

【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】 2024年4月30日
【発行者名】 マルチ・マネージャー・アクセス
(Multi Manager Access)
【代表者の役職氏名】 チェアマン・オブ・ザ・ボード・オブ・ディレクターズ
アンドレアス・エバーソルド (Andreas Aebersold)
メンバー・オブ・ザ・ボード・オブ・ディレクターズ
ジェーン・ウィルキンソン (Jane Wilkinson)
【本店の所在の場所】 ルクセンブルグ大公国、ルクセンブルグL-1855、J.F.ケネディ通り33A
(33A avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg, Grand Duchy of
Luxembourg)
【代理人の氏名又は名称】 弁護士 三 浦 健
弁護士 大 西 信 治
【代理人の住所又は所在地】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング
森・濱田松本法律事務所
【事務連絡者氏名】 弁護士 三 浦 健
弁護士 大 西 信 治
【連絡場所】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング
森・濱田松本法律事務所
【電話番号】 03 (6212) 8316
【届出の対象とした募集（売出）外国投資証券に係る外国投資法人の名称】
マルチ・マネージャー・アクセス
ーグリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド
(Multi Manager Access
- Green, Social and Sustainable Bonds)
【届出の対象とした募集（売出）外国投資証券の形態及び金額】
記名式無額面投資証券
マルチ・マネージャー・アクセス
ーグリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド
クラスF-a c c投資証券
クラスF-a c c円ヘッジ投資証券
上限見込額は以下のとおりである。
マルチ・マネージャー・アクセス
ーグリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド
クラスF-a c c投資証券：9億1,490万米ドル（約1,346億円）を上
限とする。
クラスF-a c c円ヘッジ投資証券：905億4,000万円を上限とする。
(注1) 上限見込額は、便宜上、2023年10月末日現在の1口当たり純資産価格（クラスF
ーa c c投資証券については91.49米ドル、クラスF-a c c円ヘッジ投資証券に
ついては9,054円）に1,000万口をそれぞれ乗じて算出した金額である。
(注2) 米ドルの円貨換算は、特に記載がない限り、2023年11月30日現在の株式会社三菱
U F J銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル=147.07円）による。

【縦覧に供する場所】 該当事項なし

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出しましたので、2024年1月31日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報により訂正するため、本訂正届出書を提出するものです。

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

2【訂正箇所および訂正事項】

半期報告書に係る訂正
半期報告書を提出したことによる原届出書の訂正内容は、以下のとおりです。

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

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

＊ 半期報告書の記載内容は、以下のとおりです。

[次へ](#)

1 外国投資法人の概況

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

（1）主要な経営指標等の推移

（グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド）

（別段の記載がない限り金額は米ドル表示）

	2022年7月末日に 終了する 会計年度末	2023年1月末日に 終了する 中間会計年度末	2023年7月末日に 終了する 会計年度末	2024年1月末日に 終了する 中間会計年度末
（a）営業収益 ^{（1）}	-212,590,490.47	-22,635,983.09	32,921,342.78	75,979,080.88
（b）経常利益金額または 経常損失金額	-212,590,490.47	-22,635,983.09	32,921,342.78	75,979,080.88
（c）当期純利益金額または 当期純損失金額	-212,590,490.47	-22,635,983.09	32,921,342.78	75,979,080.88
（d）出資総額 ^{（2）}	2,508,527,924.69	2,391,865,041.31	2,365,959,041.40	2,280,382,302.34
（e）発行済投資口総数 （クラスF-a c c投資証券） （クラスF-a c c円ヘッジ投資証券）	9,189,310.1930口 243,805口	8,718,238.9210口 249,665口	8,285,203.2070口 239,915口	7,681,733.9820口 209,955口
（f）純資産額	2,508,527,924.69	2,391,865,041.31	2,365,959,041.40	2,280,382,302.34
（g）資産総額	2,537,477,140.99	2,428,032,449.01	2,403,032,918.52	2,290,510,910.30
（h）1口当たり純資産価格 （クラスF-a c c投資証券） （クラスF-a c c円ヘッジ投資証券）	94.81 9,989円	92.54 9,544円	93.31 9,377円	97.75 9,516円
（i）1口当たり当期純利益金額または 当期純損失金額 （クラスF-a c c投資証券） （クラスF-a c c円ヘッジ投資証券）	-4.85 -2.55	-2.59 -1.03	-1.97 -8.59	4.41 -1.45
（j）分配総額	なし	33,171.77	33,171.77	695,941.82
（k）1口当たり分配金額	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし	該当事項なし
（l）自己資本比率	98.86%	98.51%	98.46%	99.56%
（m）自己資本利益率 ^{（3）} （クラスF-a c c投資証券） （クラスF-a c c円ヘッジ投資証券）	-5.19% -0.11%	-7.46% -4.56%	-1.58% -6.13%	5.63% -0.29%

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

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

（3）自己資本利益率は、当該会計年度の1口当たり純資産価格の前年度に対する増減の比率であるが、当該会計年度に初めて当該投資証券が発行された場合には、当初募集価格に対する増減の比率で表すものとする。以下同じ。

（4）「主要な経営指標等の推移（e）発行済投資口総数、（h）1口当たり純資産価格、（i）1口当たり当期純利益金額または当期純損失金額、（k）1口当たり分配金額および（m）自己資本利益率」は、日本で販売しているクラスのみ記載している。以下同じ。

（注1）サブ・ファンドは2022年3月10日に設立され、サブ・ファンドのクラスF-a c c投資証券は2022年3月10日に運用を開始し、クラスF-a c c円ヘッジ投資証券は2022年5月13日に運用を開始した。

（注2）名称の一部に「F」を含むクラスの投資証券は、年次財務報告書が作成された後に、取締役会の提案を経て、定時投資主総会により、分配がなされるか否か、またその額が決定される。以下同じ。

（注3）各取引に使用された1口当たりの純資産価格は、純資産価格の調整の結果、上記および財務書類に記載の価格と異なる場合がある（財務書類に対する注記1参照）。以下同じ。

（２）外国投資法人の出資総額

2024年２月末日現在のサブ・ファンドの出資総額および各クラス投資証券の発行済投資証券総数は以下のとおりである。

なお、発行可能投資口総口数には制限がない。

（グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド）

	出資総額		発行済投資証券総数 (口)	
	米ドル	百万円		
2024年２月末日現在	2,273,318,117.40	342,521	クラスF－a c c 投資証券	7,681,733.9820
			クラスF－a c c 円ヘッジ投資証券	209,955

（注）米ドルの円貨換算は、特に記載がない限り、2024年２月29日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（１米ドル＝150.67円）による。以下、同じ。

（３）主要な投資主の状況

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

（４）役員の状況

（2024年２月末日現在）

氏 名	役 職 名	略 歴	所有株式
アンドレアス・ エバーソルド (Andreas Aebersold)	チェアマン・ オブ・ザ・ ボード・オブ・ ディレクターズ	ユービーエス・スイス・エイ・ジー、 エグゼクティブ・ディレクター	該当なし
マデュ・ラマチャンドラン (Madhu Ramachandran)	メンバー・オブ・ ザ・ボード・オブ・ ディレクターズ	UBSヨーロッパSE ルクセンブルグ 支店 エグゼクティブ・ディレクター	該当なし
クリスティアン・シェーン (Christian Schön)	メンバー・オブ・ ザ・ボード・オブ・ ディレクターズ	UBSヨーロッパSE ルクセンブルグ 支店 マネージング・ディレクター	該当なし
ジェーン・ウィルキンソン (Jane Wilkinson)	インディペンデント・ ディレクター	インディペンデント・ディレクター、 ルクセンブルグ	該当なし
クリスティアン・マウラー (Christian Maurer)	メンバー・オブ・ ザ・ボード・オブ・ ディレクターズ	UBSアセットマネジメント・ スイス・エイ・ジー、 マネージング・ディレクター	該当なし

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

（５）その他

a. 定款の変更

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

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

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

b. 事業譲渡または事業譲受

投資法人、サブ・ファンドおよび投資証券クラスの解散および合併

本投資法人、サブ・ファンドおよび投資証券クラスの解散

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

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

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

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

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

サブ・ファンド同士またはサブ・ファンドとその他のUCIの合併

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

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

投資主総会

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

c. 出資の状況その他の重要事項

該当事項なし。

d. 訴訟事件その他の重要事項

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

[次へ](#)

2 外国投資法人の運用状況

(1) 投資状況

資産別および地域別の投資状況
（グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド）

(2024年2月末日現在)

資産の種類	国・地域名	時価合計（米ドル）	投資比率 （%）
債券	米国	341,430,769.03	14.94
	フランス	332,504,304.95	14.55
	オランダ	243,914,739.54	10.67
	国際機関	173,440,821.23	7.59
	スペイン	163,449,233.04	7.15
	ドイツ	157,554,651.63	6.89
	イタリア	144,460,659.69	6.32
	イギリス	108,108,860.69	4.73
	チリ	49,687,300.43	2.17
	日本	43,182,663.07	1.89
	ルクセンブルグ	38,810,841.71	1.70
	アイルランド	38,316,077.77	1.68
	デンマーク	34,843,660.16	1.52
	ベルギー	33,490,873.23	1.47
	スウェーデン	33,213,730.88	1.45
	オーストリア	28,779,392.04	1.26
	インドネシア	25,767,349.84	1.13
	メキシコ	25,725,824.37	1.13
	韓国	22,531,540.87	0.99
	ノルウェー	17,642,583.55	0.77
	カナダ	15,782,746.41	0.69
	フィンランド	15,594,074.36	0.68
	オーストラリア	14,544,845.90	0.64
	香港	14,468,388.12	0.63
	ポルトガル	13,618,264.97	0.60
	ペルー	7,709,004.46	0.34
	フィリピン	4,941,535.00	0.22
	ヨルダン	4,783,312.50	0.21
	コロンビア	4,498,507.75	0.20
	アラブ首長国連邦	4,319,952.00	0.19
	国際機関	4,013,657.56	0.18
	ブラジル	3,956,004.00	0.17
	インド	3,395,102.99	0.15
	ジャージー	2,500,638.97	0.11
	グアテマラ	2,392,150.00	0.10

	ケイマン諸島	2,255,335.56	0.10
	英領ヴァージン諸島	2,187,397.54	0.10
	スロベニア	2,066,417.16	0.09
	ハンガリー	2,028,636.27	0.09
	セルビア	1,912,185.02	0.08
	アンドラ	1,821,275.77	0.08
	ポーランド	1,632,585.60	0.07
	リトアニア	1,475,738.78	0.06
	シンガポール	1,458,710.34	0.06
	コートジボワール	968,750.00	0.04
	ルーマニア	934,901.85	0.04
	中国	886,964.00	0.04
	コスタリカ	784,198.40	0.03
	モーリシャス	424,476.87	0.02
	ケニヤ	200,250.00	0.01
	小計	2,194,411,885.87	96.03
従来型 オプション	イギリス	－7,394.58	0.00
	米国	－63,085.50	0.00
	小計	－70,480.08	0.00
短期金融商品	フランス	3,497,720.82	0.15
ポートフォリオ合計		2,197,839,126.61	96.18
現金・その他資産（負債控除後）		87,252,517.08	3.82
資産総額		2,285,091,643.69	100.00
負債総額		11,773,526.29	0.52
合計		2,273,318,117.40 (約342,521百万円)	99.48

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

（２）運用実績

① 純資産等の推移

2024年２月末日および同日前１年以内における各月末の総資産および純資産の推移は次のとおりである。

（グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド）

	資産総額		純資産総額		１口当たり純資産価格		
					(クラスF－a c c 投資証券)		(クラス F－a c c 円ヘッジ 投資証券)
	千米ドル	百万円	千米ドル	百万円	米ドル	円	円
2023年３月末日	2,361,207	355,763	2,343,834	353,145	92.18	13,889	9,427
４月末日	2,392,691	360,507	2,377,831	358,268	93.04	14,018	9,479
５月末日	2,361,020	355,735	2,307,774	347,712	92.83	13,987	9,414
６月末日	2,359,366	355,486	2,329,025	350,914	92.63	13,957	9,349
７月末日	2,403,033	362,065	2,365,959	356,479	93.31	14,059	9,377
８月末日	2,374,967	357,836	2,320,447	349,622	93.28	14,054	9,324
９月末日	2,294,984	345,785	2,205,088	332,241	91.86	13,841	9,140
10月末日	2,173,277	327,448	2,152,351	324,295	91.49	13,785	9,054
11月末日	2,266,061	341,427	2,245,805	338,375	94.66	14,262	9,319
12月末日	2,336,367	352,020	2,319,526	349,483	97.66	14,714	9,557
2024年１月末日	2,290,511	345,111	2,280,382	343,585	97.75	14,728	9,516
２月末日	2,285,092	344,295	2,273,318	342,521	96.93	14,604	9,391

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

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

② 分配の推移

（グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド）

クラスF－a c c投資証券

クラスF－a c c円ヘッジ投資証券

該当事項なし。

③ 自己資本利益率（収益率）の推移

2024年2月末日までの1年間における自己資本利益率（収益率）は次のとおりである。

（グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド）

収益率（%）（注）	
（クラスF－a c c 投資証券）	（クラスF－a c c 円ヘッジ投資証券）
6.65	0.57

（注）収益率（%）＝ $100 \times (a - b) / b$

a＝2024年2月末日現在の1口当たり純資産価格（当該期間の分配金の合計金額を加えた額）。

b＝2023年2月末日現在の1口当たり純資産価格（分配落の額）。

（3）投資リスク

- ① 当中間計算期間において、2024年1月31日提出の有価証券報告書「第一部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 3 投資リスク」に記載される投資リスクについて、重要な変更はない。
- ② 本投資法人が将来にわたり営業活動を継続するにあたり重要な疑義を生じさせるような事象または状況、その他本投資法人の経営に重要な影響を及ぼす事象は、半期報告書提出日現在、存在しない。

[次へ](#)

3 資産運用会社の概況

(1) 名称及び資本金の額

① UBSファンド・マネジメント（ルクセンブルグ）エス・エイ（「管理会社」）

資本金（株主資本）の額

2024年2月末日現在の株主資本総額は、13,738,000ユーロ（約22億円）

（注）ユーロの円貨換算は、便宜上、2024年2月29日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1ユーロ＝163.25円）による。

② ユービーエス・スイス・エイ・ジー（「投資運用会社」）

資本金（株主資本）の額

2024年2月末日現在の株主資本総額は、10,000,000スイスフラン（約17億円）

（注）スイスフランの円貨換算は、便宜上、2024年2月29日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1スイスフラン＝171.47円）による。

(2) 大株主の状況

① UBSファンド・マネジメント（ルクセンブルグ）エス・エイ

（2024年2月末日現在）

名 称	住 所	所有株式数 (株)	比率 (%)
UBSアセット・ マネジメント・エイ・ジー (UBS Asset Management AG)	バーンホフ・シュトラッセ45、 CH-8001 チューリッヒ、スイス	6,869	100

