

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 2023年 5 月31日

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

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

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

【代理人の氏名
又は名称】 弁護士 三 浦 健

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

【事務連絡者氏名】 弁護士 三 浦 健

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

【電話番号】 03 (6212) 8316

【届出の対象とした募集（売出）外国投資証券に係る外国投資法人の名称】

バークレイズ・ポートフォリオ -

バークレイズ・グローバルベータ

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

バークレイズ・マルチマネジャー

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

【届出の対象とした募集（売出）外国投資証券の形態及び金額】

記名式無額面株式・追加型

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

各クラス株式についての上限見込額は、以下のとおりです。

パークレイズ・グローバルベータ

	サブ・ファンド	募集クラス株式	上限見込額 (注1)	2022年11月末日現在 1株当たり純資産価格
1 .	パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ 1	クラスA（円建）株式 （分配型／累積型）	約954億円	954.441円
		クラスA（米ドル建）株式 （分配型／累積型）	約11億米ドル （約1,500億円）	11.234米ドル（注2）
2 .	パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ 2	クラスA（円建）株式 （分配型／累積型）	約1,011億円	1,010.507円
		クラスA（米ドル建）株式 （分配型／累積型）	約14億米ドル （約1,909億円）	14.020米ドル
3 .	パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ 3	クラスA（円建）株式 （分配型／累積型）	約1,168億円	1,168.007円
		クラスA（米ドル建）株式 （分配型／累積型）	約14億米ドル （約1,909億円）	13.740米ドル
4 .	パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ 4	クラスA（円建）株式 （分配型／累積型）	約1,589億円	1,588.590円
		クラスA（米ドル建）株式 （分配型／累積型）	約20億米ドル （約2,727億円）	19.536米ドル
5 .	パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ 5	クラスA（円建）株式 （分配型／累積型）	約1,000億円	1,000円（注2）
		クラスA（米ドル建）株式 （分配型／累積型）	約11億米ドル （約1,500億円）	10.786米ドル（注2）

パークレイズ・マルチマネジャー

	サブ・ファンド	募集クラス株式	上限見込額 (注1)	2022年11月末日現在 1株当たり純資産価格
1 .	パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ 1	クラスA（円建）株式 （分配型／累積型）	約944億円	944.060円
		クラスA（米ドル建）株式 （分配型／累積型）	約10億米ドル （約1,363億円）	9.630米ドル
2 .	パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ 2	クラスA（円建）株式 （分配型／累積型）	約1,054億円	1,053.765円
		クラスA（米ドル建）株式 （分配型／累積型）	約10億米ドル （約1,363億円）	9.836米ドル
3 .	パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ 3	クラスA（円建）株式 （分配型／累積型）	約1,162億円	1,161.937円
		クラスA（米ドル建）株式 （分配型／累積型）	約12億米ドル （約1,636億円）	11.656米ドル
4 .	パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ 4	クラスA（円建）株式 （分配型／累積型）	約1,399億円	1,399.070円
		クラスA（米ドル建）株式 （分配型／累積型）	約16億米ドル （約2,181億円）	16.162米ドル

5 .	パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ 5	クラス A（円建）株式 （分配型 / 累積型）	約1,000億円	1,000円（注 2）
		クラス A（米ドル建）株式 （分配型 / 累積型）	約17億米ドル （約2,318億円）	16.626米ドル

（注 1）上限見込額は、便宜上、2022年11月末日現在における各クラス A 株式（分配型）の 1 株当たり純資産価格にそれぞれ 1 億株を乗じた金額を記載しています。

（注 2）パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 1 のクラス A（米ドル建）株式、パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 5 のクラス A（円建）株式ならびにクラス A（米ドル建）株式およびパークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 5 のクラス A（円建）株式については、2022年11月末日現在、分配型、累積型いずれも運用されていないため、当初発行価格（パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 1 のクラス A（米ドル建）株式については累積型の当初発行価格）を記載しています。

【縦覧に供する場所】 該当事項なし

（注 1）本書中、ポンド、米ドルおよびユーロの円貨換算は、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 ポンド = 164.44円、1 米ドル = 136.33円、1 ユーロ = 144.61円）によります。

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

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

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

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2023年2月28日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」という。）につきまして、本日、半期報告書を提出いたしましたので、その関係情報を新たな情報により訂正および追加し、原届出書のその他記載事項を訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

なお、本訂正届出書の記載事項のうち外貨数字の円換算については、直近の為替レート（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場の仲値（1ポンド＝164.44円、1米ドル＝136.33円、1ユーロ＝144.61円）を用いておりますので、訂正前の換算レートとは異なっております。

2【訂正の内容】

（１）半期報告書の提出による訂正

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

原届出書	半期報告書	訂正の方法
第二部 ファンド情報 第１ ファンドの状況 1 外国投資法人の概況 （１）主要な経営指標等の推移 （５）外国投資法人の出資総額 （６）主要な投資主の状況 3 投資リスク 5 運用状況 （１）投資状況 （３）運用実績	1 外国投資法人の概況 （１）主要な経営指標等の推移 （２）外国投資法人の出資総額 （３）主要な投資主の状況 2 外国投資法人の運用状況 （３）投資リスク 2 外国投資法人の運用状況 （１）投資状況 （２）運用実績 4 外国投資法人の経理状況 （１）資産及び負債の状況 「合算純資産計算書」 「合算損益計算書」 財務諸表に対する注記中の重要な会計方針の要約	追加 更新 更新 更新 更新 追加
第三部 外国投資法人の詳細情報 第１ 外国投資法人の追加情報 2 役員の状況 5 その他 訴訟事件その他の重要事項	1 外国投資法人の概況 （４）役員の状況 （５）その他	更新 追加
第４ 関係法人の状況 1 資産運用会社の概況 （１）名称、資本金の額及び事業の内容 （３）大株主の状況 （４）役員の状況 （５）事業の内容及び営業の概況	3 資産運用会社の概況 （１）名称及び資本金の額 （２）大株主の状況 （３）役員の状況 （４）事業の内容及び営業の概況	更新
第５ 外国投資法人の経理状況	4 外国投資法人の経理状況	追加
第６ 販売及び買戻しの実績	5 販売及び買戻しの実績	追加

* 半期報告書の記載内容は以下のとおりです。

[次へ](#)

1 外国投資法人の概況

（１）主要な経営指標等の推移

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

下記の注記は下表に対するものです。

（注１）営業収益には投資収益ならびに実現および未実現投資利益（損失）を含めています。

（注２）経常利益（損失）は営業収益から費用を控除したものです。

（注３）ファンドは、変動資本を有する会社型投資信託であり、純資産総額を記載しています。

（注４）ファンドの性格上、算定していません（n/a：該当なし）。

2023年２月末日現在、以下のクラスの株式は運用されておりません。

各サブ・ファンドのクラスA（円建・累積型）株式

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

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

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

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

パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ４のクラスA（米ドル建・累積型）株式

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

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

パークレイズ・グローバルベータ

1. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 1

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

	2021年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第15期中)	2021年 8月31日 に終了した 年度 (第15期)	2022年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第16期中)	2022年 8月31日 に終了した 年度 (第16期)	2023年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第17期中)
営業収益(注1)	52 (9)	346 (57)	191 (31)	83 (14)	216 (36)
経常利益/損失金額(注2)	117 (19)	220 (36)	247 (41)	198 (33)	259 (43)
当期純利益/損失金額	117 (19)	220 (36)	247 (41)	198 (33)	259 (43)
出資総額(注3)	7,297 (1,200)	7,216 (1,187)	6,882 (1,132)	6,808 (1,120)	5,865 (964)
発行済株式総数(株)					
クラスA(円建・分配型)	104,000	104,000	104,000	118,000	118,000
クラスA(円建・累積型)	-	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・分配型)	-	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・累積型)	3,621	3,621	3,621	3,621	-
純資産額	7,297 (1,200)	7,216 (1,187)	6,882 (1,132)	6,808 (1,120)	5,865 (964)
総資産額	7,488 (1,231)	7,488 (1,231)	6,921 (1,138)	7,050 (1,159)	5,979 (983)
1株当たり純資産額					
クラスA(円建・分配型)	1,061.061	1,099.472	1,046.917	981.905	932.453
クラスA(円建・累積型)	-	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・分配型)	-	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・累積型)	15.225 (2,076)	15.906 (2,168)	15.295 (2,085)	14.562 (1,985)	- -
1株当たり当期純利益/損失金額(注4)	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a
自己資本比率	97.45%	96.37%	99.44%	96.57%	98.09%
自己資本利益率	1.60%	3.05%	3.59%	2.91%	4.42%

2. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 2

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

	2021年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第15期中)	2021年 8月31日 に終了した 年度 (第15期)	2022年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第16期中)	2022年 8月31日 に終了した 年度 (第16期)	2023年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第17期中)
営業収益（注1）	1,342 (221)	4,777 (786)	2,055 (338)	3,035 (499)	839 (138)
経常利益 / 損失金額（注2）	1,121 (184)	4,356 (716)	2,242 (369)	3,397 (559)	989 (163)
当期純利益 / 損失金額	1,121 (184)	4,356 (716)	2,242 (369)	3,397 (559)	989 (163)
出資総額（注3）	57,659 (9,481)	55,236 (9,083)	49,796 (8,188)	48,106 (7,911)	43,281 (7,117)
発行済株式総数（株）					
クラスA（円建・分配型）	126,000	126,000	82,500	82,500	82,500
クラスA（円建・累積型）	-	-	-	-	-
クラスA（米ドル建・分配型）	69,809	60,000	56,000	56,000	50,500
クラスA（米ドル建・累積型）	15,239	15,209	15,209	15,209	15,209
純資産額	57,659 (9,481)	55,236 (9,083)	49,796 (8,188)	48,106 (7,911)	43,281 (7,117)
総資産額	59,718 (9,820)	55,809 (9,177)	50,067 (8,233)	49,282 (8,104)	44,066 (7,246)
1株当たり純資産額					
クラスA（円建・分配型）	1,107.619	1,162.664	1,099.156	1,037.841	983.577
クラスA（円建・累積型）	-	-	-	-	-
クラスA（米ドル建・分配型）	15.001 (2,045)	15.780 (2,151)	14.943 (2,037)	14.246 (1,942)	13.849 (1,888)
クラスA（米ドル建・累積型）	17.754 (2,420)	18.812 (2,565)	17.970 (2,450)	17.264 (2,354)	16.976 (2,314)
1株当たり当期純利益 / 損失金額（注4）	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a
自己資本比率	96.55%	98.97%	99.46%	97.61%	98.22%
自己資本利益率	1.94%	7.89%	4.50%	7.06%	2.29%

３．パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ３

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

	2021年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第15期中)	2021年 8月31日 に終了した 年度 (第15期)	2022年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第16期中)	2022年 8月31日 に終了した 年度 (第16期)	2023年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第17期中)
営業収益（注１）	6,379 (1,049)	21,275 (3,498)	6,870 (1,130)	7,318 (1,203)	2,373 (390)
経常利益／損失金額（注２）	5,864 (964)	20,255 (3,331)	7,391 (1,215)	8,331 (1,370)	2,848 (468)
当期純利益／損失金額	5,864 (964)	20,255 (3,331)	7,391 (1,215)	8,331 (1,370)	2,848 (468)
出資総額（注３）	164,878 (27,113)	184,520 (30,342)	180,019 (29,602)	177,251 (29,147)	165,629 (27,236)
発行済株式総数（株）					
クラスＡ（円建・分配型）	163,500	211,500	174,500	146,000	146,000
クラスＡ（円建・累積型）	-	-	-	-	-
クラスＡ（米ドル建・分配型）	148,836	149,336	110,836	105,836	96,000
クラスＡ（米ドル建・累積型）	40,038	35,008	30,008	20,007	20,007
純資産額	164,878 (27,113)	184,520 (30,342)	180,019 (29,602)	177,251 (29,147)	165,629 (27,236)
総資産額	166,351 (27,355)	189,338 (31,135)	180,497 (29,681)	180,528 (29,686)	167,775 (27,589)
１株当たり純資産額					
クラスＡ（円建・分配型）	1,220.350	1,308.564	1,238.224	1,192.555	1,135.724
クラスＡ（円建・累積型）	-	-	-	-	-
クラスＡ（米ドル建・分配型）	14.046 (1,915)	15.093 (2,058)	14.309 (1,951)	13.881 (1,892)	13.551 (1,847)
クラスＡ（米ドル建・累積型）	17.445 (2,378)	18.886 (2,575)	18.061 (2,462)	17.654 (2,407)	17.437 (2,377)
１株当たり当期純利益／損失金額（注４）	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a
自己資本比率	99.11%	97.46%	99.74%	98.18%	98.72%
自己資本利益率	3.56%	10.98%	4.11%	4.70%	1.72%

４．パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ４

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

	2021年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第15期中)	2021年 8月31日 に終了した 年度 (第15期)	2022年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第16期中)	2022年 8月31日 に終了した 年度 (第16期)	2023年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第17期中)
営業収益（注１）	4,569 (751)	15,672 (2,577)	4,202 (691)	2,237 (368)	976 (160)
経常利益／損失金額（注２）	4,272 (702)	15,071 (2,478)	4,532 (745)	2,875 (473)	1,283 (211)
当期純利益／損失金額	4,272 (702)	15,071 (2,478)	4,532 (745)	2,875 (473)	1,283 (211)
出資総額（注３）	102,128 (16,794)	111,288 (18,300)	111,311 (18,304)	113,818 (18,716)	106,650 (17,538)
発行済株式総数（株）					
クラスＡ（円建・分配型）	17,000	17,000	17,000	17,000	17,000
クラスＡ（円建・累積型）	-	-	-	-	-
クラスＡ（米ドル建・分配型）	19,500	30,500	12,500	12,500	1,500
クラスＡ（米ドル建・累積型）	12,039	-	-	-	-
純資産額	102,128 (16,794)	111,288 (18,300)	111,311 (18,304)	113,818 (18,716)	106,650 (17,538)
総資産額	104,097 (17,118)	111,697 (18,367)	111,685 (18,365)	114,997 (18,910)	108,635 (17,864)
１株当たり純資産額					
クラスＡ（円建・分配型）	1,541.329	1,701.594	1,624.262	1,608.335	1,550.654
クラスＡ（円建・累積型）	-	-	-	-	-
クラスＡ（米ドル建・分配型）	18.591 (2,535)	20.556 (2,802)	19.647 (2,678)	19.567 (2,668)	19.340 (2,637)
クラスＡ（米ドル建・累積型）	25.621 (3,493)	- -	- -	- -	- -
１株当たり当期純利益／損失金額（注４）	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a
自己資本比率	98.11%	99.63%	99.67%	98.97%	98.17%
自己資本利益率	4.18%	13.54%	4.07%	2.53%	1.20%

５．パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ５

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

	2021年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第15期中)	2021年 8月31日 に終了した 年度 (第15期)	2022年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第16期中)	2022年 8月31日 に終了した 年度 (第16期)	2023年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第17期中)
営業収益（注１）	3,485 (573)	11,394 (1,874)	2,433 (400)	142 (23)	924 (152)
経常利益／損失金額（注２）	3,299 (542)	11,000 (1,809)	2,649 (436)	559 (92)	1,116 (184)
当期純利益／損失金額	3,299 (542)	11,000 (1,809)	2,649 (436)	559 (92)	1,116 (184)
出資総額（注３）	59,384 (9,765)	70,158 (11,537)	68,865 (11,324)	69,043 (11,353)	66,041 (10,860)
発行済株式総数（株）					
クラスＡ（円建・分配型）	-	-	-	-	-
クラスＡ（円建・累積型）	-	-	-	-	-
クラスＡ（米ドル建・分配型）	-	-	-	-	-
クラスＡ（米ドル建・累積型）	-	-	-	-	-
純資産額	59,384 (9,765)	70,158 (11,537)	68,865 (11,324)	69,043 (11,353)	66,041 (10,860)
総資産額	61,059 (10,041)	70,747 (11,634)	68,999 (11,346)	69,498 (11,428)	66,522 (10,939)
１株当たり純資産額					
クラスＡ（円建・分配型）	-	-	-	-	-
クラスＡ（円建・累積型）	-	-	-	-	-
クラスＡ（米ドル建・分配型）	-	-	-	-	-
クラスＡ（米ドル建・累積型）	-	-	-	-	-
１株当たり当期純利益／損失金額（注４）	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a
自己資本比率	97.26%	99.17%	99.81%	99.35%	99.28%
自己資本利益率	5.56%	15.68%	3.85%	0.81%	1.69%

パークレイズ・マルチマネジャー

1. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 1

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

	2021年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第15期中)	2021年 8月31日 に終了した 年度 (第15期)	2022年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第16期中)	2022年 8月31日 に終了した 年度 (第16期)	2023年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第17期中)
営業収益(注1)	121 (20)	1,681 (276)	1,608 (264)	1,536 (253)	548 (90)
経常利益/損失金額(注2)	350 (58)	1,238 (204)	1,805 (297)	1,921 (316)	700 (115)
当期純利益/損失金額	350 (58)	1,238 (204)	1,805 (297)	1,921 (316)	700 (115)
出資総額(注3)	45,189 (7,431)	43,350 (7,128)	39,039 (6,420)	34,145 (5,615)	30,484 (5,013)
発行済株式総数(株)					
クラスA(円建・分配型)	4,500	4,500	4,500	4,500	4,500
クラスA(円建・累積型)	-	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・分配型)	853,701	854,181	793,917	613,014	613,095
クラスA(米ドル建・累積型)	220,362	200,793	208,513	201,206	178,299
純資産額	45,189 (7,431)	43,350 (7,128)	39,039 (6,420)	34,145 (5,615)	30,484 (5,013)
総資産額	47,725 (7,848)	43,726 (7,190)	39,542 (6,502)	35,251 (5,797)	30,872 (5,077)
1株当たり純資産額					
クラスA(円建・分配型)	1,046.091	1,080.641	1,031.120	967.992	924.376
クラスA(円建・累積型)	-	-	-	-	-
クラスA(米ドル建・分配型)	10.439 (1,423)	10.801 (1,473)	10.332 (1,409)	9.782 (1,334)	9.548 (1,302)
クラスA(米ドル建・累積型)	13.176 (1,796)	13.724 (1,871)	13.239 (1,805)	12.656 (1,725)	12.514 (1,706)
1株当たり当期純利益/損失金額(注4)	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a
自己資本比率	94.69%	99.14%	98.73%	96.86%	98.74%
自己資本利益率	0.77%	2.86%	4.62%	5.63%	2.30%

2. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 2

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

	2021年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第15期中)	2021年 8月31日 に終了した 年度 (第15期)	2022年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第16期中)	2022年 8月31日 に終了した 年度 (第16期)	2023年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第17期中)
営業収益（注1）	2,360 (388)	7,573 (1,245)	3,757 (618)	3,939 (648)	980 (161)
経常利益 / 損失金額（注2）	1,681 (276)	6,264 (1,030)	4,349 (715)	5,079 (835)	1,476 (243)
当期純利益 / 損失金額	1,681 (276)	6,264 (1,030)	4,349 (715)	5,079 (835)	1,476 (243)
出資総額（注3）	92,329 (15,183)	90,350 (14,857)	82,098 (13,500)	76,331 (12,552)	67,927 (11,170)
発行済株式総数（株）					
クラスA（円建・分配型）	67,000	67,000	36,000	36,000	36,000
クラスA（円建・累積型）	-	-	-	-	-
クラスA（米ドル建・分配型）	156,061	154,550	156,010	123,768	125,360
クラスA（米ドル建・累積型）	995,497	919,012	902,664	821,349	777,328
純資産額	92,329 (15,183)	90,350 (14,857)	82,098 (13,500)	76,331 (12,552)	67,927 (11,170)
総資産額	97,254 (15,992)	91,272 (15,009)	83,084 (13,662)	78,382 (12,889)	68,696 (11,296)
1株当たり純資産額					
クラスA（円建・分配型）	1,152.210	1,206.760	1,143.598	1,080.494	1,029.670
クラスA（円建・累積型）	-	-	-	-	-
クラスA（米ドル建・分配型）	10.516 (1,434)	11.037 (1,505)	10.478 (1,428)	9.978 (1,360)	9.733 (1,327)
クラスA（米ドル建・累積型）	13.547 (1,847)	14.308 (1,951)	13.707 (1,869)	13.157 (1,794)	12.991 (1,771)
1株当たり当期純利益 / 損失金額（注4）	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a
自己資本比率	94.94%	98.99%	98.81%	97.38%	98.88%
自己資本利益率	1.82%	6.93%	5.30%	6.65%	2.17%

3. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ3

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

	2021年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第15期中)	2021年 8月31日 に終了した 年度 (第15期)	2022年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第16期中)	2022年 8月31日 に終了した 年度 (第16期)	2023年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第17期中)
営業収益（注1）	11,886 (1,955)	33,716 (5,544)	9,933 (1,633)	7,856 (1,292)	1,858 (306)
経常利益 / 損失金額（注2）	10,009 (1,646)	30,054 (4,942)	11,642 (1,914)	11,116 (1,828)	3,173 (522)
当期純利益 / 損失金額	10,009 (1,646)	30,054 (4,942)	11,642 (1,914)	11,116 (1,828)	3,173 (522)
出資総額（注3）	257,991 (42,424)	262,553 (43,174)	244,139 (40,146)	206,437 (33,947)	190,017 (31,246)
発行済株式総数（株）					
クラスA（円建・分配型）	148,000	121,500	117,500	113,500	101,000
クラスA（円建・累積型）	-	-	-	-	-
クラスA（米ドル建・分配型）	1,102,560	1,050,079	1,066,615	533,410	513,065
クラスA（米ドル建・累積型）	1,310,236	1,121,298	1,119,357	990,504	979,776
純資産額	257,991 (42,424)	262,553 (43,174)	244,139 (40,146)	206,437 (33,947)	190,017 (31,246)
総資産額	272,835 (44,865)	264,391 (43,476)	247,615 (40,718)	211,307 (34,747)	192,315 (31,624)
1株当たり純資産額					
クラスA（円建・分配型）	1,210.961	1,298.752	1,231.215	1,184.599	1,134.381
クラスA（円建・累積型）	-	-	-	-	-
クラスA（米ドル建・分配型）	11.893 (1,621)	12.773 (1,741)	12.128 (1,653)	11.763 (1,604)	11.522 (1,571)
クラスA（米ドル建・累積型）	15.041 (2,051)	16.252 (2,216)	15.558 (2,121)	15.190 (2,071)	15.050 (2,052)
1株当たり当期純利益 / 損失金額（注4）	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a
自己資本比率	94.56%	99.30%	98.60%	97.70%	98.81%
自己資本利益率	3.88%	11.45%	4.77%	5.38%	1.67%

４．パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ４

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

	2021年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第15期中)	2021年 8月31日 に終了した 年度 (第15期)	2022年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第16期中)	2022年 8月31日 に終了した 年度 (第16期)	2023年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第17期中)
営業収益（注１）	4,002 (658)	10,922 (1,796)	2,641 (434)	2,009 (330)	112 (18)
経常利益／損失金額（注２）	3,519 (579)	9,964 (1,638)	3,087 (508)	2,860 (470)	450 (74)
当期純利益／損失金額	3,519 (579)	9,964 (1,638)	3,087 (508)	2,860 (470)	450 (74)
出資総額（注３）	63,723 (10,479)	66,472 (10,931)	57,728 (9,493)	51,215 (8,422)	47,869 (7,872)
発行済株式総数（株）					
クラスＡ（円建・分配型）	113,000	113,000	113,000	113,000	113,000
クラスＡ（円建・累積型）	-	-	-	-	-
クラスＡ（米ドル建・分配型）	303,599	303,599	268,749	154,519	154,324
クラスＡ（米ドル建・累積型）	204,390	164,997	139,669	129,066	119,561
純資産額	63,723 (10,479)	66,472 (10,931)	57,728 (9,493)	51,215 (8,422)	47,869 (7,872)
総資産額	67,292 (11,065)	66,822 (10,988)	58,531 (9,625)	51,928 (8,539)	48,566 (7,986)
１株当たり純資産額					
クラスＡ（円建・分配型）	1,372.136	1,513.316	1,441.745	1,414.607	1,378.107
クラスＡ（円建・累積型）	-	-	-	-	-
クラスＡ（米ドル建・分配型）	15.551 (2,120)	17.182 (2,342)	16.387 (2,234)	16.180 (2,206)	16.124 (2,198)
クラスＡ（米ドル建・累積型）	15.753 (2,148)	17.403 (2,373)	16.598 (2,263)	16.386 (2,234)	16.329 (2,226)
１株当たり当期純利益／損失金額（注４）	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a
自己資本比率	94.70%	99.48%	98.63%	98.63%	98.56%
自己資本利益率	5.52%	14.99%	5.35%	5.58%	0.94%

