基づいて評価する。派生商品进行评估する独立した価格ソースが一つしかない場合、派生商品の派生元である裏付商品の市場価格に基づいて本投資法人が認める計算方法により評価の妥当性を検証する。

- 譲渡性のある証券を投資対象とする投資信託（以下「UCITS」という。）および/または投資信託（以下「UCI」という。）の受益証券または株式は、最新の入手可能な純資産価額で評価される。UCITSおよび/またはUCIの受益証券または株式の一部は、投資先の投資信託の投資マネージャーまたは投資アドバイザーから独立した立場にある信頼に値する価格提供会社によって提供される見積評価額に基づき評価されることがある（見積評価額）。
- 短期金融商品は、取得価格（純額）および確定した利回りに基づき評価されるが、このような評価額が買戻価格に応じて次第に調整されることを条件とする。市況が大幅に変化する場合、異なる投資対象の評価額の基準を、新しい市場利回りに沿うように調整する。
- 関係するサブ・ファンドの基準通貨以外の通貨で表示され、通貨取引によるヘッジを行わない有価証券、短期金融商品、派生商品およびその他の投資対象は、ルクセンブルグにおける為替相場の仲値（売買価格の仲値）またはこれが提供されない場合には当該通貨を最も代表する市場における為替相場の仲値で評価する。
- 定期預金および信託預金はその額面に経過利息を加えて評価する。
- スワップの価値は、外部のサービス提供会社が計算し、別の外部サービス提供会社が二次的な独立の評価を提供する。計算はすべてのキャッシュフロー（流入と流出の双方）の時価（純額）を基準とする。特定の場合に、（ブルームバーグから提供されたモデルと市場データに基づく）内部計算および/またはブローカーが算出する評価を利用することができる。評価方法は、それぞれの証券に依拠し、UBSの評価方針に基づき決定される。

異常な状況により、上記の規則に基づく評価が実行不可能または不正確であることが判明する場合、本投資法人は、純資産価額を適正に評価するために誠実に選ばれる、一般に認められ、かつ監査可能なその他の評価基準を適用する権限を有する。

異常な状況の場合、評価日の当日のうちに追加の評価を行うことができ、その後の発行および買戻しにかかる新評価を反映する。

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

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

(a) サブ・ファンドが継続的に下落している場合（すなわち買戻しによる純流出）。

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

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

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

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

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

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

c) 先渡為替契約の評価

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

d) 金融先物契約の評価

金融先物契約は、評価日に適用される直近の入手可能な公表価格に基づいて評価される。実現損益および未実現損益の変動は、運用計算書に記帳される。実現損益は、先入先出法に従って計算される。すなわち、最初の取得契約が最初に売却されるものと考えられる。

e) 証券売買実現純(損)益

証券売買実現損益は、売却証券の平均原価に基づいて計算される。

f) 外貨換算

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

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

g) 組入証券取引の会計処理

組入証券取引は、取引日の翌銀行営業日に会計処理される。

h) 結合財務書類

結合財務書類は、ユーロで表示される。本投資法人の2023年1月31日現在の結合純資産計算書、結合運用計算書および結合純資産変動計算書の各種科目は、各サブ・ファンドの財務書類の対応する科目の合計に等しい。

以下の為替レートが、2023年1月31日現在の結合財務書類の換算に用いられた。

$$\begin{array}{l} \text{為替レート} \\ \hline 1 \text{ ユーロ} = 1.086050 \text{ 米ドル} \end{array}$$

i) 有価証券売却未収金、有価証券購入未払金

「有価証券売却未収金」のポジションには、外貨取引による未収金が含まれる。また「有価証券購入未払金」のポジションには、外貨取引による未払金が含まれる。

外国為替取引からの未収金および未払金は相殺される。

j) 収益の認識

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

k) スワップ

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

未実現(損)益の変動は、運用計算書において「スワップに係る未実現評価(損)益」として反映されている。未実現(損)益は、未払または未収の経過利息を含む。

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

注2 - 報酬および費用

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

マルチ・マネージャー・アクセス	上限定率報酬（年率）
- グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド F - a c c	0.90%
- グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド F - a c c	0.90%
円ヘッジ	

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

- 保管受託銀行の報酬、コストおよび費用。
- 管理事務代行会社の報酬、コストおよび費用。
- 管理会社の報酬、コストおよび費用。
- 投資運用会社および為替マネージャーの報酬、コストおよび費用。
- ポートフォリオ・マネージャーおよびその委託先（複数の場合あり）の固定報酬、コストおよび費用（一切のパフォーマンス報酬は除く。）。
- 本投資法人の投資証券に関する販売活動における報酬、コストおよび費用。（外国の管轄当局に対して本投資法人の登録を維持するために発生するコストおよび報酬を含む。）

特定のポートフォリオ・マネージャーは、ポートフォリオ・マネージャーおよび/またはその関連会社の名義で設立され、その管理下にあり、ブローカーまたはその他の第三者のリサーチ機関から投資リサーチ・サービスを購入する目的で使用される、リサーチ支払口座（以下「リサーチ支払口座」という。）を開設し維持する権限を有している。リサーチ支払口座は、リサーチ・チャージによって資金を調達し、その資産から支払われる。リサーチ・チャージは、ポートフォリオ・マネージャーと管理会社の間で毎年書面により合意される、リサーチ予算を参照して算出された年間最大限度額に従うものとする。投資主は、その請求により、管理会社から、リサーチ予算の額およびリサーチ費用の概算額に関する情報を入手することができる。

本投資法人の運用費用および管理事務費用

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

- 本投資法人の資産および所得に賦課される可能性があるすべての租税（適用ある年次税を含む。）
- 本投資法人のポートフォリオに組み込まれた有価証券その他の資産（派生商品を含む。）に関する取引に課される通常の銀行手数料（かかる手数料は、取得価格に加算され、売却価格からは減額される。）
- 本投資法人が適正に負担する手数料、費用およびあらゆる合理的な立替費用
- 投資主の利益のために行為するに際し本投資法人、管理会社、投資運用会社またはポートフォリオ・マネージャーが負担する法務手数料および費用（疑義を避けるために付言すると、本投資法人またはそのいずれかのサブ・ファンドの組織再編に関する一切の法務手数料および費用を含む。）

- 年次報告書および半期報告書ならびに適用ある法令に基づき必要なその他の報告書および文書を投資主（投資証券の実質的保有者を含む。）の利益に適う言語において作成し配布（印刷は含まない。）するためのコスト
- 投資主に対する通知作成コストおよび本投資法人の資産管理に関するあらゆる取引コスト（ブローカーの通常の手数料、報酬、租税等）
- ルクセンブルグ内外における本投資法人の承認および監督に関する手数料およびコスト
- 定款、英文販売目論見書、KIIDならびに年次報告書および半期報告書の印刷コストおよび費用、ならびに、定款および本投資法人に関するその他の一切の文書（本投資法人または本投資法人の投資証券募集について管轄権を有するあらゆる機関（各国の証券業協会を含む。）に対する登録届出書、目論見書および説明覚書等）を必要な言語によって作成および/または提出し、印刷するコストおよび費用
- 純資産価額の公表および投資者に対する通知の公告に関連するコストおよび費用
- 証券取引所または規制ある市場への本投資法人の投資証券の上場に関連して請求される手数料および費用
- 投資主への配当金支払における手数料およびその他のコスト
- 監査における手数料、コストおよび費用（監査人の報酬および費用を含む。）
- KIIDの作成、翻訳および監督機関への提出に関する手数料および費用
- 取締役会に支払われる報酬、コストおよび費用（取締役会に関係する合理的な立替費用、保険補償および合理的な旅行費用ならびに取締役会の報酬を含む。）
- 登録、報告、救済請求、回収または外国源泉徴収税の免除に関連して、サブ・ファンドに課される可能性のある手数料、コストおよび費用。

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

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

各々の投資方針に従い、他のUCIまたはUCITSに投資するサブ・ファンドにおいて、手数料が、サブ・ファンドのレベルおよび関連する投資先の投資信託で発生する可能性がある。運用資産を投資する投資先の投資信託の運用報酬の上限は、あらゆる助言報酬を考慮し、3%を上限とする。投資運用会社自身または投資運用会社に関連するその他の会社が直接的または間接的に、または実質的に直接もしくは間接的に保有により運用するファンドの受益証券に投資する場合、投資を行うサブ・ファンドは、投資先投資信託の発行または買戻し手数料の一切を課せられないことがある。

サブ・ファンドの継続費用の詳細は、KIIDで確認することができる。

新しいサブ・ファンドの設定に伴う費用は、該当するサブ・ファンドのみにおいて最大5年間の期間にわたり償却される。

本投資法人の投資証券の販売業務に関連して、投資運用会社が受領し販売会社に支払われる料金、費用および経費、ならびに販売会社が受領し副販売会社および本投資法人の投資証券の販売に関連する仲介業者に支払われる料金、費用および経費は、かかる費用の受領および保有に適用ある法的小および規制上の制限および条件に適合するものとする。適用ある法的小および規制上の制限および条件に従い、販売会社は本投資法人の販売業務を対象として還付金を支払うことができる。

注3 - 年次税

本投資法人は、現在施行されている法律及び規則に従い、四半期ごとに支払われ、各四半期末における本投資法人の純資産に基づいて計算される年率0.05%が課せられ、特定の投資証券クラスに対しては年率0.01%の軽減された「年次税」が課される。

「年次税」は、ルクセンブルク法の法規定に従って既に「年次税」を支払っている他の投資信託の受益証券または投資証券に投資している純資産部分に対して免除される。

注4 - 分配方針

各サブ・ファンドの投資主総会は、本投資法人の取締役会の提案に従い、かつ各サブ・ファンドの年次決算後に、各サブ・ファンドまたは投資証券クラスが分配金を支払うか否か、またどの程度の特別分配金を支払うかを決定する。分配金の支払いの結果として、本投資法人の純資産が法律に定める最低資産額を下回ってはならない。分配を行う場合、会計年度が終了してから4か月以内に支払いを行うものとする。

取締役会は、中間配当を支払う権限および分配金の支払いを中止する権限を有する。

注5 - 金融先物およびスワップ契約

2023年1月31日現在、サブ・ファンドごとの金融先物およびスワップ契約ならびに関連する通貨は、以下のように要約される。

a) 金融先物

マルチ・マネージャー・アクセス	債券に係る金融先物 (購入)	債券に係る金融先物 (売却)
- グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド	329,106,256.37米ドル	389,887,165.79米ドル
マルチ・マネージャー・アクセス	指数に係る金融先物 (購入)	指数に係る金融先物 (売却)
- 該当なし		

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

b) スワップ

マルチ・マネージャー・アクセス	クレジット・デフォルト・スワップ (購入)	クレジット・デフォルト・スワップ (売却)
- グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド	- 米ドル	16,584,472.72米ドル

マルチ・マネージャー・アクセス	金利に係るスワップおよび フォワード・スワップ (購入)	金利に係るスワップおよび フォワード・スワップ (売却)
- グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド	32,700,000.00米ドル	19,893,015.00米ドル

注6 - 適用法、業務地および公認言語

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

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

注7 - 貸付有価証券

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

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

貸付有価証券

マルチ・マネージャー・アクセス	2023年1月31日現在の貸付有価証券からの取引相手方エクスポージャー*		2023年1月31日現在の担保の内訳(%)		
	貸付有価証券の時価	担保 (ユービーエス・スイス・エイ・ジー)	株式	債券	現金
- グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド	494,498,960.96 米ドル	527,818,530.81 米ドル	20.20	79.80	0.00

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

	マルチ・マネージャー・アクセス - グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド (米ドル)
貸付証券収益	373,899.32
貸付証券コスト [*]	
ユービーエス・スイス・エイ・ジー	112,169.80米ドル
U B S ヨーロッパ S E ルクセンブルグ支店	37,389.93米ドル
純貸付証券収益	224,339.59米ドル

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

(2) 【投資有価証券明細表等】

マルチ・マネージャー・アクセス - グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)	
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品				
財務省証券(T-bill)、ゼロ・クーポン				
EUR				
EUR	EUROPEAN STABILITY MECHANISM TB 0.00000% 05.01.23-06.04.23	1 480 000.00	1 600 699.55	0.06
EUR	FRANCE, REPUBLIC OF-BTF-REG-S TB 0.00000% 23.11.22-04.05.23	5 270 000.00	5 690 614.68	0.24
ユーロ合計			7 291 314.23	0.30
財務省証券(T-bill)、ゼロ・クーポン合計			7 291 314.23	0.30
ノート、固定利付債				
EUR				
EUR	ACCOR SA-REG-S 2.37500% 21-29.11.28	200 000.00	190 217.75	0.01
EUR	ACEF HOLDING SCA-REG-S 1.25000% 21-26.04.30	1 800 000.00	1 411 301.55	0.06
EUR	ACHMEA BV-REG-S 3.62500% 22-29.11.25	1 500 000.00	1 624 064.29	0.07
EUR	AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT-REG-S 2.87500% 23-21.01.30	4 000 000.00	4 289 602.09	0.18
EUR	AMPRIION GMBH-REG-S 3.45000% 22-22.09.27	1 700 000.00	1 833 261.30	0.08
EUR	AMPRIION GMBH-REG-S 3.97100% 22-22.09.32	300 000.00	327 170.39	0.01
EUR	BANQUE OUEST AFRICAINE DE DEV-REG-S 2.75000% 21-22.01.33	3 500 000.00	2 925 384.28	0.12
EUR	BERTELSMANN SE & CO KGAA-REG-S 3.50000% 22-29.05.29	1 500 000.00	1 619 180.00	0.07
EUR	CAPGEMINI SE-REG-S 1.12500% 20-23.06.30	2 000 000.00	1 849 226.02	0.08
EUR	CASSA DEPOSITI E PRESTITI SPA-REG-S 1.00000% 20-21.09.28	3 800 000.00	3 504 722.45	0.15
EUR	CBRE GLOBAL INVESTORS OPEN-ENDED-REG-S 0.50000% 21-27.01.28	800 000.00	678 781.25	0.03
EUR	CBRE GLOBAL INVESTORS OPEN-ENDED-REG-S 0.90000% 21-12.10.29	3 000 000.00	2 397 991.89	0.10
EUR	CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.30000% 21-26.07.36	4 550 000.00	3 545 545.98	0.15
EUR	CHILE, REPUBLIC OF 0.55500% 21-21.01.29	6 200 000.00	5 573 242.06	0.23
EUR	CIE GEN ETABLISSEMENTS MICHELIN-REG-S 0.62500% 20-02.11.40	1 600 000.00	1 100 159.96	0.05
EUR	COFINIMMO SA-REG-S 0.87500% 20-02.12.30	3 200 000.00	2 592 618.56	0.11
EUR	COVIVIO-REG-S 1.12500% 19-17.09.31	4 900 000.00	4 361 449.95	0.18
EUR	DIGITAL DUTCH FINCO BV-REG-S 0.62500% 20-15.07.25	2 000 000.00	1 971 967.05	0.08
EUR	DIGITAL DUTCH FINCO BV-REG-S 1.50000% 20-15.03.30	2 000 000.00	1 773 845.46	0.07
EUR	DIGITAL DUTCH FINCO BV-REG-S 1.00000% 20-15.01.32	600 000.00	483 406.50	0.02
EUR	DIGITAL EURO FINCO LLC-REG-S 1.12500% 19-09.04.28	3 000 000.00	2 736 422.44	0.11
EUR	EQT AB-REG-S 2.37500% 22-06.04.28	2 000 000.00	1 935 653.89	0.08
EUR	EQT AB-REG-S 2.87500% 22-06.04.32	2 000 000.00	1 802 820.36	0.08
EUR	ESSITY AB-REG-S 0.50000% 20-03.02.30	3 500 000.00	3 056 425.99	0.13
EUR	FAURECIA-REG-S 2.75000% 21-15.02.27	1 200 000.00	1 153 645.75	0.05
EUR	GIVAUDAN FINANCE EUROPE BV-REG-S 1.62500% 20-22.04.32	1 000 000.00	924 728.14	0.04
EUR	HUNGARY, REPUBLIC OF-REG-S 1.75000% 20-05.06.35	4 000 000.00	3 089 269.23	0.13
EUR	ICADE SANTE SAS-REG-S 1.37500% 20-17.09.30	10 300 000.00	9 050 527.54	0.38
EUR	ICADE-REG-S 0.62500% 21-18.01.31	4 100 000.00	3 306 181.00	0.14
EUR	INDONESIA, REPUBLIC OF 1.30000% 21-23.03.34	9 200 000.00	7 339 498.76	0.31
EUR	KELLOGG CO 0.50000% 21-20.05.29	2 800 000.00	2 545 570.87	0.11
EUR	KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU-REG-S 2.00000% 22-15.11.29	3 900 000.00	4 035 011.27	0.17
EUR	L'OREAL SA-REG-S 0.87500% 22-29.06.26	700 000.00	711 572.36	0.03
EUR	MADRID, COMUNIDAD DE-REG-S 1.72300% 22-30.04.32	4 000 000.00	3 740 165.05	0.16
EUR	MADRID, COMUNIDAD DE-REG-S 2.82200% 22-31.10.29	2 000 000.00	2 110 225.55	0.09
EUR	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA-REG-S 1.87500% 19-04.12.34	3 800 000.00	2 997 721.72	0.12
EUR	MEXICO, UNITED STATES OF 1.35000% 20-18.09.27	6 200 000.00	6 099 297.52	0.25
EUR	MEXICO, UNITED STATES OF 2.25000% 21-12.08.36	10 150 000.00	8 005 749.69	0.33
EUR	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GRP INC-REG-S 0.84800% 19-19.07.29	4 900 000.00	4 487 439.88	0.19
EUR	MONDELEZ INTERNATIONAL HOLDINGS N-REG-S 1.25000% 21-09.09.41	600 000.00	431 309.99	0.02
EUR	NEMAK SAB DE CV-REG-S 2.25000% 21-20.07.28	200 000.00	177 406.27	0.01