② ユービーエス・スイス・エイ・ジー

（2024年2月末日現在）

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

（３）役員の状況

① ＵＢＳファンド・マネジメント（ルクセンブルグ）エス・エイ

（2024年２月末日現在）

氏名	役職名	就任	略歴	所有株式
マイケル・ケール (Michael Kehl)	チェアマン ディレクター／ ボード・メンバー	2022年１月１日	ＵＢＳアセット・マネジ メント・スイス・エイ・ ジー、チューリッヒ、ス イス ヘッド・オブ・プロダク ト	該当なし
フランチェスカ・ジ リ・プリム (Francesca Gigli Prym)	ディレクター／ ボード・メンバー	2019年12月５日	ＵＢＳファンド・マネジ メント（ルクセンブル グ）エス・エイ、ルクセ ンブルグ、チーフ・エグ ゼクティブ・オフィサー	該当なし
ウジェーヌ・デル・シ オッポ (Eugène Del Cioppo)	ディレクター／ ボード・メンバー	2022年９月２日	ＵＢＳファンド・マネジ メント（スイス）エイ・ ジー、バーゼル、スイス チーフ・エグゼクティ ブ・オフィサー	該当なし
アン－シャルロット・ ローヤー (Ann-Charlotte Lawyer)	ディレクター／ ボード・メンバー	2022年１月１日	ルクセンブルグ大公国、 インディペンデント・ ディレクター	該当なし

② ユービーエス・スイス・エイ・ジー

(2024年2月末日現在)

氏名	役職名	略歴	所有ユービーエス・グループ・エイ・ジー株式 (2023年11月30日現在)
ロジャー・フォン・メントレン (Roger von Mentlen)	チェアマン	2023年11月1日就任	非公開
バーバラ・ランバート (Barbara Lambert)	ディレクター／ ボード・メンバー	2022年4月5日就任	非公開
ダニエル・ジェイ・クリティン (Daniel J. Crittin)	ディレクター／ ボード・メンバー	2016年4月25日就任	非公開
ガブリエラ・フーバー (Gabriela Huber)	ヴァイス・ チェアマン	2015年6月12日就任	非公開
クリストフ・ブルーナー (Christoph Brunner)	ディレクター／ ボード・メンバー	2023年11月1日就任	非公開
ピーター・ディレンディンガー (Peter Derendinger)	ディレクター／ ボード・メンバー	2023年11月1日就任	非公開
クラウディア・ディル (Claudia Dill)	ディレクター／ ボード・メンバー	2023年11月1日就任	非公開
ダミアン・フォーゲル (Damian Vogel)	ディレクター／ ボード・メンバー	2023年11月1日就任	非公開

(4) 事業の内容及び営業の概況

① UBSファンド・マネジメント（ルクセンブルグ）エス・エイ

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

2024年2月末日現在、管理会社は以下のとおり、404本の投資信託／投資法人のサブ・ファンドの管理・運用を行っている。

国別（設立国）	種類別（基本的性格）	本数	純資産額の合計（通貨別）
ルクセンブルグ	オープン・エンド型 投資信託／投資法人	404	430,261,393.67オーストラリア・ドル
			3,234,404,739.20カナダ・ドル
			15,495,368,126.37スイス・フラン
			2,123,070,878.14中国元
			2,840,687,384.08デンマーク・クローネ
			51,864,273,025.71ユーロ
			1,813,268,280.91英ポンド
			291,779,405.56香港ドル
			683,834,147,982.35日本円
			27,421,048.73シンガポール・ドル
			116,467,951,881.05米ドル

② ユービーエス・スイス・エイ・ジー

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

2024年2月末日現在、ユービーエス・スイス・エイ・ジーは42本のサブ・ファンドを運用し、そのうち運用資産額上位10位のサブ・ファンドは以下の通りである。

	名称	基本的性格	設定日	純資産総額 (ユーロ)
1	UBS (Lux) Equity Sicav - Long Term Themes (USD)	変動資本を有する 投資法人	2016年1月28日	4,986,019,039
2	Global Opportunities Access - Sustainable Equities	変動資本を有する 投資法人	2019年5月13日	1,227,860,234
3	UBS (Lux) Strategy Fund - Balanced Sustainable (CHF)	契約型投資信託	1994年7月1日	1,183,055,092
4	Global Opportunities Access - Sustainable Bonds	変動資本を有する 投資法人	2019年5月13日	1,145,444,225
5	UBS (Lux) Strategy Fund - Yield Sustainable (CHF)	契約型投資信託	1991年9月10日	1,101,639,661
6	Global Opportunities Access - High Yield and EM Bonds	変動資本を有する 投資法人	2014年11月3日	907,643,318
7	UBS (Lux) Strategy Fund - Yield Sustainable (USD)	契約型投資信託	1991年9月10日	640,491,831
8	Global Opportunities Access - Corporate Bonds	変動資本を有する 投資法人	2015年2月18日	638,635,305
9	UBS (Lux) Strategy Fund - Balanced Sustainable (USD)	契約型投資信託	1994年7月1日	604,178,340
10	Global Opportunities Access - Global Bonds USD	変動資本を有する 投資法人	2015年2月18日	562,469,620

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

[次へ](#)

4 外国投資法人の経理状況

- a. ファンドの日本語の中間財務書類は、ルクセンブルグにおける法令に準拠して作成された原文の中間財務書類を翻訳したものである。これは「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第76条第4項ただし書の規定の適用によるものである。
- b. ファンドの原文の中間財務書類は、マルチ・マネージャー・アクセスおよび全てのサブ・ファンドにつき一括して作成されている。日本語の作成にあたっては、関係するサブ・ファンドに関連する部分のみを翻訳している。なお、サブ・ファンドには下記のクラス投資証券以外のクラス投資証券も存在するが、本書においては下記のクラス投資証券に関する部分を抜粋して日本語に記載している。
- ーグリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド
- クラスF－a c c 投資証券
- クラスF－a c c 円ヘッジ投資証券
- c. ファンドの原文の中間財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいう。）の監査を受けていない。
- d. ファンドの原文の中間財務書類は、米ドルで表示されている。日本語の中間財務書類には、主要な金額について円貨換算が併記されている。日本円による金額は、2024年2月29日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝150.67円）で換算されている。なお、千円未満の金額は四捨五入されている。

（１）資産及び負債の状況

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

純資産計算書

	2024年1月31日現在	
	(米ドル)	(千円)
資 産		
投資有価証券、取得価額	2,267,301,991.10	341,614,391
投資有価証券、未実現評価（損）益	(79,330,323.63)	(11,952,700)
投資有価証券合計（注１）	2,187,971,667.47	329,661,691
現金預金、要求払預金および預託金勘定	59,114,004.46 *	8,906,707
その他の流動資産（委託証拠金）	10,877,990.16	1,638,987
発行未収金	1,547,339.29	233,138
有価証券に係る未収利息	21,757,569.51	3,278,213
金融先物に係る未実現利益（注１）	992,964.99	149,610
先渡為替契約に係る未実現利益（注１）	4,726,581.58	712,154
スワップに係る未実現利益（注１）	3,522,792.84	530,779
資産合計	2,290,510,910.30	345,111,279
負 債		
当座借越	(2,730,665.60)	(411,429)
投資有価証券購入未払金（注１）	(5,111,843.98)	(770,202)
買戻未払金	(1,212,548.94)	(182,695)
報酬引当金（注２）	(1,047,753.40)	(157,865)
年次税引当金（注３）	(19,420.86)	(2,926)
その他の手数料および報酬に係る引当金（注２）	(6,375.18)	(961)
引当金合計	(1,073,549.44)	(161,752)
負債合計	(10,128,607.96)	(1,526,077)
期末現在純資産	2,280,382,302.34	343,585,201

* 2024年1月31日現在、412,775.00米ドルの現金が取引相手方であるゴールドマン・サックスに対する担保および10,862.50米ドルの現金が取引相手方であるモルガン・スタンレーに対する担保となっている。

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

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

運用計算書

自2023年8月1日 至2024年1月31日

	(米ドル)	(千円)
収 益		
流動資産に係る利息	1,597,971.07	240,766
有価証券に係る利息	28,199,750.42	4,248,856
貸付証券に係る純収益（注8）	418,434.46	63,046
収益合計	30,216,155.95	4,552,668
費 用		
スワップに係る支払利息（注1）	(135,839.77)	(20,467)
定率報酬（注2）	(6,282,310.24)	(946,556)
年次税（注3）	(111,736.42)	(16,835)
その他の手数料および報酬（注2）	(69,982.00)	(10,544)
当座借越に係る利息	(242,449.13)	(36,530)
費用合計	(6,842,317.56)	(1,030,932)
投資純（損）益	23,373,838.39	3,521,736
実現（損）益（注1）		
無オプション市場価格証券に係る実現（損）益	(27,365,745.99)	(4,123,197)
オプションに係る実現（損）益	335,246.86	50,512
利回り評価有価証券および短期金融商品に係る 実現（損）益	(423,830.63)	(63,859)
金融先物に係る実現（損）益	(13,030,180.22)	(1,963,257)
先渡為替契約に係る実現（損）益	(31,490,449.39)	(4,744,666)
スワップに係る実現（損）益	1,395,043.16	210,191
外国為替に係る実現（損）益	3,867,186.84	582,669
実現（損）益合計	(66,712,729.37)	(10,051,607)
当期実現純（損）益	(43,338,890.98)	(6,529,871)
未実現評価（損）益の変動（注1）		
無オプション市場価格証券に係る未実現評価（損）益	75,687,292.06	11,403,804
オプションに係る未実現評価（損）益	18,622.53	2,806
利回り評価有価証券および短期金融商品に係る 未実現評価（損）益	3,989,586.40	601,111
金融先物に係る未実現評価（損）益	4,674,396.02	704,291
先渡為替契約に係る未実現評価（損）益	35,655,560.58	5,372,223
スワップに係る未実現評価（損）益	(707,485.73)	(106,597)
未実現評価（損）益の変動合計	119,317,971.86	17,977,639
運用の結果による純資産の純増（減）	75,979,080.88	11,447,768

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

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

純資産変動計算書

	自2023年8月1日 至2024年1月31日	
	(米ドル)	(千円)
期首現在純資産	2,365,959,041.40	356,479,049
発行額	76,370,978.47	11,506,815
買戻額	(237,230,856.59)	(35,743,573)
純発行（買戻）合計	(160,859,878.12)	(24,236,758)
支払分配金	(695,941.82)	(104,858)
投資純（損）益	23,373,838.39	3,521,736
実現（損）益合計	(66,712,729.37)	(10,051,607)
未実現評価（損）益の変動合計	119,317,971.86	17,977,639
運用の結果による純資産の純増（減）	75,979,080.88	11,447,768
期末現在純資産	2,280,382,302.34	343,585,201

発行済投資証券数の変動表

	自2023年8月1日 至2024年1月31日
クラスF－a c c	(口)
期首現在発行済投資証券数	8,285,203.2070
期中発行投資証券数	222,261.4770
期中買戻投資証券数	(825,730.7020)
期末現在発行済投資証券数	<u>7,681,733.9820</u>
クラスF－a c c円ヘッジ	(口)
期首現在発行済投資証券数	239,915.0000
期中発行投資証券数	0.0000
期中買戻投資証券数	(29,960.0000)
期末現在発行済投資証券数	<u>209,955.0000</u>

最重要数値

日付	ISIN	2024年1月31日	2023年7月31日	2022年7月31日
純資産額（米ドル）		2,280,382,302.34	2,365,959,041.40	2,508,527,924.69
クラスF－a c c	LU2421069035			
発行済投資証券数（口）		7,681,733.9820	8,285,203.2070	9,189,310.1930
1口当たり純資産価格（米ドル）		97.75	93.31	94.81
1口当たり発行・買戻価格（米ドル） ¹		97.75	93.31	94.81
クラスF－a c c円ヘッジ	LU2442822453			
発行済投資証券数（口）		209,955.0000	239,915.0000	243,805.0000
1口当たり純資産価格（日本円）		9,516	9,377	9,989
1口当たり発行・買戻価格（日本円） ¹		9,516	9,377	9,989

¹ 注記1を参照

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

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

組入証券の構造

地域別分類	純資産割合%	業種別分類	純資産割合%
アメリカ合衆国	14.94	銀行および金融機関	26.05
フランス	14.47	金融および持株会社	13.12
オランダ	10.89	エネルギー・水道	10.75
国際機関	7.49	国債および中央政府債	8.09
スペイン	7.35	国際機関	7.49
ドイツ	7.21	公的、非営利機関	4.45
イタリア	6.17	不動産	4.39
イギリス	4.80	交通・運輸	3.20
チリ	2.07	通信	3.00
日本	1.89	保険	2.47
ルクセンブルグ	1.63	州、連邦州	2.11
デンマーク	1.52	電気装置・部品	1.15
ベルギー	1.50	自動車	0.92
アイルランド	1.48	食品・清涼飲料	0.83
スウェーデン	1.35	インターネット、ソフトウェア・ITサービス	0.73
オーストリア	1.28	林業、紙・パルプ製品	0.70
メキシコ	1.08	各種サービス	0.68
インドネシア	1.05	モーゲージおよび貸付機関	0.63
韓国	1.00	医薬品・化粧品・医療品	0.60
フィンランド	0.76	電子工学・半導体	0.57
香港	0.72	繊維・衣服・革製品	0.54
ノルウェー	0.69	その他消費財	0.46
オーストラリア	0.64	機械工学・産業機器	0.43
カナダ	0.61	石油	0.40
ポルトガル	0.60	建築業・資材	0.37
ペルー	0.34	化学	0.32
フィリピン	0.22	小売り・百貨店	0.24
ヨルダン	0.21	包装業	0.21
コロンビア	0.20	宿泊・仕出し・レジャー	0.20
アラブ首長国連邦	0.19	投資信託	0.19
多国籍	0.18	ヘルスケア、社会事業	0.18
ブラジル	0.18	コンピュータ・ハードウェア、ネットワーク装置	0.16
インド	0.15	グラフィックデザイン・出版・メディア	0.13
ジャージー	0.11	各種貿易会社	0.08
グアテマラ	0.10	非分類会社	0.06
ケイマン諸島	0.10	ゴム・タイヤ	0.05
英領ヴァージン諸島	0.09	合計	95.95
スロベニア	0.09		
ハンガリー	0.09		
セルビア	0.08		
アンドラ	0.08		
ポーランド	0.07		
リトアニア	0.07		
シンガポール	0.06		
ルーマニア	0.04		
中国	0.04		
コスタリカ	0.03		
モーリシャス	0.02		
ガーンジー	0.02		
合計	95.95		

マルチ・マネージャー・アクセス

財務書類に対する注記

2024年1月31日現在

注1－重要な会計方針の要約

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

a) 純資産価格の計算

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

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

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

b) 評価原則

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

c) 先渡為替契約の評価

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

d) 金融先物契約の評価

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

e) 証券売買実現純（損）益

証券売買実現損益は、売却証券の平均原価に基づいて計算される。

f) オプションの評価

規制ある市場で取引される未決済オプションは、決済価格または当該商品の入手可能な直近の市場価格で評価される。OTCオプションは、ブルームバーグ・オプション・プライサー・ファンクショナルリティーから入手した日足価格に基づき値洗いされ、第三者値付機関と照合される。オプションに係る実現損益およびオプションに係る未実現評価（損）益は、オプションに係る実現（損）益およびオプションに係る未実現評価（損）益のカテゴリーに基づき、それぞれ運用計算書および純資産変動計算書に開示される。

g) 外貨換算

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

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

h) 組入証券取引の会計処理

組入証券取引は、取引日の翌銀行営業日に会計処理される。

i) 結合財務書類

結合財務書類は、ユーロで表示される。本投資法人の2024年1月31日現在の結合純資産計算書、結合運用計算書および結合純資産変動計算書の各種科目は、各サブ・ファンドの財務書類の対応する科目の合計に等しい。

以下の為替レートが、2024年1月31日現在の結合財務書類の換算に用いられた。

為替レート

1 ユーロ = 1.086250米ドル

j) 有価証券売却未収金、有価証券購入未払金

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

外国為替取引からの未収金および未払金は相殺される。

k) 収益の認識

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

l) スワップ

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

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

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

注2－報酬および費用

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

マルチ・マネージャー・アクセス	上限定率報酬（年率）	実効定率報酬（年率）
ーグリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ ボンド F－a c c	0.90%	0.55%
ーグリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ ボンド F－a c c円ヘッジ	0.90%	0.55%