５．パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ５

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

	2021年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第15期中)	2021年 8月31日 に終了した 年度 (第15期)	2022年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第16期中)	2022年 8月31日 に終了した 年度 (第16期)	2023年 2月28日 に終了した 6ヶ月間 (第17期中)
営業収益（注１）	1,835 (302)	4,201 (691)	814 (134)	76 (12)	35 (6)
経常利益／損失金額（注２）	1,636 (269)	3,809 (626)	1,011 (166)	456 (75)	185 (30)
当期純利益／損失金額	1,636 (269)	3,809 (626)	1,011 (166)	456 (75)	185 (30)
出資総額（注３）	19,617 (3,226)	20,692 (3,403)	19,748 (3,247)	17,867 (2,938)	17,005 (2,796)
発行済株式総数（株）					
クラスＡ（円建・分配型）	-	-	-	-	-
クラスＡ（円建・累積型）	-	-	-	-	-
クラスＡ（米ドル建・分配型）	91,154	91,154	291,154	260,955	260,955
クラスＡ（米ドル建・累積型）	24,786	16,922	14,569	14,212	14,212
純資産額	19,617 (3,226)	20,692 (3,403)	19,748 (3,247)	17,867 (2,938)	17,005 (2,796)
総資産額	20,677 (3,400)	20,819 (3,423)	20,064 (3,299)	18,230 (2,998)	17,269 (2,840)
１株当たり純資産額					
クラスＡ（円建・分配型）	-	-	-	-	-
クラスＡ（円建・累積型）	-	-	-	-	-
クラスＡ（米ドル建・分配型）	15.670 (2,136)	17.514 (2,388)	16.708 (2,278)	16.631 (2,267)	16.616 (2,265)
クラスＡ（米ドル建・累積型）	15.681 (2,138)	17.526 (2,389)	16.720 (2,279)	16.643 (2,269)	16.628 (2,267)
１株当たり当期純利益／損失金額（注４）	n/a	n/a	n/a	n/a	n/a
自己資本比率	94.87%	99.39%	98.43%	98.01%	98.47%
自己資本利益率	8.34%	18.41%	5.12%	2.55%	1.09%

(2) 外国投資法人の出資総額

パークレイズ・グローバルベータ

1 パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 1

発行済ファンド証券総数		2023年 3 月末日
クラス A（円建）株式	分配型	118,000.00
	累積型	-
クラス A（米ドル建）株式	分配型	-
	累積型	-

	純資産総額（サブ・ファンド）	
	ボンド	千円
2023年 3 月末日	5,926,726.68	974,591

2 パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 2

発行済ファンド証券総数		2023年 3 月末日
クラス A（円建）株式	分配型	82,500.00
	累積型	-
クラス A（米ドル建）株式	分配型	50,500.00
	累積型	15,209.31

	純資産総額（サブ・ファンド）	
	ボンド	千円
2023年 3 月末日	43,782,444.18	7,199,585

3 パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 3

発行済ファンド証券総数		2023年 3 月末日
クラス A（円建）株式	分配型	146,000.00
	累積型	-
クラス A（米ドル建）株式	分配型	96,000.00
	累積型	20,007.56

	純資産総額（サブ・ファンド）	
	ボンド	千円
2023年 3 月末日	164,388,780.61	27,032,091

4 パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 4

発行済ファンド証券総数		2023年 3 月末日
クラス A（円建）株式	分配型	17,000.00
	累積型	-
クラス A（米ドル建）株式	分配型	3,524.71
	累積型	-

	純資産総額（サブ・ファンド）	
	ボンド	千円
2023年 3 月末日	105,093,445.56	17,281,566

5 パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 5

発行済ファンド証券総数		2023年3月末日
クラスA（円建）株式	分配型	-
	累積型	-
クラスA（米ドル建）株式	分配型	-
	累積型	-

	純資産総額（サブ・ファンド）	
	ポンド	千円
2023年3月末日	63,555,437.52	10,451,056

パークレイズ・マルチマネジャー

1 パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 1

発行済ファンド証券総数		2023年3月末日
クラスA（円建）株式	分配型	4,500.00
	累積型	-
クラスA（米ドル建）株式	分配型	503,113.24
	累積型	178,299.37

	純資産総額（サブ・ファンド）	
	ポンド	千円
2023年3月末日	29,751,771.01	4,892,381

2 パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 2

発行済ファンド証券総数		2023年3月末日
クラスA（円建）株式	分配型	36,000.00
	累積型	-
クラスA（米ドル建）株式	分配型	122,031.19
	累積型	777,327.92

	純資産総額（サブ・ファンド）	
	ポンド	千円
2023年3月末日	67,657,715.26	11,125,635

3 パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 3

発行済ファンド証券総数		2023年3月末日
クラスA（円建）株式	分配型	101,000.00
	累積型	-
クラスA（米ドル建）株式	分配型	512,047.16
	累積型	980,154.20

	純資産総額（サブ・ファンド）	
	ボンド	千円
2023年3月末日	191,144,467.14	31,431,796

4 パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 4

発行済ファンド証券総数		2023年3月末日
クラスA（円建）株式	分配型	113,000.00
	累積型	-
クラスA（米ドル建）株式	分配型	154,323.89
	累積型	119,560.95

	純資産総額（サブ・ファンド）	
	ボンド	千円
2023年3月末日	45,788,169.59	7,529,407

5 パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 5

発行済ファンド証券総数		2023年3月末日
クラスA（円建）株式	分配型	-
	累積型	-
クラスA（米ドル建）株式	分配型	260,955.35
	累積型	14,218.53

	純資産総額（サブ・ファンド）	
	ボンド	千円
2023年3月末日	16,982,891.12	2,792,667

(3) 主要な投資主の状況

2023年3月末日現在、各サブ・ファンドの主要株主（所有株数上位5位）は以下のとおりです。株主の氏名／名称および住所／所在地は、ルクセンブルグの機密保持規則により開示できません。

パークレイズ・グローバルベータ

1．パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ1

	株主 (株主名簿上の 登録形態)	所在国	所有株数 (株)	発行済株式総数	発行済株式総数に 対する 所有比率 (%)
全円建クラス					
	法人	日本	118,000.00	118,000.00	100.00
全米ドル建クラス					
	法人	ルクセンブルグ	226,671.63	226,671.63	100.00

2．パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ2

	株主 (株主名簿上の 登録形態)	所在国	所有株数 (株)	発行済株式総数	発行済株式総数に 対する 所有比率 (%)
全円建クラス					
	法人	日本	82,500.00	82,500.00	100.00
全米ドル建クラス					
1	法人	ルクセンブルグ	145,274.66	334,985.29	43.37
2	法人	ルクセンブルグ	98,880.00		29.52
3	法人	日本	50,500.00		15.08
4	法人	ルクセンブルグ	20,678.21		6.17
5	法人	スペイン	15,209.31		4.54

３．パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ３

	株主 (株主名簿上の 登録形態)	所在国	所有株数 (株)	発行済株式総数	発行済株式総数に 対する 所有比率 (%)
全円建クラス					
	法人	日本	146,000.00	146,000.00	100.00
全米ドル建クラス					
1	法人	ルクセンブルグ	606,082.94	899,319.36	67.39
2	法人	ルクセンブルグ	165,411.53		18.39
3	法人	日本	96,000.00		10.67
4	個人	英国	20,007.56		2.22
5	法人	ルクセンブルグ	10,002.01		1.11

４．パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ４

	株主 (株主名簿上の 登録形態)	所在国	所有株数 (株)	発行済株式総数	発行済株式総数に 対する 所有比率 (%)
全円建クラス					
	法人	日本	17,000.00	17,000.00	100.00
全米ドル建クラス					
1	法人	ルクセンブルグ	256,807.82	398,169.59	64.50
2	法人	ルクセンブルグ	90,740.93		22.79
3	法人	ルクセンブルグ	43,002.29		10.80
4	法人	ルクセンブルグ	4,093.83		1.03
5	法人	スペイン	2,024.71		0.51

５．パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ５

	株主 (株主名簿上の 登録形態)	所在国	所有株数 (株)	発行済株式総数	発行済株式総数に 対する 所有比率 (%)
全米ドル建クラス					
1	法人	ルクセンブルグ	247,569.43	296,131.03	83.60
2	法人	ルクセンブルグ	38,171.58		12.89
3	法人	ルクセンブルグ	7,369.80		2.49
4	法人	英国	3,020.21		1.02

パークレイズ・マルチマネジャー

１．パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ１

	株主 (株主名簿上の 登録形態)	所在国	所有株数 (株)	発行済株式総数	発行済株式総数に 対する 所有比率 (%)
全円建クラス					
	法人	日本	4,500.00	4,500.00	100.00
全米ドル建クラス					
1	法人	日本	440,000.00	768,514.97	57.25
2	法人	スイス	87,102.37		11.33
3	法人	ルクセンブルグ	77,776.06		10.12
4	法人	スペイン	72,741.93		9.47
5	個人	英国	42,606.00		5.54

２．パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ２

	株主 (株主名簿上の 登録形態)	所在国	所有株数 (株)	発行済株式総数	発行済株式総数に 対する 所有比率 (%)
全円建クラス					
	法人	日本	36,000.00	36,000.00	100.00
全米ドル建クラス					
1	法人	ルクセンブルグ	721,693.55	1,087,391.34	66.37
2	法人	ルクセンブルグ	129,129.68		11.88
3	法人	スペイン	40,706.38		3.74
4	法人	ルクセンブルグ	37,398.73		3.44
5	法人	ルクセンブルグ	30,971.31		2.85

３．パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ３

	株主 (株主名簿上の 登録形態)	所在国	所有株数 (株)	発行済株式総数	発行済株式総数に 対する 所有比率 (%)
全円建クラス					
	法人	日本	101,000.00	101,000.00	100.00
全米ドル建クラス					
1	法人	ルクセンブルグ	835,355.26	2,765,305.64	30.21
2	法人	ルクセンブルグ	809,129.92		29.26
3	法人	ルクセンブルグ	144,722.64		5.23
4	法人	スイス	116,114.67		4.20
5	法人	スペイン	91,115.00		3.29

４．パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ４

	株主 (株主名簿上の 登録形態)	所在国	所有株数 (株)	発行済株式総数	発行済株式総数に 対する 所有比率 (%)
全円建クラス					
	法人	日本	113,000.00	113,000.00	100.00
全米ドル建クラス					
1	法人	ルクセンブルグ	90,315.40	359,582.15	25.12
2	法人	ルクセンブルグ	65,629.04		18.25
3	法人	日本	58,000.00		16.13
4	個人	南アフリカ	38,351.62		10.67
5	法人	スペイン	24,416.77		6.79

５．パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ５

	株主 (株主名簿上の 登録形態)	所在国	所有株数 (株)	発行済株式総数	発行済株式総数に 対する 所有比率 (%)
全米ドル建クラス					
1	法人	日本	237,000.00	285,647.11	82.97
2	個人	英国	23,612.13		8.27
3	法人	ルクセンブルグ	14,218.53		4.98
4	法人	ルクセンブルグ	10,473.22		3.67
5	法人	ルクセンブルグ	343.22		0.12

(4) 役員の状況

ファンドの取締役は、以下のとおりです。

(2023年 5 月末日現在)

氏名	役職名	主要略歴
フローレンス・ステイナー (Florence Stainier)	取締役	ルクセンブルグのアーレント・アンド・メーデルナッハ法律事務所の投資管理業務のパートナー弁護士。リエージュ大学（ベルギー）で法学の修士号を取得し、HECリエージュ（ベルギー）で税務の修士号を取得。2004年にルクセンブルグの弁護士資格を取得。特にMiFID、流通、イスラム金融およびUCITSに関連するルクセンブルグファンド協会（ALFI）の複数のワーキンググループのメンバーである。ルクセンブルグコンプライアンスオフィサー協会（ALCO）のメンバーでもある。
トーマス・ニューマー (Thomas Nummer)	取締役	トーマス・ニューマー氏はルクセンブルグに居住し、元投資マネージャーとして、および独立社外取締役としての経験を有している。彼は、数多くのルクセンブルグおよびケイマンファンドのディレクターに任命され、金融業界において、20年以上の経験を有している。彼は、UCITSおよびオルタナティブ投資ファンドに関して、投資コンプライアンスおよびリスク・マネジメントの専門知識を有する、経験豊富なリスク・マネージャーである。
ニコラス・オドノーグ (Nicholas O ' Donoghue)	取締役	パークレイズ・バンク・ユーケー・ピーエルシーの取締役およびファンド部長。 金融業界での経験は16年以上に及び、ウェルス運用業務および投資銀行業務を網羅する。 英国在住。

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

(5) その他

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

[次へ](#)

2 外国投資法人の運用状況

(1) 投資状況

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

(2023年 3 月末日現在)

投資資産の種類	国 / 地域	時 価 (ポンド)	投資比率 (%)
			対資産総額
投資信託 / 投資法人	アイルランド	5,793,304.54	95.72
	ルクセンブルグ	168,092.86	2.78
	小 計	5,961,397.40	98.50
その他資産 (現金およびデリバティブポジション)		90,665.53	1.50
資 産 総 額		6,052,062.93	100.00
負 債 総 額		125,336.25	2.07
純 資 産 総 額		5,926,726.68 (約975百万円)	97.93

2 . パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 2

(2023年 3 月末日現在)

投資資産の種類	国 / 地域	時 価 (ポンド)	投資比率 (%)
			対資産総額
投資信託 / 投資法人	アイルランド	42,094,486.51	95.14
	ルクセンブルグ	1,433,033.65	3.24
	小 計	43,527,520.16	98.38
その他資産 (現金およびデリバティブポジション)		717,779.12	1.62
資 産 総 額		44,245,299.28	100.00
負 債 総 額		462,855.10	1.05
純 資 産 総 額		43,782,444.18 (約7,200百万円)	98.95

3. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 3

（2023年3月末日現在）

投資資産の種類	国 / 地域	時 価 (ポンド)	投資比率(%)
			対資産総額
投資信託 / 投資法人	アイルランド	158,094,994.44	94.94
	ルクセンブルグ	5,311,624.40	3.19
	小 計	163,406,618.84	98.13
その他資産 (現金およびデリバティブポジション)		3,115,108.68	1.87
資 産 総 額		166,521,727.52	100.00
負 債 総 額		2,132,946.91	1.28
純 資 産 総 額		164,388,780.61 (約27,032百万円)	98.72

4. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 4

（2023年3月末日現在）

投資資産の種類	国 / 地域	時 価 (ポンド)	投資比率(%)
			対資産総額
投資信託 / 投資法人	アイルランド	101,648,854.58	95.84
	ルクセンブルグ	2,774,554.53	2.62
	小 計	104,423,409.11	98.46
その他資産 (現金およびデリバティブポジション)		1,634,271.34	1.54
資 産 総 額		106,057,680.45	100.00
負 債 総 額		964,234.89	0.91
純 資 産 総 額		105,093,445.56 (約17,282百万円)	99.09

5. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ5

（2023年3月末日現在）

投資資産の種類	国／地域	時 価 (ポンド)	投資比率(%)
			対資産総額
投資信託／投資法人	アイルランド	63,082,063.29	94.49
	ルクセンブルグ	868,416.71	1.30
	小 計	63,950,480.00	95.79
その他資産 (現金およびデリバティブポジション)		2,810,876.18	4.21
資 産 総 額		66,761,356.18	100.00
負 債 総 額		3,205,918.66	4.80
純 資 産 総 額		63,555,437.52 (約10,451百万円)	95.20

パークレイズ・マルチマネジャー

1. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ1

（2023年3月末日現在）

投資資産の種類	国／地域	時 価 (ポンド)	投資比率(%)
			対資産総額
投資信託／投資法人	アイルランド	28,578,238.03	91.45
	ルクセンブルグ	251,667.59	0.81
	小 計	28,829,905.62	92.25
その他資産 (現金およびデリバティブポジション)		2,421,443.49	7.75
資 産 総 額		31,251,349.11	100.00
負 債 総 額		1,499,578.10	4.80
純 資 産 総 額		29,751,771.01 (約4,892百万円)	95.20

２．パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ２

(2023年 3 月末日現在)

投資資産の種類	国 / 地域	時 価 (ポンド)	投資比率 (%)
			対資産総額
投資信託 / 投資法人	アイルランド	62,479,105.90	86.62
	英国	3,397,654.86	4.71
	ルクセンブルグ	576,186.32	0.80
	小 計	66,452,947.08	92.13
その他資産 (現金およびデリバティブポジション)		5,677,319.57	7.87
資 産 総 額		72,130,266.65	100.00
負 債 総 額		4,472,551.39	6.20
純 資 産 総 額		67,657,715.26 (約11,126百万円)	93.80

３．パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ３

(2023年 3 月末日現在)

投資資産の種類	国 / 地域	時 価 (ポンド)	投資比率 (%)
			対資産総額
投資信託 / 投資法人	アイルランド	175,331,310.62	87.17
	ルクセンブルグ	1,576,233.83	0.78
	小 計	176,907,544.45	87.95
その他資産 (現金およびデリバティブポジション)		24,232,691.10	12.05
資 産 総 額		201,140,235.55	100.00
負 債 総 額		9,995,768.41	4.97
純 資 産 総 額		191,144,467.14 (約31,432百万円)	95.03

4. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 4

(2023年3月末日現在)

投資資産の種類	国 / 地域	時 価 (ポンド)	投資比率(%)
			対資産総額
投資信託 / 投資法人	アイルランド	38,828,849.20	77.11
	ルクセンブルグ	4,568,887.85	9.07
	小 計	43,397,737.05	86.18
その他資産 (現金およびデリバティブポジション)		6,957,675.22	13.82
資 産 総 額		50,355,412.27	100.00
負 債 総 額		4,567,242.68	9.07
純 資 産 総 額		45,788,169.59 (約7,529百万円)	90.93

5. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 5

(2023年3月末日現在)

投資資産の種類	国 / 地域	時 価 (ポンド)	投資比率(%)
			対資産総額
投資信託 / 投資法人	アイルランド	13,406,597.56	74.43
	ルクセンブルグ	2,542,753.47	14.12
	小 計	15,949,351.03	88.54
その他資産 (現金およびデリバティブポジション)		2,063,394.07	11.46
資 産 総 額		18,012,745.10	100.00
負 債 総 額		1,029,853.98	5.72
純 資 産 総 額		16,982,891.12 (約2,793百万円)	94.28

[次へ](#)

（２）運用実績

純資産等の推移

2023年３月末日前１年間における各月末の純資産等の推移は以下のとおりです。

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

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

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

2023年３月末日現在、以下のクラスの株式は運用されておりません。

各サブ・ファンドのクラスＡ（円建・累積型）株式

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

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

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

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

パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ４のクラスＡ（米ドル建・累積型）株式

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

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

パークレイズ・グローバルベータ

1. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 1

	資産総額		純資産総額		1株当たり純資産価格（クラスA株式）					
					円建		米ドル建			
					分配型	累積型	分配型		累積型	
	千ポンド	百万円	千ポンド	百万円	円	円	米ドル	円	米ドル	円
2022年4月末日	6,794	1,117	6,661	1,095	1,011.219	-	-	-	14.840	2,023
2022年5月末日	6,751	1,110	6,626	1,090	1,006.759	-	-	-	14.798	2,017
2022年6月末日	6,723	1,106	6,584	1,083	973.411	-	-	-	14.343	1,955
2022年7月末日	7,095	1,167	6,772	1,114	1,002.087	-	-	-	14.821	2,021
2022年8月末日	7,050	1,159	6,808	1,120	981.905	-	-	-	14.561	1,985
2022年9月末日	6,806	1,119	6,617	1,088	938.349	-	-	-	-	-
2022年10月末日	6,605	1,086	6,336	1,042	931.520	-	-	-	-	-
2022年11月末日	6,137	1,009	5,954	979	954.441	-	-	-	-	-
2022年12月末日	5,968	981	5,885	968	937.560	-	-	-	-	-
2023年1月末日	6,107	1,004	5,960	980	955.440	-	-	-	-	-
2023年2月末日	5,979	983	5,865	964	932.453	-	-	-	-	-
2023年3月末日	6,052	995	5,927	975	945.446	-	-	-	-	-

（注）パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ1、クラスA（米ドル建）株式（累積型）は2022年9月16日付で、運用が停止され、2023年3月末日現在、運用されていない。

２．パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ２

	資産総額		純資産総額		１株当たり純資産価格（クラスＡ株式）					
					円建		米ドル建			
					分配型	累積型	分配型		累積型	
	千ポンド	百万円	千ポンド	百万円	円	円	米ドル	円	米ドル	円
2022年４月末日	49,191	8,089	48,422	7,963	1,063.338	-	14.495	1,976	17.509	2,387
2022年５月末日	48,735	8,014	48,409	7,960	1,059.769	-	14.454	1,971	17.458	2,380
2022年６月末日	47,634	7,833	46,850	7,704	1,016.890	-	13.900	1,895	16.844	2,296
2022年７月末日	49,695	8,172	48,008	7,894	1,052.105	-	14.420	1,966	17.474	2,382
2022年８月末日	49,282	8,104	48,106	7,911	1,037.841	-	14.246	1,942	17.264	2,354
2022年９月末日	46,237	7,603	45,249	7,441	980.658	-	13.519	1,843	16.484	2,247
2022年10月末日	45,311	7,451	44,172	7,264	978.826	-	13.534	1,845	16.502	2,250
2022年11月末日	45,806	7,532	44,878	7,380	1,010.507	-	14.020	1,911	17.095	2,331
2022年12月末日	44,212	7,270	43,719	7,189	982.682	-	13.711	1,869	16.807	2,291
2023年１月末日	45,463	7,476	44,615	7,336	1,007.243	-	14.118	1,925	17.307	2,359
2023年２月末日	44,066	7,246	43,281	7,117	983.577	-	13.849	1,888	16.976	2,314
2023年３月末日	44,245	7,276	43,782	7,200	990.857	-	14.016	1,911	17.298	2,358

3. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ3

	資産総額		純資産総額		1株当たり純資産価格（クラスA株式）					
					円建		米ドル建			
					分配型	累積型	分配型		累積型	
	千ポンド	百万円	千ポンド	百万円	円	円	米ドル	円	米ドル	円
2022年4月末日	181,189	29,795	179,238	29,474	1,210.140	-	14.006	1,909	17.753	2,420
2022年5月末日	179,895	29,582	178,771	29,397	1,207.670	-	13.983	1,906	17.725	2,416
2022年6月末日	173,200	28,481	170,577	28,050	1,151.343	-	13.351	1,820	16.980	2,315
2022年7月末日	184,182	30,287	177,543	29,195	1,199.696	-	13.940	1,900	17.729	2,417
2022年8月末日	180,528	29,686	177,251	29,147	1,192.554	-	13.881	1,892	17.654	2,407
2022年9月末日	170,349	28,012	167,767	27,588	1,121.336	-	13.105	1,787	16.766	2,286
2022年10月末日	170,496	28,036	167,607	27,561	1,123.750	-	13.172	1,796	16.852	2,297
2022年11月末日	176,159	28,968	173,315	28,500	1,168.007	-	13.740	1,873	17.578	2,396
2022年12月末日	167,488	27,542	166,630	27,401	1,126.993	-	13.329	1,817	17.152	2,338
2023年1月末日	173,132	28,470	171,151	28,144	1,162.369	-	13.809	1,883	17.769	2,422
2023年2月末日	167,775	27,589	165,629	27,236	1,135.724	-	13.551	1,847	17.437	2,377
2023年3月末日	166,522	27,383	164,389	27,032	1,143.586	-	13.704	1,868	17.734	2,418

4. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 4

	資産総額		純資産総額		1株当たり純資産価格（クラスA株式）					
					円建		米ドル建			
					分配型	累積型	分配型		累積型	
	千ポンド	百万円	千ポンド	百万円	円	円	米ドル	円	米ドル	円
2022年4月末日	112,871	18,561	111,463	18,329	1,610.238	-	19.495	2,658	-	-
2022年5月末日	110,667	18,198	110,107	18,106	1,609.095	-	19.477	2,655	-	-
2022年6月末日	106,439	17,503	105,631	17,370	1,533.384	-	18.571	2,532	-	-
2022年7月末日	116,070	19,087	112,037	18,423	1,606.564	-	19.510	2,660	-	-
2022年8月末日	114,997	18,910	113,818	18,716	1,608.335	-	19.567	2,668	-	-
2022年9月末日	108,420	17,829	107,388	17,659	1,510.401	-	18.451	2,515	-	-
2022年10月末日	111,610	18,353	109,097	17,940	1,519.570	-	18.619	2,538	-	-
2022年11月末日	114,914	18,896	113,884	18,727	1,588.590	-	19.536	2,663	-	-
2022年12月末日	110,559	18,180	110,207	18,122	1,530.780	-	18.923	2,580	-	-
2023年1月末日	115,945	19,066	113,890	18,728	1,587.172	-	19.720	2,688	-	-
2023年2月末日	108,635	17,864	106,650	17,538	1,550.654	-	19.340	2,637	-	-
2023年3月末日	106,058	17,440	105,093	17,281	1,559.917	-	19.549	2,665	-	-

5 . パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 5

	資産総額		純資産総額		1株当たり純資産価格（クラスA株式）					
					円建		米ドル建			
					分配型	累積型	分配型		累積型	
	千ポンド	百万円	千ポンド	百万円	円	円	米ドル	円	米ドル	円
2022年4月末日	69,204	11,380	68,988	11,344	-	-	-	-	-	-
2022年5月末日	69,401	11,412	69,054	11,355	-	-	-	-	-	-
2022年6月末日	66,493	10,934	65,227	10,726	-	-	-	-	-	-
2022年7月末日	70,594	11,608	68,226	11,219	-	-	-	-	-	-
2022年8月末日	69,498	11,428	69,043	11,353	-	-	-	-	-	-
2022年9月末日	65,562	10,781	65,155	10,714	-	-	-	-	-	-
2022年10月末日	65,564	10,781	65,073	10,701	-	-	-	-	-	-
2022年11月末日	67,951	11,174	67,495	11,099	-	-	-	-	-	-
2022年12月末日	65,332	10,743	65,137	10,711	-	-	-	-	-	-
2023年1月末日	67,799	11,149	67,450	11,091	-	-	-	-	-	-
2023年2月末日	66,522	10,939	66,041	10,860	-	-	-	-	-	-
2023年3月末日	66,761	10,978	63,555	10,451	-	-	-	-	-	-

パークレイズ・マルチマネジャー

1. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 1

	資産総額		純資産総額		1株当たり純資産価格（クラスA株式）					
					円建		米ドル建			
					分配型	累積型	分配型		累積型	
	千ポンド	百万円	千ポンド	百万円	円	円	米ドル	円	米ドル	円
2022年4月末日	38,386	6,312	37,508	6,168	994.869	-	9.988	1,362	12.831	1,749
2022年5月末日	38,006	6,250	37,400	6,150	990.086	-	9.948	1,356	12.797	1,745
2022年6月末日	37,414	6,152	36,613	6,021	957.609	-	9.640	1,314	12.426	1,694
2022年7月末日	34,579	5,686	34,025	5,595	984.648	-	9.935	1,354	12.830	1,749
2022年8月末日	35,251	5,797	34,145	5,615	967.992	-	9.782	1,334	12.656	1,725
2022年9月末日	33,899	5,574	33,138	5,449	926.390	-	9.392	1,280	12.179	1,660
2022年10月末日	32,597	5,360	31,831	5,234	921.955	-	9.375	1,278	12.180	1,660
2022年11月末日	33,213	5,462	32,410	5,330	944.060	-	9.630	1,313	12.539	1,709
2022年12月末日	32,359	5,321	31,952	5,254	928.589	-	9.517	1,297	12.428	1,694
2023年1月末日	31,556	5,189	31,221	5,134	945.700	-	9.732	1,327	12.729	1,735
2023年2月末日	30,872	5,077	30,484	5,013	924.376	-	9.548	1,302	12.514	1,706
2023年3月末日	31,251	5,139	29,752	4,892	933.405	-	9.691	1,321	12.739	1,737

2. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 2

	資産総額		純資産総額		1株当たり純資産価格（クラスA株式）					
					円建		米ドル建			
					分配型	累積型	分配型		累積型	
	千ポンド	百万円	千ポンド	百万円	円	円	米ドル	円	米ドル	円
2022年4月末日	80,866	13,298	79,131	13,012	1,103.592	-	10.125	1,380	13.292	1,812
2022年5月末日	79,420	13,060	78,051	12,835	1,102.282	-	10.115	1,379	13.279	1,810
2022年6月末日	76,355	12,556	74,557	12,260	1,056.057	-	9.713	1,324	12.808	1,746
2022年7月末日	76,746	12,620	75,654	12,441	1,093.029	-	10.079	1,374	13.290	1,812
2022年8月末日	78,382	12,889	76,331	12,552	1,080.494	-	9.978	1,360	13.157	1,794
2022年9月末日	74,803	12,301	72,762	11,965	1,022.392	-	9.480	1,292	12.575	1,714
2022年10月末日	72,782	11,968	70,996	11,675	1,020.089	-	9.487	1,293	12.584	1,716
2022年11月末日	73,642	12,110	72,545	11,929	1,053.765	-	9.836	1,341	13.047	1,779
2022年12月末日	72,111	11,858	71,180	11,705	1,027.690	-	9.636	1,314	12.861	1,753
2023年1月末日	72,566	11,933	71,903	11,824	1,053.424	-	9.919	1,352	13.240	1,805
2023年2月末日	68,696	11,296	67,927	11,170	1,029.670	-	9.733	1,327	12.991	1,771
2023年3月末日	72,130	11,861	67,658	11,126	1,034.791	-	9.829	1,340	13.191	1,798

3. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ3

	資産総額		純資産総額		1株当たり純資産価格（クラスA株式）					
					円建		米ドル建			
					分配型	累積型	分配型		累積型	
	千ポンド	百万円	千ポンド	百万円	円	円	米ドル	円	米ドル	円
2022年4月末日	242,129	39,816	238,155	39,162	1,196.601	-	11.804	1,609	15.190	2,071
2022年5月末日	240,351	39,523	232,539	38,239	1,196.623	-	11.809	1,610	15.195	2,072
2022年6月末日	225,166	37,026	221,563	36,434	1,140.154	-	11.277	1,537	14.564	1,986
2022年7月末日	208,379	34,266	205,403	33,776	1,190.361	-	11.801	1,609	15.239	2,078
2022年8月末日	211,307	34,747	206,437	33,947	1,184.599	-	11.763	1,604	15.190	2,071
2022年9月末日	197,450	32,469	194,413	31,969	1,115.353	-	11.117	1,516	14.437	1,968
2022年10月末日	195,589	32,163	189,920	31,230	1,116.927	-	11.168	1,523	14.504	1,977
2022年11月末日	210,487	34,612	196,445	32,303	1,161.937	-	11.656	1,589	15.138	2,064
2022年12月末日	194,031	31,906	191,999	31,572	1,126.345	-	11.345	1,547	14.818	2,020
2023年1月末日	198,599	32,658	197,172	32,423	1,162.213	-	11.757	1,603	15.357	2,094
2023年2月末日	192,315	31,624	190,017	31,246	1,134.381	-	11.522	1,571	15.050	2,052
2023年3月末日	201,140	33,075	191,144	31,432	1,139.894	-	11.633	1,586	15.266	2,081

4．パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ4

	資産総額		純資産総額		1株当たり純資産価格（クラスA株式）					
					円建		米ドル建			
					分配型	累積型	分配型		累積型	
	千ポンド	百万円	千ポンド	百万円	円	円	米ドル	円	米ドル	円
2022年4月末日	57,107	9,391	56,492	9,290	1,411.492	-	16.054	2,189	16.260	2,217
2022年5月末日	57,225	9,410	56,568	9,302	1,413.591	-	16.083	2,193	16.290	2,221
2022年6月末日	54,661	8,988	54,003	8,880	1,343.963	-	15.314	2,088	15.511	2,115
2022年7月末日	51,578	8,481	50,928	8,375	1,414.979	-	16.159	2,203	16.364	2,231
2022年8月末日	51,928	8,539	51,215	8,422	1,414.607	-	16.180	2,206	16.385	2,234
2022年9月末日	49,123	8,078	48,371	7,954	1,331.058	-	15.274	2,082	15.468	2,109
2022年10月末日	48,294	7,941	47,117	7,748	1,337.057	-	15.392	2,098	15.587	2,125
2022年11月末日	52,167	8,578	49,228	8,095	1,399.070	-	16.162	2,203	16.368	2,231
2022年12月末日	48,068	7,904	47,694	7,843	1,355.414	-	15.729	2,144	15.929	2,172
2023年1月末日	49,345	8,114	49,012	8,060	1,409.042	-	16.428	2,240	16.637	2,268
2023年2月末日	48,566	7,986	47,869	7,872	1,378.107	-	16.124	2,198	16.329	2,226
2023年3月末日	50,355	8,280	45,788	7,529	1,387.369	-	16.303	2,223	16.510	2,251

5 . パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 5

	資産総額		純資産総額		1株当たり純資産価格（クラスA株式）					
					円建		米ドル建			
					分配型	累積型	分配型		累積型	
	千ボンド	百万円	千ボンド	百万円	円	円	米ドル	円	米ドル	円
2022年4月末日	19,969	3,284	19,774	3,252	-	-	16.649	2,270	16.661	2,271
2022年5月末日	19,370	3,185	19,054	3,133	-	-	16.462	2,244	16.474	2,246
2022年6月末日	18,457	3,035	18,269	3,004	-	-	15.645	2,133	15.656	2,134
2022年7月末日	18,318	3,012	17,955	2,953	-	-	16.570	2,259	16.582	2,261
2022年8月末日	18,230	2,998	17,867	2,938	-	-	16.631	2,267	16.643	2,269
2022年9月末日	17,363	2,855	16,748	2,754	-	-	15.662	2,135	15.674	2,137
2022年10月末日	17,193	2,827	16,619	2,733	-	-	15.792	2,153	15.803	2,154
2022年11月末日	18,704	3,076	17,320	2,848	-	-	16.626	2,267	16.638	2,268
2022年12月末日	16,920	2,782	16,768	2,757	-	-	16.113	2,197	16.124	2,198
2023年1月末日	17,491	2,876	17,332	2,850	-	-	16.893	2,303	16.905	2,305
2023年2月末日	17,269	2,840	17,005	2,796	-	-	16.616	2,265	16.628	2,267
2023年3月末日	18,013	2,962	16,983	2,793	-	-	16.775	2,287	16.787	2,289

[次へ](#)

分配の推移

2023年3月末日前1年間における分配型クラスの分配の推移は以下のとおりです。累積型クラスについては、分配は行われず、投資収益および発生利益は留保され、再投資されます。

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

クラスA株式（分配型）

	1株当たり分配金		
	円建（円）	米ドル建	
		米ドル	円
自 2022年4月1日 至 2023年3月31日	18.893454	-	-

2．パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ2

クラスA株式（分配型）

	1株当たり分配金		
	円建（円）	米ドル建	
		米ドル	円
自 2022年4月1日 至 2023年3月31日	22.762992	0.305255	42

3．パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ3

クラスA株式（分配型）

	1株当たり分配金		
	円建（円）	米ドル建	
		米ドル	円
自 2022年4月1日 至 2023年3月31日	25.176745	0.286502	39

４．パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ４

クラスＡ株式（分配型）

	１株当たり分配金		
	円建（円）	米ドル建	
		米ドル	円
自 2022年４月１日 至 2023年３月31日	9.661705	0.111316	15

５．パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ５

クラスＡ株式（分配型）

	１株当たり分配金		
	円建（円）	米ドル建	
		米ドル	円
自 2022年４月１日 至 2023年３月31日	-	-	-

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

クラスＡ株式（分配型）

	１株当たり分配金		
	円建（円）	米ドル建	
		米ドル	円
自 2022年４月１日 至 2023年３月31日	23.696395	0.235765	32

２．パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ２

クラスＡ株式（分配型）

	１株当たり分配金		
	円建（円）	米ドル建	
		米ドル	円
自 2022年４月１日 至 2023年３月31日	24.114026	0.216772	30

３．パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 3

クラス A 株式（分配型）

	1 株当たり分配金		
	円建（円）	米ドル建	
		米ドル	円
自 2022年 4 月 1 日 至 2023年 3 月31日	23.850080	0.230152	31

４．パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 4

クラス A 株式（分配型）

	1 株当たり分配金		
	円建（円）	米ドル建	
		米ドル	円
自 2022年 4 月 1 日 至 2023年 3 月31日	-	-	-

５．パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 5

クラス A 株式（分配型）

	1 株当たり分配金		
	円建（円）	米ドル建	
		米ドル	円
自 2022年 4 月 1 日 至 2023年 3 月31日	-	-	-

自己資本利益率（収益率）の推移

2023年3月末日前1年間における収益率は以下のとおりです。

（注）収益率（％）＝ $100 \times (a - b) / b$

a＝2023年3月末日現在の1株当たり純資産価格（2023年3月末日前1年間の分配金の合計額を加えた額）

b＝2022年3月末日現在の1株当たり純資産価格（分配落の額）

パークレイズ・グローバルベータ

1．パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ1

計算期間	収益率（クラスA株式）			
	円建		米ドル建	
	分配型 （％）	累積型 （％）	分配型 （％）	累積型 （％）
自 2022年4月1日 至 2023年3月31日	- 7.43	-	-	-

2．パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ2

計算期間	収益率（クラスA株式）			
	円建		米ドル建	
	分配型 （％）	累積型 （％）	分配型 （％）	累積型 （％）
自 2022年4月1日 至 2023年3月31日	- 7.49	-	- 4.01	- 4.03

3．パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ3

計算期間	収益率（クラスA株式）			
	円建		米ドル建	
	分配型 （％）	累積型 （％）	分配型 （％）	累積型 （％）
自 2022年4月1日 至 2023年3月31日	- 6.39	-	- 3.17	- 3.19

4．パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ4

計算期間	収益率（クラスA株式）			
	円建		米ドル建	
	分配型 （％）	累積型 （％）	分配型 （％）	累積型 （％）
自 2022年4月1日 至 2023年3月31日	- 5.57	-	- 2.23	-

5. パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ5

計算期間	収益率（クラスA株式）			
	円建		米ドル建	
	分配型 （％）	累積型 （％）	分配型 （％）	累積型 （％）
自 2022年4月1日 至 2023年3月31日	-	-	-	-

パークレイズ・マルチマネジャー

1. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ1

計算期間	収益率（クラスA株式）			
	円建		米ドル建	
	分配型 （％）	累積型 （％）	分配型 （％）	累積型 （％）
自 2022年4月1日 至 2023年3月31日	- 6.27	-	- 3.09	- 3.06

2. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ2

計算期間	収益率（クラスA株式）			
	円建		米ドル建	
	分配型 （％）	累積型 （％）	分配型 （％）	累積型 （％）
自 2022年4月1日 至 2023年3月31日	- 6.55	-	- 3.34	- 3.31

3. パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ3

計算期間	収益率（クラスA株式）			
	円建		米ドル建	
	分配型 （％）	累積型 （％）	分配型 （％）	累積型 （％）
自 2022年4月1日 至 2023年3月31日	- 5.42	-	- 2.22	- 2.22

４．パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ４

計算期間	収益率（クラスＡ株式）			
	円建		米ドル建	
	分配型 （％）	累積型 （％）	分配型 （％）	累積型 （％）
自 2022年４月１日 至 2023年３月31日	- 4.73	-	- 1.53	- 1.54

５．パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ５

計算期間	収益率（クラスＡ株式）			
	円建		米ドル建	
	分配型 （％）	累積型 （％）	分配型 （％）	累積型 （％）
自 2022年４月１日 至 2023年３月31日	-	-	- 1.13	- 1.12

（３）投資リスク

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

[次へ](#)

3 資産運用会社の概況

投資運用会社

(1) 名称及び資本金の額

名称

パークレイズ・インベストメント・ソリューションズ・リミテッド

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

資本金の額

2021年12月末日現在の資本金は、22,325,001ポンド（約37億円）

(2) 大株主の状況

(2021年12月末日現在)

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

(3) 役員の状況

(2023年 3 月末日現在)

氏名	役職名	主要略歴	
マイケル・ジェリー (Michael Jary)	取締役会長 取締役	2018年 1 月 1 日	バークレイズ・バンク・ユーケー・ピーエルシー (BARCLAYS BANK UK PLC) 取締役
		2018年 3 月 1 日	バークレイズ・インベストメント・ソリューションズ・リミテッド (BARCLAYS INVESTMENT SOLUTIONS LIMITED) 取締役
アンドリュー・ラトクリフ (Andrew Ratcliffe)	取締役	2018年 1 月 1 日	バークレイズ・バンク・ユーケー・ピーエルシー (BARCLAYS BANK UK PLC) 取締役
		2018年 3 月 1 日	バークレイズ・インベストメント・ソリューションズ・リミテッド (BARCLAYS INVESTMENT SOLUTIONS LIMITED) 取締役
ジェームズ・マック (James Mack)	取締役	2020年 6 月 5 日	バークレイズ・インベストメント・ソリューションズ・リミテッド (BARCLAYS INVESTMENT SOLUTIONS LIMITED) 取締役
キャサリン・アン・マシュー (Kathryn Ann Matthews)	取締役	2018年 2 月19日	バークレイズ・バンク・ユーケー・ピーエルシー (BARCLAYS BANK UK PLC) 取締役
		2018年10月25日	バークレイズ・インベストメント・ソリューションズ・リミテッド (BARCLAYS INVESTMENT SOLUTIONS LIMITED) 取締役
ニコラ・エガース (Nicola Eggers)	取締役	2022年 3 月17日	バークレイズ・インベストメント・ソリューションズ・リミテッド (BARCLAYS INVESTMENT SOLUTIONS LIMITED) 取締役

(注) 2023年 3 月末日現在、バークレイズ・インベストメント・ソリューションズ・リミテッドの株式を保有している取締役はいません。

(4) 事業の内容及び営業の概況

2023年3月末日現在、パークレイズ・インベストメント・ソリューションズ・リミテッドにより運用されている主要な投資法人（純資産総額上位5位）は以下のとおりです。

（2023年3月末日現在）

	名 称	基本的性格	設立年月日	純資産総額 (英ポンド)	1株当たり 純資産価格 (英ポンド)
1	パークレイズ・マルチマネージャー・ファンド(UK) - パークレイズ・ユーケー・アルファ・ファンド (Barclays Multi-Manager Fund (UK) - Barclays UK Alpha Fund)	オープンエンド型 / アンブレラ型 / 変動資本型投資法人	2005年12月8日	786,368,913.84	5.876 (クラスR / 累積型)
2	パークレイズ・マルチマネージャー・ファンドplc - グローバルアクセス・エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド (Barclays Multi-Manager Fund plc - GlobalAccess Emerging Market Equity Fund)	オープンエンド型 / アンブレラ型 / 変動資本型投資法人	2007年8月29日	422,484,201.61	0.696 (クラスI / 累積型)
3	パークレイズ・マルチマネージャー・ファンドplc - グローバルアクセス・グローバル・ハイ・イールド・ボンド・ファンド (Barclays Multi-Manager Fund plc - GlobalAccess Global High Yield Bond Fund)	オープンエンド型 / アンブレラ型 / 変動資本型投資法人	2007年11月27日	408,319,366.06	0.606 (クラスI / 分配型)
4	パークレイズ マルチマネージャー・ファンドplc - グローバルアクセス・グローバル・コーポレート・ボンド・ファンド (Barclays Multi-Manager Fund plc - GlobalAccess Global Corporate Bond Fund)	オープンエンド型 / アンブレラ型 / 変動資本型投資法人	2007年12月4日	380,281,614.34	0.609 (クラスI / 分配型)
5	パークレイズ マルチマネージャー・ファンドplc - グローバルアクセス ユーケー・オポチュニティーズ・ファンド (Barclays Multi-Manager Fund plc - GlobalAccess UK Opportunities Fund)	オープンエンド型 / アンブレラ型 / 変動資本型投資法人	2004年10月1日	334,391,100.38	4.093 (クラスI / 累積型)

（１）名称及び資本金の額

名称

ブラックロック・インベストメント・マネジメント（UK）リミテッド

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

資本金の額

2021年12月末日現在、払込済株式資本94.5百万ポンド（約155億円）および資本剰余準備金100百万ポンド（約164億円）。

出典：ブラックロック 監査済2021年次報告書

（２）大株主の状況

副投資運用会社の大株主は以下のとおりです。

（2022年12月末日現在）

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

出典：ブラックロック。2022年12月31日現在。変更される可能性があります。

（３）役員の状況

副投資運用会社の役員は以下のとおりです。

（2023年1月末日現在）

氏 名	役 職	主要略歴
ジャスティン・アンダーソン （Justine Anderson）	業務執行取締役 最高執行責任者	2022年7月5日に就任。
ステファン・コーヘン （Stephen Cohen）	業務執行取締役 最高経営責任者	2021年4月15日に就任。
ニコラス・チャリントン （Nicholas Charrington）	非業務執行取締役 会長	2004年3月25日に現職に就任。
クリスチャン・クローセン （Christian Clausen）	非業務執行取締役	2018年9月5日に現職に就任。
マーガレット・ヤング （Margaret Young）	非業務執行取締役	2014年9月9日に現職に就任。
エレノア・ド・フライタ （Eleanor de Freitas）	非業務執行取締役	2014年4月3日に現職に就任。
デボラ・クラーク （Deborah Clarke）	非業務執行取締役	2021年7月21日に現職に就任。
マティウ・ダンカン （Matthieu Duncan）	非業務執行取締役	2021年7月21日に現職に就任。

出典：ブラックロック 2023年1月31日現在。変更される可能性があります。

（４）事業の内容及び営業の概況

副投資運用会社により運用されている主要な投資法人についての情報は提供されていません。

2022年12月31日現在、ブラックロックは、8兆59億米ドルの資産をグローバルに運用しています。

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

ブラックロックの2021年の年次報告書および四半期決算公表は、以下のリンクのブラックロックの投資家向け情報サイトにおいて参照することができます。

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

収益源

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

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

[次へ](#)

4 外国投資法人の経理状況

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

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

ファンドの原文の中間財務書類は、各サブ・ファンドについての基準通貨(ポンド)ならびに各クラス株式の該当取引通貨(ポンド、米ドル、ユーロ、円)で表示されています。日本文の中間財務書類には、主要な金額について円貨換算額が併記されています。換算は、便宜上、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ポンド=164.44円、1米ドル=136.33円、1ユーロ=144.61円)で行われています。なお、千円未満の金額は四捨五入されています。

(1) 資産及び負債の状況

パークレイズ・ポートフォリオ

2023年 2 月28日現在合算純資産計算書

		パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ 1		パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ 2		パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ 3	
	注記	2023年 2 月28日現在 (ボンド)	(千円)	2023年 2 月28日現在 (ボンド)	(千円)	2023年 2 月28日現在 (ボンド)	(千円)
資産							
投資有価証券 (時価)	2(c)	5,880,132	966,929	43,168,298	7,098,595	165,154,025	27,157,928
先物契約にかかる 未実現利益	2(e)	-	-	-	-	-	-
為替先渡契約に かかる未実現利益	2(g)	24,944	4,102	88,588	14,567	259,942	42,745
現金預金		24,871	4,090	199,093	32,739	1,247,865	205,199
投資有価証券 売却未収金		45,652	7,507	597,400	98,236	1,062,136	174,658
ファンド株式 発行未収金		-	-	-	-	482	79
未収配当金		-	-	-	-	-	-
その他資産		3,151	518	12,329	2,027	50,790	8,352
資産合計		5,978,750	983,146	44,065,708	7,246,165	167,775,240	27,588,960
負債							
先物契約にかかる 未実現損失	2(e)	-	-	-	-	-	-
為替先渡契約に かかる未実現損失	2(g)	66,336	10,908	337,888	55,562	962,239	158,231
ファンド株式 買戻未払金		-	-	333,298	54,808	873,179	143,586
その他未払金 および未払費用		47,585	7,825	113,071	18,593	310,808	51,109
負債合計		113,921	18,733	784,257	128,963	2,146,226	352,925
期末純資産		5,864,829	964,412	43,281,451	7,117,202	165,629,014	27,236,035