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)	
EUR	NETFLIX INC-REG-S 3.87500% 19-15.11.29	3 200 000.00	3 392 298.90	0.14
EUR	NEXI SPA-REG-S 1.62500% 21-30.04.26	160 000.00	155 442.43	0.01
EUR	NORDIC INVESTMENT BANK-REG-S 2.50000% 23-30.01.30	2 100 000.00	2 234 511.60	0.09
EUR	PERU, REPUBLIC OF 1.95000% 21-17.11.36	4 100 000.00	3 160 934.95	0.13
EUR	POSTNL NV 0.62500% 19-23.09.26	4 300 000.00	4 174 647.83	0.17
EUR	PROLOGIS EURO FINANCE LLC 0.37500% 20-06.02.28	800 000.00	732 227.07	0.03
EUR	REXEL SA-REG-S 2.12500% 21-15.12.28	1 600 000.00	1 489 834.70	0.06
EUR	SIG COMBIBLOC PURCHASECO SARL-REG-S 1.87500% 20-18.06.23	400 000.00	431 179.23	0.02
EUR	TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 1.37500% 20-09.07.32	3 800 000.00	3 336 073.42	0.14
EUR	TERNA RETE ELETTRICA NAZIONALE-REG-S 0.75000% 20-24.07.32	4 900 000.00	4 110 278.95	0.17
EUR	TRITAX EUROBOX PLC-REG-S 0.95000% 21-02.06.26	900 000.00	807 111.53	0.03
EUR	VERBUND AG 0.90000% 21-01.04.41	3 000 000.00	2 174 580.54	0.09
EUR	VF CORP 0.25000% 20-25.02.28	8 400 000.00	7 660 888.10	0.32
EUR	VONOVIA SE-REG-S 1.87500% 22-28.06.28	10 000 000.00	9 644 471.53	0.40
EUR	VONOVIA SE-REG-S 2.37500% 22-25.03.32	3 000 000.00	2 738 546.75	0.11
EUR	WABTEC TRANSPORTATION NETHERLANDS BV 1.25000% 21-03.12.27	3 100 000.00	2 915 461.69	0.12
ユーロ合計			162 948 271.27	6.81
GBP	BURBERRY GROUP PLC-REG-S 1.12500% 20-21.09.25	2 200 000.00	2 481 281.06	0.10
GBP	MARKS & SPENCER FINANCE PLC-REG-S 3.25000% 19-10.07.27	200 000.00	225 225.81	0.01
GBP	PEARSON FUNDING PLC-REG-S 3.75000% 20-04.06.30	200 000.00	225 781.98	0.01
GBP	WORKSPACE GROUP PLC-REG-S 2.25000% 21-11.03.28	1 200 000.00	1 141 731.99	0.05
英ボンド合計			4 074 020.84	0.17
USD	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC 2.00000% 21-18.05.32	9 800 000.00	7 813 672.88	0.33
USD	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC 2.95000% 22-15.03.34	5 000 000.00	4 220 400.50	0.18
USD	ALIBABA GROUP HOLDING LTD 2.70000% 21-09.02.41	1 300 000.00	897 858.00	0.04
USD	ALPHABET INC 1.10000% 20-15.08.30	10 700 000.00	8 687 038.53	0.36
USD	AMGEN INC 3.00000% 22-22.02.29	2 500 000.00	2 295 722.45	0.10
USD	APPLE INC 3.00000% 17-20.06.27	1 300 000.00	1 246 025.97	0.05
USD	APTIV PLC 3.25000% 22-01.03.32	4 900 000.00	4 230 277.36	0.18
USD	ARCOS DORADOS BV-REG-S 6.12500% 22-27.05.29	1 150 000.00	1 127 000.00	0.05
USD	ASTRAZENECA PLC 1.37500% 20-06.08.30	3 400 000.00	2 790 855.94	0.12
USD	AVALONBAY COMMUNITIES INC 1.90000% 21-01.12.28	1 400 000.00	1 205 748.97	0.05
USD	AVANGRID INC 3.15000% 17-01.12.24	500 000.00	482 919.39	0.02
USD	AVANGRID INC 3.20000% 20-15.04.25	5 000 000.00	4 807 683.05	0.20
USD	AVANGRID INC 3.80000% 19-01.06.29	2 800 000.00	2 634 681.03	0.11
USD	BANCOLOMBIA SA 3.00000% 20-29.01.25	500 000.00	472 593.75	0.02
USD	BOSTON PROPERTIES LP 2.55000% 21-01.04.32	9 700 000.00	7 656 592.28	0.32
USD	BOSTON PROPERTIES LP 2.45000% 21-01.10.33	1 500 000.00	1 143 175.65	0.05
USD	BROOKFIELD FINANCE INC 2.72400% 21-15.04.31	1 100 000.00	926 430.54	0.04
USD	BROOKFIELD FINANCE I UK PLC 2.34000% 21-30.01.32	1 500 000.00	1 213 350.03	0.05
USD	CAISSE D' AMORTISSEMENT DE LA DETTE-144A-1.37500% 21-20.01.31	16 400 000.00	13 707 339.59	0.57
USD	CBRE SERVICES INC 2.50000% 21-01.04.31	300 000.00	251 883.41	0.01
USD	CELULOSA ARAUCO Y CONSTITUCION SA-REG-S 4.20000% 19-29.01.30	4 700 000.00	4 386 568.75	0.18
USD	CHILE, REPUBLIC OF 2.55000% 20-27.01.32	11 600 000.00	9 796 925.00	0.41
USD	CHILE, REPUBLIC OF 3.10000% 21-07.05.41	9 900 000.00	7 473 262.50	0.31
USD	CIGNA CORP 4.37500% 19-15.10.28	4 100 000.00	4 065 983.16	0.17
USD	COCA-COLA FEMSA 1.85000% 20-01.09.32	8 100 000.00	6 402 361.50	0.27
USD	CONAGRA BRANDS INC 1.37500% 20-01.11.27	2 600 000.00	2 225 313.79	0.09
USD	CONSORCIO TRANSMANTARO-REG-S 4.70000% 19-16.04.34	4 650 000.00	4 319 268.75	0.18
USD	CSX CORP 3.35000% 19-15.09.49	3 800 000.00	2 933 503.18	0.12
USD	DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 1.68600% 21-19.03.26	3 500 000.00	3 194 003.82	0.13
USD	DEVELOPMENT BANK OF JAPAN-144A 1.75000% 22-18.02.25	4 800 000.00	4 546 272.00	0.19
USD	DOMINION ENERGY INC 2.25000% 21-15.08.31	10 100 000.00	8 382 856.48	0.35
USD	EATON CORP 4.15000% 22-15.03.33	1 000 000.00	967 057.75	0.04

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD ECOLAB INC 2.12500% 21-01.02.32	3 800 000.00	3 173 023.37	0.13
USD ECUADOR GOVT INTERNATIONAL BD-REG-S STEP-UP/DOWN 20-31.07.35	8 700 000.00	4 223 850.00	0.18
USD EQUINIX INC 1.55000% 20-15.03.28	400 000.00	340 733.65	0.01
USD EQUINIX INC 2.50000% 21-15.05.31	5 100 000.00	4 261 874.97	0.18
USD EQUINIX INC 3.90000% 22-15.04.32	3 600 000.00	3 310 168.47	0.14
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.87500% 20-17.05.30	10 700 000.00	8 827 928.00	0.37
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 5.12500% 23-11.01.33	2 450 000.00	2 567 600.00	0.11
USD FIBRIA OVERSEAS FINANCE LTD 5.50000% 17-17.01.27	2 883 000.00	2 888 045.25	0.12
USD FORD MOTOR CO 3.25000% 21-12.02.32	250 000.00	198 416.77	0.01
USD GENERAL MOTORS CO 5.40000% 22-15.10.29	1 975 000.00	1 962 049.79	0.08
USD GENERAL MOTORS CO 5.60000% 22-15.10.32	5 000 000.00	4 939 526.40	0.21
USD GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 5.37500% 20-24.04.32	2 500 000.00	2 439 531.24	0.10
USD HANWHA ENERGY USA HOLDINGS CORP-144A 4.12500% 22-05.07.25	4 000 000.00	3 890 750.00	0.16
USD HEALTHPEAK PROPERTIES 2.12500% 21-01.12.28	3 200 000.00	2 777 319.84	0.12
USD HOME DEPOT INC/THE 4.20000% 13-01.04.43	4 100 000.00	3 821 057.36	0.16
USD HONDA MOTOR CO LTD 2.27100% 22-10.03.25	700 000.00	665 741.37	0.03
USD HOST HOTELS & RESORTS LP 3.50000% 20-15.09.30	1 000 000.00	855 352.85	0.04
USD HOST HOTELS & RESORTS LP 2.90000% 21-15.12.31	3 900 000.00	3 108 393.36	0.13
USD HUMANA INC 4.87500% 20-01.04.30	4 100 000.00	4 121 473.83	0.17
USD INDIA GREEN POWER HOLDINGS-144A 4.00000% 21-22.02.27	250 000.00	127 950.00	0.01
USD INDIA GREEN POWER HOLDINGS-REG-S 4.00000% 21-22.02.27	3 800 000.00	3 313 410.00	0.14
USD INTERNATIONAL BK FOR RECONSTR & DEVE 0.12500% 21-20.04.23	600 000.00	594 046.24	0.02
USD INTERNATIONAL BK FOR RECONSTR & DEVELOP 1.62500% 21-03.11.31	2 000 000.00	1 690 301.20	0.07
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 3.62500% 22-21.09.29	2 800 000.00	2 788 443.98	0.12
USD INVERSIONES CMPC SA-REG-S 4.37500% 17-04.04.27	12 082 000.00	11 736 907.87	0.49
USD JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC 1.75000% 20-15.09.30	10 500 000.00	8 695 167.81	0.36
USD JSW HYDRO ENERGY LTD-REG-S 4.12500% 21-18.05.31	1 000 000.00	750 756.56	0.03
USD KB KOOKMIN CRD CO LTD-REG-S 4.00000% 22-09.06.25	1 100 000.00	1 059 861.00	0.04
USD KELLOGG CO 3.40000% 17-15.11.27	1 600 000.00	1 529 087.89	0.06
USD KEYBANK NA/CLEVELAND OH-SUB 3.40000% 16-20.05.26	4 100 000.00	3 895 425.21	0.16
USD KILROY REALTY LP 2.65000% 21-15.11.33	900 000.00	650 130.75	0.03
USD KIMCO REALTY CORP 2.70000% 20-01.10.30	600 000.00	509 902.77	0.02
USD KLABIN AUSTRIA GMBH-REG-S 3.20000% 21-12.01.31	200 000.00	163 000.00	0.01
USD KOREA EXCHANGE BANK-144A 3.25000% 22-30.03.27	4 800 000.00	4 511 400.00	0.19
USD KOREA WATER RESOURCES CORP-REG-S 3.50000% 22-27.04.25	2 200 000.00	2 128 148.00	0.09
USD KRAFT HEINZ FOODS CO 4.62500% 18-30.01.29	200 000.00	200 830.38	0.01
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 1.75000% 19-14.09.29	14 300 000.00	12 687 514.41	0.53
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 1.00000% 21-01.10.26	6 000 000.00	5 414 528.16	0.23
USD LENOVO GROUP LTD-REG-S 3.42100% 20-02.11.30	2 600 000.00	2 198 300.00	0.09
USD MANULIFE FINANCIAL CORP 3.70300% 22-16.03.32	10 300 000.00	9 525 083.00	0.40
USD MERCADOLIBRE INC 2.37500% 21-14.01.26	250 000.00	224 687.50	0.01
USD MERCK & CO INC 1.90000% 21-10.12.28	3 900 000.00	3 441 985.75	0.14
USD MEXICO, UNITED STATES OF 4.87500% 22-19.05.33	2 000 000.00	1 920 000.00	0.08
USD MICRON TECHNOLOGY INC 2.70300% 21-15.04.32	6 900 000.00	5 506 657.47	0.23
USD MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 2.52700% 16-13.09.23	2 200 000.00	2 167 340.12	0.09
USD MOODY 'S CORP 2.55000% 20-18.08.60	150 000.00	89 015.20	0.00
USD NAVER CORP-REG-S 1.50000% 21-29.03.26	1 600 000.00	1 424 800.00	0.06
USD NOKIA OYJ 4.37500% 17-12.06.27	1 900 000.00	1 824 000.00	0.08
USD NSTAR ELECTRIC CO 3.25000% 19-15.05.29	1 800 000.00	1 676 426.04	0.07
USD NTT FINANCE CORP-144A 4.14200% 22-26.07.24	2 300 000.00	2 283 566.04	0.10
USD NUCOR CORP 3.95000% 22-23.05.25	1 600 000.00	1 576 882.45	0.07
USD ONEMAIN FINANCE CORP 3.50000% 21-15.01.27	2 500 000.00	2 174 290.35	0.09
USD OWENS CORNING 3.87500% 20-01.06.30	500 000.00	470 489.62	0.02
USD OWENS CORNING 3.95000% 19-15.08.29	800 000.00	758 515.79	0.03
USD PARAGUAY, REPUBLIC OF-REG-S 5.40000% 19-30.03.50	3 550 000.00	3 160 165.63	0.13
USD PEIDMONT OPERATING PARTNERSHIP LP 3.15000% 20-15.08.30	400 000.00	314 355.01	0.01
USD PEPSICO INC 2.87500% 19-15.10.49	6 850 000.00	5 265 955.17	0.22
USD PERU, REPUBLIC OF 3.00000% 21-15.01.34	7 000 000.00	5 671 312.50	0.24