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

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

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

本投資法人の運用費用および管理事務費用

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

- ー本投資法人の資産および所得に賦課される可能性があるすべての租税（適用ある年次税を含む。）
- ー本投資法人のポートフォリオに組み込まれた有価証券その他の資産（派生商品を含む。）に関する取引に課される通常の銀行手数料（かかる手数料は、取得価格に加算され、売却価格からは減額される。）
- ー本投資法人が適正に負担する手数料、費用およびあらゆる合理的な立替費用

- －投資主の利益のために行為するに際し本投資法人、管理会社、投資運用会社またはポートフォリオ・マネージャーが負担する法務手数料および費用（疑義を避けるために付言すると、本投資法人またはそのいずれかのサブ・ファンドの組織再編に関する一切の法務手数料および費用を含む。）
- －年次報告書および半期報告書ならびに適用ある法令に基づき必要なその他の報告書および文書を投資主（投資証券の実質的保有者を含む。）の利益に適う言語において作成し配布（印刷は含まない。）するためのコスト
- －投資主に対する通知作成コストおよび本投資法人の資産管理に関するあらゆる取引コスト（ブローカーの通常の手数料、報酬、租税等）
- －ルクセンブルグ内外における本投資法人の承認および監督に関する手数料およびコスト
- －定款、英文販売目論見書、KID ならびに年次報告書および半期報告書の印刷コストおよび費用、ならびに、定款および本投資法人に関するその他の一切の文書（本投資法人または本投資法人の投資証券募集について管轄権を有するあらゆる機関（各国の証券業協会を含む。）に対する登録届出書、目論見書および説明覚書等）を必要な言語によって作成および／または提出し、印刷するコストおよび費用
- －純資産価額の公表および投資者に対する通知の公告に関連するコストおよび費用
- －証券取引所または規制ある市場への本投資法人の投資証券の上場に関連して請求される手数料および費用
- －投資主への配当金支払における手数料およびその他のコスト
- －監査における手数料、コストおよび費用（監査人の報酬および費用を含む。）
- －KIDの作成、翻訳および監督機関への提出に関する手数料および費用
- －取締役会に支払われる報酬、コストおよび費用（取締役会に係る合理的な立替費用、保険補償および合理的な旅行費用ならびに取締役会の報酬を含む。）
- －登録、報告、救済請求、回収または外国源泉徴収税の免除に関連して、サブ・ファンドに課される可能性のある手数料、コストおよび費用。

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

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

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

サブ・ファンドの継続費用の詳細は、KIDで確認することができる。

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

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

注3－年次税

本投資法人はルクセンブルグの「年次税」の課税対象であり、これを四半期末ごとに支払う。この年次税は、各クラスの四半期末における総純資産に基づいて計算される。年次税は純資産総額の0.05%（年率）の割合で徴収される。クラスF投資証券等の機関投資家向けのクラスについて、かかる割合は0.01%（年率）に減じられる。0.01%への低減税率の適用を受けるための条件を充足しない場合、すべてのクラスF投資証券の税率が0.05%（税率）になる場合がある。

サブ・ファンドは、タクソノミー規則第3条において定義される環境的に持続可能な投資対象に投資される部分の純資産に対する「年次税」の税率を0.01%から0.04%（年率）の範囲とする低減税率の適用を受けることがある。「年次税」を既に支払っている他のルクセンブルグのUCI内に保有される投資証券に相当する資産の評価額は、いかなる「年次税」からも除外される。

注4－分配方針

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

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

注5－金融先物、オプションおおよびスワップ契約

2024年1月31日現在、サブ・ファンドごとの金融先物、オプションおおよびスワップ契約ならびに関連する通貨は、以下のように要約される。

a) 金融先物

マルチ・マネージャー・アクセス	債券に係る金融先物 (購入)	債券に係る金融先物 (売却)
－グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド	359,934,720.60米ドル	345,420,145.39米ドル
マルチ・マネージャー・アクセス	指数に係る金融先物 (購入)	指数に係る金融先物 (売却)
－該当なし		

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

b) オプション

マルチ・マネージャー・アクセス	従来型金利スワップに係るオプション (売却)
－グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド	9,672,900.25米ドル

c) スワップ

マルチ・マネージャー・アクセス	金利に係るスワップおよび フォワード・スワップ (購入)	金利に係るスワップおよび フォワード・スワップ (売却)
－グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド	29,981,375.00米ドル	21,940,375.00米ドル

注6－後発事象

期末後において、財務書類の修正または開示を必要とする事象は発生していない。

注7－適用法、業務地および公認言語

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

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

注８－貸付有価証券

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

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

貸付有価証券

	2024年１月31日現在の貸付有価証券 からの取引相手方エクスポージャー*		2024年１月31日現在の 担保の内訳（％）		
マルチ・マネージャー・アクセス	貸付有価証券の 時価	担保 (ユービーエス・ スイス・エイ・ ジー)	株式	債券	現金
ーグリーン・ソーシャル・アンド・ サステナブル・ボンド	441,240,240.18 米ドル	468,791,541.95 米ドル	21.06	78.94	0.00

* 取引相手方エクスポージャーの価格および為替レートの情報は、2024年１月31日に証券貸付業者から直接入手されるため、2024年１月31日現在の財務書類の作成に使用された終値および為替レートとは異なる場合がある。

	マルチ・マネージャー・アクセス ーグリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ ボンド (米ドル)
貸付証券収益	697,390.77
貸付証券コスト**	
ユービーエス・スイス・エイ・ジー	209,217.23米ドル
UBSヨーロッパSE ルクセンブルグ支店	69,739.08米ドル
純貸付証券収益	418,434.46米ドル

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

[次へ](#)

(2) 投資有価証券明細表等

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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品

銘柄	数量／額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 (注1)	純資産 比率 (%)
ノート、固定利付債			
EUR			
EUR ACCOR SA-REG-S 2.37500% 21-29.11.28	200 000.00	205 872.18	0.01
EUR ACEF HOLDING SCA-REG-S 1.25000% 21-26.04.30	1 800 000.00	1 567 128.97	0.07
EUR ACHMEA BV-REG-S 3.62500% 22-29.11.25	400 000.00	435 045.73	0.02
EUR AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT-REG-S 2.87500% 23-21.01.30	2 000 000.00	2 178 131.12	0.10
EUR AMPRION GMBH-REG-S 3.45000% 22-22.09.27	1 300 000.00	1 423 407.88	0.06
EUR AMPRION GMBH-REG-S 3.97100% 22-22.09.32	300 000.00	336 904.57	0.02
EUR ANDALUCIA, COMUNIDAD AUTONOMA DE-REG-S 3.95000% 23-30.04.33	3 000 000.00	3 411 481.10	0.15
EUR ARCADIS NV-REG-S 4.87500% 23-28.02.28	900 000.00	1 019 037.20	0.05
EUR AUSTRIA, REPUBLIC OF-REG-S 2.90000% 23-23.05.29	9 400 000.00	10 459 892.30	0.46
EUR BANQUE OUEST AFRICAINE DE DEV-REG-S 2.75000% 21-22.01.33	3 500 000.00	2 889 425.00	0.13
EUR BASQUE GOVERNMENT-REG-S 3.50000% 23-30.04.33	950 000.00	1 057 830.87	0.05
EUR BERTELSMANN SE & CO KGAA-REG-S 3.50000% 22-29.05.29	1 500 000.00	1 640 809.95	0.07
EUR CAPGEMINI SE-REG-S 1.12500% 20-23.06.30	2 000 000.00	1 921 228.65	0.08
EUR CASSA DEPOSITI E PRESTITI SPA-REG-S 1.00000% 20-21.09.28	3 800 000.00	3 697 696.24	0.16
EUR CBRE GLOBAL INVESTORS OPEN-ENDED-REG-S 0.50000% 21-27.01.28	800 000.00	749 974.80	0.03
EUR CBRE GLOBAL INVESTORS OPEN-ENDED-REG-S 0.90000% 21-12.10.29	3 000 000.00	2 687 869.14	0.12
EUR CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.30000% 21-26.07.36	4 550 000.00	3 669 759.84	0.16
EUR CHILE, REPUBLIC OF 0.55500% 21-21.01.29	5 500 000.00	5 182 770.31	0.23
EUR CIE GEN ETABLISSEMENTS MICHELIN-REG-S 0.62500% 20-02.11.40	1 600 000.00	1 155 881.23	0.05
EUR COVIVIO-REG-S 1.12500% 19-17.09.31	3 800 000.00	3 388 346.56	0.15
EUR DIGITAL DUTCH FINCO BV-REG-S 1.00000% 20-15.01.32	600 000.00	515 854.91	0.02
EUR DIGITAL EURO FINCO LLC-REG-S 1.12500% 19-09.04.28	2 000 000.00	1 957 639.75	0.09
EUR E.ON SE-REG-S 3.37500% 24-15.01.31	2 700 000.00	2 950 120.31	0.13
EUR E.ON SE-REG-S 3.75000% 24-15.01.36	1 300 000.00	1 425 263.41	0.06
EUR ELIA TRANSMISSION BELGIUM SA-REG-S 3.75000% 24-16.01.36	1 400 000.00	1 539 248.40	0.07
EUR EQT AB-REG-S 2.37500% 22-06.04.28	2 000 000.00	2 032 656.18	0.09
EUR EQT AB-REG-S 2.87500% 22-06.04.32	2 000 000.00	1 943 112.96	0.09
EUR ESSITY AB-REG-S 0.50000% 20-03.02.30	800 000.00	761 157.10	0.03
EUR FAURECIA-REG-S 2.75000% 21-15.02.27	1 200 000.00	1 233 880.07	0.05
EUR GIVAUDAN FINANCE EUROPE BV-REG-S 1.62500% 20-22.04.32	1 000 000.00	964 855.05	0.04
EUR HUNGARY, REPUBLIC OF-REG-S 4.00000% 24-25.07.29	1 900 000.00	2 046 951.23	0.09
EUR ICADE SANTE SAS-REG-S 1.37500% 20-17.09.30	10 300 000.00	9 364 580.37	0.41
EUR ICADE-REG-S 0.62500% 21-18.01.31	4 100 000.00	3 507 096.08	0.15
EUR INDONESIA, REPUBLIC OF 1.30000% 21-23.03.34	9 200 000.00	7 832 405.63	0.34
EUR KELLOGG CO 0.50000% 21-20.05.29	2 800 000.00	2 628 050.66	0.12
EUR KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV-REG-S 3.50000% 23-04.04.28	1 300 000.00	1 431 728.12	0.06
EUR KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU-REG-S 2.00000% 22-15.11.29	3 900 000.00	4 118 917.27	0.18
EUR MADRID, COMUNIDAD DE-REG-S 1.72300% 22-30.04.32	4 000 000.00	3 878 972.68	0.17
EUR MADRID, COMUNIDAD DE-REG-S 2.82200% 22-31.10.29	2 000 000.00	2 154 607.29	0.10
EUR MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA-REG-S 1.87500% 19-04.12.34	3 800 000.00	3 286 638.37	0.14
EUR MEXICO, UNITED STATES OF 2.25000% 21-12.08.36	10 150 000.00	8 530 932.26	0.37
EUR MEXICO, UNITED STATES OF 4.48990% 24-25.05.32	1 700 000.00	1 872 016.10	0.08
EUR MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GRP INC-REG-S 0.84800% 19-19.07.29	800 000.00	771 398.96	0.03
EUR MONDELEZ INTERNATIONAL HOLDINGS N-REG-S 1.25000% 21-09.09.41	600 000.00	453 878.69	0.02
EUR NED WATERSCHAPSBANK NV-REG-S 2.62500% 24-10.01.34	900 000.00	959 865.47	0.04
EUR NEMAK SAB DE CV-REG-S 2.25000% 21-20.07.28	200 000.00	189 192.16	0.01
EUR NETFLIX INC-REG-S 3.87500% 19-15.11.29	3 200 000.00	3 569 316.70	0.16
EUR NEXI SPA-REG-S 1.62500% 21-30.04.26	160 000.00	163 980.30	0.01
EUR NORDIC INVESTMENT BANK-REG-S 2.50000% 23-30.01.30	2 100 000.00	2 279 067.43	0.10
EUR PERU, REPUBLIC OF 1.95000% 21-17.11.36	4 100 000.00	3 368 053.91	0.15