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2023年 2月28日現在合算純資産計算書（続き）

		パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ 4		パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ 5		パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ 1	
	注記	2023年 2 月28日現在 (ポンド) (千円)		2023年 2 月28日現在 (ポンド) (千円)		2023年 2 月28日現在 (ポンド) (千円)	
資産							
投資有価証券 (時価)	2(c)	105,279,551	17,312,169	66,024,160	10,857,013	30,028,565	4,937,897
先物契約にかかる 未実現利益	2(e)	-	-	-	-	49,638	8,162
為替先渡契約に かかる未実現利益	2(g)	120,223	19,769	57,163	9,400	182,520	30,014
現金預金		272,663	44,837	219,460	36,088	604,661	99,430
投資有価証券 売却未収金		2,936,849	482,935	211,154	34,722	-	-
ファンド株式 発行未収金		-	-	-	-	-	-
未収配当金		-	-	-	-	-	-
その他資産		26,045	4,283	10,393	1,709	6,607	1,086
資産合計		108,635,331	17,863,994	66,522,330	10,938,932	30,871,991	5,076,590
負債							
先物契約にかかる 未実現損失	2(e)	-	-	-	-	57,778	9,501
為替先渡契約に かかる未実現損失	2(g)	443,506	72,930	233,511	38,399	175,497	28,859
ファンド株式 買戻未払金		1,321,354	217,283	110,127	18,109	43,605	7,170
その他未払金 および未払費用		220,422	36,246	137,800	22,660	111,270	18,297
負債合計		1,985,282	326,460	481,438	79,168	388,150	63,827
期末純資産		106,650,049	17,537,534	66,040,892	10,859,764	30,483,841	5,012,763

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2023年2月28日現在合算純資産計算書（続き）

		パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ 2		パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ 3		パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ 4	
	注記	2023年 2 月28日現在 (ボンド) (千円)		2023年 2 月28日現在 (ボンド) (千円)		2023年 2 月28日現在 (ボンド) (千円)	
資産							
投資有価証券 (時価)	2(c)	67,043,735	11,024,672	177,865,629	29,248,224	45,915,311	7,550,314
先物契約にかかる 未実現利益	2(e)	93,673	15,404	311,266	51,185	78,505	12,909
為替先渡契約に かかる未実現利益	2(g)	357,908	58,854	662,910	109,009	86,906	14,291
現金預金		1,175,649	193,324	13,459,998	2,213,362	2,479,698	407,762
投資有価証券 売却未収金		-	-	-	-	-	-
ファンド株式 発行未収金		-	-	-	-	-	-
未収配当金		24,513	4,031	-	-	-	-
その他資産		485	80	15,219	2,503	5,786	951
資産合計		68,695,963	11,296,364	192,315,022	31,624,282	48,566,206	7,986,227
負債							
先物契約にかかる 未実現損失	2(e)	121,483	19,977	625,068	102,786	257,933	42,415
為替先渡契約に かかる未実現損失	2(g)	382,971	62,976	840,681	138,242	202,012	33,219
当座借越		-	-	24,096	3,962	-	-
ファンド株式 買戻未払金		32,851	5,402	75,796	12,464	29,356	4,827
その他未払金 および未払費用		231,846	38,125	731,897	120,353	207,911	34,189
負債合計		769,151	126,479	2,297,538	377,807	697,212	114,650
期末純資産		67,926,812	11,169,885	190,017,484	31,246,475	47,868,994	7,871,577

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2023年 2月28日現在合算純資産計算書（続き）

		パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ 5		リキッド・ オルタナティブ・ ストラテジーズ		合算	
	注記	2023年 2 月28日現在 (ボンド)	(千円)	2023年 2 月28日現在 (ボンド)	(千円)	2023年 2 月28日現在 (ボンド)	(千円)
資産							
投資有価証券 (時価)	2(c)	16,039,468	2,637,530	240,137,454	39,488,203	962,536,328	158,279,474
先物契約にかかる 未実現利益	2(e)	24,502	4,029	-	-	557,584	91,689
為替先渡契約に かかる未実現利益	2(g)	31,880	5,242	238,690	39,250	2,111,674	347,244
現金預金		1,163,779	191,372	13,239,515	2,177,106	35,221,717	5,791,859
投資有価証券 売却未収金		-	-	-	-	4,853,190	798,059
ファンド株式 発行未収金		-	-	547,680	90,060	548,162	90,140
未収配当金		-	-	-	-	24,513	4,031
その他資産		9,247	1,521	-	-	140,052	23,030
資産合計		17,268,876	2,839,694	254,163,339	41,794,619	1,005,993,220	165,425,525
負債							
先物契約にかかる 未実現損失	2(e)	85,681	14,089	-	-	1,147,943	188,768
為替先渡契約に かかる未実現損失	2(g)	66,360	10,912	62,199	10,228	3,773,200	620,465
当座借越		-	-	-	-	1,158,561	190,514
ファンド株式 買戻未払金		10,786	1,774	528,635	86,929	3,358,986	552,352
その他未払金 および未払費用		100,699	16,559	498,875	82,035	2,712,184	445,992
負債合計		263,526	43,334	1,089,709	179,192	12,150,874	1,998,090
期末純資産		17,005,350	2,796,360	253,073,630	41,615,428	993,842,346	163,427,435

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2023年2月28日現在合算純資産計算書（続き）

	パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ1		パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ2		パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ3	
	（千円）		（千円）		（千円）	
2023年2月28日現在						
純資産（ポンド）	5,864,829	964,412	43,281,451	7,117,202	165,629,014	27,236,035
2023年2月28日現在						
1株当たり純資産価格						
	（円）		（円）		（円）	
ポンド建クラス						
クラスA - 累積型	14.065	2,313	16.061	2,641	17.069	2,807
クラスA - 分配型	11.541	1,898	12.569	2,067	15.343	2,523
クラスC - 累積型	-	-	16.181	2,661	21.973	3,613
クラスC - 分配型	-	-	13.917	2,289	17.439	2,868
クラスI - 累積型	-	-	-	-	-	-
クラスI - 分配型	-	-	-	-	-	-
クラスR - 累積型	14.266	2,346	18.061	2,970	19.479	3,203
クラスR - 分配型	11.564	1,902	15.404	2,533	16.344	2,688
米ドル建クラス						
クラスA - 累積型	-	-	16.976	2,314	17.437	2,377
クラスA - 分配型	-	-	13.849	1,888	13.551	1,847
クラスC - 累積型	14.397	1,963	15.944	2,174	23.129	3,153
クラスC - 分配型	-	-	-	-	13.954	1,902
クラスR - 累積型	-	-	16.529	2,253	21.836	2,977
クラスR - 分配型	-	-	14.119	1,925	18.900	2,577
ユーロ建クラス						
クラスA - 累積型	12.608	1,823	14.130	2,043	18.757	2,712
クラスA - 分配型	-	-	9.825	1,421	-	-
クラスC - 累積型	-	-	13.980	2,022	19.448	2,812
クラスC - 分配型	-	-	-	-	16.958	2,452
クラスR - 累積型	-	-	14.701	2,126	18.257	2,640
クラスR - 分配型	-	-	-	-	15.303	2,213
クラスY - 累積型	-	-	-	-	-	-
円建クラス						
クラスA - 分配型	932.453		983.577		1,135.724	

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2023年2月28日現在合算純資産計算書（続き）

	パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ4		パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ5		パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ1	
	（千円）		（千円）		（千円）	
2023年2月28日現在						
純資産（ポンド）	106,650,049	17,537,534	66,040,892	10,859,764	30,483,841	5,012,763
2023年2月28日現在						
1株当たり純資産価格						
	（円）		（円）		（円）	
ポンド建クラス						
クラスA - 累積型	22.296	3,666	28.203	4,638	12.433	2,044
クラスA - 分配型	24.085	3,961	30.080	4,946	9.463	1,556
クラスC - 累積型	26.295	4,324	29.677	4,880	10.735	1,765
クラスC - 分配型	19.170	3,152	27.999	4,604	9.598	1,578
クラスI - 累積型	-	-	-	-	-	-
クラスI - 分配型	-	-	-	-	-	-
クラスR - 累積型	21.989	3,616	28.581	4,700	12.597	2,071
クラスR - 分配型	19.403	3,191	25.705	4,227	9.703	1,596
米ドル建クラス						
クラスA - 累積型	-	-	-	-	12.514	1,706
クラスA - 分配型	19.340	2,637	-	-	9.548	1,302
クラスC - 累積型	25.179	3,433	32.874	4,482	12.612	1,719
クラスC - 分配型	23.447	3,197	-	-	-	-
クラスR - 累積型	26.548	3,619	32.942	4,491	-	-
クラスR - 分配型	23.622	3,220	30.608	4,173	-	-
ユーロ建クラス						
クラスA - 累積型	-	-	-	-	10.990	1,589
クラスA - 分配型	15.450	2,234	-	-	8.418	1,217
クラスC - 累積型	18.824	2,722	27.609	3,993	11.155	1,613
クラスC - 分配型	-	-	24.530	3,547	9.981	1,443
クラスR - 累積型	24.119	3,488	22.256	3,218	11.274	1,630
クラスR - 分配型	16.695	2,414	-	-	-	-
クラスY - 累積型	-	-	-	-	-	-
円建クラス						
クラスA - 分配型	1,550.654		-		924.376	

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2023年 2月28日現在合算純資産計算書（続き）

	パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ 2		パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ 3		パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ 4	
	（千円）		（千円）		（千円）	
2023年 2月28日現在						
純資産（ポンド）	67,926,812	11,169,885	190,017,484	31,246,475	47,868,994	7,871,577
2023年 2月28日現在						
1株当たり純資産価格						
	（円）		（円）		（円）	
ポンド建クラス						
クラス A - 累積型	13.019	2,141	15.207	2,501	16.380	2,694
クラス A - 分配型	9.717	1,598	11.585	1,905	16.235	2,670
クラス C - 累積型	13.675	2,249	16.503	2,714	-	-
クラス C - 分配型	10.381	1,707	12.579	2,068	16.919	2,782
クラス I - 累積型	-	-	-	-	18.654	3,067
クラス I - 分配型	-	-	13.674	2,249	16.993	2,794
クラス R - 累積型	14.366	2,362	16.735	2,752	18.137	2,982
クラス R - 分配型	10.722	1,763	13.105	2,155	16.937	2,785
米ドル建クラス						
クラス A - 累積型	12.991	1,771	15.050	2,052	16.329	2,226
クラス A - 分配型	9.733	1,327	11.522	1,571	16.124	2,198
クラス C - 累積型	13.570	1,850	15.918	2,170	-	-
クラス C - 分配型	11.972	1,632	14.154	1,930	-	-
クラス R - 累積型	12.057	1,644	16.459	2,244	17.622	2,402
クラス R - 分配型	10.753	1,466	13.054	1,780	17.003	2,318
ユーロ建クラス						
クラス A - 累積型	10.905	1,577	12.540	1,813	13.608	1,968
クラス A - 分配型	8.182	1,183	9.487	1,372	13.458	1,946
クラス C - 累積型	11.425	1,652	13.418	1,940	-	-
クラス C - 分配型	8.586	1,242	10.347	1,496	14.273	2,064
クラス R - 累積型	11.923	1,724	13.707	1,982	14.552	2,104
クラス R - 分配型	9.040	1,307	10.766	1,557	14.201	2,054
クラス Y - 累積型	-	-	12.335	1,784	13.066	1,889
円建クラス						
クラス A - 分配型	1,029.670		1,134.381		1,378.107	

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2023年 2月28日現在合算純資産計算書（続き）

	パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ 5		リキッド・ オルタナティブ・ ストラテジーズ	
	（千円）		（千円）	
2023年 2月28日現在				
純資産（ポンド）	17,005,350	2,796,360	253,073,630	41,615,428
2023年 2月28日現在				
1株当たり純資産価格				
	（円）		（円）	
ポンド建クラス				
クラス A - 累積型	16.907	2,780	-	-
クラス A - 分配型	16.775	2,758	-	-
クラス C - 累積型	-	-	-	-
クラス C - 分配型	18.021	2,963	-	-
クラス I - 累積型	-	-	-	-
クラス I - 分配型	-	-	-	-
クラス R - 累積型	18.416	3,028	11.948	1,965
クラス R - 分配型	17.992	2,959	-	-
米ドル建クラス				
クラス A - 累積型	16.628	2,267	11.797	1,608
クラス A - 分配型	16.616	2,265	-	-
クラス C - 累積型	-	-	-	-
クラス C - 分配型	-	-	-	-
クラス R - 累積型	18.423	2,512	12.549	1,711
クラス R - 分配型	-	-	-	-
ユーロ建クラス				
クラス A - 累積型	13.742	1,987	10.191	1,474
クラス A - 分配型	13.567	1,962	-	-
クラス C - 累積型	14.370	2,078	-	-
クラス C - 分配型	-	-	-	-
クラス R - 累積型	14.920	2,158	10.755	1,555
クラス R - 分配型	14.679	2,123	-	-
クラス Y - 累積型	13.381	1,935	-	-
円建クラス				
クラス A - 分配型	-	-	-	-

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2023年2月28日現在合算純資産計算書（続き）

	パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ 1	パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ 2	パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ 3	パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ 4
2023年2月28日現在 発行済株式数				
ボンド建クラス				
クラスA - 累積型	12,399	21,028	79,161	31,367
クラスA - 分配型	20,698	21,813	31,926	17,570
クラスC - 累積型	-	31,712	176,188	35,022
クラスC - 分配型	-	594	213,844	38,478
クラス - 累積型	-	-	-	-
クラス - 分配型	-	-	-	-
クラスR - 累積型	44,392	960,151	3,975,889	2,771,433
クラスR - 分配型	51,206	942,493	3,046,291	1,339,777
米ドル建クラス				
クラスA - 累積型	-	15,209	20,007	-
クラスA - 分配型	-	50,500	96,000	1,500
クラスC - 累積型	226,672	20,678	10,002	43,002
クラスC - 分配型	-	-	1,815	90,741
クラスR - 累積型	-	103,323	606,083	256,808
クラスR - 分配型	-	145,275	242,671	47,317
ユーロ建クラス				
クラスA - 累積型	78,168	83,812	48,723	-
クラスA - 分配型	-	11,927	-	1,455
クラスC - 累積型	-	197,541	48,680	41,928
クラスC - 分配型	-	-	29,940	-
クラスR - 累積型	-	160,714	565,251	85,702
クラスR - 分配型	-	-	40,027	343,228
クラスY - 累積型	-	-	-	-
円建クラス				
クラスA - 分配型	118,000	82,500	146,000	17,000

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2023年2月28日現在合算純資産計算書（続き）

	パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ 5	パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ 1	パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ 2	パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ 3
2023年2月28日現在 発行済株式数				
ボンド建クラス				
クラスA - 累積型	11,462	109,028	145,092	163,550
クラスA - 分配型	14,950	148,285	171,414	1,312,389
クラスC - 累積型	9,643	10,416	46,353	66,429
クラスC - 分配型	28,047	52,080	125,163	447,804
クラス - 累積型	-	-	-	-
クラス - 分配型	-	-	-	57,341
クラスR - 累積型	1,046,648	128,017	757,255	2,651,895
クラスR - 分配型	607,783	317,948	826,934	1,943,074
米ドル建クラス				
クラスA - 累積型	-	178,299	777,328	979,776
クラスA - 分配型	-	613,095	125,360	513,065
クラスC - 累積型	10,390	87,102	30,971	173,057
クラスC - 分配型	-	-	20,408	101,947
クラスR - 累積型	38,172	-	7,523	188,723
クラスR - 分配型	247,569	-	129,130	809,519
ユーロ建クラス				
クラスA - 累積型	-	1,332,330	2,706,492	4,613,859
クラスA - 分配型	-	52,642	278,998	405,561
クラスC - 累積型	6,274	14,418	117,523	94,011
クラスC - 分配型	102,117	112,557	107,487	81,230
クラスR - 累積型	447,954	47,114	56,222	70,100
クラスR - 分配型	-	-	116,807	208,388
クラスY - 累積型	-	-	-	347,181
円建クラス				
クラスA - 分配型	-	4,500	36,000	101,000

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2023年2月28日現在合算純資産計算書（続き）

	パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ 4	パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ 5	リクィッド・ オルタナティブ・ ストラテジーズ
2023年2月28日現在 発行済株式数			
ボンド建クラス			
クラスA - 累積型	21,312	15,743	-
クラスA - 分配型	242,198	44,384	-
クラスC - 累積型	-	-	-
クラスC - 分配型	187,063	37,024	-
クラス - 累積型	8,776	-	-
クラス - 分配型	17,653	-	-
クラスR - 累積型	570,493	297,720	20,650,842
クラスR - 分配型	650,823	60,846	-
米ドル建クラス			
クラスA - 累積型	119,561	14,212	46,520
クラスA - 分配型	154,324	260,955	-
クラスC - 累積型	-	-	-
クラスC - 分配型	-	-	-
クラスR - 累積型	24,123	10,473	154,816
クラスR - 分配型	65,922	-	-
ユーロ建クラス			
クラスA - 累積型	911,140	113,810	379,098
クラスA - 分配型	47,485	2,843	-
クラスC - 累積型	-	11,876	-
クラスC - 分配型	12	-	-
クラスR - 累積型	8,023	7,741	94,047
クラスR - 分配型	50,043	3,237	-
クラスY - 累積型	48,446	265,971	-
円建クラス			
クラスA - 分配型	113,000	-	-

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

パークレイズ・ポートフォリオ

2023年2月28日に終了した期間の合算損益計算書

	注記	パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ 1		パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ 2		パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ 3	
		2023年2月28日に 終了した期間		2023年2月28日に 終了した期間		2023年2月28日に 終了した期間	
		(ポンド)	(千円)	(ポンド)	(千円)	(ポンド)	(千円)
収益							
受取配当金（純額）	2(d)	65,985	10,851	517,792	85,146	1,936,605	318,455
銀行利息	2(d)	36	6	667	110	2,514	413
収益合計		66,021	10,856	518,459	85,255	1,939,119	318,869
費用							
管理報酬	3(a)	13,692	2,252	96,124	15,807	336,328	55,306
管理事務代行報酬							
および保管銀行報酬	5(a)	20,742	3,411	28,332	4,659	47,809	7,862
ルクセンブルグ税	4	1,352	222	9,398	1,545	41,839	6,880
専門家報酬		7,519	1,236	7,519	1,236	7,519	1,236
取締役報酬		106	17	939	154	3,968	652
為替ヘッジ							
運用会社報酬	5(c)	-	-	-	-	-	-
当座借越利息		3	0	5	1	6	1
税務・法務報酬		79	13	1,191	196	4,196	690
公告手数料		1,841	303	2,877	473	7,748	1,274
一般費用		(2,203)	(362)	3,631	597	25,569	4,205
費用合計		43,131	7,092	150,016	24,669	474,982	78,106
費用の免除 / 返還	5(b)	(31,185)	(5,128)	(61,796)	(10,162)	(163,282)	(26,850)
投資収益（純額）		54,075	8,892	430,239	70,749	1,627,419	267,613
投資有価証券、 先物契約および 為替先渡契約に かかる実現（損失） / 利益（純額）		(55,451)	(9,118)	507,496	83,453	956,350	157,262
投資有価証券に かかる未実現評価 （損）の変動（純額）		(258,394)	(42,490)	(2,397,238)	(394,202)	(6,424,786)	(1,056,492)
先物契約にかかる 未実現評価益の 変動（純額）		-	-	-	-	-	-
為替先渡契約に かかる未実現 評価益の変動（純額）		1,122	185	470,655	77,395	993,260	163,332
運用による 資産の変動（純額）		(258,648)	(42,532)	(988,848)	(162,606)	(2,847,757)	(468,285)

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2023年2月28日に終了した期間の合算損益計算書（続き）

	注記	パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ4		パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ5		パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ1	
		2023年2月28日に 終了した期間		2023年2月28日に 終了した期間		2023年2月28日に 終了した期間	
		(ポンド)	(千円)	(ポンド)	(千円)	(ポンド)	(千円)
収益							
受取配当金（純額）	2(d)	1,090,769	179,366	564,133	92,766	397,018	65,286
銀行利息	2(d)	1,886	310	1,098	181	4,427	728
収益合計		1,092,655	179,676	565,231	92,947	401,445	66,014
費用							
管理報酬	3(a)	209,438	34,440	126,766	20,845	90,316	14,852
管理事務代行報酬							
および保管銀行報酬	5(a)	33,718	5,545	24,002	3,947	31,739	5,219
ルクセンブルグ税	4	27,144	4,464	16,490	2,712	7,930	1,304
専門家報酬		7,519	1,236	7,519	1,236	7,519	1,236
取締役報酬		2,978	490	1,658	273	628	103
為替ヘッジ							
運用会社報酬	5(c)	-	-	-	-	7,121	1,171
当座借越利息		1	0	1	0	87	14
税務・法務報酬		4,395	723	3,072	505	1,731	285
公告手数料		5,950	978	3,816	628	2,353	387
一般費用		15,505	2,550	8,441	1,388	2,397	394
費用合計		306,648	50,425	191,765	31,534	151,821	24,965
費用の免除／返還	5(b)	(105,182)	(17,296)	(58,714)	(9,655)	(18,446)	(3,033)
投資収益（純額）		891,189	146,547	432,180	71,068	268,070	44,081
投資有価証券、 先物契約および 為替先渡契約に かかる実現利益 （純額）		803,372	132,106	580,993	95,538	203,518	33,466
投資有価証券に かかる未実現評価 （損）の変動（純額）		(2,991,116)	(491,859)	(1,686,755)	(277,370)	(1,313,597)	(216,008)
先物契約にかかる 未実現評価益の 変動（純額）		-	-	-	-	46,117	7,583
為替先渡契約に かかる未実現 評価益／（損）の 変動（純額）		13,675	2,249	(442,130)	(72,704)	95,697	15,736
運用による 資産の変動（純額）		(1,282,880)	(210,957)	(1,115,712)	(183,468)	(700,195)	(115,140)

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2023年2月28日に終了した期間の合算損益計算書（続き）

	注記	パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ2 2023年2月28日に 終了した期間		パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ3 2023年2月28日に 終了した期間		パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ4 2023年2月28日に 終了した期間	
		(ポンド)	(千円)	(ポンド)	(千円)	(ポンド)	(千円)
収益							
受取配当金（純額）	2(d)	812,189	133,556	1,963,592	322,893	409,105	67,273
銀行利息	2(d)	9,170	1,508	74,547	12,259	13,544	2,227
収益合計		821,359	135,064	2,038,139	335,152	422,649	69,500
費用							
管理報酬	3(a)	400,575	65,871	1,106,289	181,918	268,131	44,091
管理事務代行報酬							
および保管銀行報酬	5(a)	36,238	5,959	59,274	9,747	32,387	5,326
ルクセンブルグ税	4	17,923	2,947	47,759	7,853	11,889	1,955
専門家報酬		7,519	1,236	7,519	1,236	7,520	1,237
取締役報酬		1,607	264	4,457	733	1,117	184
為替ヘッジ							
運用会社報酬	5(c)	-	-	29,428	4,839	5,780	950
当座借越利息		56	9	331	54	215	35
税務・法務報酬		3,599	592	10,242	1,684	2,881	474
公告手数料		4,681	770	9,329	1,534	3,014	496
一般費用		23,596	3,880	41,140	6,765	5,229	860
費用合計		495,794	81,528	1,315,768	216,365	338,163	55,608
費用の免除／返還	5(b)	-	-	-	-	(8,980)	(1,477)
投資収益（純額）		325,565	53,536	722,371	118,787	93,466	15,370
投資有価証券、 先物契約および 為替先渡契約に かかる実現利益 （純額）		600,959	98,822	3,604,663	592,751	764,103	125,649
投資有価証券に かかる未実現評価 （損）の変動（純額）		(2,909,946)	(478,512)	(6,287,779)	(1,033,962)	(764,340)	(125,688)
先物契約にかかる 未実現評価益／ （損）の変動（純額）		152,769	25,121	(498,927)	(82,044)	(154,465)	(25,400)
為替先渡契約に かかる未実現 評価益／（損）の 変動（純額）		354,411	58,279	(713,615)	(117,347)	(388,504)	(63,886)
運用による 資産の変動（純額）		(1,476,242)	(242,753)	(3,173,287)	(521,815)	(449,740)	(73,955)

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2023年2月28日に終了した期間の合算損益計算書（続き）