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD PERUSAHAAN SBSN INDONESIA III-REG-S 4.70000% 22-06.06.32	2 106 000.00	2 106 231.66	0.09
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 5.50000% 23-17.01.48	3 500 000.00	3 627 260.00	0.15
USD PNC FINANCIAL SERVICES GROUP 2.20000% 19-01.11.24	2 600 000.00	2 501 946.80	0.10
USD PROCTER & GAMBLE CO 3.55000% 20-25.03.40	3 800 000.00	3 448 558.56	0.14
USD PROLOGIS LP 1.25000% 20-15.10.30	4 800 000.00	3 792 075.93	0.16
USD PROLOGIS LP 2.12500% 20-15.04.27	4 100 000.00	3 757 985.63	0.16
USD RABOBANK NEDERLAND NV-REG-S 1.00400% 20-24.09.26	6 200 000.00	5 532 294.16	0.23
USD RAYONIER LP 2.75000% 21-17.05.31	100 000.00	83 076.63	0.00
USD RENEW WIND ENER AP2 / RENEW POWER-REG-S 4.50000% 21-14.07.28	200 000.00	168 750.00	0.01
USD RENEW WIND ENERGY AP2 / RENEW POWE-144A 4.50000% 21-14.07.28	250 000.00	210 937.50	0.01
USD ROYALTY PHARMA PLC 2.12500% 21-02.09.31	2 900 000.00	2 304 828.45	0.10
USD SALESFORCE.COM INC 1.50000% 21-15.07.28	8 300 000.00	7 243 102.16	0.30
USD SK BATTERY AMERICA INC-REG-S 2.12500% 21-26.01.26	1 640 000.00	1 427 620.00	0.06
USD SK HYNIX INC-144A 2.37500% 21-19.01.31	1 900 000.00	1 431 887.50	0.06
USD SK HYNIX INC-144A 6.37500% 23-17.01.28	1 700 000.00	1 721 590.00	0.07
USD SK HYNIX INC-REG-S 6.50000% 23-17.01.33	1 000 000.00	1 010 740.00	0.04
USD SOUTHWESTERN ELECTRIC POWER 3.25000% 21-01.11.51	1 700 000.00	1 203 743.04	0.05
USD STAR ENERGY GEOTHERMAL WAYANG-REG-S 6.75000% 18-24.04.33	1 000 000.00	788 655.03	0.03
USD STARBUCKS CORP 4.45000% 19-15.08.49	2 000 000.00	1 827 744.02	0.08
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 2.47200% 22-14.01.29	3 500 000.00	3 046 725.15	0.13
USD SUZANO AUSTRIA GMBH 3.12500% 19-15.01.32	900 000.00	715 500.00	0.03
USD SUZANO AUSTRIA GMBH-REG-S 5.75000% 16-14.07.26	4 750 000.00	4 783 546.87	0.20
USD SYSCO CORP 2.40000% 20-15.02.30	4 500 000.00	3 901 038.84	0.16
USD T-MOBILE USA INC 3.30000% 21-15.02.51	2 150 000.00	1 547 912.50	0.06
USD TELEFONICA EMISIONES SA 4.10300% 17-08.03.27	2 900 000.00	2 814 271.01	0.12
USD TELUS CORP 3.40000% 22-13.05.32	2 800 000.00	2 482 985.15	0.10
USD TOYOTA MOTOR CORP 2.36200% 21-25.03.31	4 500 000.00	3 896 050.50	0.16
USD URUGUAY, REPUBLIC OF 5.75000% 22-28.10.34	2 760 000.00	3 059 460.00	0.13
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.87500% 19-08.02.29	3 000 000.00	2 887 866.63	0.12
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 1.50000% 20-18.09.30	11 600 000.00	9 377 227.94	0.39
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.85000% 21-03.09.41	11 250 000.00	8 330 230.46	0.35
USD VISA INC 0.75000% 20-15.08.27	5 900 000.00	5 150 295.55	0.22
USD VMWARE INC 1.80000% 21-15.08.28	1 400 000.00	1 180 480.42	0.05
USD WASTE MANAGEMENT INC 1.15000% 20-15.03.28	4 100 000.00	3 501 485.12	0.15
USD WELLTOWER INC 2.70000% 19-15.02.27	3 000 000.00	2 751 106.65	0.11
USD WELLTOWER OP LLC 3.85000% 22-15.06.32	1 500 000.00	1 344 835.75	0.06
USD WHIRLPOOL CORP 2.40000% 21-15.05.31	4 000 000.00	3 316 240.36	0.14
USD WISCONSIN PUBLIC SERVICE CORP 2.85000% 21-01.12.51	800 000.00	554 913.67	0.02
USD XYLEM INC/NY 1.95000% 20-30.01.28	3 200 000.00	2 830 411.07	0.12
USD XYLEM INC/NY 2.25000% 20-30.01.31	4 300 000.00	3 610 306.45	0.15
USD YANLORD LAND HK CO LTD-REG-S 5.12500% 21-20.05.26	200 000.00	182 000.00	0.01
米ドル合計		414 542 019.55	17.33
ノート、固定利付債合計		581 564 311.66	24.31
ノート、ゼロ・クーポン			
EUR			
EUR APPLE INC 0.00000% 19-15.11.25	1 600 000.00	1 603 482.45	0.07
EUR KOREA INTERNATIONAL BOND 0.00000% 22-15.10.26	3 200 000.00	3 065 484.73	0.13
ユーロ合計		4 668 967.18	0.20
ノート、ゼロ・クーポン合計		4 668 967.18	0.20

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
ノート、変動利付債			
EUR			
EUR	AIB GROUP PLC-REG-S 5.750%/VAR 22-16.02.29	5 868 000.00	0.28
EUR	AUSTRALIA & NZ BANKING GRP-REG-S-SUB 1.125%/VAR 19-21.11.29	7 100 000.00	0.30
EUR	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENT-REG-S-SUB 6.000%/VAR 20-PRP	4 000 000.00	0.18
EUR	BANK OF IRELAND GROUP PLC-REG-S 4.875%/VAR 23-16.07.28	550 000.00	0.02
EUR	CNP ASSURANCES-REG-S-SUB 2.000%/VAR 19-27.07.50	8 500 000.00	0.32
EUR	DE VOLKSBANK NV-REG-S-SUB 7.000%/VAR 22-PRP	3 000 000.00	0.13
EUR	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA-REG-S-SUB 4.496%/VAR 19-30.04.79	4 500 000.00	0.20
EUR	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA-REG-S-SUB 1.700%/VAR 20-20.07.80	5 400 000.00	0.22
EUR	ING GROEP NV-REG-S 2.125%/VAR 22-23.05.26	6 300 000.00	0.27
EUR	ING GROEP NV-REG-S-SUB 4.125%/VAR 22-24.08.33	3 000 000.00	0.13
EUR	KONINKLIJKE KPN-REG-S-SUB 6.000%/VAR 22-PRP	986 000.00	0.04
EUR	LA BANQUE POSTALE SA-REG-S-SUB 5.500%/VAR 22-05.03.34	1 900 000.00	0.09
EUR	MUENCHENR RUECKVR AG-REG-S-SUB 1.250%/VAR 20-26.05.41	3 000 000.00	0.11
EUR	NATWEST GROUP PLC-REG-S 0.750%/VAR 19-15.11.25	6 500 000.00	0.28
EUR	ORSTED A/S-REG-S-SUB 1.750%/VAR 19-09.12.3019	7 400 000.00	0.29
EUR	ORSTED A/S-REG-S-SUB 1.500%/VAR 21-18.02.3021	2 900 000.00	0.10
EUR	RED ELECTRICA CORP SA-REG-S-SUB 4.625%/VAR 23-PRP	1 500 000.00	0.07
EUR	SSE PLC-REG-S-SUB 4.000%/VAR 22-PRP	1 550 000.00	0.06
EUR	STANDARD CHARTERED PLC-REG-S 0.800%/VAR 21-17.11.29	1 500 000.00	0.06
EUR	TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 2.502%/VAR 20-PRP	6 500 000.00	0.26
EUR	TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 2.376%/VAR 21-PRP	1 600 000.00	0.06
EUR	TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 7.125%/VAR 22-PRP	600 000.00	0.03
EUR	TELIA CO AB-REG-S-SUB 1.375%/VAR 20-11.05.81	7 700 000.00	0.31
EUR	TELIA CO AB-REG-S-SUB 2.750%/VAR 22-30.06.83	3 000 000.00	0.12
EUR	TENNET HOLDING BV-REG-S-SUB 2.374%/VAR 20-PRP	8 200 000.00	0.35
EUR	TERNA - RETE ELETTRICA NAZIONALE-REG-S-SUB 2.375%/VAR PRP	1 000 000.00	0.04
ユーロ合計			4.32
GBP			
GBP	NATWEST GROUP PLC-REG-S 2.057%/VAR 21-09.11.28	2 200 000.00	0.10
英ボンド合計			0.10
USD			
USD	ABN AMRO BANK NV-144A 2.470%/VAR 21-13.12.29	6 200 000.00	0.22
USD	ABN AMRO BANK NV-REG-S 2.470%/VAR 21-13.12.29	6 000 000.00	0.21
USD	BNP PARIBAS SA 144A-SUB 4.625%/VAR 21-PRP	300 000.00	0.01
USD	CITIGROUP INC 0.776%/VAR 20-30.10.24	800 000.00	0.03
USD	CITIGROUP INC 1.678%/VAR 20-15.05.24	6 300 000.00	0.26
USD	CITIGROUP INC 2.014%/VAR 22-25.01.26	7 000 000.00	0.27
USD	GOLDMAN SACHS GROUP INC 4.387%/VAR 22-15.06.27	2 100 000.00	0.09
USD	HSBC HOLDINGS PLC 2.871%/VAR 21-22.11.32	1 300 000.00	0.04
USD	HSBC HOLDINGS PLC-SUB 4.60000%/VAR 20-PRP	1 300 000.00	0.05
USD	ING GROEP NV-REG-S 1.400%/VAR 20-01.07.26	6 200 000.00	0.24
USD	JPMORGAN CHASE & CO 0.653%/VAR 20-16.09.24	5 200 000.00	0.21
USD	JPMORGAN CHASE & CO 0.768%/VAR 21-09.08.25	1 200 000.00	0.05
USD	JPMORGAN CHASE 4.323%/VAR 22-26.04.28	1 300 000.00	0.05
USD	MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 3.261%/VAR 22-22.05.30	2 900 000.00	0.11
USD	NATWEST GROUP PLC 2.359%/VAR 20-22.05.24	7 100 000.00	0.29
USD	SOCIETE GENERALE-144A-SUB 6.750%/VAR 18-PRP	200 000.00	0.01
USD	STANDARD CHARTERED PLC-144A 1.214%/VAR 21-23.03.25	3 000 000.00	0.12
USD	STANDARD CHARTERED PLC-144A 2.678%/VAR 21-29.06.32	2 300 000.00	0.08
USD	STANDARD CHARTERED PLC-REG-S 1.214%/VAR 21-23.03.25	7 900 000.00	0.31
USD	SWISS RE FINANCE LUXEMBOURG-144A-SUB 5.000%/VAR 19-02.04.49	4 200 000.00	0.17
米ドル合計			2.82
ノート、変動利付債合計			7.24