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量／額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 比率 （%）
EUR POSTNL NV 0.62500% 19-23.09.26	2 800 000.00	2 806 799.61	0.12
EUR PROLOGIS EURO FINANCE LLC 0.37500% 20-06.02.28	800 000.00	774 348.52	0.03
EUR SACHSEN-ANHALT, FEDERAL STATE-REG-S 2.95000% 23-20.06.33	1 900 000.00	2 109 775.58	0.09
EUR SIEMENS ENERGY FINANCE BV-REG-S 4.25000% 23-05.04.29	800 000.00	869 948.95	0.04
EUR TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 1.37500% 20-09.07.32	3 800 000.00	3 509 335.56	0.15
EUR TERNA RETE ELETTRICA NAZIONALE-REG-S 0.75000% 20-24.07.32	4 900 000.00	4 323 302.15	0.19
EUR TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 7.37500% 23-15.09.29	800 000.00	940 440.49	0.04
EUR THAMES WATER UTILITIES FINANCE-REG-S 0.87500% 22-31.01.28	900 000.00	830 860.64	0.04
EUR TRITAX EUROBOX PLC-REG-S 0.95000% 21-02.06.26	900 000.00	897 754.46	0.04
EUR VF CORP 0.25000% 20-25.02.28	5 400 000.00	5 014 066.56	0.22
EUR VONOVIA SE-REG-S 1.87500% 22-28.06.28	1 900 000.00	1 903 206.46	0.08
EUR VONOVIA SE-REG-S 2.37500% 22-25.03.32	1 900 000.00	1 810 435.28	0.08
EUR WABTEC TRANSPORTATION NETHERLANDS BV 1.25000% 21-03.12.27	3 100 000.00	3 097 183.56	0.14
ユーロ合計		155 697 389.28	6.83
GBP			
GBP BURBERRY GROUP PLC-REG-S 1.12500% 20-21.09.25	2 200 000.00	2 612 460.99	0.11
GBP MARKS & SPENCER FINANCE PLC-REG-S STEP-UP 19-10.07.27	200 000.00	243 814.73	0.01
GBP PEARSON FUNDING PLC-REG-S 3.75000% 20-04.06.30	200 000.00	234 377.96	0.01
GBP UNITED KING OF GREAT BRIT & N IRL-REG-S 3.75000% 23-22.10.53	600 000.00	675 437.88	0.03
GBP WORKSPACE GROUP PLC-REG-S 2.25000% 21-11.03.28	1 200 000.00	1 297 974.61	0.06
英ポンド合計		5 064 066.17	0.22
USD			
USD AES CORP/THE 5.45000% 23-01.06.28	1 600 000.00	1 621 001.51	0.07
USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC 2.00000% 21-18.05.32	9 800 000.00	7 758 885.59	0.34
USD ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC 2.95000% 22-15.03.34	5 000 000.00	4 145 671.20	0.18
USD ALIBABA GROUP HOLDING LTD 2.70000% 21-09.02.41	1 300 000.00	884 819.00	0.04
USD ALPHABET INC 1.10000% 20-15.08.30	4 100 000.00	3 394 470.69	0.15
USD AMERICAN HOMES 4 RENT LP 5.50000% 24-01.02.34	2 700 000.00	2 727 717.09	0.12
USD AMGEN INC 3.00000% 22-22.02.29	2 500 000.00	2 331 687.03	0.10
USD APTIV PLC 3.25000% 22-01.03.32	2 900 000.00	2 557 459.78	0.11
USD ARCOS DORADOS BV-REG-S 6.12500% 22-27.05.29	1 150 000.00	1 138 500.00	0.05
USD ASTRAZENECA PLC 1.37500% 20-06.08.30	3 400 000.00	2 818 444.25	0.12
USD AVANGRID INC 3.20000% 20-15.04.25	5 000 000.00	4 868 288.55	0.21
USD AVANGRID INC 3.80000% 19-01.06.29	2 800 000.00	2 634 258.01	0.12
USD BNG BANK NV-144A 3.50000% 23-19.05.28	3 400 000.00	3 318 731.57	0.15
USD BOSTON PROPERTIES LP 2.55000% 21-01.04.32	2 700 000.00	2 147 292.83	0.09
USD BOSTON PROPERTIES LP 6.50000% 23-15.01.34	2 100 000.00	2 199 857.22	0.10
USD BRAZIL, FEDERATIVE REPUBLIC OF 6.25000% 23-18.03.31	3 900 000.00	4 005 300.00	0.18
USD BROOKFIELD FINANCE INC 2.72400% 21-15.04.31	1 100 000.00	940 897.53	0.04
USD BROOKFIELD FINANCE I UK PLC 2.34000% 21-30.01.32	1 500 000.00	1 213 400.78	0.05
USD CAISSE D ' AMORTISSEMENT DE LA DETTE-144A-1.37500% 21-20.01.31	16 400 000.00	13 606 530.44	0.60
USD CBRE SERVICES INC 2.50000% 21-01.04.31	300 000.00	251 138.14	0.01
USD CELULOSA ARAUCO Y CONSTITUCION SA-REG-S 4.20000% 19-29.01.30	4 700 000.00	4 315 775.00	0.19
USD CHILE, REPUBLIC OF 2.55000% 20-27.01.32	14 300 000.00	12 226 500.00	0.54
USD CHILE, REPUBLIC OF 3.10000% 21-07.05.41	3 950 000.00	2 952 625.00	0.13
USD CHILE, REPUBLIC OF 4.95000% 23-05.01.36	4 600 000.00	4 498 800.00	0.20
USD CIGNA CORP 4.37500% 19-15.10.28	4 100 000.00	4 042 864.12	0.18
USD COCA-COLA FEMSA 1.85000% 20-01.09.32	8 100 000.00	6 399 000.00	0.28
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 8.00000% 23-14.11.35	700 000.00	735 700.00	0.03
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 8.75000% 23-14.11.53	375 000.00	407 812.50	0.02
USD COMCAST CORP 4.65000% 23-15.02.33	900 000.00	898 235.13	0.04
USD CONAGRA BRANDS INC 1.37500% 20-01.11.27	2 600 000.00	2 284 186.66	0.10
USD CONSORCIO TRANSMANTARO-REG-S 4.70000% 19-16.04.34	4 650 000.00	4 352 400.00	0.19
USD COSTA RICA, REPUBLIC OF-REG-S 6.55000% 23-03.04.34	760 000.00	777 480.00	0.03
USD CSX CORP 3.35000% 19-15.09.49	3 800 000.00	2 816 851.69	0.12
USD DEUTSCHE BANK AG/NEW YORK NY 1.68600% 21-19.03.26	3 500 000.00	3 276 952.98	0.14

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量／額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 比率 （%）
USD DEVELOPMENT BANK OF JAPAN-144A 1.75000% 22-18.02.25	4 800 000.00	4 635 984.00	0.20
USD DOMINION ENERGY INC 2.25000% 21-15.08.31	6 200 000.00	5 112 697.88	0.22
USD ECOLAB INC 2.12500% 21-01.02.32	3 800 000.00	3 182 714.55	0.14
USD EQUINIX INC 2.50000% 21-15.05.31	5 100 000.00	4 331 867.02	0.19
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.87500% 20-17.05.30	10 700 000.00	8 856 771.24	0.39
USD EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 5.12500% 23-11.01.33	2 450 000.00	2 517 620.00	0.11
USD FINANCE DEP GOVT OF SHARJAH-REG-S 6.50000% 23-23.11.32	4 200 000.00	4 336 500.00	0.19
USD FORD MOTOR CO 3.25000% 21-12.02.32	250 000.00	206 955.62	0.01
USD GENERAL MOTORS CO 5.40000% 22-15.10.29	1 975 000.00	2 006 057.35	0.09
USD GENERAL MOTORS CO 5.60000% 22-15.10.32	5 000 000.00	5 071 086.90	0.22
USD GUATEMALA, REPUBLIC OF-REG-S 5.37500% 20-24.04.32	2 500 000.00	2 397 500.00	0.11
USD HANWHA ENERGY USA HOLDINGS CORP-144A 4.12500% 22-05.07.25	4 000 000.00	3 929 462.40	0.17
USD HANWHA Q CELLS AMERICAS HOLDINGS-144A 5.00000% 23-27.07.28	1 600 000.00	1 604 944.00	0.07
USD HEALTHPEAK OP LLC 2.12500% 21-01.12.28	3 200 000.00	2 821 699.65	0.12
USD HOME DEPOT INC/THE 4.20000% 13-01.04.43	4 100 000.00	3 685 019.61	0.16
USD HOST HOTELS & RESORTS LP 3.50000% 20-15.09.30	1 000 000.00	899 115.74	0.04
USD HOST HOTELS & RESORTS LP 2.90000% 21-15.12.31	3 900 000.00	3 296 250.20	0.15
USD HUMANA INC 4.87500% 20-01.04.30	4 100 000.00	4 093 157.51	0.18
USD INDIA GREEN POWER HOLDINGS-144A 4.00000% 21-22.02.27	250 000.00	231 187.50	0.01
USD INTEL CORP 4.15000% 22-05.08.32	4 000 000.00	3 865 301.36	0.17
USD INTERN BK FOR RECONSTR & DEVELP 3.50000% 23-12.07.28	1 650 000.00	1 615 789.08	0.07
USD INTERNATIONAL BK FOR RECONSTR& DEVELOP 1.62500% 21-03.11.31	2 000 000.00	1 678 420.46	0.07
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 3.62500% 22-21.09.29	2 800 000.00	2 744 465.22	0.12
USD INVERSIONES CMPC SA-REG-S 4.37500% 17-04.04.27	12 082 000.00	11 610 802.00	0.51
USD JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC 1.75000% 20-15.09.30	10 500 000.00	8 731 895.13	0.38
USD JORDAN, KINGDOM OF-REG-S 7.50000% 23-13.01.29	4 850 000.00	4 746 937.50	0.21
USD JSW HYDRO ENERGY LTD-REG-S 4.12500% 21-18.05.31	1 000 000.00	703 368.75	0.03
USD KB KOOKMIN CRD CO LTD-REG-S 4.00000% 22-09.06.25	1 100 000.00	1 078 363.00	0.05
USD KELLOGG CO 3.40000% 17-15.11.27	1 600 000.00	1 536 261.36	0.07
USD KILROY REALTY LP 2.65000% 21-15.11.33	900 000.00	680 721.59	0.03
USD KIMCO REALITY CORP 2.70000% 20-01.10.30	600 000.00	520 978.55	0.02
USD KOREA EXCHANGE BANK-144A 3.25000% 22-30.03.27	4 800 000.00	4 573 920.00	0.20
USD KOREA HOUSING FINANCE CORP-144A 4.62500% 23-24.02.33	2 000 000.00	1 942 725.00	0.09
USD KOREA WATER RESOURCES CORP-REG-S 3.50000% 22-27.04.25	2 200 000.00	2 157 584.00	0.10
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 1.75000% 19-14.09.29	9 800 000.00	8 706 403.50	0.38
USD LENOVO GROUP LTD-144A 6.53600% 22-27.07.32	3 500 000.00	3 715 845.00	0.16
USD MANULIFE FINANCIAL CORP 3.70300% 22-16.03.32	10 300 000.00	9 545 266.47	0.42
USD MEXICO, UNITED STATES OF 4.87500% 22-19.05.33	2 000 000.00	1 911 000.00	0.08
USD MEXICO, UNITED STATES OF 6.33800% 23-04.05.53	1 490 000.00	1 481 060.00	0.07
USD MICRON TECHNOLOGY INC 2.70300% 21-15.04.32	6 900 000.00	5 791 337.25	0.25
USD MOODY ' S CORP 2.55000% 20-18.08.60	150 000.00	85 123.43	0.00
USD NORINCHUKIN BANK/THE-144A 5.43000% 23-09.03.28	3 500 000.00	3 573 616.66	0.16
USD OWENS CORNING 3.95000% 19-15.08.29	800 000.00	763 778.63	0.03
USD PEIDMONT OPERATING PARTNERSHIP LP 3.15000% 20-15.08.30	400 000.00	308 451.62	0.01
USD PEPSICO INC 2.87500% 19-15.10.49	6 850 000.00	4 885 930.73	0.21
USD PERTAMINA GEOTHERMAL ENERGY PT-REG-S 5.15000% 23-27.04.28	2 500 000.00	2 493 750.00	0.11
USD PERUSAHAAN SBSN INDONESIA III-REG-S 4.70000% 22-06.06.32	6 106 000.00	6 015 081.66	0.26
USD PHILIPPINES, REPUBLIC OF THE 5.50000% 23-17.01.48	1 500 000.00	1 528 290.00	0.07
USD PROCTER & GAMBLE CO 3.55000% 20-25.03.40	3 800 000.00	3 344 601.65	0.15
USD PROLOGIS LP 1.25000% 20-15.10.30	4 800 000.00	3 877 873.05	0.17
USD PROLOGIS LP 2.12500% 20-15.04.27	4 100 000.00	3 795 632.89	0.17
USD PUBLIC SERVICE ELECTRIC AND GAS CO 4.65000% 23-15.03.33	100 000.00	99 249.46	0.00
USD PUBLIC SERVICE ELECTRIC AND GAS CO 5.12500% 23-15.03.53	5 200 000.00	5 247 315.16	0.23
USD RABOBANK NEDERLAND NV-REG-S 1.00400% 20-24.09.26	6 200 000.00	5 778 017.52	0.25
USD RAYONIER LP 2.75000% 21-17.05.31	100 000.00	82 910.67	0.00
USD RENEW WIND ENER AP2 / RENEW POWER-REG-S 4.50000% 21-14.07.28	200 000.00	180 370.00	0.01
USD RENEW WIND ENERGY AP2 / RENEW POWE-144A 4.50000% 21-14.07.28	250 000.00	225 462.50	0.01
USD ROYALTY PHARMA PLC 2.12500% 21-02.09.31	2 900 000.00	2 362 709.73	0.10

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量／額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 比率 （%）
USD SALESFORCE.COM INC 1.50000% 21-15.07.28	6 000 000.00	5 343 922.92	0.23
USD SK BATTERY AMERICA INC-REG-S 2.12500% 21-26.01.26	1 640 000.00	1 520 263.60	0.07
USD SK HYNIX INC-144A 2.37500% 21-19.01.31	1 900 000.00	1 561 040.00	0.07
USD SK HYNIX INC-144A 6.37500% 23-17.01.28	1 700 000.00	1 759 024.00	0.08
USD SOUTHWESTERN ELECTRIC POWER 3.25000% 21-01.11.51	1 000 000.00	676 754.47	0.03
USD STAR ENERGY GEOTHERMAL WAYANG-REG-S 6.75000% 18-24.04.33	1 000 000.00	810 394.60	0.04
USD SUMITOMO MITSUI FIN GP INC 2.47200% 22-14.01.29	3 500 000.00	3 118 227.89	0.14
USD SUZANO AUSTRIA GMBH-REG-S 5.75000% 16-14.07.26	4 750 000.00	4 770 496.25	0.21
USD SUZANO INTERNATIONAL FINANCE B.V. 5.50000% 17-17.01.27	2 883 000.00	2 880 693.60	0.13
USD SYSCO CORP 2.40000% 20-15.02.30	2 100 000.00	1 846 304.31	0.08
USD T-MOBILE USA INC 3.30000% 21-15.02.51	2 150 000.00	1 531 963.00	0.07
USD TELEFONICA EMISIONES SA 4.10300% 17-08.03.27	2 900 000.00	2 840 049.75	0.13
USD TELUS CORP 3.40000% 22-13.05.32	1 400 000.00	1 245 063.52	0.06
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.87500% 19-08.02.29	2 500 000.00	2 417 923.77	0.11
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 1.50000% 20-18.09.30	10 300 000.00	8 456 266.21	0.37
USD VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.85000% 21-03.09.41	11 250 000.00	8 230 557.94	0.36
USD VISA INC 0.75000% 20-15.08.27	4 900 000.00	4 351 668.44	0.19
USD VMWARE INC 1.80000% 21-15.08.28	1 400 000.00	1 230 273.23	0.05
USD WHIRLPOOL CORP 2.40000% 21-15.05.31	4 000 000.00	3 339 314.24	0.15
USD WISCONSIN POWER AND LIGHT CO 4.95000% 23-01.04.33	4 600 000.00	4 600 572.61	0.20
USD WISCONSIN PUBLIC SERVICE CORP 2.85000% 21-01.12.51	800 000.00	525 171.89	0.02
USD XYLEM INC/NY 1.95000% 20-30.01.28	3 000 000.00	2 715 855.81	0.12
USD XYLEM INC/NY 2.25000% 20-30.01.31	4 300 000.00	3 677 673.00	0.16
米ドル合計		371 202 211.09	16.28
ノート、固定利付債合計		531 963 666.54	23.33
ノート、ゼロ・クーポン			
EUR			
EUR KOREA INTERNATIONAL BOND 0.00000% 22-15.10.26	3 200 000.00	3 185 406.40	0.14
ユーロ合計		3 185 406.40	0.14
ノート、ゼロ・クーポン合計		3 185 406.40	0.14
ノート、変動利付債			
EUR			
EUR AIB GROUP PLC-REG-S 5.750%/VAR 22-16.02.29	5 868 000.00	6 843 428.33	0.30
EUR AUSTRALIA & NZ BANKING GRP-REG-S-SUB 1.125%/VAR 19-21.11.29	2 000 000.00	2 113 116.88	0.09
EUR CNP ASSURANCES-REG-S-SUB 2.000%/VAR 19-27.07.50	500 000.00	471 541.13	0.02
EUR EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA-REG-S-SUB 4.496%/VAR 19-30.04.79	4 500 000.00	4 877 234.26	0.21
EUR EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA-REG-S-SUB 1.700%/VAR 20-20.07.80	5 400 000.00	5 601 720.86	0.25
EUR ENBW ENERGIE BADEN-WUERTEM-REG-S-SUB 5.250%/VAR 24-23.01.84	800 000.00	882 591.16	0.04
EUR ING GROEP NV-REG-S 2.125%/VAR 22-23.05.26	600 000.00	637 698.27	0.03
EUR ING GROEP NV-REG-S-SUB 4.125%/VAR 22-24.08.33	1 000 000.00	1 076 578.03	0.05
EUR KONINKLIJKE KPN-REG-S-SUB 6.000%/VAR 22-PRP	986 000.00	1 126 636.03	0.05
EUR LA BANQUE POSTALE SA-REG-S-SUB 5.500%/VAR 22-05.03.34	1 900 000.00	2 155 717.44	0.09
EUR MUENCHENR RUECKVR AG-REG-S-SUB 1.250%/VAR 20-26.05.41	500 000.00	449 544.56	0.02
EUR NATWEST GROUP PLC-REG-S 0.750%/VAR 19-15.11.25	5 500 000.00	5 824 382.34	0.26
EUR ORSTED A/S-REG-S-SUB 1.750%/VAR 19-09.12.3019	4 500 000.00	4 374 871.87	0.19
EUR ORSTED A/S-REG-S-SUB 1.500%/VAR 21-18.02.3021	1 100 000.00	937 976.88	0.04
EUR RAIFFEISEN BANK INTL AG-REG-S-SUB 1.375%/VAR 21-17.06.33	900 000.00	812 744.64	0.04
EUR RED ELECTRICA CORP SA-REG-S-SUB 4.625%/VAR 23-PRP	3 600 000.00	3 988 710.00	0.17
EUR STANDARD CHARTERED PLC-REG-S 0.800%/VAR 21-17.11.29	1 500 000.00	1 427 006.63	0.06
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 2.502%/VAR 20-PRP	6 500 000.00	6 575 207.03	0.29
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 2.376%/VAR 21-PRP	1 600 000.00	1 522 922.50	0.07
EUR TELEFONICA EUROPE BV-REG-S-SUB 7.125%/VAR 22-PRP	200 000.00	235 446.86	0.01
EUR TELIA CO AB-REG-S-SUB 1.375%/VAR 20-11.05.81	5 800 000.00	5 890 733.75	0.26
EUR TELIA CO AB-REG-S-SUB 2.750%/VAR 22-30.06.83	1 500 000.00	1 513 282.03	0.07