	注記	パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ5		リクィッド・ オルタナティブ・ ストラテジーズ		合算	
		2023年2月28日に 終了した期間		2023年2月28日に 終了した期間		2023年2月28日に 終了した期間	
		(ポンド)	(千円)	(ポンド)	(千円)	(ポンド)	(千円)
収益							
受取配当金（純額）	2(d)	110,165	18,116	-	-	7,867,353	1,293,708
銀行利息	2(d)	5,394	887	30,406	5,000	143,689	23,628
収益合計		115,559	19,003	30,406	5,000	8,011,042	1,317,336
費用							
管理報酬	3(a)	108,746	17,882	645,085	106,078	3,401,490	559,341
管理事務代行報酬							
および保管銀行報酬	5(a)	26,740	4,397	60,551	9,957	401,532	66,028
ルクセンブルグ税	4	3,801	625	62,231	10,233	247,756	40,741
専門家報酬		7,519	1,236	7,519	1,236	82,710	13,601
取締役報酬		400	66	6,199	1,019	24,057	3,956
為替ヘッジ							
運用会社報酬	5(c)	2,627	432	-	-	44,956	7,393
当座借越利息		89	15	86	14	880	145
税務・法務報酬		919	151	10,847	1,784	43,152	7,096
公告手数料		1,800	296	11,655	1,917	55,064	9,055
一般費用		(2,233)	(367)	55,880	9,189	176,952	29,098
費用合計		150,408	24,733	860,053	141,427	4,478,549	736,453
費用の免除 / 返還	5(b)	(24,591)	(4,044)	-	-	(472,176)	(77,645)
投資（損失） / 収益（純額）		(10,258)	(1,687)	(829,647)	(136,427)	4,004,669	658,528
投資有価証券、 先物契約および 為替先渡契約に かかる実現利益 （純額）		334,253	54,965	2,142,618	352,332	10,442,874	1,717,226
投資有価証券に かかる未実現評価 （損）の変動（純額）		(128,579)	(21,144)	(845,886)	(139,097)	(26,008,416)	(4,276,824)
先物契約にかかる 未実現評価（損）の 変動（純額）		(58,801)	(9,669)	-	-	(513,307)	(84,408)
為替先渡契約に かかる未実現 評価（損） / 益の 変動（純額）		(322,001)	(52,950)	1,632,224	268,403	1,694,794	278,692
運用による 資産の変動（純額）		(185,386)	(30,485)	2,099,309	345,210	(10,379,386)	(1,706,786)

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

パークレイズ・ポートフォリオ

2023年2月28日に終了した期間の合算純資産額変動計算書

	パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ1		パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ2		パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ3	
	2023年2月28日に 終了した期間		2023年2月28日に 終了した期間		2023年2月28日に 終了した期間	
	(ポンド)	(千円)	(ポンド)	(千円)	(ポンド)	(千円)
期首純資産	6,808,115	1,119,526	48,106,263	7,910,594	177,250,820	29,147,125
投資収益（純額）	54,075	8,892	430,239	70,749	1,627,419	267,613
投資有価証券、 先物契約および 為替先渡契約に かかる実現（損失） ／利益（純額）	(55,451)	(9,118)	507,496	83,453	956,350	157,262
当期利益（純額）	6,806,739	1,119,300	49,043,998	8,064,795	179,834,589	29,572,000
ファンド株式 申込手取金	22,771	3,744	61,083	10,044	848,824	139,581
ファンド株式 買戻支払金	(684,235)	(112,516)	(3,676,605)	(604,581)	(8,880,882)	(1,460,372)
ファンド株式の 取引による手取金 （純額）	(661,464)	(108,771)	(3,615,522)	(594,536)	(8,032,058)	(1,320,792)
投資有価証券に かかる未実現評価 （損）の変動（純額）	(258,394)	(42,490)	(2,397,238)	(394,202)	(6,424,786)	(1,056,492)
先物契約にかかる 未実現評価益の 変動（純額）	-	-	-	-	-	-
為替先渡契約に かかる未実現 評価益の変動（純額）	1,122	185	470,655	77,395	993,260	163,332
分配金	(23,174)	(3,811)	(220,442)	(36,249)	(741,991)	(122,013)
期末純資産	5,864,829	964,412	43,281,451	7,117,202	165,629,014	27,236,035

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2023年2月28日に終了した期間の合算純資産額変動計算書（続き）

	パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ4		パークレイズ・ グローバルベータ・ ポートフォリオ5		パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ1	
	2023年2月28日に 終了した期間		2023年2月28日に 終了した期間		2023年2月28日に 終了した期間	
	(ポンド)	(千円)	(ポンド)	(千円)	(ポンド)	(千円)
期首純資産	113,817,515	18,716,152	69,042,953	11,353,423	34,144,816	5,614,774
投資収益（純額）	891,189	146,547	432,180	71,068	268,070	44,081
投資有価証券、 先物契約および 為替先渡契約に かかる実現利益 （純額）	803,372	132,106	580,993	95,538	203,518	33,466
当期利益（純額）	115,512,076	18,994,806	70,056,126	11,520,029	34,616,404	5,692,321
ファンド株式 申込手取金	3,227,234	530,686	194,213	31,936	38,162	6,275
ファンド株式 買戻支払金	(8,858,422)	(1,456,679)	(1,947,849)	(320,304)	(2,839,605)	(466,945)
ファンド株式の 取引による手取金 （純額）	(5,631,188)	(925,993)	(1,753,636)	(288,368)	(2,801,443)	(460,669)
投資有価証券に かかる未実現評価 （損）の変動（純額）	(2,991,116)	(491,859)	(1,686,755)	(277,370)	(1,313,597)	(216,008)
先物契約にかかる 未実現評価益の 変動（純額）	-	-	-	-	46,117	7,583
為替先渡契約に かかる未実現 評価益／（損）の 変動（純額）	13,675	2,249	(442,130)	(72,704)	95,697	15,736
分配金	(253,398)	(41,669)	(132,713)	(21,823)	(159,337)	(26,201)
期末純資産	106,650,049	17,537,534	66,040,892	10,859,764	30,483,841	5,012,763

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2023年2月28日に終了した期間の合算純資産額変動計算書（続き）

	パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ2		パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ3		パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ4	
	2023年2月28日に 終了した期間		2023年2月28日に 終了した期間		2023年2月28日に 終了した期間	
	(ポンド)	(千円)	(ポンド)	(千円)	(ポンド)	(千円)
期首純資産	76,331,357	12,551,928	206,436,592	33,946,433	51,214,715	8,421,748
投資収益（純額）	325,565	53,536	722,371	118,787	93,466	15,370
投資有価証券、 先物契約および 為替先渡契約に かかる実現利益 （純額）	600,959	98,822	3,604,663	592,751	764,103	125,649
当期利益（純額）	77,257,881	12,704,286	210,763,626	34,657,971	52,072,284	8,562,766
ファンド株式 申込手取金	151,830	24,967	1,097,286	180,438	62,103	10,212
ファンド株式 買戻支払金	(6,849,319)	(1,126,302)	(13,507,042)	(2,221,098)	(2,914,240)	(479,218)
ファンド株式の 取引による手取金 （純額）	(6,697,489)	(1,101,335)	(12,409,756)	(2,040,660)	(2,852,137)	(469,005)
投資有価証券に かかる未実現評価 （損）の変動（純額）	(2,909,946)	(478,512)	(6,287,779)	(1,033,962)	(764,340)	(125,688)
先物契約にかかる 未実現評価益 / （損）の変動（純額）	152,769	25,121	(498,927)	(82,044)	(154,465)	(25,400)
為替先渡契約に かかる未実現 評価益 / （損）の 変動（純額）	354,411	58,279	(713,615)	(117,347)	(388,504)	(63,886)
分配金	(230,814)	(37,955)	(836,065)	(137,483)	(43,844)	(7,210)
期末純資産	67,926,812	11,169,885	190,017,484	31,246,475	47,868,994	7,871,577

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2023年2月28日に終了した期間の合算純資産額変動計算書（続き）

	パークレイズ・ マルチマネジャー・ ポートフォリオ5		リクィッド・ オルタナティブ・ ストラテジーズ		合算	
	2023年2月28日に 終了した期間		2023年2月28日に 終了した期間		2023年2月28日に 終了した期間	
	（ポンド）	（千円）	（ポンド）	（千円）	（ポンド）	（千円）
期首純資産	17,866,555	2,937,976	259,336,893	42,645,359	1,060,356,594	174,365,038
投資（損失）/ 収益（純額）	(10,258)	(1,687)	(829,647)	(136,427)	4,004,669	658,528
投資有価証券、 先物契約および 為替先渡契約に かかる実現利益 （純額）	334,253	54,965	2,142,618	352,332	10,442,874	1,717,226
当期利益（純額）	18,190,550	2,991,254	260,649,864	42,861,264	1,074,804,137	176,740,792
ファンド株式 申込手取金	375,737	61,786	10,252,706	1,685,955	16,331,949	2,685,626
ファンド株式 買戻支払金	(1,051,499)	(172,908)	(18,615,278)	(3,061,096)	(69,824,976)	(11,482,019)
ファンド株式の 取引による手取金 （純額）	(675,762)	(111,122)	(8,362,572)	(1,375,141)	(53,493,027)	(8,796,393)
投資有価証券に かかる未実現評価 （損）の変動（純額）	(128,579)	(21,144)	(845,886)	(139,097)	(26,008,416)	(4,276,824)
先物契約にかかる 未実現評価（損）の 変動（純額）	(58,801)	(9,669)	-	-	(513,307)	(84,408)
為替先渡契約に かかる未実現 評価（損）/ 益の 変動（純額）	(322,001)	(52,950)	1,632,224	268,403	1,694,794	278,692
分配金	(57)	(9)	-	-	(2,641,835)	(434,423)
期末純資産	17,005,350	2,796,360	253,073,630	41,615,428	993,842,346	163,427,435

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

パークレイズ・ポートフォリオ

2023年2月28日に終了した期間の合算発行済株式数計算書

	クラス通貨	期首発行済株式数	期中発行数	期中買戻数	期末発行済株式数
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ1					
ボンド建クラス					
クラスA - 累積型	ボンド	12,292	107	-	12,399
クラスA - 分配型	ボンド	20,570	128	-	20,698
クラスR - 累積型	ボンド	44,404	1,363	(1,375)	44,392
クラスR - 分配型	ボンド	104,880	-	(53,674)	51,206
米ドル建クラス					
クラスA - 累積型	米ドル	3,621	-	(3,621)	-
クラスC - 累積型	米ドル	227,172	-	(500)	226,672
ユーロ建クラス					
クラスA - 累積型	ユーロ	78,168	-	-	78,168
円建クラス					
クラスA - 分配型	円	118,000	-	-	118,000

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2023年2月28日に終了した期間の合算発行済株式数計算書（続き）

	クラス通貨	期首発行済株式数	期中発行数	期中買戻数	期末発行済株式数
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ2					
ボンド建クラス					
クラスA - 累積型	ボンド	21,028	-	-	21,028
クラスA - 分配型	ボンド	21,318	495	-	21,813
クラスC - 累積型	ボンド	31,712	-	-	31,712
クラスC - 分配型	ボンド	594	-	-	594
クラスR - 累積型	ボンド	1,069,953	2,969	(112,771)	960,151
クラスR - 分配型	ボンド	998,277	-	(55,784)	942,493
米ドル建クラス					
クラスA - 累積型	米ドル	15,209	-	-	15,209
クラスA - 分配型	米ドル	56,000	-	(5,500)	50,500
クラスC - 累積型	米ドル	20,678	-	-	20,678
クラスR - 累積型	米ドル	112,869	-	(9,546)	103,323
クラスR - 分配型	米ドル	145,275	-	-	145,275
ユーロ建クラス					
クラスA - 累積型	ユーロ	130,849	-	(47,037)	83,812
クラスA - 分配型	ユーロ	11,786	141	-	11,927
クラスC - 累積型	ユーロ	197,541	-	-	197,541
クラスR - 累積型	ユーロ	160,714	-	-	160,714
円建クラス					
クラスA - 分配型	円	82,500	-	-	82,500

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2023年2月28日に終了した期間の合算発行済株式数計算書（続き）

	クラス通貨	期首発行済株式数	期中発行数	期中買戻数	期末発行済株式数
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ3					
ボンド建クラス					
クラスA - 累積型	ポンド	79,161	-	-	79,161
クラスA - 分配型	ポンド	33,044	227	(1,345)	31,926
クラスC - 累積型	ポンド	176,188	-	-	176,188
クラスC - 分配型	ポンド	217,094	-	(3,250)	213,844
クラスR - 累積型	ポンド	4,341,152	39,735	(404,998)	3,975,889
クラスR - 分配型	ポンド	3,058,570	1,295	(13,574)	3,046,291
米ドル建クラス					
クラスA - 累積型	米ドル	20,007	-	-	20,007
クラスA - 分配型	米ドル	105,836	-	(9,836)	96,000
クラスC - 累積型	米ドル	10,002	-	-	10,002
クラスC - 分配型	米ドル	1,815	-	-	1,815
クラスR - 累積型	米ドル	616,073	-	(9,990)	606,083
クラスR - 分配型	米ドル	242,671	-	-	242,671
ユーロ建クラス					
クラスA - 累積型	ユーロ	53,828	-	(5,105)	48,723
クラスC - 累積型	ユーロ	48,680	-	-	48,680
クラスC - 分配型	ユーロ	29,582	358	-	29,940
クラスR - 累積型	ユーロ	580,573	2,673	(17,995)	565,251
クラスR - 分配型	ユーロ	40,027	-	-	40,027
円建クラス					
クラスA - 分配型	円	146,000	-	-	146,000

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2023年2月28日に終了した期間の合算発行済株式数計算書（続き）

	クラス通貨	期首発行済株式数	期中発行数	期中買戻数	期末発行済株式数
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ4					
ボンド建クラス					
クラスA - 累積型	ポンド	37,151	136	(5,920)	31,367
クラスA - 分配型	ポンド	19,600	-	(2,030)	17,570
クラスC - 累積型	ポンド	35,022	-	-	35,022
クラスC - 分配型	ポンド	38,320	158	-	38,478
クラスR - 累積型	ポンド	2,816,718	110,363	(155,648)	2,771,433
クラスR - 分配型	ポンド	1,485,226	2,042	(147,491)	1,339,777
米ドル建クラス					
クラスA - 分配型	米ドル	12,500	-	(11,000)	1,500
クラスC - 累積型	米ドル	43,002	-	-	43,002
クラスC - 分配型	米ドル	90,741	-	-	90,741
クラスR - 累積型	米ドル	256,808	-	-	256,808
クラスR - 分配型	米ドル	118,453	-	(71,136)	47,317
ユーロ建クラス					
クラスA - 分配型	ユーロ	2,911	-	(1,456)	1,455
クラスC - 累積型	ユーロ	41,928	-	-	41,928
クラスR - 累積型	ユーロ	117,939	-	(32,237)	85,702
クラスR - 分配型	ユーロ	290,904	52,324	-	343,228
円建クラス					
クラスA - 分配型	円	17,000	-	-	17,000

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2023年2月28日に終了した期間の合算発行済株式数計算書（続き）

	クラス通貨	期首発行済株式数	期中発行数	期中買戻数	期末発行済株式数
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ5					
ボンド建クラス					
クラスA - 累積型	ポンド	15,177	107	(3,822)	11,462
クラスA - 分配型	ポンド	14,938	12	-	14,950
クラスC - 累積型	ポンド	9,643	-	-	9,643
クラスC - 分配型	ポンド	28,047	-	-	28,047
クラスR - 累積型	ポンド	645,934	1,572	(39,723)	607,783
クラスR - 分配型	ポンド	1,070,421	5,271	(29,044)	1,046,648
米ドル建クラス					
クラスC - 累積型	米ドル	10,390	-	-	10,390
クラスR - 累積型	米ドル	38,172	-	-	38,172
クラスR - 分配型	米ドル	247,569	-	-	247,569
ユーロ建クラス					
クラスC - 累積型	ユーロ	6,274	-	-	6,274
クラスC - 分配型	ユーロ	102,117	-	-	102,117
クラスR - 累積型	ユーロ	447,954	-	-	447,954

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2023年2月28日に終了した期間の合算発行済株式数計算書（続き）

	クラス通貨	期首発行済株式数	期中発行数	期中買戻数	期末発行済株式数
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ1					
ボンド建クラス					
クラスA - 累積型	ボンド	113,049	-	(4,021)	109,028
クラスA - 分配型	ボンド	166,343	1,146	(19,204)	148,285
クラスC - 累積型	ボンド	10,416	-	-	10,416
クラスC - 分配型	ボンド	52,012	585	(517)	52,080
クラスR - 累積型	ボンド	128,017	-	-	128,017
クラスR - 分配型	ボンド	327,812	-	(9,864)	317,948
米ドル建クラス					
クラスA - 累積型	米ドル	201,206	-	(22,907)	178,299
クラスA - 分配型	米ドル	613,014	81	-	613,095
クラスC - 累積型	米ドル	87,102	-	-	87,102
ユーロ建クラス					
クラスA - 累積型	ユーロ	1,440,935	2,190	(110,795)	1,332,330
クラスA - 分配型	ユーロ	52,642	-	-	52,642
クラスC - 累積型	ユーロ	14,493	-	(75)	14,418
クラスC - 分配型	ユーロ	245,596	-	(133,039)	112,557
クラスR - 累積型	ユーロ	47,114	-	-	47,114
円建クラス					
クラスA - 分配型	円	4,500	-	-	4,500

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2023年2月28日に終了した期間の合算発行済株式数計算書（続き）

	クラス通貨	期首発行済株式数	期中発行数	期中買戻数	期末発行済株式数
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ2					
ボンド建クラス					
クラスA - 累積型	ボンド	150,030	-	(4,938)	145,092
クラスA - 分配型	ボンド	169,983	1,431	-	171,414
クラスC - 累積型	ボンド	46,353	-	-	46,353
クラスC - 分配型	ボンド	124,757	406	-	125,163
クラスR - 累積型	ボンド	969,427	3,855	(216,027)	757,255
クラスR - 分配型	ボンド	842,764	2,208	(18,038)	826,934
米ドル建クラス					
クラスA - 累積型	米ドル	821,349	1,522	(45,543)	777,328
クラスA - 分配型	米ドル	123,768	1,592	-	125,360
クラスC - 累積型	米ドル	37,407	-	(6,436)	30,971
クラスC - 分配型	米ドル	20,408	-	-	20,408
クラスR - 累積型	米ドル	16,342	-	(8,819)	7,523
クラスR - 分配型	米ドル	129,130	-	-	129,130
ユーロ建クラス					
クラスA - 累積型	ユーロ	2,952,840	2,467	(248,815)	2,706,492
クラスA - 分配型	ユーロ	300,922	152	(22,076)	278,998
クラスC - 累積型	ユーロ	143,888	-	(26,365)	117,523
クラスC - 分配型	ユーロ	107,487	-	-	107,487
クラスR - 累積型	ユーロ	56,222	-	-	56,222
クラスR - 分配型	ユーロ	117,900	-	(1,093)	116,807
円建クラス					
クラスA - 分配型	円	36,000	-	-	36,000

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2023年2月28日に終了した期間の合算発行済株式数計算書（続き）

	クラス通貨	期首発行済株式数	期中発行数	期中買戻数	期末発行済株式数
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ3					
ボンド建クラス					
クラスA - 累積型	ボンド	175,689	641	(12,780)	163,550
クラスA - 分配型	ボンド	1,366,238	13,458	(67,307)	1,312,389
クラスC - 累積型	ボンド	66,429	-	-	66,429
クラスC - 分配型	ボンド	452,657	3,280	(8,133)	447,804
クラスI - 分配型	ボンド	67,616	-	(10,275)	57,341
クラスR - 累積型	ボンド	2,714,056	45,834	(107,995)	2,651,895
クラスR - 分配型	ボンド	2,091,247	3,331	(151,504)	1,943,074
米ドル建クラス					
クラスA - 累積型	米ドル	990,504	35	(10,763)	979,776
クラスA - 分配型	米ドル	533,410	4,805	(25,150)	513,065
クラスC - 累積型	米ドル	173,057	-	-	173,057
クラスC - 分配型	米ドル	101,344	603	-	101,947
クラスR - 累積型	米ドル	323,810	-	(135,087)	188,723
クラスR - 分配型	米ドル	812,209	-	(2,690)	809,519
ユーロ建クラス					
クラスA - 累積型	ユーロ	5,105,016	2,844	(494,001)	4,613,859
クラスA - 分配型	ユーロ	411,164	374	(5,977)	405,561
クラスC - 累積型	ユーロ	94,602	-	(591)	94,011
クラスC - 分配型	ユーロ	80,691	539	-	81,230
クラスR - 累積型	ユーロ	70,100	-	-	70,100
クラスR - 分配型	ユーロ	220,639	-	(12,251)	208,388
クラスY - 累積型	ユーロ	394,356	56	(47,231)	347,181
円建クラス					
クラスA - 分配型	円	113,500	-	(12,500)	101,000

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2023年2月28日に終了した期間の合算発行済株式数計算書（続き）

	クラス通貨	期首発行済株式数	期中発行数	期中買戻数	期末発行済株式数
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ4					
ボンド建クラス					
クラスA - 累積型	ボンド	21,976	-	(664)	21,312
クラスA - 分配型	ボンド	259,168	281	(17,251)	242,198
クラスC - 分配型	ボンド	187,098	67	(102)	187,063
クラスI - 累積型	ボンド	8,776	-	-	8,776
クラスI - 分配型	ボンド	17,653	-	-	17,653
クラスR - 累積型	ボンド	576,691	-	(6,198)	570,493
クラスR - 分配型	ボンド	670,909	-	(20,086)	650,823
米ドル建クラス					
クラスA - 累積型	米ドル	129,066	13	(9,518)	119,561
クラスA - 分配型	米ドル	154,519	13	(208)	154,324
クラスR - 累積型	米ドル	24,123	-	-	24,123
クラスR - 分配型	米ドル	66,503	-	(581)	65,922
ユーロ建クラス					
クラスA - 累積型	ユーロ	1,008,505	4,728	(102,093)	911,140
クラスA - 分配型	ユーロ	50,315	-	(2,830)	47,485
クラスC - 分配型	ユーロ	12	-	-	12
クラスR - 累積型	ユーロ	8,023	-	-	8,023
クラスR - 分配型	ユーロ	50,043	-	-	50,043
クラスY - 累積型	ユーロ	121,382	-	(72,936)	48,446
円建クラス					
クラスA - 分配型	円	113,000	-	-	113,000

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2023年2月28日に終了した期間の合算発行済株式数計算書（続き）

	クラス通貨	期首発行済株式数	期中発行数	期中買戻数	期末発行済株式数
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ5					
ボンド建クラス					
クラスA - 累積型	ボンド	15,743	-	-	15,743
クラスA - 分配型	ボンド	44,384	-	-	44,384
クラスC - 分配型	ボンド	37,024	-	-	37,024
クラスR - 累積型	ボンド	303,212	20,156	(25,648)	297,720
クラスR - 分配型	ボンド	61,013	-	(167)	60,846
米ドル建クラス					
クラスA - 累積型	米ドル	14,212	-	-	14,212
クラスA - 分配型	米ドル	260,955	-	-	260,955
クラスR - 累積型	米ドル	10,473	-	-	10,473
ユーロ建クラス					
クラスA - 累積型	ユーロ	114,073	15	(278)	113,810
クラスA - 分配型	ユーロ	2,943	150	(250)	2,843
クラスC - 累積型	ユーロ	11,876	-	-	11,876
クラスR - 累積型	ユーロ	10,726	-	(2,985)	7,741
クラスR - 分配型	ユーロ	3,237	-	-	3,237
クラスY - 累積型	ユーロ	311,653	648	(46,330)	265,971

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

2023年2月28日に終了した期間の合算発行済株式数計算書（続き）

	クラス通貨	期首発行済株式数	期中発行数	期中買戻数	期末発行済株式数
リキッド・オルタナティブ・ストラテジーズ					
ボンド建クラス					
クラス R - 累積型	ポンド	20,856,095	869,168	(1,074,421)	20,650,842
米ドル建クラス					
クラス A - 累積型	米ドル	622,215	-	(575,695)	46,520
クラス R - 累積型	米ドル	156,002	1,285	(2,471)	154,816
ユーロ建クラス					
クラス A - 累積型	ユーロ	402,160	-	(23,062)	379,098
クラス R - 累積型	ユーロ	109,066	916	(15,935)	94,047