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)	
中期債券、固定利付債				
EUR				
EUR	A2A SPA-REG-S 1.00000% 19-16.07.29	7 400 000.00	6 606 064.21	0.28
EUR	A2A SPA-REG-S 1.00000% 21-02.11.33	4 100 000.00	3 169 025.70	0.13
EUR	A2A SPA-REG-S 2.50000% 22-15.06.26	2 818 000.00	2 946 471.85	0.12
EUR	AB IGNITIS GRUPE-REG-S 1.87500% 18-10.07.28	1 500 000.00	1 410 982.58	0.06
EUR	ABB FINANCE BV-REG-S 0.62500% 22-31.03.24	2 400 000.00	2 528 037.68	0.11
EUR	ABN AMRO BANK NV-REG-S 4.25000% 22-21.02.30	2 700 000.00	2 971 041.82	0.12
EUR	ABN AMRO BANK NV-REG-S 4.00000% 23-16.01.28	1 700 000.00	1 851 546.91	0.08
EUR	ACCIONA ENERGIA FINANCIACION-REG-S 1.37500% 22-26.01.32	3 400 000.00	3 061 495.02	0.13
EUR	ACEA SPA-REG-S 0.25000% 21-28.07.30	5 800 000.00	4 832 598.84	0.20
EUR	ACEA SPA-REG-S 3.87500% 23-24.01.31	1 600 000.00	1 732 154.17	0.07
EUR	ACTION LOGEMENT SERVICES-REG-S 0.50000% 19-30.10.34	3 000 000.00	2 363 957.25	0.10
EUR	ACTION LOGEMENT SERVICES-REG-S 1.37500% 22-13.04.32	1 500 000.00	1 394 162.38	0.06
EUR	ACTION LOGEMENT SERVICES-REG-S 3.12500% 22-28.09.37	1 400 000.00	1 445 860.55	0.06
EUR	ADIF - ALTA VELOCIDAD-REG-S 0.55000% 21-31.10.31	4 000 000.00	3 350 021.14	0.14
EUR	ADIF ALTA VELOCIDAD-REG-S 0.55000% 20-30.04.30	4 100 000.00	3 625 919.11	0.15
EUR	ADIF ALTA VELOCIDAD-REG-S 3.50000% 22-30.07.29	2 500 000.00	2 704 981.29	0.11
EUR	AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT-REG-S 0.01000% 21-25.11.28	4 100 000.00	3 738 735.37	0.16
EUR	AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT-REG-S 1.37500% 14-17.09.24	2 000 000.00	2 111 607.01	0.09
EUR	AIR LIQUIDE FINANCE-REG-S 0.37500% 21-27.05.31	3 300 000.00	2 913 620.19	0.12
EUR	AKZO NOBEL NV-REG-S 1.50000% 22-28.03.28	1 100 000.00	1 081 365.87	0.05
EUR	AKZO NOBEL NV-REG-S 2.00000% 22-28.03.32	1 100 000.00	1 037 947.33	0.04
EUR	ALLIANDER NV-REG-S 0.87500% 19-24.06.32	3 300 000.00	2 873 960.03	0.12
EUR	ALLIANDER NV-REG-S 2.62500% 22-09.09.27	950 000.00	1 008 192.71	0.04
EUR	ANDORRA INTERNATIONAL BOND-REG-S 1.25000% 21-06.05.31	2 000 000.00	1 755 056.80	0.07
EUR	ASSICURAZIONI GENERALI SPA-REG-S-SUB 2.12400% 19-01.10.30	3 100 000.00	2 828 821.62	0.12
EUR	ASSICURAZIONI GENERALI SPA-REG-S-SUB 2.42900% 20-14.07.31	8 500 000.00	7 749 301.25	0.32
EUR	ATRIUM FINANCE ISSUER BV-REG-S 2.62500% 21-05.09.27	200 000.00	155 420.27	0.01
EUR	BANCA INTESA SPA-REG-S 0.75000% 21-16.03.28	6 600 000.00	6 056 757.49	0.25
EUR	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENT-REG-S 1.37500% 18-14.05.25	1 000 000.00	1 037 551.35	0.04
EUR	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA-REG-S 1.00000% 19-21.06.26	2 300 000.00	2 305 800.36	0.10
EUR	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA-REG-S 0.75000% 20-04.06.25	6 700 000.00	6 863 009.52	0.29
EUR	BANCO SANTANDER SA-REG-S 0.30000% 19-04.10.26	1 100 000.00	1 062 394.74	0.04
EUR	BANCO SANTANDER SA-REG-S 1.12500% 20-23.06.27	7 700 000.00	7 536 361.61	0.31
EUR	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT-REG-S 0.10000% 20-08.10.27	4 100 000.00	3 829 412.30	0.16
EUR	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT-REG-S 0.25000% 21-29.06.28	3 000 000.00	2 753 039.01	0.11
EUR	BANQUE FEDERATIVE DU CR MUTUEL-REG-S 4.00000% 22-21.11.29	2 600 000.00	2 873 037.98	0.12
EUR	BELFIUS BANK SA-REG-S 0.37500% 21-08.06.27	2 300 000.00	2 190 361.71	0.09
EUR	BERLIN HYP AG 1.50000% 18-18.04.28	5 600 000.00	5 647 595.75	0.24
EUR	BERLIN HYP AG-REG-S 1.12500% 17-25.10.27	2 000 000.00	1 953 573.70	0.08
EUR	BNG BANK NV-REG-S 0.12500% 21-19.04.33	4 300 000.00	3 505 621.48	0.15
EUR	BNG BANK NV-REG-S 0.25000% 21-22.11.36	3 200 000.00	2 374 087.93	0.10
EUR	BNG BANK NV-REG-S 0.25000% 22-12.01.32	2 000 000.00	1 716 032.85	0.07
EUR	BNG BANK NV-REG-S 1.25000% 22-30.03.37	3 900 000.00	3 336 318.88	0.14
EUR	BNG BANK NV-REG-S 3.00000% 23-11.01.33	8 400 000.00	9 126 104.21	0.38
EUR	BNP PARIBAS-REG-S 1.00000% 18-17.04.24	700 000.00	739 434.97	0.03
EUR	BPIFRANCE FINANCEMENT SA-REG-S 2.12500% 22-29.11.27	6 900 000.00	7 196 513.10	0.30
EUR	CAISSE D'AMORTIS DE LA DETTE SOC-REG-S 2.75000% 22-25.11.32	8 000 000.00	8 473 466.36	0.35
EUR	CAISSE D'AMORTISSEMENT DE LA DETTE-REG-S 3.00000% 23-25.05.28	2 200 000.00	2 395 049.12	0.10
EUR	CAISSE D'AMORTISSEMENT DE LA DE-REG-S 2.87500% 22-25.05.27	4 400 000.00	4 762 315.35	0.20
EUR	CAISSE D'AMTISEMT DE LA DTE SCIL-REG-S 1.75000% 22-25.11.27	3 000 000.00	3 086 660.54	0.13
EUR	CAISSE DES DEPOTS ET CONSIGNAIONS-REG-S 3.00000% 22-25.11.27	1 000 000.00	1 078 773.47	0.04
EUR	CAIXABANK SA-REG-S 0.62500% 19-01.10.24	6 400 000.00	6 621 311.48	0.28
EUR	CAIXABANK SA-REG-S 3.75000% 22-07.09.29	1 500 000.00	1 625 947.17	0.07
EUR	CASSA DEPOSITI E PRESTITI SPA-REG-S 1.00000% 20-11.02.30	9 500 000.00	8 338 583.29	0.35
EUR	CASSA DEPOSITI E PRESTITI SPA-REG-S 2.00000% 20-20.04.27	6 900 000.00	6 972 090.43	0.29
EUR	CASTELLUM AB-REG-S 0.75000% 19-04.09.26	1 500 000.00	1 307 088.33	0.05
EUR	CITYCON TREASURY BV-REG-S 1.62500% 21-12.03.28	1 000 000.00	810 464.82	0.03

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR COCA-COLA HBC FINANCE BV-REG-S 2.75000% 22-23.09.25	1 379 000.00	1 466 900.95	0.06
EUR COMMERZBANK AG-REG-S 1.25000% 18-23.10.23	2 000 000.00	2 141 456.02	0.09
EUR COMMUNAUTE FRANCAISE DE BELGIQUE-REG-S 1.62500% 22-03.05.32	3 000 000.00	2 851 480.75	0.12
EUR COVESTRO AG-REG-S 4.75000% 22-15.11.28	1 700 000.00	1 884 004.60	0.08
EUR CPI PROPERTY GROUP SA-REG-S 1.62500% 19-23.04.27	3 800 000.00	2 889 666.81	0.12
EUR CPI PROPERTY GROUP SA-REG-S 2.75000% 20-12.05.26	1 500 000.00	1 259 063.19	0.05
EUR CREDIT AGRICOLE SA 0.12500% 20-09.12.27	13 400 000.00	12 339 548.07	0.52
EUR CREDIT MUTUEL ARKEA SA-REG-S 0.37500% 19-03.10.28	2 800 000.00	2 521 206.86	0.11
EUR CREDIT MUTUEL ARKEA SA-REG-S 4.25000% 22-01.12.32	1 800 000.00	1 985 867.19	0.08
EUR CTP BV-REG-S 0.50000% 21-21.06.25	1 900 000.00	1 811 335.91	0.08
EUR CTP BV-REG-S 0.75000% 21-18.02.27	4 500 000.00	3 883 359.65	0.16
EUR CTP BV-REG-S 2.12500% 20-01.10.25	4 100 000.00	4 034 588.65	0.17
EUR CTP NV-REG-S 0.62500% 21-27.09.26	5 000 000.00	4 400 750.63	0.18
EUR CTP NV-REG-S 0.87500% 22-20.01.26	1 600 000.00	1 467 383.88	0.06
EUR DAIMLER AG-REG-S 0.75000% 20-10.09.30	3 000 000.00	2 715 967.76	0.11
EUR DAIMLER AG-REG-S 0.75000% 21-11.03.33	3 000 000.00	2 494 126.85	0.10
EUR DANONE SA-REG-S 3.07100% 22-07.09.32	2 400 000.00	2 569 809.77	0.11
EUR DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH-REG-S 0.62500% 20-08.12.50	100 000.00	56 887.30	0.00
EUR DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH-REG-S 3.87500% 22-13.10.42	700 000.00	798 444.41	0.03
EUR DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH-REG-S 3.62500% 23-18.12.37	1 000 000.00	1 092 446.83	0.05
EUR DEUTSCHE WOHNEN AG-REG-S 0.50000% 21-07.04.31	3 000 000.00	2 327 257.44	0.10
EUR DEUTSCHE WOHNEN SE-REG-S 1.30000% 21-07.04.41	1 100 000.00	661 666.84	0.03
EUR DEVELOPMENT BANK OF JAPAN-REG-S 0.01000% 20-15.10.24	1 000 000.00	1 024 959.68	0.04
EUR DEVELOPMENT BANK OF JAPAN INC-REG-S 0.01000% 21-09.09.25	3 060 000.00	3 050 801.33	0.13
EUR E.ON AG ECP-REG-S 0.60000% 21-01.10.32	5 400 000.00	4 416 389.75	0.18
EUR E.ON SE-REG-S 0.35000% 19-28.02.30	2 700 000.00	2 350 178.53	0.10
EUR E.ON SE-REG-S 0.87500% 20-20.08.31	2 900 000.00	2 526 445.31	0.11
EUR E.ON SE-REG-S 1.62500% 22-29.03.31	3 988 000.00	3 742 414.50	0.16
EUR E.ON SE-REG-S 3.87500% 23-12.01.35	3 100 000.00	3 341 841.01	0.14
EUR EDP FINANCE BV-REG-S 1.87500% 22-21.09.29	2 400 000.00	2 340 112.80	0.10
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S 4.75000% 22-12.10.34	4 200 000.00	4 670 263.49	0.20
EUR ENBW INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S 4.04900% 22-22.11.29	1 900 000.00	2 097 476.64	0.09
EUR ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-REG-S 3.87500% 22-09.03.29	2 350 000.00	2 559 588.31	0.11
EUR ENEXIS HOLDING NV-REG-S 0.62500% 20-17.06.32	3 000 000.00	2 532 195.08	0.11
EUR ENEXIS HOLDING NV-REG-S 0.37500% 21-14.04.33	3 000 000.00	2 398 650.03	0.10
EUR ENGIE SA-REG-S 4.25000% 23-11.01.43	800 000.00	875 556.14	0.04
EUR ERG SPA-REG-S 0.50000% 20-11.09.27	4 000 000.00	3 737 019.85	0.16
EUR ERG SPA-REG-S 1.87500% 19-11.04.25	3 300 000.00	3 454 619.70	0.14
EUR ERSTE GROUP BANK AG-REG-S 0.12500% 21-17.05.28	3 100 000.00	2 768 071.89	0.12
EUR ESB FINANCE DAC-REG-S 1.12500% 19-11.06.30	6 600 000.00	6 078 261.29	0.25
EUR ESSITY CAPITAL BV-REG-S 3.00000% 22-21.09.26	1 050 000.00	1 123 029.86	0.05
EUR EUROFIMA EURO RAILROADMAT FIN CO-REG-S 0.15000% 19-10.10.34	3 000 000.00	2 337 168.74	0.10
EUR EUROFIMA-REG-S 0.01000% 21-23.06.28	1 300 000.00	1 202 677.44	0.05
EUR EUROGRID GMBH-REG-S 3.27900% 22-05.09.31	2 400 000.00	2 538 396.00	0.11
EUR EUROPEAN COMMUNITY-REG-S 2.62500% 22-04.02.48	2 200 000.00	2 177 631.47	0.09
EUR EUROPEAN UNION-REG-S-2.75000% 22-04.12.37	3 550 000.00	3 667 885.39	0.15
EUR EUROPEAN UNION-REG-S 1.12500% 22-04.06.37	1 050 000.00	879 526.52	0.04
EUR EUROPEAN UNION-REG-S 0.20000% 21-04.06.36	3 000 000.00	2 243 190.66	0.09
EUR FERROVIE DELLO STATO-REG-S 0.37500% 21-25.03.28	6 900 000.00	6 201 073.98	0.26
EUR FLEMISH COMMUNITY-REG-S 1.50000% 19-11.04.44	2 600 000.00	2 019 554.29	0.08
EUR FLEMISH COMMUNITY-REG-S 0.87500% 21-21.03.46	600 000.00	389 596.54	0.02
EUR FLEMISH COMMUNITY-REG-S 3.25000% 22-12.01.43	1 400 000.00	1 471 586.89	0.06
EUR FLUVIUS SYSTEM OPERATOR CVBA-REG-S 0.25000% 20-02.12.30	3 000 000.00	2 521 749.45	0.11
EUR GECINA SA-REG-S 0.87500% 21-30.06.36	4 900 000.00	3 717 807.64	0.16
EUR GLOBALWORTH REAL ESTATE INVEST-REG-S 2.95000% 20-29.07.26	1 000 000.00	884 655.61	0.04
EUR H LUNDBECK A/S-REG-S 0.87500% 20-14.10.27	3 000 000.00	2 829 116.81	0.12
EUR HYPO NOE LANDESBANK FUER NIED AG-REG-S 4.00000% 23-01.02.27	2 000 000.00	2 161 035.32	0.09
EUR IBERDROLA FINANZAS SA-REG-S 1.37500% 22-11.03.32	2 000 000.00	1 860 772.91	0.08
EUR ILE DE FRANCE-REG-S 0.50000% 16-14.06.25	1 700 000.00	1 737 723.44	0.07
EUR ILE-DE-FRANCE MOBILITES-REG-S 0.95000% 21-28.05.41	1 500 000.00	1 079 066.70	0.04