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量／額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 比率 （%）
EUR TENNET HOLDING BV-REG-S-SUB 2.374%/VAR 20-PRP	6 600 000.00	6 924 721.22	0.30
EUR TERNA - RETE ELETTRICA NAZIONALE-REG-S-SUB 2.375%/VAR PRP	1 000 000.00	993 658.05	0.04
EUR UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD-REG-S-SUB 7.250%/VAR 23-PRP	4 700 000.00	5 252 154.53	0.23
ユーロ合計		72 509 625.28	3.18
GBP			
GBP NATWEST GROUP PLC-REG-S 2.057%/VAR 21-09.11.28	2 200 000.00	2 503 018.95	0.11
英ボンド合計		2 503 018.95	0.11
USD			
USD ABN AMRO BANK NV-REG-S 2.470%/VAR 21-13.12.29	6 000 000.00	5 279 528.06	0.23
USD CITIGROUP INC 2.014%/VAR 22-25.01.26	7 000 000.00	6 756 380.54	0.30
USD GOLDMAN SACHS GROUP INC 4.387%/VAR 22-15.06.27	2 100 000.00	2 075 325.72	0.09
USD ING GROEP NV-REG-S 1.400%/VAR 20-01.07.26	6 200 000.00	5 870 351.52	0.26
USD JPMORGAN CHASE & CO 6.070%/VAR 23-22.10.27	6 000 000.00	6 180 473.04	0.27
USD MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 3.261%/VAR 22-22.05.30	2 900 000.00	2 634 260.98	0.11
USD STANDARD CHARTERED PLC-144A 1.214%/VAR 21-23.03.25	3 000 000.00	2 976 690.00	0.13
USD STANDARD CHARTERED PLC-REG-S 1.214%/VAR 21-23.03.25	7 900 000.00	7 838 617.00	0.34
USD SWISS RE FINANCE LUXEMBOURG-144A-SUB 5.000%/VAR 19-02.04.49	4 200 000.00	4 053 000.00	0.18
米ドル合計		43 664 626.86	1.91
ノート、変動利付債合計		118 677 271.09	5.20

中期債券、固定利付債

EUR			
EUR A2A SPA-REG-S 1.00000% 19-16.07.29	7 400 000.00	7 083 273.74	0.31
EUR A2A SPA-REG-S 1.00000% 21-02.11.33	4 100 000.00	3 410 897.78	0.15
EUR A2A SPA-REG-S 2.50000% 22-15.06.26	2 818 000.00	2 997 872.37	0.13
EUR AB IGNITIS GRUPE-REG-S 1.87500% 18-10.07.28	1 500 000.00	1 491 448.41	0.07
EUR ABB FINANCE BV-REG-S 0.62500% 22-31.03.24	2 400 000.00	2 592 739.71	0.11
EUR ABN AMRO BANK NV-REG-S 4.25000% 22-21.02.30	1 000 000.00	1 127 201.62	0.05
EUR ABN AMRO BANK NV-REG-S 4.00000% 23-16.01.28	800 000.00	887 422.80	0.04
EUR ACCIONA ENERGIA FINANCIA FILIALES-REG-S 3.75000% 23-25.04.30	1 700 000.00	1 831 593.47	0.08
EUR ACCIONA ENERGIA FINANCIA FILIALES-REG-S 5.12500% 23-23.04.31	1 400 000.00	1 612 277.86	0.07
EUR ACEA SPA-REG-S 0.25000% 21-28.07.30	5 800 000.00	5 176 713.82	0.23
EUR ACEA SPA-REG-S 3.87500% 23-24.01.31	1 600 000.00	1 769 718.50	0.08
EUR ACTION LOGEMENT SERVICES-REG-S 0.50000% 19-30.10.34	3 000 000.00	2 480 710.41	0.11
EUR ACTION LOGEMENT SERVICES-REG-S 1.37500% 22-13.04.32	1 500 000.00	1 440 462.00	0.06
EUR ACTION LOGEMENT SERVICES-REG-S 3.12500% 22-28.09.37	1 400 000.00	1 473 022.78	0.06
EUR ACTION LOGEMENT SERVICES-REG-S 3.62500% 23-25.05.43	800 000.00	872 912.41	0.04
EUR ACTION LOGEMENT SERVICES-REG-S 4.12500% 23-03.10.38	1 000 000.00	1 165 848.22	0.05
EUR ADIF - ALTA VELOCIDAD-REG-S 0.55000% 21-31.10.31	4 000 000.00	3 524 829.11	0.15
EUR ADIF ALTA VELOCIDAD-REG-S 0.55000% 20-30.04.30	3 100 000.00	2 864 902.04	0.13
EUR ADIF ALTA VELOCIDAD-REG-S 3.50000% 22-30.07.29	2 500 000.00	2 757 096.13	0.12
EUR AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT-REG-S 0.01000% 21-25.11.28	4 100 000.00	3 897 999.65	0.17
EUR AIR LIQUIDE FINANCE-REG-S 0.37500% 21-27.05.31	1 000 000.00	909 208.63	0.04
EUR AKZO NOBEL NV-REG-S 1.50000% 22-28.03.28	1 100 000.00	1 117 719.53	0.05
EUR AKZO NOBEL NV-REG-S 2.00000% 22-28.03.32	1 100 000.00	1 065 204.77	0.05
EUR ALLIANDER NV-REG-S 0.87500% 19-24.06.32	3 300 000.00	3 028 857.57	0.13
EUR ALLIANDER NV-REG-S 2.62500% 22-09.09.27	950 000.00	1 022 691.34	0.04
EUR AMPRION GMBH-REG-S 3.87500% 23-07.09.28	3 200 000.00	3 560 112.24	0.16
EUR AMPRION GMBH-REG-S 4.12500% 23-07.09.34	1 300 000.00	1 472 289.99	0.06
EUR ANDORRA INTERNATIONAL BOND-REG-S 1.25000% 21-06.05.31	2 000 000.00	1 852 286.53	0.08
EUR ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.55000% 24-10.01.31	4 400 000.00	4 753 595.11	0.21
EUR ASSICURAZIONI GENERALI SPA-REG-S-SUB 2.12400% 19-01.10.30	3 100 000.00	2 963 929.81	0.13
EUR ASSICURAZIONI GENERALI SPA-REG-S-SUB 2.42900% 20-14.07.31	8 500 000.00	8 022 754.64	0.35
EUR ASSICURAZIONI GENERALI SPA-REG-S-SUB 5.39900% 23-20.04.33	1 913 000.00	2 196 799.44	0.10
EUR ASSICURAZIONI GENERALI SPA-REG-S 3.21200% 24-15.01.29	5 000 000.00	5 422 722.94	0.24

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量／額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 比率 （%）
EUR AUTOLIV INC-REG-S 4.25000% 23-15.03.28	1 250 000.00	1 386 668.75	0.06
EUR BANCA INTESA SPA-REG-S 0.75000% 21-16.03.28	2 000 000.00	1 963 501.16	0.09
EUR BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENT-REG-S 1.37500% 18-14.05.25	1 000 000.00	1 054 353.34	0.05
EUR BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA-REG-S 1.00000% 19-21.06.26	2 300 000.00	2 367 135.36	0.10
EUR BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA-REG-S 0.75000% 20-04.06.25	5 800 000.00	6 074 789.25	0.27
EUR BANCO SANTANDER SA-REG-S 1.12500% 20-23.06.27	7 700 000.00	7 804 146.82	0.34
EUR BANK OF AMERICA CORP-REG-S 4.13400% 23-12.06.28	1 200 000.00	1 343 071.65	0.06
EUR BANQUE FEDERATIVE CREDIT MUTUEL-REG-S 4.12500% 23-18.09.30	2 200 000.00	2 499 357.31	0.11
EUR BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT-REG-S 0.10000% 20-08.10.27	4 100 000.00	3 996 193.18	0.18
EUR BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT-REG-S 0.25000% 21-29.06.28	3 000 000.00	2 863 528.80	0.13
EUR BANQUE FEDERATIVE DU CR MUTUEL-REG-S 4.00000% 22-21.11.29	1 600 000.00	1 798 159.13	0.08
EUR BELFIUS BANK SA-REG-S 0.37500% 21-08.06.27	1 300 000.00	1 274 620.74	0.06
EUR BERLIN HYP AG-REG-S 1.50000% 18-18.04.28	500 000.00	501 537.92	0.02
EUR BERLIN HYP AG-REG-S 1.12500% 17-25.10.27	2 000 000.00	1 980 924.79	0.09
EUR BNG BANK NV-REG-S 0.12500% 21-19.04.33	4 300 000.00	3 664 880.62	0.16
EUR BNG BANK NV-REG-S 0.25000% 21-22.11.36	3 200 000.00	2 472 965.44	0.11
EUR BNG BANK NV-REG-S 0.25000% 22-12.01.32	2 000 000.00	1 787 989.24	0.08
EUR BNG BANK NV-REG-S 3.00000% 23-11.01.33	8 400 000.00	9 249 323.16	0.41
EUR BNP PARIBAS-REG-S 1.00000% 18-17.04.24	700 000.00	755 637.86	0.03
EUR BPIFRANCE FINANCEMENT SA-REG-S 2.12500% 22-29.11.27	6 900 000.00	7 330 981.75	0.32
EUR BPIFRANCE FINANCEMENT SA-REG-S 3.12500% 23-25.05.33	2 300 000.00	2 554 123.74	0.11
EUR CADENT FINANCE PLC-REG-S 4.25000% 23-05.07.29	400 000.00	450 476.57	0.02
EUR CAISSE D ' AMORTIS DE LA DETTE SOC-REG-S 2.75000% 22-25.11.32	8 000 000.00	8 687 393.00	0.38
EUR CAISSE D ' AMORTIS DE LA DETTE SOC-REG-S 3.12500% 23-01.03.30	3 000 000.00	3 347 394.52	0.15
EUR CAISSE D ' AMORTIS DE LA DETE SOCAL-REG-S 3.00000% 23-25.11.31	3 200 000.00	3 543 524.77	0.16
EUR CAISSE D ' AMORTISSEMENT DE LA DETTE-REG-S 3.00000% 23-25.05.28	2 200 000.00	2 425 926.04	0.11
EUR CAISSE D ' AMORTISSEMENT DE LA DE-REG-S 2.87500% 22-25.05.27	1 600 000.00	1 749 832.31	0.08
EUR CAISSE D ' AMTISEMT DE LA DTE SCIL-REG-S 1.75000% 22-25.11.27	3 000 000.00	3 156 366.59	0.14
EUR CAISSE DES DEPOTS ET CONSIGNATIONS-REG-S 3.00000% 22-25.11.27	1 000 000.00	1 096 683.54	0.05
EUR CAISSE DES DEPOTS ET-REG-S 3.37500% 23-25.11.30	3 000 000.00	3 390 012.45	0.15
EUR CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT-REG-S 3.62500% 23-17.01.29	1 200 000.00	1 350 074.06	0.06
EUR CAIXABANK SA-REG-S 3.75000% 22-07.09.29	1 500 000.00	1 664 888.85	0.07
EUR CASSA DEPOSITI E PRESTITI SPA-REG-S 1.00000% 20-11.02.30	9 500 000.00	8 872 289.05	0.39
EUR CASSA DEPOSITI E PRESTITI SPA-REG-S 2.00000% 20-20.04.27	2 800 000.00	2 928 161.55	0.13
EUR CASSA DI RISPARMINO DI PARMA-REG-S 3.50000% 24-15.07.33	1 000 000.00	1 098 192.23	0.05
EUR CASTELLUM AB-REG-S 0.75000% 19-04.09.26	1 500 000.00	1 480 166.61	0.06
EUR COMMUNAUTE FRANCAISE DE BELGIQUE-REG-S 1.62500% 22-03.05.32	3 000 000.00	2 942 488.31	0.13
EUR COOPERATIEVE RABOBANK UA-REG-S 3.29600% 23-22.11.28	4 200 000.00	4 683 240.87	0.21
EUR COUNCIL OF EUROPE DEV BANK-REG-S 2.87500% 23-13.04.30	2 000 000.00	2 208 845.92	0.10
EUR COVESTRO AG-REG-S 4.75000% 22-15.11.28	900 000.00	1 030 710.04	0.05
EUR CPI PROPERTY GROUP SA-REG-S 1.62500% 19-23.04.27	2 400 000.00	2 102 024.10	0.09
EUR CREDIT AGRICOLE SA 0.12500% 20-09.12.27	7 200 000.00	6 936 992.36	0.30
EUR CREDIT AGRICOLE SA-REG-S 4.37500% 23-27.11.33	1 100 000.00	1 252 582.68	0.05
EUR CREDIT MUTUEL ARKEA SA-REG-S 0.37500% 19-03.10.28	2 800 000.00	2 655 576.23	0.12
EUR CREDIT MUTUEL ARKEA SAC-REG-S 0.87500% 21-11.03.33	1 900 000.00	1 626 176.64	0.07
EUR CREDIT MUTUEL ARKEA SA-REG-S 4.25000% 22-01.12.32	1 800 000.00	2 046 560.17	0.09
EUR CTP BV-REG-S 0.50000% 21-21.06.25	1 900 000.00	1 962 823.55	0.09
EUR CTP BV-REG-S 0.75000% 21-18.02.27	4 500 000.00	4 431 222.18	0.19
EUR CTP NV-REG-S 0.87500% 22-20.01.26	1 600 000.00	1 629 566.18	0.07
EUR CTP NV-REG-S 4.75000% 24-05.02.30	1 100 000.00	1 203 545.06	0.05
EUR DAIMLER AG-REG-S 0.75000% 20-10.09.30	2 000 000.00	1 892 069.36	0.08
EUR DAIMLER AG-REG-S 0.75000% 21-11.03.33	5 400 000.00	4 801 409.65	0.21
EUR DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH-REG-S 3.62500% 23-18.12.37	1 000 000.00	1 124 703.24	0.05
EUR DEUTSCHE WOHNEN AG-REG-S 0.50000% 21-07.04.31	1 000 000.00	869 477.95	0.04
EUR DEUTSCHE WOHNEN SE-REG-S 1.30000% 21-07.04.41	1 100 000.00	762 490.36	0.03
EUR DEVELOPMENT BANK OF JAPAN INC-REG-S 0.01000% 21-09.09.25	3 060 000.00	3 162 927.37	0.14
EUR DEVELOPMENT BANK OF JAPAN-REG-S 3.50000% 23-13.09.27	1 200 000.00	1 332 716.09	0.06
EUR DS SMITH PLC-REG-S 4.37500% 23-27.07.27	2 750 000.00	3 058 151.12	0.13