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

財務諸表に対する注記

2023年2月28日に終了した期間

1. ファンドの概要

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

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

2023年2月28日現在、ファンドはポンド建の11のサブ・ファンドを運用しています。

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

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

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

管理会社による投資運用機能、販売機能および管理機能の委託に関する詳細な情報は、英文目論見書の該当箇所を参照してください。

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

2. 重要な会計方針の要約

（a）財務書類の表示

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

(b) 通貨の取扱い

ファンドの報告通貨はポンド（GBP）であり、ファンドの合算財務書類はポンド表示です。しかし、ファンドは、ポンド以外の通貨建ての資産に投資する場合があります。各サブ・ファンドの原資産の通貨エクスポージャーは、為替変動に対する保護の一手段として、該当サブ・ファンドの基準通貨にヘッジすることができます。

外国通貨による取引は、取引日における実勢為替レートで換算されます。

サブ・ファンドの報告通貨以外の通貨で表示されるサブ・ファンドのすべての資産および負債は、2023年2月28日の中央ヨーロッパ時間午後11時現在における入手可能な直近の為替レートにより該当サブ・ファンドの報告通貨に換算されています。

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

ポンド	2023年2月28日現在
ユーロ	1.14158
香港ドル	9.50300
日本円	164.90880
スイスフラン	1.13468
米ドル	1.21065

(c) 投資有価証券の評価

英文目論見書に従い、本財務書類の目的上、2023年2月28日現在の評価が使用されています。

公設証券取引所への上場が認められている有価証券またはその他規制された市場で取引されている有価証券は、2023年2月28日の中央ヨーロッパ時間午後11時現在における入手可能な直近の市場価格の仲値で評価されています。

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

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

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

2023年2月28日現在サブ・ファンドのポートフォリオで保有される有価証券が証券取引所または規制された市場で値付または取引されていない場合、または規制された市場で値付または取引されているが、上記に従い決定された価格が入手できないかまたは当該有価証券の公正市場価額を表示していない場合には、その価格は、慎重かつ誠実に決定されるその推定換金価格を基に決定されます。

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

（d）収益の取扱い

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

預金利息は発生主義で認識されます。

（e）先物契約

ファンドの投資戦略の一環として、ファンドは、先物契約を締結することができます。先物契約の締結の際に差入れられる当初証拠金は、合算純資産計算書の現金預金に含まれます。先物契約は、2023年2月28日現在における反対売買決済コストで評価され、合算純資産計算書および投資明細表に記載されます。未決済の先物契約にかかる未実現利益または損失は、取引日の契約価格と、当該日の中央ヨーロッパ時間午後11時現在の時価の差額として毎日計算されます。投資明細表に開示されるように、約定額は、欧州証券市場監督局（ESMA）により公表されるガイドラインに従い計算され、各金融商品の原資産に対する同等ポジションの市場価値を表しています。

（f）投資有価証券にかかる実現利益または損失（純額）

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

（g）為替先渡契約

為替先渡契約は、満期までの残存期間について、2023年2月28日の中央ヨーロッパ時間午後11時現在の適用先渡レートで評価され、合算純資産計算書および投資明細表に表示されます。

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

（h）証券貸付取引

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

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

2023年2月28日現在、各サブ・ファンドに貸付有価証券はありません。また各サブ・ファンドは、当会計報告期間中に有価証券の貸付は行っておりません。

（i）合算財務書類

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

（j）分配金

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

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

分配金は、分配落ちの日にサブ・ファンドにより計上されます。

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

3. 管理会社

(a) 管理報酬

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

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

管理会社に支払われた報酬は、2023年2月28日に終了した会計期間における合算損益計算書の「管理報酬」の項目に記載されています。

投資運用報酬および主販売会社報酬

2023年2月28日に終了した会計期間における合算損益計算書の「管理報酬」の項目には、義務および責任を遂行するための対価として、投資運用会社および主販売会社に支払われる報酬も含まれています。投資運用会社および主販売会社はそれぞれ、自己の報酬の一部を副投資運用会社および副販売会社に対して支払うことができます。

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

サブ・ファンド	管理報酬の料率				
	クラス A	クラス C	クラス I	クラス R	クラス Y
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 1	0.55%	0.45%	0.50%まで	0.30%	-
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 2	1.10%	0.70%	0.50%まで	0.35%	-
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 3	1.25%	0.75%	0.50%まで	0.35%	-
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 4	1.25%	0.75%	0.50%まで	0.35%	-
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 5	1.25%	0.75%	0.50%まで	0.35%	-
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 1	0.60%	0.50%	0.35%まで	0.45%	-
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 2	1.35%	0.95%	0.40%まで	0.75%	-
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 3	1.50%	1.00%	0.50%まで	0.75%	2.00%まで
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 4	1.50%	1.00%	0.50%まで	0.75%	2.00%まで
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 5	1.50%	1.00%	0.50%まで	0.75%	2.00%まで
リキッド・オルタナティブ・ストラテジーズ	1.00%まで	-	-	0.50%	-

(b) 投資先ファンドの管理報酬

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

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

管理報酬の年率

(%)

iShares \$ Treasury Bond 20+yr UCITS ETF	0.07
iShares € Government Bond 1-3yr UCITS ETF	0.20
iShares Core £ Corporate Bond UCITS ETF	0.20
iShares Core € Corporate Bond UCITS ETF	0.20
iShares Core EURO STOXX 50 UCITS ETF	0.10
iShares Core FTSE 100 UCITS ETF	0.07
iShares Core MSCI EM IMI UCITS ETF	0.18
iShares Core MSCI Japan IMI UCITS ETF	0.15
iShares Core MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF	0.20
iShares Emerging Markets Government Bond Index Fund	0.20
iShares Emerging Markets Index Fund	0.14
iShares Euro Government Bond Index Fund	0.03
iShares Euro Investment Grade Corporate Bond Index Fund	0.12
iShares Europe ex-UK Index Fund	0.08
iShares Global Corp Bond UCITS ETF	0.20
iShares Global Government Bond UCITS ETF	0.20
iShares Global High Yield Corporate Bond UCITS ETF	0.50
iShares Global Inflation Linked Government Bond UCITS ETF	0.20
iShares Japan Index Fund	0.13
iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF	0.50
iShares MSCI China UCITS ETF	0.40
iShares North America Index Fund	0.07
iShares Pacific Index Fund	0.16
iShares S&P 500 Swap UCITS ETF	0.00
iShares UK Credit Bond Index Fund	0.10
iShares UK Index Fund	0.04
iShares US Corporate Bond Index Fund	0.12
iShares US Index Fund	0.00
iShares USD High Yield Bond UCITS ETF	0.55
iShares World ex-Euro Government Bond Index Fund	0.19
Janus Henderson Global Multi-Strategy Fund	0.50
Janus Henderson Horizon Pan European Absolute Return Fund	1.00
Kepler Liquid Strategies ICAV - KLS Arete Macro Fund	1.50
Kepler Liquid Strategies ICAV - KLS Athos Event Driven Fund	0.75
Lazard Global Investment Funds - Lazard Rathmore Alternative Fund	1.00
Lyxor Newcits IRL plc - Lyxor/Tiedemann Arbitrage Strategy Fund	1.40
Man AHL Trend Alternative Fund	0.00
Man Funds VI plc - Man GLG Alpha Select Alternative Fund	0.75
Northill Global Funds ICAV - Securis Catastrophe Bond Fund	0.00
Ossiam Shiller Barclays Cape US Sector Value UCITS ETF	0.65
Pimco GIS Global Real Return Institutional GBP (Dist)	0.49
Royal London Cash Plus Fund	0.25
U Access IRL Trend Macro Fund	1.50
Variety Capital ICAV - Variety CKC Credit Opportunity Fund	0.00
Veritas Global Real Return Fund	0.85
Xtrackers MSCI China UCITS ETF	0.65
Xtrackers S&P 500 Swap UCITS ETF	0.15

- † このファンドはバークレイズ・マルチマネジャー・ファンド(UKシリーズ2)の一部を構成します。
- * これらのファンドはバークレイズ・マルチマネジャー・ファンド・ピーエルシーの一部を構成します。

4. 税金

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

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

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

5. サブ・ファンドの費用

(a) 管理事務代行報酬および保管銀行報酬

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

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

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

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

(b) 費用の上限

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

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

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

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

上限は損益計算書の「費用の免除 / 返還」系列項目に開示されています。

(c) 為替ヘッジ運用会社報酬

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

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

6. リサーチ費用

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

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

2022年9月1日から2023年2月28日までにファンドにおいて生じたリサーチ費用は、すべて投資運用会社により支払われています。

7．関連当事者取引

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

8．希薄化

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

希薄化の影響を緩和するために、取締役会は、その裁量により、すべてのファンドについて1株当たり純資産価格の希薄化調整を行うことができます。調整が必要となるか否かは、当該評価日における当該サブ・ファンドの申込みおよび買戻しの量によります。取締役会は、希薄化調整を行わなければ既存株主（申込みの場合）または残存株主（買戻しの場合）が悪影響を受けると判断した場合には、その裁量により、希薄化調整を行うことができます。希薄化調整は、サブ・ファンドが正味申込超過ポジションにある場合は、税金、手数料およびスプレッドを賄うために適切であると取締役会が判断する数値を1株当たり純資産価格に加算し、サブ・ファンドが正味買戻超過ポジションにある場合には、税金、手数料およびスプレッドを賄うために適切であると取締役会が判断する数値を1株当たり純資産価格から差し引きます。希薄化調整が行われた場合、該当サブ・ファンドが正味申込超過ポジションにある場合には価格が当該調整額分増加し、該当サブ・ファンドが正味買戻超過ポジションにある場合には価格が当該調整額分減少します。これは、日々の申込みと買戻しの数量に従って、毎日行われます。取締役会は、希薄化調整の規模に関して定期的な見直しを行います。適用される基準は0.5%です。2023年2月28日現在、すべてのファンドにおいて適用可能な最大スウィング・ファクターは0.10%です。

2023年2月28日現在の合算純資産計算書につきましては、スウィング・プライシング調整は適用を除外しています。

2023年2月28日現在の1株当たりの資産価格はスウィング・プライシング調整（適用できる場合）されています。2023年2月28日時点では、スウィング・プライシング調整はパークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ4に対してのみ適用されています。

9．投資ポートフォリオの変動

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

[次へ](#)

10. 分配

当会計期間についての分配金は以下の通りです。

	クラスA - 分配型	クラスC - 分配型	クラスI - 分配型	クラスR - 分配型	クラスY - 分配型
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 1					
ボンド建クラス					
2022年9月15日支払	0.019858	該当なし†	該当なし†	0.019871	該当なし†
2022年10月17日支払	0.052404	該当なし†	該当なし†	0.052452	該当なし†
2022年11月16日支払	0.025304	該当なし†	該当なし†	0.025329	該当なし†
2022年12月15日支払	0.008733	該当なし†	該当なし†	0.008742	該当なし†
2023年1月17日支払	0.013338	該当なし†	該当なし†	0.013359	該当なし†
2023年2月15日支払	0.018901	該当なし†	該当なし†	0.018934	該当なし†
米ドル建クラス					
2022年9月15日支払	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
2022年10月17日支払	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
2022年11月16日支払	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
2022年12月15日支払	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
2023年1月17日支払	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
2023年2月15日支払	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
ユーロ建クラス					
2022年9月15日支払	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
2022年10月17日支払	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
2022年11月16日支払	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
2022年12月15日支払	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
2023年1月17日支払	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
2023年2月15日支払	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
円建クラス					
2022年9月15日支払	1.627835	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
2022年10月17日支払	4.279403	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
2022年11月16日支払	2.214912	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
2022年12月15日支払	0.720921	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
2023年1月17日支払	1.050997	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
2023年2月15日支払	1.512499	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 2					
ボンド建クラス					
2022年9月15日支払	0.085892	0.095123	該当なし†	0.104642	該当なし†
2022年12月15日支払	0.066687	0.073958	該当なし†	0.081384	該当なし†
米ドル建クラス					
2022年9月15日支払	0.089007	該当なし†	該当なし†	0.090210	該当なし†
2022年12月15日支払	0.074951	該当なし†	該当なし†	0.076096	該当なし†
ユーロ建クラス					
2022年9月15日支払	0.066269	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
2022年12月15日支払	0.052935	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
円建クラス					
2022年9月15日支払	6.819951	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
2022年12月15日支払	5.430339	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 3					
ボンド建クラス					
2022年9月15日支払	0.099133	0.112301	該当なし†	0.104964	該当なし†
2022年12月15日支払	0.087872	0.099652	該当なし†	0.093218	該当なし†
米ドル建クラス					
2022年9月15日支払	0.081957	0.084194	該当なし†	0.113610	該当なし†
2022年12月15日支払	0.079120	0.081330	該当なし†	0.109876	該当なし†
ユーロ建クラス					
2022年9月15日支払	該当なし†	0.107937	該当なし†	0.097147	該当なし†
2022年12月15日支払	該当なし†	0.098295	該当なし†	0.088541	該当なし†
円建クラス					
2022年9月15日支払	7.446226	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
2022年12月15日支払	6.780034	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 4					
ボンド建クラス					
2022年9月15日支払	0.055911	0.093090	該当なし†	0.133484	該当なし†
米ドル建クラス					
2022年9月15日支払	0.039130	0.102361	該当なし†	0.147278	該当なし†
ユーロ建クラス					
2022年9月15日支払	0.035809	該当なし†	該当なし†	0.105189	該当なし†
円建クラス					
2022年9月15日支払	3.777470	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 5					
ボンド建クラス					
2022年9月15日支払	0.022754	0.095536	該当なし†	0.139521	該当なし†
米ドル建クラス					
2022年9月15日支払	該当なし†	該当なし†	該当なし†	0.149860	該当なし†

	クラス A - 分配型	クラス C - 分配型	クラス I - 分配型	クラス R - 分配型	クラス Y - 分配型
ユーロ建クラス					
2022年 9 月15日支払	該当なし†	0.083919	該当なし†	該当なし†	該当なし†
円建クラス					
2022年 9 月15日支払	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 1					
ボンド建クラス					
2022年 9 月15日支払	0.024341	0.024671	該当なし†	0.024933	該当なし†
2022年10月17日支払	0.017615	0.017858	該当なし†	0.01805	該当なし†
2022年11月16日支払	0.019319	0.019586	該当なし†	0.019796	該当なし†
2022年12月15日支払	0.026407	0.026774	該当なし†	0.027062	該当なし†
2023年 1 月17日支払	0.01441	0.014613	該当なし†	0.014771	該当なし†
2023年 2 月15日支払	0.020185	0.02047	該当なし†	0.020691	該当なし†
米ドル建クラス					
2022年 9 月15日支払	0.023135	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
2022年10月17日支払	0.017424	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
2022年11月16日支払	0.019829	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
2022年12月15日支払	0.027614	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
2023年 1 月17日支払	0.014579	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
2023年 2 月15日支払	0.020733	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
ユーロ建クラス					
2022年 9 月15日支払	0.021629	0.025634	該当なし†	該当なし†	該当なし†
2022年10月17日支払	0.015726	0.01864	該当なし†	該当なし†	該当なし†
2022年11月16日支払	0.017698	0.020979	該当なし†	該当なし†	該当なし†
2022年12月15日支払	0.023913	0.028345	該当なし†	該当なし†	該当なし†
2023年 1 月17日支払	0.012598	0.014935	該当なし†	該当なし†	該当なし†
2023年 2 月15日支払	0.017824	0.021133	該当なし†	該当なし†	該当なし†
円建クラス					
2022年 9 月15日支払	2.365111	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
2022年10月17日支払	1.766674	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
2022年11月16日支払	2.056778	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
2022年12月15日支払	2.665555	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
2023年 1 月17日支払	1.376760	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
2023年 2 月15日支払	1.921333	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 2					
ボンド建クラス					
2022年 9 月15日支払	0.063334	0.067473	該当なし†	0.069583	該当なし†
2022年12月15日支払	0.059063	0.062987	該当なし†	0.064991	該当なし†
米ドル建クラス					
2022年 9 月15日支払	0.058930	0.072271	該当なし†	0.064823	該当なし†
2022年12月15日支払	0.061033	0.074929	該当なし†	0.067240	該当なし†
ユーロ建クラス					
2022年 9 月15日支払	0.053350	0.055826	該当なし†	0.058691	該当なし†
2022年12月15日支払	0.050618	0.053021	該当なし†	0.055772	該当なし†
円建クラス					
2022年 9 月15日支払	6.782444	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
2022年12月15日支払	6.579083	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 3					
ボンド建クラス					
2022年 9 月15日支払	0.072224	0.078140	0.084609	0.081259	該当なし†
2022年12月15日支払	0.064939	0.070349	0.076281	0.073207	該当なし†
米ドル建クラス					
2022年 9 月15日支払	0.066634	0.081540	該当なし†	0.075081	該当なし†
2022年12月15日支払	0.066383	0.081345	該当なし†	0.074941	該当なし†
ユーロ建クラス					
2022年 9 月15日支払	0.059195	0.064331	該当なし†	0.066814	該当なし†
2022年12月15日支払	0.054049	0.058813	該当なし†	0.061124	該当なし†
円建クラス					
2022年 9 月15日支払	7.164255	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
2022年12月15日支払	6.684168	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 4					
ボンド建クラス					
2022年 9 月15日支払	該当なし†	0.021940	0.075968	0.051199	該当なし†
米ドル建クラス					
2022年 9 月15日支払	該当なし†	該当なし†	該当なし†	0.040971	該当なし†
ユーロ建クラス					
2022年 9 月15日支払	該当なし†	0.078296	該当なし†	0.039044	該当なし†
円建クラス					
2022年 9 月15日支払	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 5					
ボンド建クラス					
2022年 9 月15日支払	- *	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
米ドル建クラス					
2022年 9 月15日支払	- *	該当なし†	- *	該当なし†	該当なし†

	クラス A - 分配型	クラス C - 分配型	クラス I - 分配型	クラス R - 分配型	クラス Y - 分配型
ユーロ建クラス 2022年9月15日支払	- *	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
円建クラス 2022年9月15日支払	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
リキッド・オルタナティブ・ストラテジーズ					
ボンド建クラス 2022年9月15日支払	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
米ドル建クラス 2022年9月15日支払	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†
ユーロ建クラス 2022年9月15日支払	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†	該当なし†

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

† 支払日において、当該株式クラスにおいて株式は発行されていません。

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

[次へ](#)

11．為替取引

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

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

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

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

2023年2月28日現在で保有する為替先渡契約は、各サブ・ファンドの投資明細表に記載されており、当該契約に附随する損益は、合算純資産計算書および合算純資産額変動計算書に含まれています。

12．取引費用および仲介手数料

2022年9月1日から2023年2月28日までに発生した各サブ・ファンドの取引費用は、譲渡可能な有価証券、デリバティブまたはその他適格資産の購入または売却に関係します。取引費用には、手数料費用、決済手数料、仲介手数料および預託取引手数料を含みます。手数料費用、決済手数料および仲介手数料は、当会計期間の合算損益計算書の投資にかかる実現利益（純額）の一部に含まれています。預託取引手数料は、当会計期間の合算損益計算書の管理事務代行報酬および保管銀行報酬の一部に含まれています。2023年2月28日に終了した会計期間中に発生した取引費用は、以下の通りです。

サブ・ファンド	取引費用（ポンド）
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ1	163
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ2	973
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ3	3,094
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ4	1,717
パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ5	602
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ1	181
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ2	456
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ3	932
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ4	255
パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ5	112
リクィッド・オルタナティブ・ストラテジーズ	-

13．世界全体のエクスポージャー

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

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

14．当会計期間における重要事象

取締役の意見では、2023年2月28日に終了した会計期間において、財務諸表の修正または開示を必要とするその他の重要な事象はありませんでした。

15．後発事象

当会計期間末以降、取締役の意見において、2023年2月28日に終了した会計期間の財務書類に対する修正または当該財務書類における開示が要求される重大な事象は生じていません。

[次へ](#)

（２）投資有価証券明細表等

パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ １

2023年２月28日現在の投資明細表（ボンド表示）

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

投 資	保有	時価 (ボンド)	純資産に 対する割合 (%)
投資信託／投資法人 100.26%			
iShares \$ Corporate Bond UCITS ETF	4,180	347,393	5.92
iShares \$ Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF USD (Dist)	7,409	776,469	13.24
iShares \$ Treasury Bond 20+yr UCITS ETF	62,608	194,786	3.32
iShares € Government Bond 1-3yr UCITS ETF	5,108	610,609	10.41
iShares Core £ Corporate Bond UCITS ETF	373	45,156	0.77
iShares Core € Corporate Bond UCITS ETF	3,058	304,612	5.19
iShares Core EURO STOXX 50 UCITS ETF	50	6,493	0.11
iShares Core FTSE 100 UCITS ETF	324	2,494	0.04
iShares Core MSCI EM IMI UCITS ETF	1,207	28,801	0.49
iShares Core MSCI Japan IMI UCITS ETF	19	688	0.01
iShares Core MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF	70	9,620	0.16
iShares Emerging Markets Government Bond Index Fund	2,742	175,094	2.99
iShares Emerging Markets Index Fund	4,652	57,582	0.98
iShares Euro Government Bond Index Fund	30,512	209,134	3.57
iShares Euro Investment Grade Corporate Bond Index Fund	12,919	103,376	1.76
iShares Europe ex-UK Index Fund	6,592	118,845	2.03
iShares Global Government Bond UCITS ETF	789	58,929	1.01
iShares Global High Yield Corporate Bond UCITS ETF	6,458	438,174	7.47
iShares Global Inflation Linked Government Bond UCITS ETF	117,087	507,771	8.66
iShares Japan Index Fund	5,599	64,523	1.10
iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF	7,386	261,522	4.46
iShares MSCI China UCITS ETF	12,082	44,494	0.76
iShares North America Index Fund	20,430	557,851	9.51
iShares Pacific Index Fund	1,321	18,192	0.31
iShares S&P 500 Swap UCITS ETF	5,174	27,188	0.46
iShares UK Credit Bond Index Fund	3,334	33,299	0.57
iShares UK Index Fund	2,478	30,839	0.53
iShares US Corporate Bond Index Fund	47,830	339,741	5.79
iShares World ex-Euro Government Bond Index Fund	78,137	506,457	8.64
投資信託／投資法人合計		5,880,132	100.26
投資有価証券合計（取得原価 6,199,084 ボンド）		5,880,132	100.26

為替先渡契約にかかる未実現利益 0.43%

Sold Australian Dollar for Sterling - Maturing 03/03/2023	AUD\$17,673		
	£10,120	276	0.01
Sold Canadian Dollars for Sterling - Maturing 03/03/2023	CAD\$28,623		
	£17,416	51	-
Sold Danish Kroner for Sterling - Maturing 03/03/2023	DKK17,136		
	£2,035	18	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 03/03/2023	€1,698,334		
	£1,499,966	12,266	0.21

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
Sold New Zealand Dollar for Sterling - Maturing 03/03/2023	NZD\$2,553		
	£1,340	33	-
Sold Norwegian Krone for Sterling - Maturing 03/03/2023	NOK16,401		
	£1,335	26	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 20/03/2023	£2,727,062		
	\$3,317,334	12,271	0.21
Sold Danish Kroner for Sterling - Maturing 05/04/2023	DKK15,000		
	£1,769	-	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 05/04/2023	€338,334		
	£296,769	-	-
Sold Norwegian Krone for Sterling - Maturing 05/04/2023	NOK15,000		
	£1,199	-	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 05/04/2023	£87,231		
	\$105,671	3	-
Sold Swedish Krona for Sterling - Maturing 05/04/2023	SEK20,000		
	£1,586	-	-
為替先渡契約にかかる未実現利益合計		24,944	0.43
為替先渡契約にかかる未実現損失（1.13%）			
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 03/03/2023	£34,211		
	¥5,459,521	(1,104)	(0.02)
Sold Swedish Krona for Sterling - Maturing 03/03/2023	SEK20,590		
	£1,599	(32)	-
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 03/03/2023	\$3,022,925		
	£2,453,927	(43,017)	(0.73)
Sold Sterling for Euro - Maturing 20/03/2023	£887,363		
	€1,005,145	(6,292)	(0.11)
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 20/03/2023	£701,400		
	¥112,837,023	(15,824)	(0.27)
Sold Australian Dollar for Sterling - Maturing 05/04/2023	AUD\$17,673		
	£9,850	-	-
Sold Canadian Dollars for Sterling - Maturing 05/04/2023	CAD\$28,623		
	£17,360	-	-
Sold Danish Kroner for Sterling - Maturing 05/04/2023	DKK2,136		
	£252	-	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 05/04/2023	€1,360,000		
	£1,192,917	(3)	-
Sold New Zealand Dollar for Sterling - Maturing 05/04/2023	NZD\$2,553		
	£1,306	-	-
Sold Norwegian Krone for Sterling - Maturing 05/04/2023	NOK1,401		
	£112	-	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 05/04/2023	£29,283		
	€33,383	(2)	-
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 05/04/2023	£37,655		
	¥6,184,728	(5)	-
Sold Swedish Krona for Sterling - Maturing 05/04/2023	SEK590		
	£47	-	-
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 05/04/2023	\$3,022,925		
	£2,495,440	(57)	-
為替先渡契約にかかる未実現損失合計		(66,336)	(1.13)