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR ILE-DE-FRANCE MOBILITES-REG-S 3.05000% 23-03.02.33	6 700 000.00	7 175 100.11	0.30
EUR IMERYS SA-REG-S 1.87500% 16-31.03.28	3 000 000.00	2 953 838.79	0.12
EUR INFORMA PLC-REG-S 2.12500% 20-06.10.25	400 000.00	414 762.49	0.02
EUR ING GROEP NV-REG-S 2.50000% 18-15.11.30	2 800 000.00	2 819 602.14	0.12
EUR INMOBILIARIA COLONIAL SA-REG-S 1.35000% 20-14.10.28	6 500 000.00	6 030 908.41	0.25
EUR INSTITUTO DE CREDITO OFICIAL-REG-S 2.65000% 22-31.01.28	7 700 000.00	8 161 849.51	0.34
EUR INTERNATIONAL BANK FOR RECONS & DEV 2.90000% 23-19.01.33	5 350 000.00	5 764 465.60	0.24
EUR INTERNATIONAL BK FOR RECONST & DEV 0.10000% 20-17.09.35	5 700 000.00	4 306 633.74	0.18
EUR INTERNATIONAL DEVELOP ASSOCIATION-REG-S 1.75000% 22-05.05.37	5 000 000.00	4 647 273.12	0.19
EUR INTERNATIONAL DEVELOPMENT ASSOC-REG-S 2.50000% 22-15.01.38	2 000 000.00	2 034 861.34	0.08
EUR INTESA SANPAOLO SPA-REG-S 4.75000% 22-06.09.27	5 793 000.00	6 385 205.64	0.27
EUR IREN SPA-REG-S 1.50000% 17-24.10.27	5 800 000.00	5 718 817.83	0.24
EUR JAPAN FINANCE ORG FOR MUNI-REG-S 0.01000% 21-02.02.28	800 000.00	736 687.09	0.03
EUR KBC GROUP NV-REG-S 0.87500% 18-27.06.23	2 500 000.00	2 695 505.51	0.11
EUR KBC GROUP NV-REG-S 3.00000% 22-25.08.30	1 800 000.00	1 848 993.62	0.08
EUR KOJAMO OYJ-REG-S 2.00000% 22-31.03.26	1 800 000.00	1 779 438.62	0.07
EUR KOMMUNINVEST I SVERIGE AB-REG-S 0.87500% 22-01.09.29	2 100 000.00	2 012 854.44	0.08
EUR KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU-REG-S 0.01000% 19-05.05.27	3 000 000.00	2 898 561.01	0.12
EUR LA BANQUE POSTALE SA-REG-S 4.37500% 23-17.01.30	2 500 000.00	2 723 525.59	0.11
EUR LA BANQUE POSTALE-REG-S 1.37500% 19-24.04.29	7 400 000.00	6 896 207.68	0.29
EUR LA BANQUE POSTALE-REG-S 0.75000% 21-23.06.31	8 000 000.00	6 653 402.96	0.28
EUR LA POSTE SA-REG-S 1.45000% 18-30.11.28	4 100 000.00	3 985 990.74	0.17
EUR LA POSTE SA-REG-S 2.62500% 22-14.09.28	2 000 000.00	2 087 314.25	0.09
EUR LA POSTE SA-REG-S 2.62500% 22-14.03.33	1 000 000.00	1 026 551.83	0.04
EUR LANDESBANK BADEN-WUERTTEMBERG REG S-0.37500% 21-21.02.31	2 800 000.00	2 299 966.32	0.10
EUR LANDESBANK BADEN-WUERTTEMBERG-REG-S 0.25000% 21-21.07.28	3 000 000.00	2 714 169.28	0.11
EUR LANDESBANK HESSEN-THUER GIRO-REG-S 2.62500% 22-24.08.27	3 100 000.00	3 203 703.06	0.13
EUR LANDESBANK HESSEN-THUERINGEN GIRO-REG-S 4.00000% 23-04.02.30	1 400 000.00	1 514 695.26	0.06
EUR LEASEPLAN CORP NV-REG-S 3.50000% 20-09.04.25	2 800 000.00	3 024 518.92	0.13
EUR LEASEPLAN CORP NV-REG-S 0.25000% 21-23.02.26	7 700 000.00	7 487 362.62	0.31
EUR LEASEPLAN CORP NV-REG-S 0.25000% 21-07.09.26	6 200 000.00	5 935 925.74	0.25
EUR LOGICOR FINANCING SARL-REG-S 2.00000% 22-17.01.34	1 000 000.00	729 328.19	0.03
EUR MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINAN-REG-S 1.00000% 20-08.09.27	6 900 000.00	6 643 504.68	0.28
EUR MERCK FINANCIAL SERVICES GMBH-REG-S 1.87500% 22-15.06.26	1 600 000.00	1 667 818.32	0.07
EUR MIZUHO FINANCIAL GROUP INC-REG-S 0.21400% 20-07.10.25	2 700 000.00	2 692 851.20	0.11
EUR MOTABILITY OPERATIONS GROUP PLC-REG-S 0.12500% 21-20.07.28	1 700 000.00	1 560 073.90	0.07
EUR MOTABILITY OPERATIONS GROUP PLC-REG-S 3.50000% 23-17.07.31	9 054 000.00	9 815 495.45	0.41
EUR MUNICIPALITY FINANCE PLC-REG-S 0.05000% 20-10.09.35	4 300 000.00	3 243 175.98	0.14
EUR NATIONAL GRID PLC-REG-S 3.87500% 23-16.01.29	1 000 000.00	1 088 823.77	0.05
EUR NATIONAL GRID TRANSCO PLC-REG-S 0.25000% 21-01.09.28	1 700 000.00	1 525 699.76	0.06
EUR NATIONALE-NEDERLANDEN BANK-REG-S 1.87500% 22-17.05.32	300 000.00	294 725.08	0.01
EUR NATIONALE-NEDERLANDEN BANK NV/THE 0.50000% 21-21.09.28	2 600 000.00	2 337 003.66	0.10
EUR NE PROPERTY BV-REG-S 2.00000% 22-20.01.30	2 800 000.00	2 130 999.53	0.09
EUR NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK NV-REG-S 1.25000% 17-07.06.32	1 000 000.00	936 240.26	0.04
EUR NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK NV-REG-S 2.75000% 22-09.11.27	2 050 000.00	2 213 260.70	0.09
EUR NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK NV-REG-S 2.75000% 23-17.12.29	3 000 000.00	3 221 769.49	0.13
EUR NORDEA BANK ABP-REG-S 0.50000% 21-19.03.31	2 800 000.00	2 437 921.60	0.10
EUR NORDEA BANK ABP-REG-S 1.12500% 22-16.02.27	2 400 000.00	2 387 243.90	0.10
EUR NRW BANK 0.10000% 20-09.07.35	6 100 000.00	4 611 331.38	0.19
EUR ONTARIO TEACHERS ' FINANCE TRUST-REG-S 0.05000% 20-25.11.30	800 000.00	672 118.12	0.03
EUR ORANGE SA-REG-S 0.12500% 20-16.09.29	8 800 000.00	7 795 725.98	0.33
EUR ORIX CORP-REG-S 1.91900% 22-20.04.26	1 600 000.00	1 640 057.14	0.07
EUR ORSTED AS REG-S 3.25000% 22-13.09.31	1 950 000.00	2 065 187.18	0.09
EUR ORSTED AS-REG-S 2.25000% 22-14.06.28	3 450 000.00	3 531 914.43	0.15
EUR POLAND, REPUBLIC OF-REG-S 2.00000% 19-08.03.49	2 200 000.00	1 717 764.55	0.07
EUR PROLOGIS INTERNATIONAL FUNDING II-REG-S 0.87500% 19-09.07.29	2 800 000.00	2 481 607.74	0.10
EUR PROLOGIS INTERNATIONAL FUNDING II-REG-S 1.62500% 20-17.06.32	1 300 000.00	1 108 816.65	0.05
EUR PROLOGIS INTERNATIONAL FUNDING II-REG-S 0.75000% 21-23.03.33	3 100 000.00	2 347 483.38	0.10
EUR PROLOGIS INTERNATIONAL FUND II SA-REG-S 3.62500% 22-07.03.30	1 700 000.00	1 773 910.62	0.07
EUR RED ELECTRICA FINANCIACIONES SAU-REG-S 0.37500% 20-24.07.28	2 800 000.00	2 650 811.73	0.11

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
EUR RED ELECTRICA FINANCIACIONES SAU-REG-S 0.50000% 21-24.05.33	2 800 000.00	2 344 181.58	0.10
EUR REGIE AUTONOME DES TRANSPORTS PA-REG-S 0.87500% 17-25.05.27	500 000.00	496 194.52	0.02
EUR REGION OF ILE DE FRANCE-REG-S 1.37500% 18-20.06.33	3 300 000.00	3 022 931.11	0.13
EUR REGION OF ILE DE FRANCE-REG-S 2.90000% 23-30.04.31	2 900 000.00	3 110 175.68	0.13
EUR REGION WALLONNE BELGIUM-REG-S 0.25000% 19-03.05.26	1 200 000.00	1 193 288.32	0.05
EUR REN FINANCE B V-REG-S 0.50000% 21-16.04.29	10 500 000.00	9 331 504.50	0.39
EUR SBAB BANK AB-REG-S 1.87500% 22-10.12.25	3 250 000.00	3 381 091.95	0.14
EUR SBB TREASURY OYJ-REG-S 0.75000% 20-14.12.28	4 300 000.00	3 105 559.99	0.13
EUR SBB TREASURY OYJ-REG-S 1.12500% 21-26.11.29	600 000.00	430 075.80	0.02
EUR SCHNEIDER ELECTRIC SE-REG-S 3.25000% 22-09.11.27	1 000 000.00	1 088 671.73	0.05
EUR SCHNEIDER ELECTRIC SE-REG-S 3.50000% 22-09.11.32	800 000.00	880 843.89	0.04
EUR SCHNEIDER ELECTRIC SE-REG-S 3.12500% 23-13.10.29	1 600 000.00	1 731 963.03	0.07
EUR SCHNEIDER ELECTRIC SE-REG-S 3.37500% 23-13.04.34	2 500 000.00	2 694 598.66	0.11
EUR SEGRO CAPITAL SARL-REG-S 1.25000% 22-23.03.26	11 500 000.00	11 507 170.01	0.48
EUR SEGRO CAPITAL SARL-REG-S 1.87500% 22-23.03.30	2 600 000.00	2 440 832.21	0.10
EUR SHAEFFLER AG-REG-S 3.37500% 20-12.10.28	900 000.00	880 155.99	0.04
EUR SKF AB-REG-S 0.87500% 19-15.11.29	3 800 000.00	3 464 426.52	0.14
EUR SNCF RESEAU-REG-S 1.00000% 16-09.11.31	100 000.00	91 385.46	0.00
EUR SOCIETE DU GRAND PARIS EPIC-REG-S 1.12500% 18-22.10.28	1 300 000.00	1 275 704.74	0.05
EUR SOCIETE DU GRAND PARIS EPIC-REG-S 0.30000% 21-25.11.31	1 500 000.00	1 278 286.29	0.05
EUR SOCIETE DU GRAND PARIS EPIC-REG-S 1.62500% 22-08.04.42	2 000 000.00	1 593 595.92	0.07
EUR SOCIETE DU GRAND PARIS EPIC-REG-S 3.50000% 23-25.05.43	1 300 000.00	1 407 205.84	0.06
EUR SPAREBANK 1 SR-BANK ASA-REG-S 3.75000% 23-23.11.27	2 300 000.00	2 479 080.72	0.10
EUR SSE PLC-REG-S 1.37500% 18-04.09.27	4 300 000.00	4 274 931.73	0.18
EUR SSE PLC-REG-S 2.87500% 22-01.08.29	1 200 000.00	1 244 743.63	0.05
EUR STANDARD CHARTERED PLC-REG-S 0.90000% 19-02.07.27	10 800 000.00	10 558 751.88	0.44
EUR STATKRAFT AS-REG-S 2.87500% 22-13.09.29	800 000.00	848 987.00	0.04
EUR STEDIN HOLDING NV-REG-S 0.50000% 19-14.11.29	3 800 000.00	3 409 512.79	0.14
EUR SUEZ SACA-REG-S 4.62500% 22-03.11.28	5 800 000.00	6 521 712.44	0.27
EUR SUMITOMO MITSUI FIN GP INC-REG-S 0.93400% 17-11.10.24	800 000.00	833 542.94	0.03
EUR SUMITOMO MITSUI FIN GP INC-REG-S 0.46500% 19-30.05.24	1 800 000.00	1 881 855.31	0.08
EUR SVENSK EXPORTKREDIT AB-REG-S 2.00000% 22-30.06.27	3 200 000.00	3 325 335.66	0.14
EUR SVENSKA HANDELSBANKEN AB-REG-S 0.01000% 20-02.12.27	4 300 000.00	3 953 914.90	0.17
EUR TDC NET A/S-REG-S 5.05600% 22-31.05.28	2 800 000.00	3 003 031.64	0.13
EUR TDC NET A/S-REG-S 5.61800% 23-06.02.30	900 000.00	976 819.34	0.04
EUR TELEFONICA EMISIONES SA-REG-S 1.06900% 19-05.02.24	1 000 000.00	1 062 949.72	0.04
EUR TENNET HOLDING BV-REG-S 2.00000% 18-05.06.34	2 800 000.00	2 561 718.26	0.11
EUR TENNET HOLDING BV-REG-S 0.12500% 20-30.11.32	2 800 000.00	2 155 600.73	0.09
EUR TENNET HOLDING BV-REG-S 1.62500% 22-17.11.26	1 450 000.00	1 480 049.93	0.06
EUR TENNET HOLDING BV-REG-S 3.87500% 22-28.10.28	1 100 000.00	1 217 628.22	0.05
EUR TENNET HOLDING BV-REG-S 4.25000% 22-28.04.32	2 000 000.00	2 263 067.54	0.09
EUR TENNET HOLDING BV-REG-S 4.50000% 22-28.10.34	2 000 000.00	2 308 229.85	0.10
EUR TESCO CORP TREASURY SERVICES PLC-REG-S STEP-UP 21-27.07.29	4 700 000.00	4 100 178.25	0.17
EUR UNEDIC ASSEO-REG-S 0.25000% 20-16.07.35	7 400 000.00	5 624 983.55	0.24
EUR UNEDIC ASSEO-REG-S 0.01000% 21-25.05.31	5 000 000.00	4 276 050.36	0.18
EUR UNIPOL GRUPPO FINANZIARIO SPA 3.25000% 20-23.09.30	400 000.00	413 667.81	0.02
EUR VALEO-REG-S 1.00000% 21-03.08.28	1 500 000.00	1 300 813.13	0.05
EUR VESTEDA FINANCE BV-REG-S 0.75000% 21-18.10.31	600 000.00	490 468.87	0.02
EUR VODAFONE GROUP PLC-REG-S 0.90000% 19-24.11.26	4 100 000.00	4 086 437.11	0.17
EUR VOLVO TREASURY AB-REG-S 2.62500% 22-20.02.26	2 400 000.00	2 541 779.25	0.11
EUR VONOVIA SE-REG-S 0.62500% 21-24.03.31	13 000 000.00	10 490 721.71	0.44
EUR VONOVIA SE-REG-S 1.37500% 22-28.01.26	4 700 000.00	4 720 714.21	0.20
EUR VONOVIA SE-REG-S 4.75000% 22-23.05.27	2 500 000.00	2 769 894.50	0.12
EUR VONOVIA SE-REG-S 5.00000% 22-23.11.30	500 000.00	558 606.35	0.02
EUR WESFARMERS LTD-REG-S 0.95400% 21-21.10.33	2 100 000.00	1 710 642.79	0.07
EUR WESTERN POWER DISTRIBUTION EAST-REG-S 3.53000% 22-20.09.28	1 300 000.00	1 395 893.98	0.06
EUR ZF FINANCE GMBH-REG-S 2.75000% 20-25.05.27	1 000 000.00	953 695.26	0.04
EUR ZF FINANCE GMBH-REG-S 2.25000% 21-03.05.28	1 500 000.00	1 350 131.75	0.06
ユーロ合計		700 641 764.08	29.29