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量／額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 比率 （%）
EUR DS SMITH PLC-REG-S 4.50000% 23-27.07.30	1 450 000.00	1 625 398.35	0.07
EUR E.ON AG ECP-REG-S 0.60000% 21-01.10.32	5 400 000.00	4 714 772.54	0.21
EUR E.ON SE-REG-S 0.35000% 19-28.02.30	2 700 000.00	2 479 493.59	0.11
EUR E.ON SE-REG-S 0.87500% 20-20.08.31	2 900 000.00	2 664 533.24	0.12
EUR E.ON SE-REG-S 1.62500% 22-29.03.31	3 988 000.00	3 901 558.28	0.17
EUR E.ON SE-REG-S 3.75000% 23-01.03.29	2 700 000.00	3 030 686.38	0.13
EUR E.ON SE-REG-S 3.87500% 23-12.01.35	1 800 000.00	2 009 332.21	0.09
EUR EAST JAPAN RAILWAY CO-REG-S 4.11000% 23-22.02.43	3 833 000.00	4 395 532.10	0.19
EUR EAST JAPAN RAILWAY CO-REG-S 3.97600% 23-05.09.32	2 250 000.00	2 584 079.33	0.11
EUR EAST JAPAN RAILWAY CO-REG-S 4.38900% 23-05.09.43	3 422 000.00	4 013 610.59	0.18
EUR EDP - ENERGIAS DE PORTUGAL SA-REG-S 3.87500% 23-26.06.28	1 200 000.00	1 334 614.55	0.06
EUR EDP FINANCE BV-REG-S 1.87500% 22-21.09.29	2 400 000.00	2 421 579.74	0.11
EUR EDP SERVICIOS FINANCIEROS ESPANA-REG-S 4.37500% 23-04.04.32	2 885 000.00	3 337 241.97	0.15
EUR EDP SERVICIOS FINANCIEROS ESPANA-REG-S 3.50000% 24-16.07.30	1 450 000.00	1 583 174.07	0.07
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S 4.75000% 22-12.10.34	4 200 000.00	4 885 768.27	0.21
EUR ELECTRICITE DE FRANCE SA-REG-S 3.75000% 23-05.06.27	1 000 000.00	1 101 242.43	0.05
EUR ENBW INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S 4.04900% 22-22.11.29	1 900 000.00	2 155 473.90	0.09
EUR ENBW INTERNATIONAL FINANCE BV-REG-S 4.30000% 23-23.05.34	1 000 000.00	1 144 690.25	0.05
EUR ENEXIS HOLDING NV-REG-S 0.62500% 20-17.06.32	3 000 000.00	2 674 788.52	0.12
EUR ENEXIS HOLDING NV-REG-S 0.37500% 21-14.04.33	2 500 000.00	2 132 906.19	0.09
EUR ENEXIS HOLDING NV-REG-S 3.62500% 23-12.06.34	1 400 000.00	1 586 589.35	0.07
EUR ENGIE SA-REG-S 3.87500% 23-06.12.33	2 500 000.00	2 789 625.78	0.12
EUR ENGIE SA-REG-S 4.50000% 23-06.09.42	4 000 000.00	4 606 881.84	0.20
EUR ERG SPA-REG-S 0.50000% 20-11.09.27	3 100 000.00	3 033 984.67	0.13
EUR ERG SPA-REG-S 1.87500% 19-11.04.25	1 300 000.00	1 383 100.17	0.06
EUR ERSTE GROUP BANK AG-REG-S 0.12500% 21-17.05.28	2 800 000.00	2 670 801.98	0.12
EUR ESB FINANCE DAC-REG-S 1.12500% 19-11.06.30	3 600 000.00	3 448 185.05	0.15
EUR ESB FINANCE DAC-REG-S 4.25000% 23-03.03.36	1 900 000.00	2 192 454.42	0.10
EUR ESSITY CAPITAL BV-REG-S 3.00000% 22-21.09.26	550 000.00	594 044.05	0.03
EUR EUROFIMA EURO RAILROADMAT FIN CO-REG-S 0.15000% 19-10.10.34	2 400 000.00	1 970 568.73	0.09
EUR EUROFIMA-REG-S 0.01000% 21-23.06.28	1 300 000.00	1 258 135.59	0.06
EUR EUROGRID GMBH-REG-S 3.27900% 22-05.09.31	1 900 000.00	2 044 912.13	0.09
EUR EUROGRID GMBH-REG-S 3.59800% 24-01.02.29	400 000.00	440 556.93	0.02
EUR EUROPEAN COMMUNITY-REG-S 2.62500% 22-04.02.48	4 000 000.00	3 949 370.37	0.17
EUR EUROPEAN UNION-REG-S-2.75000% 22-04.12.37	2 550 000.00	2 694 373.61	0.12
EUR EUROPEAN UNION-REG-S 1.12500% 22-04.06.37	1 050 000.00	910 189.40	0.04
EUR EUROPEAN UNION-REG-S 0.20000% 21-04.06.36	3 000 000.00	2 354 446.87	0.10
EUR FERROVIE DELLO STATO-REG-S 0.37500% 21-25.03.28	6 000 000.00	5 788 739.23	0.25
EUR FERROVIE DELLO STATO ITALI S.P.A-REG-S 4.12500% 23-23.05.29	2 000 000.00	2 233 860.10	0.10
EUR FERROVIE DELLO STATO ITALIANE SPA-REG-S 4.50000% 23-23.05.33	5 808 000.00	6 632 197.46	0.29
EUR FLEMISH COMMUNITY-REG-S 1.50000% 19-11.04.44	2 600 000.00	2 033 279.24	0.09
EUR FLEMSH COMMUNITY-REG-S 0.87500% 21-21.03.46	600 000.00	393 686.98	0.02
EUR FLEMSH COMMUNITY-REG-S 3.25000% 22-12.01.43	1 400 000.00	1 481 958.71	0.06
EUR FLUVIUS SYSTEM OPERATOR CVBA-REG-S 0.25000% 20-02.12.30	2 000 000.00	1 789 953.18	0.08
EUR GLOBALWORTH REAL ESTATE INVEST-REG-S 2.95000% 20-29.07.26	1 000 000.00	928 895.82	0.04
EUR H LUNDBECK A/S-REG-S 0.87500% 20-14.10.27	2 000 000.00	1 964 596.10	0.09
EUR HYPO NOE LANDESBANK FUER NIED AG-REG-S 4.00000% 23-01.02.27	2 000 000.00	2 191 965.60	0.10
EUR IBERDROLA FINANZAS SA-REG-S 1.37500% 22-11.03.32	2 000 000.00	1 913 364.20	0.08
EUR IBERDROLA FINANZAS SA-REG-S 3.62500% 23-13.07.33	3 300 000.00	3 668 548.24	0.16
EUR ILE DE FRANCE-REG-S 0.50000% 16-14.06.25	1 700 000.00	1 778 702.44	0.08
EUR ILE DE FRANCE-REG-S 3.20000% 24-25.05.34	2 000 000.00	2 198 470.06	0.10
EUR ILE-DE-FRANCE MOBILITES-REG-S 0.95000% 21-28.05.41	1 500 000.00	1 106 710.60	0.05
EUR ILE-DE-FRANCE MOBILITES-REG-S 3.05000% 23-03.02.33	6 300 000.00	6 898 464.17	0.30
EUR ILE-DE-FRANCE MOBILITES-REG-S 3.70000% 23-14.06.38	2 300 000.00	2 596 885.93	0.11
EUR IMERYS SA-REG-S 1.87500% 16-31.03.28	3 000 000.00	3 033 563.86	0.13
EUR INFORMA PLC-REG-S 2.12500% 20-06.10.25	400 000.00	423 213.43	0.02
EUR ING GROEP NV-REG-S 2.50000% 18-15.11.30	1 300 000.00	1 342 959.12	0.06
EUR INMOBILIARIA COLONIAL SA-REG-S 1.35000% 20-14.10.28	6 500 000.00	6 498 203.85	0.28

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量／額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 比率 （%）
EUR INSTITUTO DE CREDITO OFICIAL-REG-S 2.65000% 22-31.01.28	5 000 000.00	5 390 624.24	0.24
EUR INSTITUTO DE CREDITO OFICIAL-REG-S 3.05000% 23-31.10.27	2 250 000.00	2 469 187.46	0.11
EUR INTERNATIONAL BANK FOR RECONS & DEV 2.90000% 23-19.01.33	4 400 000.00	4 854 222.71	0.21
EUR INTERNATIONAL BK FOR RECONST & DEV 0.10000% 20-17.09.35	5 700 000.00	4 530 523.45	0.20
EUR INTERNATIONAL DEVELOP ASSOCIATION-REG-S 1.75000% 22-05.05.37	5 000 000.00	4 718 235.50	0.21
EUR INTERNATIONAL DEVELOPMENT ASSOC-REG-S 2.50000% 22-15.01.38	2 000 000.00	2 046 257.05	0.09
EUR INTERNATIONAL DEVELOPMENT ASSOCIA-REG-S 3.20000% 24-18.01.44	600 000.00	650 914.46	0.03
EUR INTESA SANPAOLO SPA-REG-S 4.75000% 22-06.09.27	4 793 000.00	5 389 650.98	0.24
EUR INTESA SANPAOLO SPA-REG-S 5.62500% 23-08.03.33	3 752 000.00	4 439 146.27	0.19
EUR INTESA SANPAOLO SPA-REG-S 4.87500% 23-19.05.30	1 300 000.00	1 498 185.55	0.07
EUR INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 3.45000% 23-13.09.38	4 200 000.00	4 781 456.98	0.21
EUR IREN SPA-REG-S 1.50000% 17-24.10.27	5 800 000.00	5 950 258.51	0.26
EUR JAPAN FINANCE ORG FOR MUNI-REG-S 0.01000% 21-02.02.28	800 000.00	775 871.91	0.03
EUR JAPAN FINANCE ORG FOR MUNI-REG-S 2.87500% 24-23.01.29	800 000.00	868 086.06	0.04
EUR JUNTA DE CASTILLA Y LEON-REG-S 3.50000% 23-30.04.33	600 000.00	658 622.05	0.03
EUR KBC GROUP NV-REG-S 3.00000% 22-25.08.30	1 800 000.00	1 899 928.16	0.08
EUR KOJAMO OYJ-REG-S 2.00000% 22-31.03.26	1 000 000.00	1 025 830.61	0.04
EUR KOMMUNINVEST I SVERIGE AB-REG-S 0.87500% 22-01.09.29	2 100 000.00	2 087 767.72	0.09
EUR KOMMUNINVEST I SVERIGE AB-REG-S 3.37500% 23-15.03.27	500 000.00	556 301.22	0.02
EUR KOMMUNINVEST I SVERIGE AB-REG-S 3.12500% 23-08.12.27	1 400 000.00	1 554 364.65	0.07
EUR KREDITANSTALT FUER WIEDER-REG-S 2.75000% 23-15.05.30	3 250 000.00	3 578 593.05	0.16
EUR LA BANQUE POSTALE SA-REG-S 4.37500% 23-17.01.30	1 800 000.00	2 015 635.94	0.09
EUR LA BANQUE POSTALE SA-REG-S 4.00000% 23-03.05.28	900 000.00	1 003 539.89	0.04
EUR LA BANQUE POSTALE-REG-S 1.37500% 19-24.04.29	6 500 000.00	6 372 383.52	0.28
EUR LA BANQUE POSTALE-REG-S 0.75000% 21-23.06.31	8 000 000.00	7 121 628.80	0.31
EUR LA POSTE SA-REG-S 1.45000% 18-30.11.28	4 100 000.00	4 129 445.64	0.18
EUR LA POSTE SA-REG-S 2.62500% 22-14.09.28	2 000 000.00	2 138 248.36	0.09
EUR LA POSTE SA-REG-S 3.12500% 22-14.03.33	1 000 000.00	1 071 576.93	0.05
EUR LANDESBANK BADEN-WUERTTEMBERG REG S-0.37500% 21-21.02.31	2 800 000.00	2 401 994.21	0.11
EUR LANDESBANK BADEN-WUERTTEMBERG-REG-S 0.25000% 21-21.07.28	3 000 000.00	2 791 705.95	0.12
EUR LANDESBANK HESSEN-THUER GIRO-REG-S 2.62500% 22-24.08.27	2 100 000.00	2 219 876.80	0.10
EUR LANDESBANK HESSEN-THUERINGEN GIRO-REG-S 4.00000% 23-04.02.30	1 400 000.00	1 560 335.12	0.07
EUR LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK-REG-S 3.25000% 23-26.09.33	1 700 000.00	1 936 858.48	0.08
EUR LEASEPLAN CORP NV-REG-S 0.25000% 21-23.02.26	7 700 000.00	7 799 546.56	0.34
EUR LEASEPLAN CORP NV-REG-S 0.25000% 21-07.09.26	6 200 000.00	6 186 931.98	0.27
EUR LOGICOR FINANCING SARL-REG-S 2.00000% 22-17.01.34	1 000 000.00	842 914.80	0.04
EUR MEDIABANCA BANCA DI CREDITO FINAN-REG-S 1.00000% 20-08.09.27	6 900 000.00	6 896 609.28	0.30
EUR MERCEDES-BENZ INTERNATIONAL FIN-REG-S 3.50000% 23-30.05.26	7 141 000.00	7 847 108.62	0.34
EUR MERCEDES-BENZ INTERNATIONAL FIN-REG-S 3.70000% 23-30.05.31	1 900 000.00	2 147 408.28	0.09
EUR MERCK FINANCIAL SERVICES GMBH-REG-S 1.87500% 22-15.06.26	1 600 000.00	1 695 133.97	0.07
EUR MOTABILITY OPERATIONS GROUP PLC-REG-S 0.12500% 21-20.07.28	1 700 000.00	1 618 197.49	0.07
EUR MOTABILITY OPERATIONS GROUP PLC-REG-S 3.50000% 23-17.07.31	8 054 000.00	8 864 909.66	0.39
EUR MOTABILITY OPERATIONS GROUP PLC-REG-S 3.62500% 24-24.07.29	3 186 000.00	3 520 062.02	0.15
EUR MOTABILITY OPERATIONS GROUP PLC-REG-S 3.87500% 24-24.01.34	1 950 000.00	2 157 412.09	0.09
EUR MUNICIPALITY FINANCE PLC-REG-S 0.05000% 20-10.09.35	4 300 000.00	3 385 973.34	0.15
EUR NATIONAL GRID PLC-REG-S 3.87500% 23-16.01.29	1 000 000.00	1 107 464.45	0.05
EUR NATIONAL GRID TRANSCO PLC-REG-S 0.25000% 21-01.09.28	1 700 000.00	1 606 822.28	0.07
EUR NATIONALE-NEDERLANDEN BANK-REG-S 1.87500% 22-17.05.32	300 000.00	301 019.86	0.01
EUR NATIONALE-NEDERLANDEN BANK NV-REG-S 3.25000% 23-28.05.27	1 000 000.00	1 099 862.88	0.05
EUR NATIONALE-NEDERLANDEN BANK NV/THE 0.50000% 21-21.09.28	2 600 000.00	2 489 480.36	0.11
EUR NE PROPERTY BV-REG-S 2.00000% 22-20.01.30	2 800 000.00	2 539 652.49	0.11
EUR NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK NV-REG-S 1.25000% 17-07.06.32	1 000 000.00	965 576.31	0.04
EUR NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK NV-REG-S 2.75000% 22-09.11.27	1 550 000.00	1 691 654.20	0.07
EUR NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK NV-REG-S 2.75000% 23-17.12.29	3 000 000.00	3 275 845.40	0.14
EUR NESTE OYJ-REG-S 3.87500% 23-16.03.29	1 000 000.00	1 112 665.43	0.05
EUR NESTE OYJ-REG-S 3.87500% 23-21.05.31	1 000 000.00	1 119 406.69	0.05
EUR NESTE OYJ-REG-S 4.25000% 23-16.03.33	1 700 000.00	1 956 587.82	0.09
EUR NOKIA OYJ-REG-S 4.37500% 23-21.08.31	1 300 000.00	1 424 407.66	0.06