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
為替先渡契約にかかる未実現損失（純額）合計		(41,392)	(0.70)
ポートフォリオ合計 \$		5,838,740	99.56
その他純負債		26,089	0.44
純資産合計		5,864,829	100.00

これらの未決済の為替先渡契約の相手方はバンク・オブ・アメリカ、パークレイズ・バンク・ユークー・ピーエルシー、HSBC銀行、JPモルガン・チェース銀行、ノーザン・トラスト・カンパニーおよびトロント・ドミニオン銀行です。

\$ デリバティブ資産および負債を含みます。

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 2

2023年2月28日現在の投資明細表（債券表示）

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

投 資	保有	時価 (債券)	純資産に 対する割合 (%)
投資信託／投資法人 99.74%			
iShares \$ Corporate Bond UCITS ETF	15,494	1,287,682	2.97
iShares \$ Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF USD (Dist)	33,655	3,527,071	8.15
iShares \$ Treasury Bond 20+yr UCITS ETF	453,578	1,411,172	3.26
iShares € Government Bond 1-3yr UCITS ETF	23,201	2,773,443	6.41
iShares Core £ Corporate Bond UCITS ETF	1,409	170,576	0.39
iShares Core € Corporate Bond UCITS ETF	10,880	1,083,773	2.50
iShares Core EURO STOXX 50 UCITS ETF	129	16,752	0.04
iShares Core FTSE 100 UCITS ETF	4,269	32,864	0.08
iShares Core MSCI EM IMI UCITS ETF	5,397	128,780	0.30
iShares Core MSCI Japan IMI UCITS ETF	6,454	233,591	0.54
iShares Core MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF	1,469	201,885	0.47
iShares Emerging Markets Government Bond Index Fund	23,373	1,492,724	3.45
iShares Emerging Markets Index Fund	171,614	2,124,346	4.91
iShares Euro Government Bond Index Fund	160,875	1,102,673	2.55
iShares Euro Investment Grade Corporate Bond Index Fund	128,287	1,026,531	2.37
iShares Europe ex-UK Index Fund	87,897	1,584,746	3.66
iShares Global Government Bond UCITS ETF	9,074	677,726	1.57
iShares Global High Yield Corporate Bond UCITS ETF	55,075	3,736,828	8.63
iShares Global Inflation Linked Government Bond UCITS ETF	664,209	2,880,475	6.66
iShares Japan Index Fund	55,429	638,714	1.48
iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF	62,986	2,230,196	5.15
iShares MSCI China UCITS ETF	89,772	330,599	0.76
iShares North America Index Fund	245,313	6,698,446	15.48
iShares Pacific Index Fund	12,316	169,644	0.39
iShares S&P 500 Swap UCITS ETF	164,969	866,862	2.00
iShares UK Credit Bond Index Fund	29,383	293,458	0.68
iShares UK Index Fund	33,504	417,007	0.96
iShares US Corporate Bond Index Fund	486,736	3,457,335	7.99
iShares World ex-Euro Government Bond Index Fund	396,875	2,572,399	5.94
投資信託／投資法人合計		43,168,298	99.74
投資有価証券合計（取得原価 43,497,893 ポンド）		43,168,298	99.74

為替先渡契約にかかる未実現利益 0.20%

Sold Australian Dollar for Sterling - Maturing 03/03/2023	AUD\$90,439		
	£51,789	1,414	-
Sold Canadian Dollars for Sterling - Maturing 03/03/2023	CAD\$175,143		
	£106,570	309	-
Sold Danish Kroner for Sterling - Maturing 03/03/2023	DKK121,656		
	£14,447	129	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 03/03/2023	€9,336,018		
	£8,245,551	67,427	0.16

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
Sold New Zealand Dollar for Sterling - Maturing 03/03/2023	NZD\$12,968		
	£6,805	169	-
Sold Norwegian Krone for Sterling - Maturing 03/03/2023	NOK97,560		
	£7,939	151	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 20/03/2023	£4,215,716		
	\$5,128,207	18,969	0.04
Sold Danish Kroner for Sterling - Maturing 05/04/2023	DKK121,656		
	£14,343	1	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 05/04/2023	€1,866,018		
	£1,636,774	1	-
Sold Norwegian Krone for Sterling - Maturing 05/04/2023	NOK97,560		
	£7,798	-	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 05/04/2023	£557,892		
	\$675,825	18	-
Sold Swedish Krona for Sterling - Maturing 05/04/2023	SEK104,578		
	£8,293	-	-
為替先渡契約にかかる未実現利益合計		88,588	0.20
為替先渡契約にかかる未実現損失（0.78%）			
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 03/03/2023	£469,532		
	¥74,930,996	(15,153)	(0.04)
Sold Swedish Krona for Sterling - Maturing 03/03/2023	SEK104,578		
	£8,121	(162)	-
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 03/03/2023	\$18,936,176		
	£15,371,861	(269,468)	(0.62)
Sold Sterling for Euro - Maturing 20/03/2023	£5,783,792		
	€6,551,489	(41,009)	(0.09)
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 20/03/2023	£516,616		
	¥83,110,048	(11,655)	(0.03)
Sold Australian Dollar for Sterling - Maturing 05/04/2023	AUD\$90,439		
	£50,405	(1)	-
Sold Canadian Dollars for Sterling - Maturing 05/04/2023	CAD\$175,143		
	£106,227	(2)	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 05/04/2023	€7,470,000		
	£6,552,273	(16)	-
Sold New Zealand Dollar for Sterling - Maturing 05/04/2023	NZD\$12,968		
	£6,633	-	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 05/04/2023	£177,282		
	€202,101	(9)	-
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 05/04/2023	£480,196		
	¥78,871,000	(58)	-
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 05/04/2023	\$18,930,864		
	£15,627,524	(355)	-
為替先渡契約にかかる未実現損失合計		(337,888)	(0.78)
為替先渡契約にかかる未実現損失（純額）合計		(249,300)	(0.58)
ポートフォリオ合計 \$		42,918,998	99.16
その他純資産		362,453	0.84

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
純資産合計		43,281,451	100.00

これらの未決済の為替先渡契約の相手方はバンク・オブ・アメリカ、パークレイズ・バンク・ユークー・ピーエルシー、HSBC銀行、JPモルガン・チェース銀行およびノーザン・トラスト・カンパニーです。

§ デリバティブ資産および負債を含みます。

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 3

2023年2月28日現在の投資明細表（ボンド表示）

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

投 資	保有	時価 (ボンド)	純資産に 対する割合 (%)
投資信託／投資法人 99.71%			
iShares \$ Corporate Bond UCITS ETF	39,802	3,307,881	2.00
iShares \$ Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF USD (Dist)	58,165	6,095,739	3.68
iShares \$ Treasury Bond 20+yr UCITS ETF	1,807,881	5,624,679	3.40
iShares € Government Bond 1-3yr UCITS ETF	40,098	4,793,307	2.89
iShares Core £ Corporate Bond UCITS ETF	3,552	430,012	0.26
iShares Core € Corporate Bond UCITS ETF	28,771	2,865,922	1.73
iShares Core EURO STOXX 50 UCITS ETF	15,839	2,056,838	1.24
iShares Core FTSE 100 UCITS ETF	7,393	56,914	0.03
iShares Core MSCI EM IMI UCITS ETF	23,070	550,482	0.33
iShares Core MSCI Japan IMI UCITS ETF	19,298	698,458	0.42
iShares Core MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF	8,063	1,108,101	0.67
iShares Emerging Markets Government Bond Index Fund	88,603	5,658,791	3.42
iShares Emerging Markets Index Fund	1,194,919	14,791,451	8.93
iShares Euro Government Bond Index Fund	362,459	2,484,370	1.50
iShares Euro Investment Grade Corporate Bond Index Fund	358,053	2,865,082	1.73
iShares Europe ex-UK Index Fund	438,309	7,902,578	4.77
iShares Global Government Bond UCITS ETF	20,702	1,546,208	0.93
iShares Global High Yield Corporate Bond UCITS ETF	206,146	13,986,965	8.44
iShares Global Inflation Linked Government Bond UCITS ETF	1,491,524	6,468,292	3.91
iShares Japan Index Fund	411,579	4,742,649	2.86
iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF	235,738	8,346,964	5.04
iShares MSCI China UCITS ETF	344,612	1,269,085	0.77
iShares North America Index Fund	1,166,140	31,842,332	19.22
iShares Pacific Index Fund	89,704	1,235,588	0.75
iShares S&P 500 Swap UCITS ETF	211,495	1,111,343	0.67
iShares UK Credit Bond Index Fund	82,630	825,262	0.50
iShares UK Index Fund	212,176	2,640,856	1.59
iShares US Corporate Bond Index Fund	1,354,121	9,618,464	5.81
iShares US Index Fund	865,205	14,389,783	8.69
iShares World ex-Euro Government Bond Index Fund	900,949	5,839,629	3.53
投資信託／投資法人合計		165,154,025	99.71
投資有価証券合計（取得原価 152,178,422 ボンド）		165,154,025	99.71

為替先渡契約にかかる未実現利益 0.16%

Sold Australian Dollar for Sterling - Maturing 03/03/2023	AUD\$218,709		
	£125,243	3,419	-
Sold Canadian Dollars for Sterling - Maturing 03/03/2023	CAD\$459,872		
	£279,820	813	-
Sold Danish Kroner for Sterling - Maturing 03/03/2023	DKK257,518		
	£30,582	272	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 03/03/2023	€23,828,803		
	£21,045,558	172,106	0.10
Sold Japanese Yen for Sterling - Maturing 03/03/2023	¥33,600,493		

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
	£210,782	7,029	0.01
Sold New Zealand Dollar for Sterling - Maturing 03/03/2023	NZD\$29,400		
	£15,429	383	-
Sold Norwegian Krone for Sterling - Maturing 03/03/2023	NOK232,879		
	£18,951	360	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 03/03/2023	£21,045		
	\$25,942	384	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 20/03/2023	€1,000		
	£891	14	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 20/03/2023	£16,692,433		
	\$20,305,510	75,109	0.05
Sold Danish Kroner for Sterling - Maturing 05/04/2023	DKK257,518		
	£30,361	2	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 05/04/2023	€4,763,803		
	£4,178,560	4	-
Sold Norwegian Krone for Sterling - Maturing 05/04/2023	NOK232,879		
	£18,613	1	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 05/04/2023	£1,423,578		
	\$1,724,509	45	-
Sold Swedish Krona for Sterling - Maturing 05/04/2023	SEK237,402		
	£18,825	1	-
為替先渡契約にかかる未実現利益合計		259,942	0.16
為替先渡契約にかかる未実現損失（0.58%）			
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 03/03/2023	£3,009,258		
	¥480,240,024	(97,101)	(0.06)
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 03/03/2023	£138,469		
	\$166,787	(703)	-
Sold Swedish Krona for Sterling - Maturing 03/03/2023	SEK237,402		
	£18,436	(367)	-
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 03/03/2023	\$52,897,522		
	£42,940,730	(752,756)	(0.46)
Sold Sterling for Euro - Maturing 20/03/2023	£11,990,696		
	€13,581,868	(85,352)	(0.05)
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 20/03/2023	£1,055,933		
	¥169,872,172	(23,823)	(0.01)
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 20/03/2023	\$202,712		
	£166,638	(754)	-
Sold Australian Dollar for Sterling - Maturing 05/04/2023	AUD\$218,709		
	£121,896	(1)	-
Sold Canadian Dollars for Sterling - Maturing 05/04/2023	CAD\$459,872		
	£278,920	(6)	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 05/04/2023	€19,065,000		
	£16,722,769	(41)	-
Sold New Zealand Dollar for Sterling - Maturing 05/04/2023	NZD\$29,400		
	£15,037	-	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 05/04/2023	£525,900		
	€599,526	(27)	-
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 05/04/2023	£2,772,490		
	¥455,376,528	(321)	-

投 資	保有	時価 (ボンド)	純資産に 対する割合 (%)
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 05/04/2023	\$52,704,792		
	£43,508,073	(987)	-
為替先渡契約にかかる未実現損失合計		(962,239)	(0.58)
為替先渡契約にかかる未実現損失（純額）合計		(702,297)	(0.42)
ポートフォリオ合計 §		164,451,728	99.29
その他純負債		1,177,286	0.71
純資産合計		165,629,014	100.00

これらの未決済の為替先渡契約の相手方はバンク・オブ・アメリカ、パークレイズ・バンク・ユークー・ビーエルシー、HSBC銀行、JPモルガン・チェース銀行、モルガン・スタンレー、スタンダードチャータード銀行およびノーザン・トラスト・カンパニーです。

§ デリバティブ資産および負債を含みます。

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 4

2023年2月28日現在の投資明細表（ボンド表示）

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

投 資	保有	時価 (ボンド)	純資産に 対する割合 (%)
投資信託／投資法人 98.71%			
iShares \$ Corporate Bond UCITS ETF	15,663	1,301,727	1.22
iShares \$ Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF USD (Dist)	5,611	588,037	0.55
iShares \$ Treasury Bond 20+yr UCITS ETF	1,018,425	3,168,524	2.97
iShares € Government Bond 1-3yr UCITS ETF	3,868	462,380	0.43
iShares Core £ Corporate Bond UCITS ETF	1,499	181,472	0.17
iShares Core € Corporate Bond UCITS ETF	11,469	1,142,444	1.07
iShares Core EURO STOXX 50 UCITS ETF	13,543	1,758,682	1.65
iShares Core FTSE 100 UCITS ETF	49,312	379,619	0.36
iShares Core MSCI EM IMI UCITS ETF	92,421	2,205,294	2.07
iShares Core MSCI Japan IMI UCITS ETF	35,832	1,296,878	1.22
iShares Core MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF	8,698	1,195,369	1.12
iShares Emerging Markets Government Bond Index Fund	46,518	2,970,971	2.79
iShares Emerging Markets Index Fund	1,025,868	12,698,835	11.91
iShares Euro Investment Grade Corporate Bond Index Fund	98,664	789,493	0.74
iShares Europe ex-UK Index Fund	390,608	7,042,532	6.60
iShares Global Government Bond UCITS ETF	33,797	2,524,257	2.37
iShares Global High Yield Corporate Bond UCITS ETF	108,091	7,333,953	6.88
iShares Global Inflation Linked Government Bond UCITS ETF	391,741	1,698,863	1.59
iShares Japan Index Fund	303,729	3,499,880	3.28
iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF	124,517	4,408,873	4.13
iShares MSCI China UCITS ETF	233,839	861,147	0.81
iShares North America Index Fund	736,392	20,107,738	18.85
iShares Pacific Index Fund	66,545	916,591	0.86
iShares S&P 500 Swap UCITS ETF	489,894	2,574,246	2.41
iShares UK Credit Bond Index Fund	22,868	228,391	0.21
iShares UK Index Fund	160,935	2,003,085	1.88
iShares US Corporate Bond Index Fund	379,930	2,698,683	2.53
iShares US Index Fund	1,156,926	19,241,587	18.04
投資信託／投資法人合計		105,279,551	98.71
投資有価証券合計（取得原価 89,845,934 ボンド）		105,279,551	98.71

為替先渡契約にかかる未実現利益 0.11%

Sold Canadian Dollars for Sterling - Maturing 03/03/2023	CAD\$179,917		
	£109,475	318	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 03/03/2023	€8,220,852		
	£7,260,639	59,372	0.06
Sold Japanese Yen for Sterling - Maturing 03/03/2023	¥7,623,962		
	£46,904	672	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 03/03/2023	£146,903		
	\$179,639	1,480	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 20/03/2023	€790,929		
	£697,421	4,123	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 20/03/2023	£10,716,422		
	\$13,035,970	48,202	0.04
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 20/03/2023	\$2,059,919		
	£1,706,709	5,704	0.01
Sold Euro for Sterling - Maturing 05/04/2023	€1,565,501		
	£1,373,176	1	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 05/04/2023	£605,536		

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
	\$733,942	351	-
為替先渡契約にかかる未実現利益合計		120,223	0.11
為替先渡契約にかかる未実現損失 (0.41%)			
Sold Sterling for Euro - Maturing 03/03/2023	£172,200		
	€195,055	(1,337)	-
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 03/03/2023	£2,374,507		
	¥378,942,225	(76,616)	(0.07)
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 03/03/2023	£160,249		
	\$193,786	(181)	-
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 03/03/2023	\$21,035,827		
	£17,076,300	(299,346)	(0.28)
Sold Sterling for Euro - Maturing 20/03/2023	£8,435,395		
	€9,555,059	(59,797)	(0.06)
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 20/03/2023	£167,257		
	¥26,907,354	(3,773)	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 20/03/2023	£2,371		
	\$2,853	(16)	-
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 20/03/2023	\$677,690		
	£557,997	(1,615)	-
Sold Canadian Dollars for Sterling - Maturing 05/04/2023	CAD\$179,917		
	£109,123	(3)	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 05/04/2023	€6,265,000		
	£5,495,313	(13)	-
Sold Japanese Yen for Sterling - Maturing 05/04/2023	¥3,903,796		
	£23,681	(84)	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 05/04/2023	£229,016		
	€260,984	(95)	-
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 05/04/2023	£2,240,053		
	¥367,925,871	(253)	-
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 05/04/2023	\$20,145,797		
	£16,630,458	(377)	-
為替先渡契約にかかる未実現損失合計		(443,506)	(0.41)
為替先渡契約にかかる未実現損失(純額)合計		(323,283)	(0.30)
ポートフォリオ合計 \$		104,956,268	98.41
その他純負債		1,693,781	1.59
純資産合計		106,650,049	100.00

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

§ デリバティブ資産および負債を含みます。

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ 5

2023年2月28日現在の投資明細表（ボンド表示）

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

投 資	保有	時価 (ボンド)	純資産に 対する割合 (%)
投資信託／投資法人 99.98%			
iShares \$ Corporate Bond UCITS ETF	7,897	656,307	1.00
iShares \$ Treasury Bond 1-3yr UCITS ETF USD (Dist)	3,522	369,108	0.56
iShares \$ Treasury Bond 20+yr UCITS ETF	606,739	1,887,686	2.86
iShares € Government Bond 1-3yr UCITS ETF	2,494	298,132	0.45
iShares Core £ Corporate Bond UCITS ETF	674	81,596	0.12
iShares Core € Corporate Bond UCITS ETF	5,638	561,610	0.85
iShares Core EURO STOXX 50 UCITS ETF	2,034	264,133	0.40
iShares Core FTSE 100 UCITS ETF	27,686	213,135	0.32
iShares Core MSCI EM IMI UCITS ETF	65,848	1,571,226	2.38
iShares Core MSCI Japan IMI UCITS ETF	20,503	742,071	1.12
iShares Core MSCI Pacific ex-Japan UCITS ETF	4,833	664,201	1.01
iShares Emerging Markets Government Bond Index Fund	14,164	904,589	1.37
iShares Emerging Markets Index Fund	772,119	9,557,767	14.47
iShares Europe ex-UK Index Fund	351,352	6,334,766	9.59
iShares Global Government Bond UCITS ETF	10,308	769,892	1.17
iShares Global High Yield Corporate Bond UCITS ETF	34,454	2,337,697	3.54
iShares Global Inflation Linked Government Bond UCITS ETF	106,235	460,709	0.70
iShares Japan Index Fund	250,302	2,884,246	4.37
iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF	38,635	1,367,980	2.07
iShares MSCI China UCITS ETF	136,459	502,531	0.76
iShares North America Index Fund	450,373	12,297,773	18.62
iShares Pacific Index Fund	70,200	966,935	1.47
iShares S&P 500 Swap UCITS ETF	1,471,793	7,733,831	11.71
iShares UK Index Fund	133,830	1,665,729	2.52
iShares US Index Fund	657,211	10,930,510	16.55
投資信託／投資法人合計		66,024,160	99.98
投資有価証券合計（取得原価 53,542,658 ボンド）		66,024,160	99.98

為替先渡契約にかかる未実現利益 0.09%

Sold Canadian Dollars for Sterling - Maturing 03/03/2023	CAD\$55,240		
	£33,612	98	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 03/03/2023	€2,562,145		
	£2,262,880	18,504	0.03
Sold Euro for Sterling - Maturing 20/03/2023	€462,501		
	£407,686	2,275	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 20/03/2023	£7,881,267		
	\$9,587,167	35,462	0.06
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 20/03/2023	\$326,728		
	£270,620	819	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 05/04/2023	€512,145		
	£449,227	-	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 05/04/2023	£150,874		
	\$182,767	5	-

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
為替先渡契約にかかる未実現利益合計		57,163	0.09
為替先渡契約にかかる未実現損失 (0.36%)			
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 03/03/2023	£1,607,039		
	¥256,463,782	(51,853)	(0.08)
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 03/03/2023	\$7,036,519		
	£5,713,673	(98,509)	(0.15)
Sold Sterling for Euro - Maturing 20/03/2023	£11,682,909		
	€13,233,610	(82,835)	(0.13)
Sold Canadian Dollars for Sterling - Maturing 05/04/2023	CAD\$55,240		
	£33,504	(1)	-
Sold Euro for Sterling - Maturing 05/04/2023	€2,050,000		
	£1,798,147	(4)	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 05/04/2023	£24,286		
	€27,687	(1)	-
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 05/04/2023	£1,561,436		
	¥256,463,782	(176)	-
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 05/04/2023	\$7,036,519		
	£5,808,682	(132)	-
為替先渡契約にかかる未実現損失合計		(233,511)	(0.36)
為替先渡契約にかかる未実現損失(純額)合計		(176,348)	(0.27)
ポートフォリオ合計 \$		65,847,812	99.71
その他純資産		193,080	0.29
純資産合計		66,040,892	100.00

これらの未決済の為替先渡契約の相手方はバンク・オブ・アメリカ、パークレイズ・バンク・ユーケー・ピーエルシー、HSBC銀行、JPモルガン・チェース銀行およびノーザン・トラスト・カンパニーです。

\$ デリバティブ資産および負債を含みます。

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 1

2023年2月28日現在の投資明細表（債券表示）

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

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
投資信託／投資法人 98.51%			
Barclays Capital Emerging Markets Local Bond UCITS ETF†	6,300	284,989	0.94
GlobalAccess Asia Pacific (ex-Japan) Fund*	192,300	594,529	1.95
GlobalAccess Emerging Market Debt Fund*	1,218,923	970,587	3.18
GlobalAccess Emerging Market Equity Fund*	875,360	784,763	2.58
GlobalAccess Emerging Market Local Currency Debt Fund*	2,605,628	1,067,519	3.50
GlobalAccess Europe (ex-UK) Alpha Fund*	284,883	665,304	2.18
GlobalAccess Global Corporate Bond Fund*	4,679,960	4,035,133	13.24
GlobalAccess Global Government Bond Fund*	4,402,760	4,273,894	14.02
GlobalAccess Global High Yield Bond Fund*	2,015,950	1,713,470	5.62
GlobalAccess Global Short Duration Bond Fund*	2,320,839	3,072,723	10.08
GlobalAccess Japan Fund*	295,300	363,871	1.19
GlobalAccess UK Opportunities Fund*	50,850	172,781	0.57
GlobalAccess US Equity Fund*	74,620	2,814,509	9.23
GlobalAccess US Small & Mid Cap Equity Fund*	283,850	673,836	2.21
Institutional Cash Series Plc			
- Institutional Sterling Liquidity Fund	4,420,705	4,420,705	14.50
iShares Global Corp Bond UCITS ETF	146,900	646,375	2.12
iShares USD High Yield Bond UCITS ETF	154,900	642,510	2.11
Pimco GIS Global Real Return Institutional GBP (Dist)	320,330	2,585,063	8.48
Xtrackers MSCI China UCITS ETF	38,000	246,004	0.81
投資信託／投資法人合計		30,028,565	98.51
投資有価証券合計（取得原価 30,174,348 ポンド）		30,028,565	98.51