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
GBP			
GBP ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-REG-S 2.87500% 22-11.04.29	5 350 000.00	5 849 763.69	0.24
GBP INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC-REG-S 3.37500% 20-08.10.28	200 000.00	223 200.57	0.01
GBP LEND LEASE EUROPE FINANCE PLC-REG-S 3.50000% 21-02.12.33	1 200 000.00	1 006 134.30	0.04
GBP ORSTED AS-REG-S 5.12500% 22-13.09.34	900 000.00	1 136 975.02	0.05
GBP SOUTH EASTERN POWER NET-REG-S 1.75000% 21-30.09.34	200 000.00	182 334.77	0.01
GBP THE BRITISH LAND CO PLC-REG-S 2.37500% 17-14.09.29	200 000.00	200 395.99	0.01
英ボンド合計		8 598 804.34	0.36
USD			
USD ADANIREN KODSOPAR WARSOM-144A 4.62500% 19-15.10.39	200 000.00	130 851.71	0.00
USD AGENCE FRANCAISE DE DVLPMT EPIC-REG-S 4.00000% 22-21.09.27	3 000 000.00	2 983 520.94	0.12
USD AGRICULTURAL BANK OF CHINA/NY-REG-S 1.25000% 21-19.01.26	3 200 000.00	2 907 584.00	0.12
USD ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.75000% 16-14.08.26	1 600 000.00	1 486 063.67	0.06
USD BANK MANDIRI PERSERO TBK PT-REG-S 2.00000% 21-19.04.26	900 000.00	811 125.00	0.03
USD BANK OF CHINA LTD/PARIS 0.95000% 20-21.09.23	2 000 000.00	1 950 680.00	0.08
USD BANK OF THE PHILIPPINE ISLANDS-REG-S 2.50000% 19-10.09.24	3 500 000.00	3 326 750.00	0.14
USD BNG BANK NV-144A 1.50000% 19-16.10.24	3 000 000.00	2 849 550.48	0.12
USD CAISSE D'AMORTIS DE LA DETTE SOC-REG-S 4.00000% 23-25.01.26	3 350 000.00	3 335 217.62	0.14
USD CHINA CONSTRUCTION BANK CORP/HK-REG-S 1.25000% 20-04.08.25	1 800 000.00	1 651 536.00	0.07
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK-REG-S 2.87500% 18-13.06.25	2 000 000.00	1 943 140.00	0.08
USD HONG KONG GOVERNMENT INTERNATIONA-REG-S 4.62500% 23-11.01.33	2 000 000.00	2 086 231.40	0.09
USD HYUNDAI CAPITAL SERVICES INC-REG-S 1.25000% 21-08.02.26	6 200 000.00	5 449 412.50	0.23
USD INDUSTRIAL COMMERCIAL BANK CHINA-REG-S 1.00000% 21-28.10.24	2 000 000.00	1 875 180.00	0.08
USD INTERNATIONAL FINANCE CORP 2.12500% 16-07.04.26	8 300 000.00	7 850 887.00	0.33
USD JOHN DEERE CAPITAL CORP 3.35000% 22-18.04.29	2 400 000.00	2 271 962.33	0.09
USD LINK FINANCE CAYMAN 2009 LTD-REG-S 2.87500% 16-21.07.26	1 200 000.00	1 129 608.00	0.05
USD MTR CORP CI LTD-REG-S 2.50000% 16-02.11.26	2 000 000.00	1 863 620.00	0.08
USD MTR CORP LTD-REG-S 1.62500% 20-19.08.30	2 900 000.00	2 375 923.33	0.10
USD PRUDENTIAL FINANCIAL INC 1.50000% 20-10.03.26	5 400 000.00	4 931 658.00	0.21
USD PUBLIC SERVICE ELECTRIC & GAS CO 3.10000% 22-15.03.32	3 100 000.00	2 806 887.01	0.12
USD QNB FINANCE LTD-REG-S 1.62500% 20-22.09.25	7 900 000.00	7 259 606.25	0.30
USD SHINHAN BANK CO LTD-144A 4.37500% 22-13.04.32	1 300 000.00	1 192 181.25	0.05
USD SUMITOMO MITSUI TRUST BANK LTD-144A 2.80000% 22-10.03.27	1 200 000.00	1 113 187.44	0.05
USD SWIRE PROPERTIES MTN FINANCING-REG-S 3.50000% 18-10.01.28	3 450 000.00	3 267 529.50	0.14
USD TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 2.15000% 20-13.02.30	5 000 000.00	4 359 703.55	0.18
USD UDR INC 1.90000% 20-15.03.33	1 000 000.00	754 606.92	0.03
米ドル合計		73 964 203.90	3.09
中期債券、固定利付債合計		783 204 772.32	32.74
中期債券、ゼロ・クーポン			
EUR			
EUR ASIAN DEVELOPMENT BANK 0.00000% 19-24.10.29	3 200 000.00	2 880 691.15	0.12
EUR COUNCIL OF EUROPE DEVELOPMENT BANK-REG- 0.00000% 21-15.04.28	4 800 000.00	4 503 076.09	0.19
EUR EUROPEAN UNION-REG-S 0.00000% 20-04.07.35	32 000 000.00	23 994 371.99	1.00
EUR EUROPEAN UNION-REG-S 0.00000% 21-02.06.28	4 500 000.00	4 211 184.94	0.18
EUR HONG KONG GOVERNMENT INTERNATI BD-REG-S 0.00000% 21-24.11.26	4 100 000.00	3 897 458.73	0.16
EUR KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU-REG-S 0.00000% 21-15.09.31	6 000 000.00	5 127 585.24	0.21
EUR LSEG NETHERLANDS BV-REG-S 0.00000% 21-06.04.25	400 000.00	403 050.53	0.02
EUR NORTH RHINE WESTPHALIA, STATE OF-REG-S 0.00000% 20-12.10.35	1 800 000.00	1 338 595.29	0.05
EUR NRW BANK-REG-S 0.00000% 21-22.09.28	3 000 000.00	2 775 057.58	0.12
EUR UNEDIC ASSEO-REG-S 0.00000% 20-19.11.30	9 900 000.00	8 594 828.33	0.36
ユーロ合計		57 725 899.87	2.41
中期債券、ゼロ・クーポン合計		57 725 899.87	2.41

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
中期債券、変動利付債			
EUR			
EUR ABB FINANCE BV-REG-S 3M EURIBOR+70BP 22-31.03.24	1 200 000.00	1 308 303.61	0.05
EUR AIB GROUP PLC-REG-S 0.50000% 21-17.11.27	6 300 000.00	5 937 755.72	0.25
EUR AIB GROUP PLC-REG-S 2.250%/VAR 22-04.04.28	8 200 000.00	8 169 561.32	0.34
EUR AIB GROUP PLC-REG-S 4.625%/VAR 23-23.07.29	1 200 000.00	1 299 285.62	0.05
EUR AUSTRALIA & NEW ZEALAND BK-REG-S-SUB 0.669%/VAR 21-05.05.31	3 000 000.00	2 824 952.90	0.12
EUR AXA SA-REG-S-SUB 0.000%/VAR 21-07.10.41	8 700 000.00	7 303 794.86	0.31
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S 2.625%/VAR 22-24.03.26	10 700 000.00	11 106 889.35	0.46
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S 5.125%/VAR 22-10.11.28	1 800 000.00	2 008 289.77	0.08
EUR BANCO SANTANDER SA-REG-S 0.625%/VAR 21-24.06.29	5 500 000.00	5 000 551.06	0.21
EUR BNP PARIBAS SA-REG-S 0.375%/VAR 20-14.10.27	5 000 000.00	4 768 712.78	0.20
EUR CAIXA GERAL DE DEPOSITOS SA-REG-S 2.875%/VAR 22-15.06.26	3 000 000.00	3 118 212.46	0.13
EUR CAIXABANK SA-REG-S 0.750%/VAR 20-10.07.26	7 100 000.00	7 133 250.26	0.30
EUR CAIXABANK SA-REG-S 0.750%/VAR 21-26.05.28	4 300 000.00	4 027 332.01	0.17
EUR CAIXABANK SA-REG-S 0.625%/VAR 22-21.01.28	2 800 000.00	2 682 182.06	0.11
EUR CAIXABANK SA-REG-S 5.375%/VAR 22-14.11.30	3 500 000.00	3 975 010.34	0.17
EUR CAIXABANK SA-REG-S-SUB VAR 21-18.06.31	9 000 000.00	8 597 058.85	0.36
EUR CNP ASSURANCES-REG-S-SUB 5.250%/VAR 23-18.07.53	1 900 000.00	2 054 077.21	0.09
EUR COMMERZBANK AG-REG-S 0.750%/VAR 20-24.03.26	8 200 000.00	8 232 702.11	0.34
EUR CREDIT AGRICOLE SA-REG-S 4.000%/VAR 22-12.10.26	6 100 000.00	6 639 731.53	0.28
EUR CREDIT MUTUEL ARKEA SA-REG-S 1.250%/VAR 20-11.06.29	10 700 000.00	10 095 815.67	0.42
EUR DANONE SA-REG-S-SUB 1.750%/VAR 17-PRP	1 000 000.00	1 076 840.30	0.05
EUR DANSKE BANK A/S-REG-S 0.750%/VAR 21-09.06.29	5 000 000.00	4 503 903.65	0.19
EUR DE VOLKSBANK NV-REG-S-SUB 1.750%/VAR 20-22.10.30	8 100 000.00	8 074 155.09	0.34
EUR EDP - ENERGIAS DE PORT SA-REG-S-SUB 5.943%/VAR 23-23.04.83	1 200 000.00	1 300 848.96	0.05
EUR IBERDROLA INTERNATIONAL BV-REG-S-SUB 2.625%/VAR 18-PRP	6 600 000.00	7 052 669.69	0.30
EUR ICCREA BANCA SPA-REG-S 6.875%/VAR 23-20.01.28	2 500 000.00	2 748 792.55	0.12
EUR ING GROEP NV-REG-S-SUB 0.875%/VAR 21-09.06.32	8 500 000.00	7 967 292.12	0.33
EUR KBC GROEP NV-REG-S 0.375%/VAR 20-16.06.27	4 300 000.00	4 174 956.05	0.17
EUR NATWEST GROUP PLC-REG-S 0.780%/VAR 21-26.02.30	13 700 000.00	12 157 834.51	0.51
EUR NATWEST GROUP PLC-REG-S 4.067%/VAR 22-06.09.28	3 954 000.00	4 292 077.40	0.18
EUR NN GROUP N.V-REG-S-SUB 5.250%/VAR 22-01.03.43	2 300 000.00	2 427 443.82	0.10
EUR SOCIETE GENERALE SA-REG-S SUB 5.250%/VAR 22-06.09.32	4 200 000.00	4 632 650.11	0.19
EUR UNICREDIT SPA-REG-S 0.800%/VAR 21-05.07.29	5 000 000.00	4 474 145.88	0.19
EUR UNICREDIT SPA-REG-S 5.850%/VAR 22-15.11.27	2 641 000.00	2 969 553.46	0.12
ユーロ合計		174 136 633.08	7.28
GBP			
GBP ING GROEP NV-REG-S 1.125%/VAR 21-07.12.28	200 000.00	205 846.82	0.01
英ポンド合計		205 846.82	0.01
USD			
USD BANK OF AMERICA CORP 2.456%/VAR 19-22.10.25	6 300 000.00	6 022 817.83	0.25
USD BANK OF AMERICA CORP 1.486%/VAR 20-19.05.24	8 900 000.00	8 802 169.69	0.37
USD BANK OF AMERICA CORP 0.981%/VAR 20-25.09.25	2 200 000.00	2 051 363.67	0.09
USD BANK OF AMERICA CORP 1.530%/VAR 21-06.12.2025	2 000 000.00	1 869 073.38	0.08
USD MORGAN STANLEY 0.864%/VAR 20-21.10.25	16 900 000.00	15 662 118.77	0.65
USD UNITED OVERSEAS BANK LTD-REG-S-SUB 2.000%/VAR 21-14.10.31	1 600 000.00	1 418 944.64	0.06
米ドル合計		35 826 487.98	1.50
中期債券、変動利付債合計		210 168 967.88	8.79
債券、固定利付債			
CAD			
CAD CANADA, GOVERNMENT 2.25000% 22-01.12.29	3 000 000.00	2 158 561.10	0.09
カナダドル合計		2 158 561.10	0.09

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)	
EUR				
EUR	AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT-REG-S 0.12500% 21-29.09.31	5 900 000.00	4 974 421.78	0.21
EUR	AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT-REG-S 3.50000% 22-25.02.33	3 100 000.00	3 450 176.46	0.14
EUR	BANKINTER SA-REG-S 0.62500% 20-06.10.27	10 200 000.00	9 632 445.50	0.40
EUR	BASQUE GOVERNMENT-REG-S 1.12500% 19-30.04.29	4 200 000.00	4 038 608.55	0.17
EUR	BELGIUM, KINGDOM OF-REG-S 1.25000% 18-22.04.33	13 100 000.00	12 223 090.04	0.51
EUR	BELGIUM, KINGDOM OF-144A-REG-S 2.75000% 22-22.04.39	2 800 000.00	2 892 694.17	0.12
EUR	CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.25000% 20-29.01.40	3 850 000.00	2 780 559.52	0.12
EUR	DH EUROPE FINANCE II SARL 0.75000% 19-18.09.31	3 800 000.00	3 284 671.34	0.14
EUR	DIGITAL INTREPID HOLDING BV-REG-S 0.62500% 21-15.07.31	3 200 000.00	2 525 196.58	0.10
EUR	EQT AB-REG-S 0.87500% 21-14.05.31	800 000.00	618 659.26	0.03
EUR	EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.50000% 17-15.11.47	3 000 000.00	2 408 098.66	0.10
EUR	EUROPEAN INVESTMENT BANK-REG-S 0.01000% 20-15.11.35	2 800 000.00	2 077 424.25	0.09
EUR	EUROPEAN INVESTMENT BANK-REG-S 1.50000% 22-15.06.32	1 900 000.00	1 829 977.53	0.08
EUR	EUROPEAN UNION-REG-S 0.10000% 20-04.10.40	3 000 000.00	1 928 003.74	0.08
EUR	EUROPEAN UNION-REG-S 0.30000% 20-04.11.50	6 800 000.00	3 574 407.76	0.15
EUR	EUROPEAN UNION-REG-S 2.75000% 22-04.02.33	6 750 000.00	7 208 265.89	0.30
EUR	FEDEX CORP 0.45000% 21-04.05.29	8 500 000.00	7 508 841.10	0.31
EUR	FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-144A-REG-S 1.75000% 17-25.06.39	6 000 000.00	5 491 416.33	0.23
EUR	GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 1.30000% 22-15.10.27	3 000 000.00	3 122 285.15	0.13
EUR	ICADE-REG-S 1.50000% 17-13.09.27	500 000.00	502 569.64	0.02
EUR	IMERYSA SA-REG-S 1.00000% 21-15.07.31	900 000.00	709 627.02	0.03
EUR	IRELAND, REPUBLIC OF-REG-S 3.00000% 23-18.10.43	2 200 000.00	2 377 908.21	0.10
EUR	ITALIAN REPUBLIC-REG-S-144A 1.50000% 21-30.04.45	12 700 000.00	8 329 493.06	0.35
EUR	JYSKE BANK A/S-REG-S 5.50000% 22-16.11.27	1 950 000.00	2 188 239.68	0.09
EUR	KOMMUNEKREDIT-REG-S 0.62500% 19-21.11.39	1 100 000.00	820 183.22	0.03
EUR	LG CHEM LTD-REG-S 0.50000% 19-15.04.23	400 000.00	431 379.06	0.02
EUR	MERCIALYS-REG-S 1.80000% 18-27.02.26	3 500 000.00	3 338 123.47	0.14
EUR	NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK-REG-S 0.12500% 20-03.09.35	1 100 000.00	829 733.30	0.03
EUR	NETHERLANDS, KINGDOM OF THE-144A-REG-S 0.50000% 19-15.01.40	4 300 000.00	3 346 140.47	0.14
EUR	NIDEC CORP-REG-S 0.04600% 21-30.03.26	1 900 000.00	1 844 764.53	0.08
EUR	PEARSON FUNDING FIVE PLC-REG-S 1.37500% 15-06.05.25	2 000 000.00	2 066 483.81	0.09
EUR	PROLOGIS EURO FINANCE 1.50000% 22-08.02.34	900 000.00	752 355.05	0.03
EUR	SEB SA-REG-S 1.50000% 17-31.05.24	1 900 000.00	1 978 800.91	0.08
EUR	SELP FINANCE SARL-REG-S 0.87500% 21-27.05.29	1 100 000.00	932 649.51	0.04
EUR	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-REG-S 4.00000% 22-09.11.26	1 500 000.00	1 646 392.07	0.07
EUR	SLOVENIA, REPUBLIC OF-REG-S 3.62500% 23-11.03.33	1 850 000.00	2 027 331.49	0.08
EUR	SOCIETE NATIONALE SNCF SA-REG-S 3.12500% 22-02.11.27	2 400 000.00	2 594 003.49	0.11
EUR	SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.00000% 21-30.07.42	8 600 000.00	5 964 094.84	0.25
EUR	SPAREBANK 1 SMN-REG-S 0.01000% 21-18.02.28	4 300 000.00	3 840 639.01	0.16
EUR	VIA OUTLETS BV-REG-S 1.75000% 21-15.11.28	200 000.00	169 365.41	0.01
ユーロ合計			128 259 520.86	5.36
GBP				
GBP	BERKELEY GROUP PLC/THE-REG-S 2.50000% 21-11.08.31	200 000.00	178 455.34	0.01
GBP	DERWENT LONDON PLC-REG-S 1.87500% 21-17.11.31	200 000.00	181 691.65	0.01
GBP	ENW FINANCE PLC-REG-S 4.89300% 23-24.11.32	900 000.00	1 114 914.93	0.04
GBP	VMED O2 UK FINANCING I PLC-144A 4.50000% 21-15.07.31	200 000.00	196 422.01	0.01
英ポンド合計			1 671 483.93	0.07
USD				
USD	AUTORIDAD DEL CANAL DE PANAMA-REG-S 4.95000% 15-29.07.35	2 670 000.00	2 583 725.62	0.11
USD	BANK RAKYAT INDONESIA-REG-S 3.95000% 19-28.03.24	2 500 000.00	2 462 500.00	0.10
USD	DTE ELECTRIC CO 3.65000% 22-01.03.52	350 000.00	289 864.52	0.01
USD	DTE ELECTRIC CO 4.05000% 18-15.05.48	2 900 000.00	2 583 424.37	0.11
USD	DUKE ENERGY PROGRESS LLC 3.40000% 22-01.04.32	4 800 000.00	4 393 403.18	0.18
USD	EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.12500% 16-13.04.26	2 800 000.00	2 643 424.00	0.11
USD	EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.62500% 19-09.10.29	7 900 000.00	6 956 819.00	0.29