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量／額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 比率 （%）
EUR NORDEA BANK ABP-REG-S 0.50000% 21-19.03.31	1 300 000.00	1 172 651.19	0.05
EUR NORDEA BANK ABP-REG-S 1.12500% 22-16.02.27	2 400 000.00	2 442 550.44	0.11
EUR NRW BANK 0.10000% 20-09.07.35	5 100 000.00	4 044 563.03	0.18
EUR OESTERREICHISCHE KONTROLLBANK AG-REG-S 3.12500% 23-15.11.28	2 000 000.00	2 223 549.41	0.10
EUR ONTARIO TEACHERS ' FINANCE TRUST-REG-S 0.05000% 20-25.11.30	800 000.00	709 886.10	0.03
EUR ORANGE SA-REG-S 0.12500% 20-16.09.29	7 800 000.00	7 257 639.03	0.32
EUR ORSTED AS-REG-S 2.25000% 22-14.06.28	3 450 000.00	3 589 677.69	0.16
EUR ORSTED AS-REG-S 3.62500% 23-01.03.26	800 000.00	871 368.89	0.04
EUR ORSTED AS-REG-S 3.75000% 23-01.03.30	800 000.00	887 122.12	0.04
EUR ORSTED AS-REG-S 4.12500% 23-01.03.35	4 000 000.00	4 513 698.98	0.20
EUR POLAND, REPUBLIC OF-REG-S 2.00000% 19-08.03.49	2 200 000.00	1 634 493.41	0.07
EUR PROLOGIS INTERNATIONAL FUNDING II-REG-S 0.87500% 19-09.07.29	2 800 000.00	2 643 975.95	0.12
EUR PROLOGIS INTERNATIONAL FUNDING II-REG-S 1.62500% 20-17.06.32	1 300 000.00	1 180 036.60	0.05
EUR PROLOGIS INTERNATIONAL FUNDING II-REG-S 0.75000% 21-23.03.33	2 100 000.00	1 727 067.12	0.08
EUR PROLOGIS INTERNATIONAL FUND II SA-REG-S 3.62500% 22-07.03.30	1 700 000.00	1 822 652.12	0.08
EUR RCI BANQUE SA-REG-S 4.87500% 23-14.06.28	2 496 000.00	2 836 606.21	0.12
EUR RED ELEC FINANCIACIONES SAU-REG-S 3.00000% 24-17.01.34	1 900 000.00	2 052 449.39	0.09
EUR RED ELECTRICA FINANCIACIONES SAU-REG-S 0.50000% 21-24.05.33	2 800 000.00	2 458 821.59	0.11
EUR REGIE AUTONOME DES TRANSPORTS PA-REG-S 0.87500% 17-25.05.27	500 000.00	510 989.38	0.02
EUR REGION OF ILE DE FRANCE-REG-S 1.37500% 18-20.06.33	3 300 000.00	3 108 049.10	0.14
EUR REGION OF ILE DE FRANCE-REG-S 2.90000% 23-30.04.31	1 900 000.00	2 064 906.93	0.09
EUR REGION WALLONNE BELGIUM-REG-S 3.50000% 23-15.03.43	3 200 000.00	3 434 107.25	0.15
EUR REGION WALLONNE BELGIUM-REG-S 3.00000% 24-06.12.30	1 700 000.00	1 855 636.53	0.08
EUR REGION WALLONNE BELGIUM-REG-S 0.25000% 19-03.05.26	1 200 000.00	1 227 558.09	0.05
EUR REN FINANCE B V-REG-S 0.50000% 21-16.04.29	8 500 000.00	8 093 129.53	0.35
EUR SBAB BANK AB-REG-S 1.87500% 22-10.12.25	2 300 000.00	2 427 491.10	0.11
EUR SCHNEIDER ELECTRIC SE-REG-S 3.25000% 22-09.11.27	1 000 000.00	1 096 688.86	0.05
EUR SCHNEIDER ELECTRIC SE-REG-S 3.12500% 23-13.10.29	1 600 000.00	1 759 203.60	0.08
EUR SCHNEIDER ELECTRIC SE-REG-S 3.37500% 23-13.04.34	1 000 000.00	1 106 323.79	0.05
EUR SEGRO CAPITAL SARL-REG-S 1.25000% 22-23.03.26	9 500 000.00	9 819 607.67	0.43
EUR SEGRO CAPITAL SARL-REG-S 1.87500% 22-23.03.30	1 600 000.00	1 560 741.37	0.07
EUR SERBIA INTERNATIONAL BOND-REG-S 1.00000% 21-23.09.28	2 100 000.00	1 918 996.41	0.08
EUR SHAEFFLER AG-REG-S 3.37500% 20-12.10.28	900 000.00	943 408.13	0.04
EUR SIEMENS FININGSMAATSCH NV-REG-S 3.37500% 23-24.08.31	1 400 000.00	1 564 191.74	0.07
EUR SIEMENS FININGSMAATSCH NV-REG-S 3.50000% 23-24.02.36	1 800 000.00	2 020 457.59	0.09
EUR SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-REG-S 4.37500% 23-06.11.28	1 082 000.00	1 214 688.75	0.05
EUR SKF AB-REG-S 0.87500% 19-15.11.29	3 800 000.00	3 593 337.65	0.16
EUR SNCF RESEAU-REG-S 1.00000% 16-09.11.31	100 000.00	94 374.70	0.00
EUR SOCIETE DU GRAND PARIS EPIC-REG-S 1.12500% 18-22.10.28	1 300 000.00	1 312 838.49	0.06
EUR SOCIETE DU GRAND PARIS EPIC-REG-S 0.30000% 21-25.11.31	1 500 000.00	1 336 527.43	0.06
EUR SOCIETE DU GRAND PARIS EPIC-REG-S 1.62500% 22-08.04.42	2 000 000.00	1 631 547.51	0.07
EUR SOCIETE DU GRAND PARIS EPIC-REG-S 3.50000% 23-25.05.43	1 300 000.00	1 405 099.67	0.06
EUR SPAREBANK 1 SR-BANK ASA-REG-S 3.75000% 23-23.11.27	1 300 000.00	1 431 931.46	0.06
EUR SSE PLC-REG-S 1.37500% 18-04.09.27	1 300 000.00	1 331 588.69	0.06
EUR SSE PLC-REG-S 2.87500% 22-01.08.29	1 200 000.00	1 282 469.32	0.06
EUR SSE PLC-REG-S 4.00000% 23-05.09.31	2 000 000.00	2 258 400.64	0.10
EUR STANDARD CHARTERED PLC-REG-S 0.90000% 19-02.07.27	10 800 000.00	10 997 084.63	0.48
EUR STATKRAFT AS-REG-S 2.87500% 22-13.09.29	800 000.00	862 280.89	0.04
EUR STATKRAFT AS-REG-S 3.12500% 23-13.12.26	2 350 000.00	2 559 584.86	0.11
EUR STATNETT SF-REG-S 3.50000% 23-08.06.33	1 150 000.00	1 288 327.04	0.06
EUR STEDIN HOLDING NV-REG-S 0.50000% 19-14.11.29	2 800 000.00	2 606 121.43	0.11
EUR STELLANTIS NV-REG-S 4.37500% 23-14.03.30	2 800 000.00	3 189 973.84	0.14
EUR SUEZ SACA-REG-S 4.50000% 23-13.11.33	400 000.00	459 625.27	0.02
EUR SUEZ SACA-REG-S 4.62500% 22-03.11.28	5 800 000.00	6 633 092.21	0.29
EUR SUMITOMO MITSUI FIN GP INC-REG-S 0.46500% 19-30.05.24	1 800 000.00	1 932 408.77	0.08
EUR SVENSK EXPORTKREDIT AB-REG-S 2.00000% 22-30.06.27	3 200 000.00	3 388 724.59	0.15
EUR TDC NET A/S-REG-S 5.05600% 22-31.05.28	2 700 000.00	3 034 877.46	0.13
EUR TDC NET A/S-REG-S 5.61800% 23-06.02.30	900 000.00	1 011 595.52	0.04

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄		数量／額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 比率 （%）
EUR	TELEFONICA EMISIONES SA-REG-S 1.06900% 19-05.02.24	1 000 000.00	1 085 965.40	0.05
EUR	TELEFONICA EMISIONES SA-REG-S 4.18300% 23-21.11.33	2 400 000.00	2 742 548.35	0.12
EUR	TELEFONICA EMISIONES SA-REG-S 3.69800% 24-24.01.32	6 700 000.00	7 409 764.66	0.32
EUR	TELEFONICA EMISIONES SA-REG-S 4.05500% 24-24.01.36	2 600 000.00	2 899 544.50	0.13
EUR	TENNET HOLDING BV-REG-S 2.00000% 18-05.06.34	2 800 000.00	2 730 774.27	0.12
EUR	TENNET HOLDING BV-REG-S 0.12500% 20-30.11.32	2 800 000.00	2 622 855.77	0.12
EUR	TENNET HOLDING BV-REG-S 1.62500% 22-17.11.26	1 450 000.00	1 532 337.35	0.07
EUR	TENNET HOLDING BV-REG-S 3.87500% 22-28.10.28	1 100 000.00	1 234 379.96	0.05
EUR	TENNET HOLDING BV-REG-S 4.25000% 22-28.04.32	2 000 000.00	2 316 984.29	0.10
EUR	TERNA - RETE ELETTRICA NAZIONALE-REG-S 3.87500% 23-24.07.33	2 814 000.00	3 131 902.51	0.14
EUR	TESCO CORP TREASURY SERVICES PLC-REG-S STEP-UP 21-27.07.29	4 700 000.00	4 345 072.34	0.19
EUR	UNEDIC ASSEO-REG-S 0.25000% 20-16.07.35	2 400 000.00	1 947 741.84	0.09
EUR	UNEDIC ASSEO-REG-S 3.12500% 23-25.04.33	1 000 000.00	1 121 435.81	0.05
EUR	UNICREDIT BANK AUSTRIA AG-REG-S 3.12500% 23-21.09.29	1 600 000.00	1 754 684.80	0.08
EUR	UNICREDIT BANK AUSTRIA AG-REG-S 2.87500% 24-10.11.28	1 000 000.00	1 082 710.99	0.05
EUR	UNIPOL GRUPPO FINANZIARIO SPA-REG-S 3.25000% 20-23.09.30	400 000.00	423 808.69	0.02
EUR	VESTEDA FINANCE BV-REG-S 0.75000% 21-18.10.31	600 000.00	520 971.14	0.02
EUR	VF CORP 4.25000% 23-07.03.29	4 387 000.00	4 672 157.40	0.20
EUR	VOLKSBANK WIEN AG-REG-S 4.75000% 23-15.03.27	1 100 000.00	1 230 706.91	0.05
EUR	VONOVIA SE-REG-S 0.62500% 21-24.03.31	12 300 000.00	10 541 276.12	0.46
EUR	VONOVIA SE-REG-S 1.37500% 22-28.01.26	1 900 000.00	1 971 970.64	0.09
EUR	VONOVIA SE-REG-S 4.75000% 22-23.05.27	2 500 000.00	2 801 558.23	0.12
EUR	VONOVIA SE-REG-S 5.00000% 22-23.11.30	300 000.00	341 992.13	0.02
EUR	WESFARMERS LTD-REG-S 0.95400% 21-21.10.33	2 100 000.00	1 804 552.36	0.08
EUR	WESTERN POWER DISTRIBUTION EAST-REG-S 3.53000% 22-20.09.28	1 300 000.00	1 423 139.58	0.06
EUR	ZF FINANCE GMBH-REG-S 2.75000% 20-25.05.27	1 000 000.00	1 025 311.36	0.04
EUR	ZF FINANCE GMBH-REG-S 2.25000% 21-03.05.28	1 500 000.00	1 473 150.52	0.06
ユーロ合計			778 311 609.94	34.13
GBP				
GBP	ABN AMRO BANK NV-REG-S 5.25000% 23-26.05.26	900 000.00	1 152 127.89	0.05
GBP	CADENT FINANCE PLC-REG-S 5.75000% 23-14.03.34	500 000.00	651 185.02	0.03
GBP	ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-REG-S 2.87500% 22-11.04.29	1 900 000.00	2 190 447.34	0.10
GBP	INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 5.00000% 23-20.07.30	400 000.00	538 480.93	0.02
GBP	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC-REG-S 3.37500% 20-08.10.28	200 000.00	235 756.35	0.01
GBP	INTESA SANPAOLO SPA-REG-S 6.62500% 23-31.05.33	3 300 000.00	4 436 062.82	0.19
GBP	ORSTED AS-REG-S 5.12500% 22-13.09.34	900 000.00	1 117 470.71	0.05
GBP	PLACES FOR PEOPLE TREASURY PLC-REG-S 6.25000% 23-06.12.41	1 000 000.00	1 338 169.28	0.06
GBP	SEVERN TRENT UTILITIES FINANCE-REG-S 5.25000% 23-04.04.36	1 100 000.00	1 408 440.54	0.06
GBP	SOUTH EASTERN POWER NET-REG-S 1.75000% 21-30.09.34	200 000.00	188 098.75	0.01
GBP	THE BRITISH LAND CO PLC-REG-S 2.37500% 17-14.09.29	200 000.00	218 545.42	0.01
英ポンド合計			13 474 785.05	0.59
USD				
USD	ADANIREN KODSOPAR WARSON-144A 4.62500% 19-15.10.39	200 000.00	142 916.37	0.01
USD	AGENCE FRANCAISE DE DVLPMT EPIC-REG-S 4.00000% 22-21.09.27	3 000 000.00	2 968 531.89	0.13
USD	ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.75000% 16-14.08.26	1 600 000.00	1 507 839.28	0.07
USD	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT-REG-S 2.00000% 21-19.04.26	900 000.00	837 000.00	0.04
USD	BANK OF THE PHILIPPINE ISLANDS-REG-S 2.50000% 19-10.09.24	3 500 000.00	3 421 250.00	0.15
USD	BNG BANK NV-144A 1.50000% 19-16.10.24	3 000 000.00	2 925 306.00	0.13
USD	CAISSE D ' AMORTIS DE LA DETTE SOC-REG-S 4.00000% 23-25.01.26	3 350 000.00	3 325 102.77	0.15
USD	CAISSE D ' AMORTIS DE LA DETTE-REG-S 3.75000% 23-24.05.28	3 000 000.00	2 958 835.62	0.13
USD	CHINA CONSTRUCTION BANK CORP/HK-REG-S 1.25000% 20-04.08.25	1 800 000.00	1 701 666.00	0.07
USD	EUROPEAN INVESTMENT BANK-REG-S 2.87500% 18-13.06.25	2 000 000.00	1 956 251.14	0.09
USD	HONG KONG MORTGAGE CORP LTD-REG-S 4.87500% 23-13.09.28	2 500 000.00	2 547 900.00	0.11
USD	INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 3.50000% 23-12.04.33	5 000 000.00	4 757 572.30	0.21
USD	LINK FINANCE CAYMAN 2009 LTD-REG-S 2.87500% 16-21.07.26	1 200 000.00	1 139 740.05	0.05
USD	MTR CORP CI LTD-REG-S 2.50000% 16-02.11.26	1 200 000.00	1 130 544.00	0.05