先物契約にかかる未実現利益 0.16%#

FTSE 100 Index Future Expiry March 2023	4	13,150	0.04
MSCI Emerging Markets Index Future Expiry March 2023	(22)	34,316	0.11
US Treasury Bond Future CBT Expiry June 2023	7	1,133	0.01
US Treasury Bond Future Expiry June 2023	7	1,039	-
先物契約にかかる未実現利益合計		49,638	0.16

先物契約にかかる未実現損失（0.19%）#

FTSE 250 Index Future Expiry March 2023	(8)	(45,163)	(0.15)
Russel 2000 Emini Index Future Expiry March 2023	(6)	(12,615)	(0.04)
先物契約にかかる未実現損失合計		(57,778)	(0.19)

先物契約にかかる未実現損失（純額）合計		(8,140)	(0.03)
---------------------	--	---------	--------

為替先渡契約にかかる未実現利益 0.60%

Sold US Dollars for Sterling - Maturing 06/03/2023	\$18,686,525		
	£15,564,314	129,757	0.43
Sold Euro for Sterling - Maturing 16/03/2023	€630,406		
	£556,398	3,900	0.01
Sold Japanese Yen for Sterling - Maturing 16/03/2023	¥119,009		
	£734	11	-

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 16/03/2023	£7,744,426		
	\$9,436,173	48,182	0.16
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 16/03/2023	\$242,359		
	£200,815	670	-
為替先渡契約にかかる未実現利益合計		182,520	0.60
為替先渡契約にかかる未実現損失（0.58%）			
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 06/03/2023	£816,088		
	¥128,800,000	(34,859)	(0.12)
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 06/03/2023	£577,041		
	\$695,700	(2,412)	(0.01)
Sold Sterling for Euro - Maturing 16/03/2023	£15,526,321		
	€17,558,746	(137,570)	(0.45)
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 16/03/2023	£26,689		
	¥4,286,756	(656)	-
為替先渡契約にかかる未実現損失合計		(175,497)	(0.58)
為替先渡契約にかかる未実現利益（純額）合計		7,023	0.02
ポートフォリオ合計 §		30,027,448	98.50
その他純資産		456,393	1.50
純資産合計		30,483,841	100.00

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

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

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

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

先物契約の約定の絶対額は3,482,447ポンドで、証拠金額268,776ポンドは、合算純資産計算書の現金預金および当座借越の各残高に開示されています。

§ デリバティブ資産および負債を含みます。

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 2

2023年2月28日現在の投資明細表（債券表示）

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

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
投資信託／投資法人 98.70%			
Barclays Capital Emerging Markets Local Bond UCITS ETF†	13,000	588,073	0.87
GlobalAccess Asia Pacific (ex-Japan) Fund*	758,420	2,344,787	3.45
GlobalAccess Emerging Market Debt Fund*	3,056,462	2,433,758	3.58
GlobalAccess Emerging Market Equity Fund*	3,994,640	3,581,209	5.27
GlobalAccess Emerging Market Local Currency Debt Fund*	6,864,189	2,812,239	4.14
GlobalAccess Europe (ex-UK) Alpha Fund*	1,071,141	2,501,500	3.68
GlobalAccess Global Corporate Bond Fund*	7,941,672	6,847,431	10.08
GlobalAccess Global Government Bond Fund*	7,453,350	7,235,194	10.65
GlobalAccess Global High Yield Bond Fund*	5,526,550	4,697,327	6.92
GlobalAccess Global Short Duration Bond Fund*	5,205,638	6,892,111	10.15
GlobalAccess Japan Fund*	1,178,500	1,452,158	2.14
GlobalAccess UK Opportunities Fund*	201,380	684,261	1.01
GlobalAccess US Equity Fund*	298,855	11,272,181	16.59
GlobalAccess US Small & Mid Cap Equity Fund*	1,032,950	2,452,136	3.61
iShares Global Corp Bond UCITS ETF	312,650	1,375,691	2.02
iShares USD High Yield Bond UCITS ETF	336,200	1,394,524	2.05
Pimco GIS Global Real Return Institutional GBP (Dist)	561,100	4,528,077	6.67
Royal London Cash Plus Fund	3,378,297	3,387,858	4.99
Xtrackers MSCI China UCITS ETF	87,000	563,220	0.83
投資信託／投資法人合計		67,043,735	98.70
投資有価証券合計（取得原価 64,107,747 ポンド）		67,043,735	98.70
先物契約にかかる未実現利益 0.14%#			
FTSE 100 Index Future Expiry March 2023	9	29,588	0.04
MSCI Emerging Markets Index Future Expiry March 2023	(50)	59,142	0.09
US Treasury Bond Future CBT Expiry June 2023	17	2,523	0.01
US Treasury Bond Future Expiry June 2023	15	2,420	-
先物契約にかかる未実現利益合計		93,673	0.14
先物契約にかかる未実現損失（0.18%）#			
FTSE 250 Index Future Expiry March 2023	(18)	(68,921)	(0.10)
Russel 2000 Emini Index Future Expiry March 2023	(25)	(52,562)	(0.08)
先物契約にかかる未実現損失合計		(121,483)	(0.18)
先物契約にかかる未実現損失（純額）合計		(27,810)	(0.04)
為替先渡契約にかかる未実現利益 0.53%			
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 06/03/2023	£45,642		
	\$55,466	171	-
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 06/03/2023	\$39,992,982		
	£33,310,862	277,755	0.41
Sold Euro for Sterling - Maturing 16/03/2023	€1,317,988		
	£1,162,670	7,565	0.01
Sold Japanese Yen for Sterling - Maturing 16/03/2023	¥1,179,710		

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
	£7,273	109	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 16/03/2023	£11,422,264		
	\$13,917,424	71,064	0.11
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 16/03/2023	\$426,230		
	£353,235	1,244	-
為替先渡契約にかかる未実現利益合計		357,908	0.53
為替先渡契約にかかる未実現損失 (0.57%)			
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 06/03/2023	£1,792,280		
	¥282,868,750	(76,556)	(0.11)
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 06/03/2023	£2,432,049		
	\$2,933,889	(8,737)	(0.02)
Sold Sterling for Euro - Maturing 16/03/2023	£32,925,431		
	€37,235,432	(291,734)	(0.43)
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 16/03/2023	£239,026		
	¥38,392,108	(5,877)	(0.01)
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 16/03/2023	£9,977		
	\$12,000	(67)	-
為替先渡契約にかかる未実現損失合計		(382,971)	(0.57)
為替先渡契約にかかる未実現損失(純額)合計		(25,063)	(0.04)
ポートフォリオ合計 §		66,990,862	98.62
その他純資産		935,950	1.38
純資産合計		67,926,812	100.00

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

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

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

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

先物契約の絶対約定額は8,819,249ポンドで、証拠金額551,941ポンドは、合算純資産計算書の現金預金および当座借越の各残高に開示されています。

§ デリバティブ資産および負債を含みます。

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 3

2023年2月28日現在の投資明細表（債券表示）

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

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
投資信託／投資法人 93.61%			
Barclays Capital Emerging Markets Local Bond UCITS ETF †	44,500	2,013,018	1.06
GlobalAccess Asia Pacific (ex-Japan) Fund*	3,615,493	11,177,922	5.88
GlobalAccess Emerging Market Debt Fund*	8,496,366	6,765,371	3.56
GlobalAccess Emerging Market Equity Fund*	15,987,498	14,332,847	7.54
GlobalAccess Emerging Market Local Currency Debt Fund*	18,948,818	7,763,278	4.09
GlobalAccess Europe (ex-UK) Alpha Fund*	4,965,274	11,595,701	6.10
GlobalAccess Global Corporate Bond Fund*	15,423,889	13,298,712	7.00
GlobalAccess Global Government Bond Fund*	12,287,800	11,928,143	6.28
GlobalAccess Global High Yield Bond Fund*	15,203,334	12,922,174	6.80
GlobalAccess Global Short Duration Bond Fund*	9,602,455	12,713,367	6.69
GlobalAccess Japan Fund*	5,123,800	6,313,592	3.32
GlobalAccess UK Opportunities Fund*	1,072,197	3,643,177	1.92
GlobalAccess US Equity Fund*	948,700	35,782,966	18.83
GlobalAccess US Small & Mid Cap Equity Fund*	4,880,992	11,587,062	6.10
iShares Global Corp Bond UCITS ETF	803,250	3,534,380	1.86
iShares USD High Yield Bond UCITS ETF	909,100	3,770,856	1.99
Pimco GIS Global Real Return Institutional GBP (Dist)	890,000	7,182,300	3.78
Xtrackers MSCI China UCITS ETF	238,000	1,540,763	0.81
投資信託／投資法人合計		177,865,629	93.61
投資有価証券合計（取得原価 158,800,673 ポンド）		177,865,629	93.61
先物契約にかかる未実現利益 0.16%#			
FTSE 100 Index Future Expiry March 2023	24	92,820	0.05
MSCI Emerging Markets Index Future Expiry March 2023	(150)	198,956	0.10
US Treasury Bond Future CBT Expiry June 2023	45	10,164	0.01
US Treasury Bond Future Expiry June 2023	39	9,326	-
先物契約にかかる未実現利益合計		311,266	0.16
先物契約にかかる未実現損失（0.33%）#			
FTSE 250 Index Future Expiry March 2023	(49)	(81,487)	(0.04)
Russel 2000 Emini Index Future Expiry March 2023	(112)	(234,553)	(0.13)
S&P 500 Emini Index Future Expiry March 2023	94	(309,028)	(0.16)
先物契約にかかる未実現損失合計		(625,068)	(0.33)
先物契約にかかる未実現損失（純額）合計		(313,802)	(0.17)
為替先渡契約にかかる未実現利益 0.35%			
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 06/03/2023	\$64,604,316		
	£53,810,164	448,771	0.24
Sold Euro for Sterling - Maturing 16/03/2023	€1,707,304		
	£1,505,106	8,799	-
Sold Japanese Yen for Sterling - Maturing 16/03/2023	¥2,606,518		
	£15,990	161	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 16/03/2023	£32,947,699		
	\$40,145,025	204,985	0.11
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 16/03/2023	\$30,297		

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
	£25,214	194	-
為替先渡契約にかかる未実現利益合計		662,910	0.35
為替先渡契約にかかる未実現損失 (0.44%)			
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 06/03/2023	£5,418,619		
	¥855,200,000	(231,453)	(0.12)
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 06/03/2023	£1,274,132		
	\$1,535,100	(6,182)	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 16/03/2023	£65,923,563		
	€74,553,072	(584,122)	(0.31)
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 16/03/2023	£745,656		
	¥119,766,595	(18,332)	(0.01)
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 16/03/2023	\$775,042		
	£639,456	(592)	-
為替先渡契約にかかる未実現損失合計		(840,681)	(0.44)
為替先渡契約にかかる未実現損失(純額)合計		(177,771)	(0.09)
ポートフォリオ合計 §		177,374,056	93.35
その他純資産		12,643,428	6.65
純資産合計		190,017,484	100.00

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

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

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

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

先物契約の絶対約定額は56,558,010ポンドで、証拠金額2,410,841ポンドは、合算純資産計算書の現金預金および当座借越の各残高に開示されています。

§ デリバティブ資産および負債を含みます。

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 4

2023年2月28日現在の投資明細表（債券表示）

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

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
投資信託／投資法人 95.92%			
Barclays Capital Emerging Markets Local Bond UCITS ETF†	10,800	488,553	1.02
GlobalAccess Asia Pacific (ex-Japan) Fund*	1,233,950	3,814,970	7.97
GlobalAccess Emerging Market Debt Fund*	1,759,138	1,400,743	2.92
GlobalAccess Emerging Market Equity Fund*	5,695,863	5,106,360	10.67
GlobalAccess Emerging Market Local Currency Debt Fund*	3,691,738	1,512,495	3.16
GlobalAccess Europe (ex-UK) Alpha Fund*	1,743,890	4,072,612	8.51
GlobalAccess Global Corporate Bond Fund*	2,205,800	1,901,874	3.97
GlobalAccess Global Government Bond Fund*	1,448,800	1,406,394	2.94
GlobalAccess Global High Yield Bond Fund*	2,915,550	2,478,091	5.18
GlobalAccess Japan Fund*	1,792,040	2,208,168	4.61
GlobalAccess UK Opportunities Fund*	369,127	1,254,242	2.62
GlobalAccess US Equity Fund*	240,088	9,055,629	18.92
GlobalAccess US Small & Mid Cap Equity Fund*	1,622,150	3,850,847	8.04
iShares Global Corp Bond UCITS ETF	215,000	946,021	1.98
iShares USD High Yield Bond UCITS ETF	229,750	952,980	1.99
Ossiam Shiller Barclays Cape US Sector Value UCITS ETF	3,265	2,925,946	6.11
Pimco GIS Global Real Return Institutional GBP (Dist)	95,300	769,071	1.61
Xtrackers MSCI China UCITS ETF	60,000	388,428	0.81
Xtrackers S&P 500 Swap UCITS ETF	193,000	1,381,887	2.89
投資信託／投資法人合計		45,915,311	95.92
投資有価証券合計（取得原価 39,854,232 ポンド）		45,915,311	95.92
先物契約にかかる未実現利益 0.16%#			
FTSE 100 Index Future Expiry March 2023	6	19,725	0.04
MSCI Emerging Markets Index Future Expiry March 2023	(34)	56,946	0.12
US Treasury Bond Future CBT Expiry June 2023	8	1,187	-
US Treasury Bond Future Expiry June 2023	4	647	-
先物契約にかかる未実現利益合計		78,505	0.16
先物契約にかかる未実現損失（0.54%）#			
FTSE 250 Index Future Expiry March 2023	(12)	(69,832)	(0.15)
Russel 2000 Emini Index Future Expiry March 2023	(37)	(77,792)	(0.16)
S&P 500 Emini Index Future Expiry March 2023	29	(110,309)	(0.23)
先物契約にかかる未実現損失合計		(257,933)	(0.54)
先物契約にかかる未実現損失（純額）合計		(179,428)	(0.38)
為替先渡契約にかかる未実現利益 0.18%			
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 06/03/2023	\$7,230,291		
	£6,022,342	50,320	0.10
Sold Euro for Sterling - Maturing 16/03/2023	€702,146		
	£619,093	3,721	0.01
Sold Japanese Yen for Sterling - Maturing 16/03/2023	¥5,187,092		
	£31,978	478	-
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 16/03/2023	£5,119,990		

投 資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
	\$6,238,436	31,854	0.07
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 16/03/2023	\$195,730		
	£162,171	533	-
為替先渡契約にかかる未実現利益合計		86,906	0.18
為替先渡契約にかかる未実現損失（0.42%）			
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 06/03/2023	£1,330,578		
	¥210,000,000	(56,835)	(0.12)
Sold Sterling for Euro - Maturing 16/03/2023	£13,605,903		
	€15,387,226	(120,305)	(0.25)
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 16/03/2023	£1,010,372		
	¥162,284,903	(24,841)	(0.05)
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 16/03/2023	\$8,536		
	£7,018	(31)	-
為替先渡契約にかかる未実現損失合計		(202,012)	(0.42)
為替先渡契約にかかる未実現損失（純額）合計		(115,106)	(0.24)
ポートフォリオ合計 §		45,620,777	95.30
その他純資産		2,248,217	4.70
純資産合計		47,868,994	100.00

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

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

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

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

先物契約の絶対約定額は11,269,828ポンドで、証拠金額610,131ポンドは、合算純資産計算書の現金預金および当座借越の各残高に開示されています。

§ デリバティブ資産および負債を含みます。

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ 5

2023年2月28日現在の投資明細表（債券表示）

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

投資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
投資信託／投資法人 94.32%			
Barclays Capital Emerging Markets Local Bond UCITS ETF †	4,750	214,873	1.26
GlobalAccess Asia Pacific (ex-Japan) Fund*	510,162	1,577,253	9.27
GlobalAccess Emerging Market Debt Fund*	328,416	261,507	1.54
GlobalAccess Emerging Market Equity Fund*	2,360,011	2,115,758	12.44
GlobalAccess Emerging Market Local Currency Debt Fund*	311,795	127,741	0.75
GlobalAccess Europe (ex-UK) Alpha Fund*	746,046	1,742,285	10.25
GlobalAccess Global Corporate Bond Fund*	193,500	166,838	0.98
GlobalAccess Global Government Bond Fund*	248,720	241,440	1.42
GlobalAccess Global High Yield Bond Fund*	414,000	351,882	2.07
GlobalAccess Japan Fund*	738,270	909,703	5.35
GlobalAccess UK Opportunities Fund*	137,621	467,618	2.75
GlobalAccess US Equity Fund*	84,677	3,193,838	18.78
GlobalAccess US Small & Mid Cap Equity Fund*	664,087	1,576,487	9.27
iShares Global Corp Bond UCITS ETF	39,170	172,352	1.01
iShares USD High Yield Bond UCITS ETF	60,080	249,206	1.47
Ossiam Shiller Barclays Cape US Sector Value UCITS ETF	1,351	1,210,705	7.12
Pimco GIS Global Real Return Institutional GBP (Dist)	17,230	139,046	0.82
Xtrackers MSCI China UCITS ETF	21,000	135,950	0.80
Xtrackers S&P 500 Swap UCITS ETF	165,500	1,184,986	6.97
投資信託／投資法人合計		16,039,468	94.32
投資有価証券合計（取得原価 13,719,192 ポンド）		16,039,468	94.32
先物契約にかかる未実現利益 0.14%#			
FTSE 100 Index Future Expiry March 2023	2	6,575	0.04
MSCI Emerging Markets Index Future Expiry March 2023	(11)	17,158	0.10
US Treasury Bond Future CBT Expiry June 2023	3	445	-
US Treasury Bond Future Expiry June 2023	2	324	-
先物契約にかかる未実現利益合計		24,502	0.14
先物契約にかかる未実現損失（0.50%）#			
HSBC FTSE 250 Index Future Expiry March 2023	(4)	(14,233)	(0.08)
Russel 2000 Emini Index Future Expiry March 2023	(15)	(31,537)	(0.19)
S&P 500 Emini Index Future Expiry March 2023	12	(39,911)	(0.23)
先物契約にかかる未実現損失合計		(85,681)	(0.50)
先物契約にかかる未実現損失（純額）合計			
		(61,179)	(0.36)
為替先渡契約にかかる未実現利益 0.19%			
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 06/03/2023	\$610,550		
	£508,418	4,120	0.03
Sold Euro for Sterling - Maturing 16/03/2023	€306,167		
	£270,412	2,082	0.01
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 16/03/2023	£4,064,197		
	\$4,952,009	25,286	0.15

投資	保有	時価 (ポンド)	純資産に 対する割合 (%)
Sold US Dollars for Sterling - Maturing 16/03/2023	\$141,879		
	£117,559	392	-
為替先渡契約にかかる未実現利益合計		31,880	0.19
為替先渡契約にかかる未実現損失（0.39%）			
Sold Sterling for Japanese Yen - Maturing 06/03/2023	£462,534		
	¥73,000,000	(19,757)	(0.12)
Sold Sterling for US Dollars - Maturing 06/03/2023	£133,630		
	\$161,000	(648)	-
Sold Sterling for Euro - Maturing 16/03/2023	£5,196,987		
	€5,877,387	(45,955)	(0.27)
為替先渡契約にかかる未実現損失合計		(66,360)	(0.39)
為替先渡契約にかかる未実現損失（純額）合計		(34,480)	(0.20)
ポートフォリオ合計 \$		15,943,809	93.76
その他純資産		1,061,541	6.24
純資産合計		17,005,350	100.00

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

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

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

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

先物契約の絶対約定額は4,441,756ポンドで、証拠金額244,242ポンドは、合算純資産計算書の現金預金および当座借越の各残高に開示されています。

\$ デリバティブ資産および負債を含みます。

添付の注記は本財務諸表と不可分です。

[次へ](#)

５ 販売及び買戻しの実績

2023年３月末日前１年間における販売および買戻しの実績ならびに2023年３月末日における発行済株式数は以下のとおりです。

（注１）販売株数および買戻株数には乗換数を含みます。

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

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

パークレイズ・グローバルベータ

１．パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ１

計算期間	クラスＡ株式					
	販売株数	買戻株数	発行済株数	販売株数	買戻株数	発行済株数
自 2022年４月１日 至 2023年３月31日	円建・分配型			円建・累積型		
	14,000 (14,000)	0 (0)	118,000 (118,000)	-		
	米ドル建・分配型			米ドル建・累積型		
	-			0 (0)	3,621 (0)	0 (0)

２．パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ２

計算期間	クラスＡ株式					
	販売株数	買戻株数	発行済株数	販売株数	買戻株数	発行済株数
自 2022年４月１日 至 2023年３月31日	円建・分配型			円建・累積型		
	0 (0)	0 (0)	82,500 (82,500)	-		
	米ドル建・分配型			米ドル建・累積型		
	0 (0)	5,500 (5,500)	50,500 (50,500)	0 (0)	0 (0)	15,209 (0)

３．パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ３

計算期間	クラスＡ株式					
	販売株数	買戻株数	発行済株数	販売株数	買戻株数	発行済株数
自 2022年４月１日 至 2023年３月31日	円建・分配型			円建・累積型		
	0 (0)	28,500 (28,500)	146,000 (146,000)	-		
	米ドル建・分配型			米ドル建・累積型		
	0 (0)	14,836 (5,000)	96,000 (96,000)	0 (0)	10,000 (0)	20,008 (0)

４．パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ４

計算期間	クラスＡ株式					
	販売株数	買戻株数	発行済株数	販売株数	買戻株数	発行済株数
自 2022年４月１日 至 2023年３月31日	円建・分配型			円建・累積型		
	0 (0)	0 (0)	17,000 (17,000)	-		
	米ドル建・分配型			米ドル建・累積型		
	2,025 (0)	11,000 (11,000)	3,525 (1,500)	-		

５．パークレイズ・グローバルベータ・ポートフォリオ５

計算期間	クラスＡ株式					
	販売株数	買戻株数	発行済株数	販売株数	買戻株数	発行済株数
自 2022年４月１日 至 2023年３月31日	円建・分配型			円建・累積型		
	-			-		
	米ドル建・分配型			米ドル建・累積型		
	-			-		

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

計算期間	クラスＡ株式					
	販売株数	買戻株数	発行済株数	販売株数	買戻株数	発行済株数
自 2022年４月１日 至 2023年３月31日	円建・分配型			円建・累積型		
	0 (0)	0 (0)	4,500 (4,500)	-		
	米ドル建・分配型			米ドル建・累積型		
	509 (0)	274,660 (110,000)	503,113 (440,000)	26,068 (0)	57,933 (0)	178,299 (0)

２．パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ２

計算期間	クラスＡ株式					
	販売株数	買戻株数	発行済株数	販売株数	買戻株数	発行済株数
自 2022年４月１日 至 2023年３月31日	円建・分配型			円建・累積型		
	0 (0)	0 (0)	36,000 (36,000)	-		
	米ドル建・分配型			米ドル建・累積型		
	14,646 (0)	48,728 (0)	122,031 (20,000)	16,823 (0)	142,159 (0)	777,328 (0)

３．パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ３

計算期間	クラスＡ株式					
	販売株数	買戻株数	発行済株数	販売株数	買戻株数	発行済株数
自 2022年４月１日 至 2023年３月31日	円建・分配型			円建・累積型		
	0 (0)	16,500 (16,500)	101,000 (101,000)	-		
	米ドル建・分配型			米ドル建・累積型		
	31,750 (0)	578,616 (3,500)	512,047 (86,500)	11,901 (0)	151,391 (0)	980,154 (0)

４．パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ４

計算期間	クラスＡ株式					
	販売株数	買戻株数	発行済株数	販売株数	買戻株数	発行済株数
自 2022年４月１日 至 2023年３月31日	円建・分配型			円建・累積型		
	0 (0)	0 (0)	113,000 (113,000)	-		
	米ドル建・分配型			米ドル建・累積型		
	13 (0)	114,438 (0)	154,324 (58,000)	2,947 (0)	23,043 (0)	119,561 (0)

５．パークレイズ・マルチマネジャー・ポートフォリオ５

計算期間	クラスＡ株式					
	販売株数	買戻株数	発行済株数	販売株数	買戻株数	発行済株数
自 2022年４月１日 至 2023年３月31日	円建・分配型			円建・累積型		
	-			-		
	米ドル建・分配型			米ドル建・累積型		
	98 (0)	30,297 (0)	260,955 (237,000)	6 (0)	357 (0)	14,219 (0)