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD GREENKO DUTCH BV-REG-S 3.85000% 21-29.03.26	1 400 000.00	1 188 258.75	0.05
USD INDIAN RAILWAY FINANCE CORP LTD-REG-S 3.83500% 17-13.12.27	6 400 000.00	6 019 200.00	0.25
USD ING GROEP NV-144A 4.62500% 18-06.01.26	1 600 000.00	1 600 104.55	0.07
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.62500% 20-22.04.25	18 200 000.00	16 823 481.04	0.70
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 1.12500% 21-13.09.28	20 000 000.00	17 370 643.60	0.73
USD ISRAEL, STATE OF 4.50000% 23-17.01.33	7 365 000.00	7 392 618.75	0.31
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 0.75000% 20-30.09.30	8 300 000.00	6 706 139.88	0.28
USD MIDAMERICAN ENERGY CO 3.95000% 17-01.08.47	2 000 000.00	1 760 238.26	0.07
USD MIDAMERICAN ENERGY CO 2.70000% 21-01.08.52	4 000 000.00	2 795 085.12	0.12
USD NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD/NY 3.62500% 18-20.06.23	1 300 000.00	1 293 968.00	0.05
USD NORTHERN STATES POWER CO 2.25000% 21-01.04.31	500 000.00	428 759.07	0.02
USD NORTHERN STATES POWER CO 3.20000%21-01.04.52	6 100 000.00	4 682 138.02	0.20
USD NWD FINANCE BVI LTD-REG-S 5.87500% 22-PRP	2 200 000.00	2 117 066.82	0.09
USD PACIFICORP 5.35000% 22-01.12.53	800 000.00	854 389.77	0.04
USD PERU PENER SBSN INDO III-REG-S 2.30000% 20-23.06.25	3 600 000.00	3 406 896.00	0.14
USD PERUSAHAAN PENERBIT SBSN INDONE-144A 2.55000% 21-09.06.31	1 250 000.00	1 075 137.50	0.05
USD PERUSAHAAN PENERBIT SBSN-REG-S 2.55000% 21-09.06.31	900 000.00	774 099.00	0.03
USD PERUSAHAAN PENERBIT SBSN IDN III-REG-S 3.55000% 21-09.06.51	3 400 000.00	2 618 374.00	0.11
USD RENEW POWER PVT LTD-REG-S 5.87500% 20-05.03.27	3 300 000.00	3 147 993.75	0.13
USD SAN DIEGO GAS & ELECTRIC CO 2.95000% 21-15.08.51	1 250 000.00	908 514.66	0.04
USD SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO 2.50000% 21-01.06.31	600 000.00	512 437.27	0.02
USD SOUTHERN CALIFORNIA EDISON 2.75000% 22-01.02.32	5 300 000.00	4 587 755.42	0.19
USD SOUTHERN CALIFORNIA EDISON 3.45000% 22-01.02.52	1 800 000.00	1 371 830.24	0.06
USD STAR ENERGY GEOTHERMAL DARAJAT II-REG-S 4.85000% 20-14.10.38	4 800 000.00	4 170 900.00	0.17
米ドル合計		115 519 190.16	4.83
債券、固定利付債合計		247 608 756.05	10.35
ボンド、ゼロ・クーポン債			
EUR			
EUR GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 20-15.08.30	4 000 000.00	3 693 621.30	0.16
EUR GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 21-15.08.31	52 840 000.00	47 654 640.68	1.99
EUR GRAND-DUCHY OF LUXEMBOURG-REG-S 0.00000% 20-14.09.32	2 300 000.00	1 918 566.08	0.08
EUR THERMO FISHER SCIENTIFIC FINANCE 0.00000% 21-18.11.25	800 000.00	792 854.73	0.03
ユーロ合計		54 059 682.79	2.26
ボンド、ゼロ・クーポン債合計		54 059 682.79	2.26
債券、変動利付債			
EUR			
EUR BANCO DE SABADELL SA-REG-S 1.125%/VAR 20-11.03.27	7 300 000.00	7 196 791.77	0.30
EUR COMMERZBANK AG-REG-S 3.000%/VAR 22-14.09.27	1 600 000.00	1 651 630.10	0.07
EUR DEUTSCHE BANK AG-REG-S 0.000%/VAR 22-24.05.28	5 800 000.00	5 969 647.59	0.25
EUR ERSTE GROUP BANK AG-REG-S 4.000%/VAR 23-16.01.31	2 400 000.00	2 599 889.01	0.11
EUR FERROVIAL NETHERLANDS BV-REG-S-SUB 2.124%/VAR 17-PRP	1 900 000.00	1 702 280.21	0.07
EUR MUENCHENER RUECKVERSICHERUN-REG-S-SUB 1.000%/VAR 21-26.05.42	3 600 000.00	2 856 336.70	0.12
EUR SOCIETE GENERALE SA-REG-S 0.875%/VAR 20-22.09.28	3 700 000.00	3 490 650.50	0.15
EUR SOCIETE GENERALE SA-REG-S 0.500%/VAR 21-12.06.29	700 000.00	626 871.53	0.03
EUR SOCIETE GENERALE SA-REG-S 0.625%/VAR 21-02.12.27	7 100 000.00	6 748 905.41	0.28
EUR STOREBRAND LIVSFORSIKRING-REG-S-SUB 1.875%/VAR 21-30.09.51	4 300 000.00	3 415 181.97	0.14
EUR UNIBAIL-RODAMCO SE-REG-S-SUB 2.125%/VAR 18-PRP	5 500 000.00	5 487 588.01	0.23
EUR VEOLIA ENVIRONNEMENT SA-REG-S-SUB 2.875%/VAR 17-PRP	3 000 000.00	3 168 863.66	0.13
ユーロ合計		44 914 636.46	1.88

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
GBP			
GBP HSBC HOLDINGS PLC 3.000%/VAR 19-22.07.28	200 000.00	222 577.46	0.01
GBP YORKSHIRE BUILDING SOCIETY-REG-S 3.511%/VAR 22-11.10.30	2 400 000.00	2 621 504.35	0.11
英ボンド合計		2 844 081.81	0.12
USD			
USD ENEL SPA-144A-SUB 8.750%/VAR 13-24.09.73	6 600 000.00	6 645 920.36	0.28
USD ING GROEP NV-REG-S-SUB 4.875%/VAR 20-PRP	250 000.00	208 704.50	0.01
米ドル合計		6 854 624.86	0.29
債券、変動利付債合計		54 613 343.13	2.29
財務省証券（T-note）、固定利付債			
USD			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 2.87500% 22-15.05.52	1 800 000.00	1 551 093.75	0.06
USD AMERICA, UNITED STATES OF 3.37500% 22-15.08.42	4 700 000.00	4 443 703.12	0.19
USD AMERICA, UNITED STATES OF 4.12500% 22-30.09.27	7 000 000.00	7 141 914.08	0.30
米ドル合計		13 136 710.95	0.55
財務省証券（T-note）、固定利付債合計		13 136 710.95	0.55
財務省証券（T-note）、変動利付債			
USD			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.625%/CPI LINKED 22-15.07.32	4 800 000.00	4 651 366.67	0.19
米ドル合計		4 651 366.67	0.19
財務省証券（T-note）、変動利付債合計		4 651 366.67	0.19
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品 合計		2 191 951 611.58	91.63
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
モーゲージ・バック証券、固定利付債			
USD			
USD ENTERGY LOUISIANA LLC 4.75000% 22-15.09.52	950 000.00	915 987.71	0.04
米ドル合計		915 987.71	0.04
モーゲージ・バック証券、固定利付債合計		915 987.71	0.04
ノート、固定利付債			
USD			
USD ATLANTICA SUSTAINABLE INFRASTRUCTU-144A 4.12500% 21-15.06.28	250 000.00	222 500.00	0.01
USD AUTODESK INC 2.40000% 21-15.12.31	3 400 000.00	2 850 455.17	0.12
USD BMW US CAPITAL LLC-144A 1.95000% 21-12.08.31	300 000.00	244 385.44	0.01
USD CLEAN RENEWABLE POWER MAURITIUS-144A 4.25000% 21-25.03.27	250 000.00	212 457.66	0.01
USD COOPERATIEVE RADOBANK UA-144A 1.00400% 20-24.09.26	4 100 000.00	3 658 452.59	0.15
USD ELECTRICITE DE FRANCE SA-144A 3.62500% 15-13.10.25	2 229 000.00	2 170 076.27	0.09
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL SA-144A 2.65000% 19-10.09.24	1 950 000.00	1 873 601.99	0.08
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-144A 1.87500% 21-12.07.28	2 800 000.00	2 342 166.79	0.10
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-144A 4.62500% 22-15.06.27	900 000.00	880 371.99	0.04
USD GOODMAN US FINANCE FIVE LLC-144A 4.62500% 22-04.05.32	2 800 000.00	2 646 534.78	0.11
USD INDIA GREEN ENERGY HOLDINGS-REG-S 5.37500% 20-29.04.24	1 700 000.00	1 647 045.00	0.07
USD JAB HOLDINGS BV-144A 4.50000% 22-08.04.52	2 229 000.00	1 660 704.10	0.07

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD JDE PEET ' S NV-144A 2.25000% 21-24.09.31	1 200 000.00	942 936.11	0.04
USD LIBERTY UTILITIES FIN GP 1-144A 2.05000% 20-15.09.30	1 400 000.00	1 107 322.55	0.05
USD METALSA S A P I DE CV-144A 3.75000% 21-04.05.31	600 000.00	481 987.50	0.02
USD NATIONAL RURAL UTIL COOPERTIVE FNC CORP 4.15000% 22-15.12.32	2 900 000.00	2 778 461.17	0.11
USD NEW YORK STATE ELECTRIC & GAS CORP-144A 2.15000% 21-01.10.31	3 750 000.00	3 042 549.94	0.13
USD NIAGARA MOHAWK POWER-144A 5.78300% 22-16.09.52	1 150 000.00	1 235 324.78	0.05
USD NSTAR ELECTRIC CO 4.95000% 22-15.09.52	950 000.00	973 278.97	0.04
USD NXP BV / NXP FUNDING LLC / NXP USA 2.50000% 22-11.05.31	5 300 000.00	4 322 150.00	0.18
USD PROTECTIVE LIFE GLOBAL FUNDING-144A 1.73700% 20-21.09.30	600 000.00	473 748.94	0.02
USD PUBLIC SERVICE CO OF OKLAHOMA 2.20000% 21-15.08.31	2 700 000.00	2 230 317.15	0.09
USD SCENTRE GROUP TRUST 1 / 2-144A 4.37500% 20-28.05.30	5 400 000.00	5 044 013.10	0.21
USD STARWOOD PROPERTY TRUST INC-144A 4.37500% 22-15.01.27	250 000.00	224 375.00	0.01
USD TERRAFORM POWER OPERATING LLC-144A 5.00000% 17-31.01.28	100 000.00	93 932.25	0.00
USD TRANSALTA CORP 7.75000% 22-15.11.29	900 000.00	925 472.98	0.04
USD WEIR GROUP PLC/THE-144A 2.20000% 21-13.05.26	2 300 000.00	2 061 424.08	0.09
USD WISCONSIN ELECTRIC POWER CO 4.75000% 22-30.09.32	1 400 000.00	1 428 229.37	0.06
米ドル合計		47 774 275.67	2.00
ノート、固定利付債合計		47 774 275.67	2.00
ノート、変動利付債			
USD			
USD BANK OF AMERICA CORP 6.204%/VAR 22-10.11.28	1 500 000.00	1 581 810.32	0.07
USD BANK OF IRELAND GROUP-144A 6.253%/VAR 22-16.09.26	4 400 000.00	4 434 547.48	0.18
USD BNP PARIBAS SA-144A 1.675%/VAR 21-30.06.27	16 600 000.00	14 756 448.15	0.62
USD FIFTH THIRD BANCORP 1.707%/VAR 21-01.11.27	6 000 000.00	5 401 209.60	0.22
USD ING GROEP NV-144A 1.400%/VAR 20-01.07.26	6 200 000.00	5 647 776.23	0.24
USD RABOBANK NEDERLAND NV-144A 6M H15TSY+550BP 21-24.02.27	8 100 000.00	7 180 821.72	0.30
USD SANTANDER HOLDINGS USA INC 5.807%/VAR 22-09.09.26	3 500 000.00	3 537 567.88	0.15
米ドル合計		42 540 181.38	1.78
ノート、変動利付債合計		42 540 181.38	1.78
中期債券、変動利付債			
USD			
USD BB&T CORP 1.267%/VAR 21-02.03.27	4 700 000.00	4 250 935.12	0.18
USD WELLS FARGO & CO 0.805%/VAR 21-19.05.25	1 200 000.00	1 135 832.23	0.05
米ドル合計		5 386 767.35	0.23
中期債券、変動利付債合計		5 386 767.35	0.23
債券、固定利付債			
EUR			
EUR ARDAGH METAL PACKAGING FINANCE-144A 2.00000% 21-01.09.28	500 000.00	451 498.14	0.02
ユーロ合計		451 498.14	0.02
USD			
USD ANDREW W MELLON FOUNDATION/THE 0.94700% 20-01.08.27	600 000.00	521 754.56	0.02
USD INTERSTATE POWER & LIGHT CO 3.60000% 19-01.04.29	1 100 000.00	1 029 215.10	0.05
USD NATIONAL RURAL UTILITIES COOPERATIVE 1.35000% 20-15.03.31	300 000.00	230 946.29	0.01
USD NORTHERN STATES POWER CO 4.50000% 22-01.06.52	550 000.00	532 684.99	0.02
米ドル合計		2 314 600.94	0.10
債券、固定利付債合計		2 766 099.08	0.12

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量/額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
債券、変動利付債			
USD			
USD SCENTRE GROUP TRUST CPN-144A-SUB 5.125%/VAR 20-24.09.80	4 000 000.00	3 529 577.60	0.15
米ドル合計		3 529 577.60	0.15
債券、変動利付債合計		3 529 577.60	0.15
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
合計		102 912 888.79	4.32
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されていない譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
ノート、固定利付債			
USD			
USD AES CORP-SUB 2.45000% 21-15.01.31	8 600 000.00	7 110 104.78	0.30
USD AES CORPORATION 1.37500% 21-15.01.26	2 897 000.00	2 611 752.66	0.11
USD AMDPCS LTD 2.53800% 20-15.06.30	400 000.00	338 293.22	0.01
USD NIAGARA MOHAWK POWER CORP-144A 1.96000% 20-27.06.30	8 000 000.00	6 558 624.80	0.27
米ドル合計		16 618 775.46	0.69
ノート、固定利付債合計		16 618 775.46	0.69
中期債券、固定利付債			
AUD			
AUD VICINITY CENTRES TRUST-REG-S 4.92700% 22-02.06.28	1 500 000.00	1 048 720.03	0.04
豪ドル合計		1 048 720.03	0.04
中期債券、固定利付債合計		1 048 720.03	0.04
地方債、固定利付債			
USD			
USD CALIFORNIA HEALTH FACILITIES FINANCING 4.19000% 22-01.06.37	2 900 000.00	2 776 657.49	0.12
米ドル合計		2 776 657.49	0.12
地方債、固定利付債合計		2 776 657.49	0.12
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されていない譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計			
		20 444 152.98	0.85
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されていない派生商品			
金利スワップに係るオプション、従来型			
USD			
USD GS/SWAPTION IRS CALL 3.17000% 23-03.02.23	-1 000 000.00	-1 868.46	0.00
USD GS/SWAPTION IRS PUT 3.67000% 23-03.02.23	-1 000 000.00	-0.01	0.00
USD GS/SWAPTION IRS PUT 3.61000% 23-06.02.23	-200 000.00	-1.32	0.00
USD GS/SWAPTION IRS PUT 3.33000% 23-06.02.23	-400 000.00	-1.46	0.00
USD GS/SWAPTION IRS CALL 3.11000% 23-06.02.23	-200 000.00	-308.52	0.00
USD GS/SWAPTION IRS CALL 2.83000% 23-06.02.23	-400 000.00	-506.17	0.00
USD MORGAN STANLEY/SWAPTION IRS CALL 3.11000% 23-06.02.23	-200 000.00	-308.52	0.00
USD MORGAN STANLEY/SWAPTION IRS PUT 3.61000% 22-06.02.23	-200 000.00	-1.32	0.00
USD GS/SWAPTION IRS PUT 3.65000% 23-06.02.23	-400 000.00	-1.04	0.00

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面	米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
USD GS/SWAPTION IRS CALL 3.15000% 23-06.02.23	-400 000.00	-1 006.17	0.00
USD BARCLAYS/SWAPTION IRS CALL 2.92000% 23-09.02.23	-900 000.00	-192.91	0.00
USD BARCLAYS/SWAPTION IRS PUT 3.42000% 23-09.02.23	-900 000.00	-567.95	0.00
USD MORGAN STANLEY/SWAPTION IRS PUT 3.66000% 22-13.02.23	-1 800 000.00	-873.74	0.00
USD MORGAN STANLEY/SWAPTION IRS CALL 3.00000% 23-13.02.23	-500 000.00	-629.92	0.00
USD MORGAN STANLEY/SWAPTION IRS PUT 3.45000% 23-13.02.23	-500 000.00	-443.16	0.00
USD MORGAN STANLEY/SWAPTION IRS CALL 3.16000% 23-13.02.23	-1 800 000.00	-1 211.42	0.00
USD MORGAN STANLEY/SWAPTION IRS PUT 3.42000 23-13.02.23	-400 000.00	-472.29	0.00
USD MORGAN STANLEY/SWAPTION IRS CALL 2.93000 23-13.02.23	-400 000.00	-236.12	0.00
USD GS/SWAPTION IRS PUT 3.47000 23-17.02.23	-1 700 000.00	-2 423.54	0.00
USD GS/SWAPTION IRS CALL 2.97000 23-17.02.23	-1 700 000.00	-1 288.94	0.00
USD MORGAN STANLEY/SWAPTION IRS CALL 2.84000% 23-21.02.23	-700 000.00	-253.96	0.00
USD MS/SWAPTION IRS PUT 3.34000% 23-21.02.23	-700 000.00	-2 832.17	0.00
USD BOA/SWAPTION IRS CALL 2.68000% 23-21.02.23	-200 000.00	-336.21	0.00
USD GS/SWAPTION IRS CALL 2.84000% 23-21.02.23	-700 000.00	-253.96	0.00
USD BOA/SWAPTION IRS PUT 3.08000% 23-21.02.23	-200 000.00	-1 323.24	0.00
USD GS/SWAPTION IRS PUT 3.34000% 23-21.02.23	-700 000.00	-2 832.17	0.00
USD MS/SWAPTION IRS CALL 2.93000 23-23.02.23	-1 200 000.00	-2 031.49	0.00
USD MS/SWAPTION IRS PUT 3.43000 23-23.02.23	-1 200 000.00	-2 837.06	0.00
USD GS/SWAPTION IRS CALL 2.90000% 23-21.02.23	-400 000.00	-452.32	0.00
USD GS/SWAPTION IRS PUT 3.40000% 23-21.02.23	-400 000.00	-1 038.28	0.00
USD MS/SWAPTION IRS CALL 2.92000 23-27.02.23	-800 000.00	-1 605.22	0.00
USD MS/SWAPTION IRS PUT 3.37000 23-27.02.23	-800 000.00	-3 215.76	0.00
USD BOA/SWAPTION IRS PUT 3.40500 23-27.02.23	-900 000.00	-2 983.38	0.00
USD BOA/SWAPTION IRS CALL 2.96500 23-27.02.23	-900 000.00	-2 440.03	0.00
USD BOA/SWAPTION IRS CALL 2.98500 23-27.02.23	-900 000.00	-2 772.54	0.00
USD BOA/SWAPTION IRS PUT 3.42500 23-27.02.23	-900 000.00	-2 663.53	0.00
米ドル合計		-42 214.30	0.00
金利スワップに係るオプション、従来型合計		-42 214.30	0.00
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されて いない派生商品合計		-42 214.30	0.00
投資有価証券合計		2 315 266 439.05	96.80
派生商品			
公認の証券取引所に上場されている派生商品			
債券に係る金融先物			
EUR EURO BTP ITALY GOVERNMENT FUTURE 08.03.23	-267.00	872 652.04	0.04
EUR EURO-BUND FUTURE 08.03.23	-1 548.00	6 081 250.10	0.25
EUR EURO-BOBL FUTURE 08.03.23	-70.00	174 093.82	0.01
EUR EURO-BUXL FUTURE 08.03.23	-188.00	1 881 646.78	0.08
EUR EURO-OAT FUTURE 08.03.23	47.00	-245 012.88	-0.01
GBP LONG GILT FUTURE 29.03.23	-82.00	72 893.43	0.00
USD US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 22.03.23	299.00	1 177 941.40	0.05
USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 22.03.23	-396.00	-413 501.69	-0.02
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 22.03.23	470.00	282 967.15	0.01
USD US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.23	347.00	297 835.83	0.01
JPY JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (OSE) FUTURE 13.03.23	-11.00	138 721.21	0.01
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.03.23	1 257.00	835 747.79	0.04
債券に係る金融先物合計		11 157 234.98	0.47
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		11 157 234.98	0.47

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量/額面	米ドル建評価額 先物/先渡為替契約/ スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されていない派生商品			
金利に係るスワップおよびフォワード・スワップ			
USD CITIGROUP/INTEREST RATE SWAP TP PAY 1.75000% 22-15.06.32	-26 300 000.00	3 290 369.09	0.14
USD CITIGROUP/INTEREST RATE SWAP TP REC SOFR O/N 22-15.06.32			
USD CITIGROUP/INTEREST RATE SWAP TP PAY 1.75000% 22-15.06.52	-6 400 000.00	1 551 527.43	0.06
USD CITIGROUP/INTEREST RATE SWAP TP REC SOFR O/N 22-15.06.52			
EUR LCH/INTEREST RATE SWAP REC TP 1.50000% 22-15.03.28	18 300 000.00	-1 318 022.81	-0.06
EUR LCH/INTEREST RATE SWAP TP PAY 6MEIB 22-15.03.28			
金利に係るスワップおよびフォワード・スワップ合計		3 523 873.71	0.14
クレジット・デフォルト・スワップ*			
EUR BOFA/ITRX EUROPE S38 V1 CDI PAY 1.00000% 22-20.12.27	-10 000 000.00	-112 542.88	0.00
EUR BOFA/ITRX XOVER EUROPE S38 V1 CDI PAY 5.00000% 22-20.12.27	-5 000 000.00	-213 202.06	-0.01
クレジット・デフォルト・スワップ合計		-325 744.94	-0.01
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されて いない派生商品合計		3 198 128.77	0.13
派生商品合計		14 355 363.75	0.60

先渡為替契約

購入通貨	購入額	売却通貨	売却額	満期日		
EUR	238 732.00	JPY	32 985 855.00	2.2.2023	5 625.34	0.00
USD	272 606 194.13	EUR	257 016 377.43	2.2.2023	-6 526 442.59	-0.27
EUR	9 614 346.00	GBP	8 527 931.63	2.2.2023	-57 076.16	0.00
USD	478 928 643.00	EUR	447 600 000.00	8.2.2023	-7 391 723.87	-0.31
EUR	8 174 944.56	USD	8 740 000.00	2.2.2023	138 398.54	0.01
EUR	3 131 015.16	GBP	2 749 000.00	2.2.2023	16 145.11	0.00
EUR	128 453.26	AUD	198 000.00	2.2.2023	-14.04	0.00
USD	160 127 960.88	EUR	150 666 411.57	2.2.2023	-3 503 295.41	-0.15
EUR	6 947 940.76	USD	7 470 000.00	2.2.2023	75 811.06	0.00
USD	4 600 000.00	EUR	4 278 682.50	2.2.2023	-46 863.13	0.00
USD	180 000.00	EUR	166 172.09	2.2.2023	-471.20	0.00
EUR	572 173 135.28	USD	621 800 000.00	24.2.2023	503 131.44	0.02
GBP	107 538 795.44	USD	132 000 000.00	24.2.2023	454 606.67	0.02
JPY	1 996 237 140.00	USD	15 590 000.00	24.2.2023	-194 192.04	-0.01
CHF	696 723 291.00	USD	759 000 000.00	24.2.2023	1 133 283.16	0.05
USD	2 945 504.52	EUR	2 700 000.00	31.3.2023	2 782.25	0.00
EUR	12 899 980.01	USD	14 000 000.00	24.2.2023	30 190.27	0.00
JPY	25 685 320.00	USD	200 000.00	24.2.2023	-1 904.17	0.00
CHF	20 180 292.00	USD	22 000 000.00	24.2.2023	16 935.29	0.00
GBP	3 153 640.51	USD	3 900 000.00	24.2.2023	-15 688.19	0.00
EUR	16 592 017.95	USD	18 000 000.00	24.2.2023	45 699.96	0.00
USD	3 600 000.00	EUR	3 318 268.39	2.2.2023	-3 805.39	0.00
JPY	327 771 620.00	USD	2 530 000.00	24.2.2023	-2 089.45	0.00
EUR	1 073 542.44	GBP	943 000.00	2.2.2023	4 993.47	0.00
EUR	45 463.33	GBP	40 000.00	2.2.2023	131.45	0.00
USD	4 000 000.00	EUR	3 674 741.30	24.2.2023	3 302.36	0.00
EUR	138 197.35	GBP	122 000.00	2.2.2023	-104.97	0.00
CHF	3 677 020.00	USD	4 000 000.00	24.2.2023	11 671.95	0.00

* 額面が正：サブ・ファンドは「受取側」、額面が負：サブ・ファンドは「支払側」

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

マルチ・マネージャー・アクセス - グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド

2023年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量 / 額面			米ドル建評価額 先物 / 先渡為替契約 / スワップに係る 未実現(損)益 (注1)	純資産 比率 (%)
先渡為替契約					
購入通貨	購入額	売却通貨	売却額	満期日	
USD	2 181 919.24	CAD	2 906 875.00	28.2.2023	3 096.90 0.00
USD	5 027 094.06	GBP	4 057 261.00	28.2.2023	29 580.77 0.00
USD	553 551 640.36	EUR	508 550 000.00	28.2.2023	376 959.89 0.02
EUR	257 288 853.72	USD	279 415 695.14	2.2.2023	12 864.46 0.00
USD	279 928 471.83	EUR	257 288 853.72	2.3.2023	-6 946.74 0.00
JPY	33 858 905.00	EUR	238 732.00	2.2.2023	1 088.10 0.00
EUR	238 732.00	JPY	33 793 027.00	2.3.2023	-1 087.33 0.00
USD	1 263 119.71	EUR	1 160 000.00	28.2.2023	1 331.04 0.00
USD	155 546 387.59	EUR	143 034 172.94	2.3.2023	-77 653.22 0.00
EUR	14 002 564.00	GBP	12 325 602.93	2.3.2023	51 694.74 0.00
先渡為替契約合計					-14 910 033.68 -0.62
現金預金、要求払預金および預託金勘定ならびにその他の流動資産					70 954 539.38* 2.97
当座借越およびその他の短期負債					-1 844 135.70 -0.08
その他の資産および負債					8 042 868.51 0.33
純資産総額					2 391 865 041.31 100.00

* 2023年1月31日現在、10,860.50米ドルの現金が取引相手方であるバンク・オブ・アメリカに対する担保、120,000.00米ドルの現金が取引相手方であるバンク・オブ・アメリカ・セキュリティーズ・ヨーロッパに対する担保、7,743.785.00米ドルの現金が取引相手方であるシティバンクに対する担保、3,334,173.50米ドルの現金が取引相手方であるゴールドマン・サックスに対する担保、6,168,764.00米ドルの現金が取引相手方であるJPモルガンに対する担保、110,000.00米ドルの現金が取引相手方であるモルガン・スタンレーに対する担保および8,090,000.00米ドルの現金が取引相手方であるステート・ストリートに対する担保となっている。

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

5【販売及び買戻しの実績】

2023年2月末日までの1年間における販売および買戻しの実績ならびに2023年2月末日現在の発行済口数は以下のとおりである。

(グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド)

(クラスF - a c c 投資証券)

販売口数	買戻し口数	発行済口数
10,488,924.7450 (242,755)	1,752,550.0590 (53,810)	8,736,374.6860 (188,945)

(クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券)

販売口数	買戻し口数	発行済口数
258,815 (258,815)	17,760 (10,540)	241,055 (248,275)

(注1) ()内の数字は本邦内における販売、買戻しおよび発行済口数であり、受渡日を基準として算出している。一方、()の上段の数字は約定日を基準として算出している。

(注2) サブ・ファンドは2022年3月10日に設立され、サブ・ファンドのクラスF - a c c 投資証券は2022年3月10日に運用を開始し、クラスF - a c c 円ヘッジ投資証券は2022年5月13日に運用を開始した。