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄		数量／額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 比率 （%）
USD	MTR CORP LTD-REG-S 1.62500% 20-19.08.30	2 900 000.00	2 425 870.47	0.11
USD	NEDERLANDSE FINAN-MAATSCHAPPIJ-REG-S 4.75000% 23-15.11.28	1 100 000.00	1 129 393.88	0.05
USD	NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK NV-144A 4.00000% 23-01.06.28	3 700 000.00	3 683 349.53	0.16
USD	PRUDENTIAL FINANCIAL INC 1.50000% 20-10.03.26	2 000 000.00	1 870 424.76	0.08
USD	PUBLIC SERVICE ELECTRIC & GAS CO 3.10000% 22-15.03.32	3 100 000.00	2 755 390.02	0.12
USD	SHINHAN BANK CO LTD-144A-SUB 4.37500% 22-13.04.32	1 300 000.00	1 191 359.00	0.05
USD	SUMITOMO MITSUI TRUST BANK LTD-144A 2.80000% 22-10.03.27	1 200 000.00	1 125 317.69	0.05
USD	SUMITOMO TRUST & BANKING CO-144A 5.50000% 23-09.03.28	1 600 000.00	1 640 301.90	0.07
USD	SWIRE PROPERTIES MTN FINANCING-REG-S 3.50000% 18-10.01.28	2 000 000.00	1 893 820.00	0.08
USD	UDR INC 1.90000% 20-15.03.33	1 000 000.00	763 382.98	0.03
米ドル合計			49 799 065.65	2.19
中期債券、固定利付債合計			841 585 460.64	36.91
中期債券、ゼロ・クーポン				
EUR				
EUR	ASIAN DEVELOPMENT BANK-REG-S 0.00000% 19-24.10.29	3 200 000.00	3 016 069.58	0.13
EUR	EUROPEAN UNION-REG-S 0.00000% 20-04.07.35	32 000 000.00	25 200 999.99	1.10
EUR	HONG KONG GOVERNMENT INTERNATI BD-REG-S 0.00000% 21-24.11.26	4 100 000.00	4 070 249.03	0.18
EUR	KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU-REG-S 0.00000% 21-15.09.31	6 000 000.00	5 371 045.68	0.24
EUR	LSEG NETHERLANDS BV-REG-S 0.00000% 21-06.04.25	400 000.00	416 946.20	0.02
EUR	NORTH RHIEEN WESTPHALIA, STATE OF-REG-S 0.00000% 20-12.10.35	1 800 000.00	1 405 768.24	0.06
EUR	UNEDIC ASSEO-REG-S 0.00000% 20-19.11.30	6 400 000.00	5 828 348.24	0.26
EUR	UNEDIC ASSEO-REG-S 0.00000% 20-25.11.28	5 000 000.00	4 797 423.12	0.21
ユーロ合計			50 106 850.08	2.20
中期債券、ゼロ・クーポン合計			50 106 850.08	2.20
中期債券、変動利付債				
EUR				
EUR	ABB FINANCE BV-REG-S 3M EURIBOR+70BP 22-31.03.24	1 200 000.00	1 304 540.19	0.06
EUR	AIB GROUP PLC-REG-S 0.50000% 21-17.11.27	4 800 000.00	4 792 343.81	0.21
EUR	AIB GROUP PLC-REG-S 2.250%/VAR 22-04.04.28	8 200 000.00	8 552 296.11	0.38
EUR	AIB GROUP PLC-REG-S 4.625%/VAR 23-23.07.29	1 200 000.00	1 343 806.82	0.06
EUR	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BK-REG-S-SUB 0.669%/VAR 21-05.05.31	4 100 000.00	4 099 392.57	0.18
EUR	AXA SA-REG-S-SUB 0.000%/VAR 21-07.10.41	6 400 000.00	5 725 027.03	0.25
EUR	BANCO DE SABADELL SA-REG-S 2.625%/VAR 22-24.03.26	6 700 000.00	7 161 429.00	0.31
EUR	BANCO DE SABADELL SA-REG-S 5.125%/VAR 22-10.11.28	1 800 000.00	2 061 760.29	0.09
EUR	BANCO SANTANDER SA-REG-S 0.625%/VAR 21-24.06.29	5 500 000.00	5 289 580.18	0.23
EUR	BNP PARIBAS SA-REG-S 0.375%/VAR 20-14.10.27	3 200 000.00	3 203 446.86	0.14
EUR	BNP PARIBAS SA-REG-S 4.250%/VAR 23-13.04.31	4 000 000.00	4 489 401.74	0.20
EUR	BPCE SA-REG-S-SUB 5.750%/VAR 23-01.06.33	600 000.00	686 752.89	0.03
EUR	CAIXA GERAL DE DEPOSITOS SA-REG-S 2.875%/VAR 22-15.06.26	900 000.00	965 449.65	0.04
EUR	CAIXABANK S.A-REG-S 4.625%/VAR 23-16.05.27	2 300 000.00	2 545 849.12	0.11
EUR	CAIXABANK SA-REG-S 0.750%/VAR 20-10.07.26	5 100 000.00	5 327 343.24	0.23
EUR	CAIXABANK SA-REG-S 0.750%/VAR 21-26.05.28	4 300 000.00	4 266 657.48	0.19
EUR	CAIXABANK SA-REG-S 0.625%/VAR 22-21.01.28	2 800 000.00	2 813 259.76	0.12
EUR	CAIXABANK SA-REG-S 5.375%/VAR 22-14.11.30	8 500 000.00	9 942 616.80	0.44
EUR	CAIXABANK SA-REG-S-SUB VAR 21-18.06.31	6 500 000.00	6 586 631.13	0.29
EUR	COMMERZBANK AG-REG-S 0.750%/VAR 20-24.03.26	7 300 000.00	7 645 696.86	0.34
EUR	COMMERZBANK AG-REG-S 4.625%/VAR 24-17.01.31	800 000.00	888 347.42	0.04
EUR	CREDIT AGRICOLE SA-REG-S 4.000%/VAR 22-12.10.26	6 100 000.00	6 673 647.56	0.29
EUR	CREDIT MUTUEL ARKEA SA-REG-S 1.250%/VAR 20-11.06.29	10 700 000.00	10 509 984.72	0.46
EUR	DANSKE BANK A/S-REG-S 0.750%/VAR 21-09.06.29	2 000 000.00	1 923 909.52	0.08
EUR	DE VOLKSBANK NV-REG-S-SUB 1.750/VAR 20-22.10.30	7 200 000.00	7 436 285.00	0.33
EUR	DNB BANK ASA-REG-S 4.000%/VAR 23-14.03.29	4 300 000.00	4 791 589.09	0.21
EUR	DNB BANK ASA-REG-S 4.625%/VAR 23-01.11.29	1 700 000.00	1 932 622.32	0.09
EUR	EDP - ENERGIAS DE PORT SA-REG-S-SUB 5.943%/VAR 23-23.04.83	800 000.00	903 760.00	0.04

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量／額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 比率 （%）
EUR IBERDROLA FINANZAS SA-REG-S-SUB 4.871%/VAR 24-PRP	1 100 000.00	1 206 823.75	0.05
EUR IBERDROLA INTERNATIONAL BV-REG-S-SUB 2.625%/VAR 18-PRP	6 600 000.00	7 139 425.92	0.31
EUR ICCREA BANCA SPA-REG-S 4.250%/VAR 24-05.02.30	1 500 000.00	1 624 568.34	0.07
EUR ING GROEP NV-REG-S-SUB 0.875%/VAR 21-09.06.32	6 500 000.00	6 320 727.98	0.28
EUR KBC GROEP NV-REG-S 0.375%/VAR 20-16.06.27	2 300 000.00	2 327 111.39	0.10
EUR NATWEST GROUP PLC-REG-S 0.780%/VAR 21-26.02.30	10 700 000.00	10 017 081.83	0.44
EUR NATWEST GROUP PLC-REG-S 4.067%/VAR 22-06.09.28	3 700 000.00	4 084 749.28	0.18
EUR NATWEST GROUP PLC-REG-S 4.699%/VAR 23-14.03.28	1 150 000.00	1 284 114.78	0.06
EUR NN GROUP N.V-REG-S-SUB 5.250%/VAR 22-01.03.43	1 300 000.00	1 441 276.91	0.06
EUR NN GROUP NV-REG-S-SUB 6.000%/VAR 23-03.11.43	5 163 000.00	5 961 044.46	0.26
EUR SOCIETE GENERALE SA-REG-S-SUB 5.250%/VAR 22-06.09.32	3 200 000.00	3 586 321.29	0.16
EUR UNICREDIT SPA-REG-S 0.800%/VAR 21-05.07.29	5 000 000.00	4 836 452.09	0.21
EUR UNICREDIT SPA-REG-S 5.850%/VAR 22-15.11.27	2 641 000.00	3 034 498.83	0.13
ユーロ合計		176 727 624.01	7.75
GBP			
GBP ING GROEP NV-REG-S 1.125%/VAR 21-07.12.28	200 000.00	220 704.16	0.01
GBP NORDEA BANK ABP-REG-S 6.000%/VAR 23-02.06.26	2 800 000.00	3 595 254.98	0.16
英ポンド合計		3 815 959.14	0.17
USD			
USD BANK OF AMERICA CORP 2.456%/VAR 19-22.10.25	9 200 000.00	8 984 931.23	0.39
USD BANK OF AMERICA CORP 0.981%/VAR 20-25.09.25	900 000.00	873 179.11	0.04
USD BANK OF AMERICA CORP 1.530%/VAR 21-06.12.2025	2 000 000.00	1 930 754.24	0.08
USD MORGAN STANLEY 0.864%/VAR 20-21.10.25	16 900 000.00	16 326 266.30	0.72
USD UNITED OVERSEAS BANK LTD-REG-S-SUB 2.000%/VAR 21-14.10.31	1 600 000.00	1 462 939.21	0.06
米ドル合計		29 578 070.09	1.29
中期債券、変動利付債合計		210 121 653.24	9.21
債券、固定利付債			
CAD			
CAD CANADA, GOVERNMENT 2.25000% 22-01.12.29	2 000 000.00	1 414 300.37	0.06
カナダドル合計		1 414 300.37	0.06
DKK			
DKK DENMARK, KINGDOM OF 2.25000% 23-15.11.33	31 000 000.00	4 485 722.32	0.20
デンマーク・クローネ合計		4 485 722.32	0.20
EUR			
EUR AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT-REG-S 0.12500% 21-29.09.31	5 900 000.00	5 188 522.66	0.23
EUR AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT-REG-S 3.50000% 22-25.02.33	3 100 000.00	3 501 975.71	0.15
EUR AUSTRIA, REPUBLIC OF-144A-REG-S 1.85000% 22-23.05.49	400 000.00	345 849.84	0.02
EUR BANKINTER SA-REG-S 0.62500% 20-06.10.27	9 600 000.00	9 450 750.40	0.41
EUR BASQUE GOVERNMENT-REG-S 1.12500% 19-30.04.29	3 200 000.00	3 180 748.56	0.14
EUR BELGIUM, KINGDOM OF-REG-S 1.25000% 18-22.04.33	11 300 000.00	10 923 041.50	0.48
EUR BELGIUM, KINGDOM OF-144A-REG-S 2.75000% 22-22.04.39	1 000 000.00	1 047 514.33	0.05
EUR BERLIN, STATE OF 2.75000% 23-14.02.33	2 600 000.00	2 842 539.84	0.12
EUR CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.25000% 20-29.01.40	3 850 000.00	2 828 119.77	0.12
EUR COENTREPRISE DE TRANSPORT D ' ELECT-REG-S 3.75000% 24-17.01.36	500 000.00	547 609.04	0.02
EUR CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA-REG-S 2.87500% 24-12.01.34	1 100 000.00	1 179 642.73	0.05
EUR DH EUROPE FINANCE II SARL 0.75000% 19-18.09.31	3 800 000.00	3 467 276.97	0.15
EUR DIGITAL INTREPID HOLDING BV-REG-S 0.62500% 21-15.07.31	3 200 000.00	2 705 266.52	0.12
EUR EQT AB-REG-S 0.87500% 21-14.05.31	800 000.00	690 898.45	0.03
EUR EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.50000% 17-15.11.47	3 000 000.00	2 405 009.64	0.11
EUR EUROPEAN INVESTMENT BANK-REG-S 0.01000% 20-15.11.35	2 800 000.00	2 187 732.70	0.10
EUR EUROPEAN INVESTMENT BANK-REG-S 1.50000% 22-15.06.32	1 900 000.00	1 891 124.54	0.08
EUR EUROPEAN UNION-REG-S 0.10000% 20-04.10.40	2 000 000.00	1 350 938.71	0.06

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量／額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 比率 （%）
EUR EUROPEAN UNION-REG-S 0.30000% 20-04.11.50	6 800 000.00	3 720 742.56	0.16
EUR EUROPEAN UNION-REG-S 2.75000% 22-04.02.33	6 750 000.00	7 369 559.66	0.32
EUR FEDEX CORP 0.45000% 21-04.05.29	8 500 000.00	7 990 808.01	0.35
EUR FRANCE, REPUBLIC OF-0AT-144A-REG-S 1.75000% 17-25.06.39	11 800 000.00	10 934 771.25	0.48
EUR GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 1.30000% 22-15.10.27	2 000 000.00	2 114 963.51	0.09
EUR GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 2.30000% 23-15.02.33	3 500 000.00	3 865 799.72	0.17
EUR HANA BANK-REG-S 3.75000% 23-04.05.26	2 500 000.00	2 739 060.84	0.12
EUR HESSEN, STATE OF 2.87500% 23-04.07.33	4 400 000.00	4 854 988.85	0.21
EUR INVESTITIONSBANK BERLIN-REG-S 3.12500% 23-13.09.28	1 700 000.00	1 889 041.98	0.08
EUR IRELAND, REPUBLIC OF-REG-S 3.00000% 23-18.10.43	1 900 000.00	2 114 733.01	0.09
EUR ITALIAN REPUBLIC-REG-S-144A 1.50000% 21-30.04.45	10 200 000.00	6 953 540.31	0.30
EUR ITALY, REPUBLIC OF-144A-REG-S 4.00000% 23-30.10.31	8 802 000.00	9 940 368.60	0.44
EUR JYSKE BANK A/S-REG-S 5.50000% 22-16.11.27	750 000.00	851 307.70	0.04
EUR KOMMUNEKREDIT-REG-S 0.62500% 19-21.11.39	1 100 000.00	846 556.99	0.04
EUR MERICIALYS-REG-S 1.80000% 18-27.02.26	1 500 000.00	1 556 134.59	0.07
EUR NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK-REG-S 0.12500% 20-03.09.35	1 100 000.00	866 494.68	0.04
EUR NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK NV-REG-S 3.00000% 23-20.04.33	1 600 000.00	1 771 800.63	0.08
EUR NETHERLANDS, KINGDOM OF THE-144A-REG-S 0.50000% 19-15.01.40	2 800 000.00	2 204 667.77	0.10
EUR NETHERLANDS, KINGDOM OF THE-144A-REG-S 3.25000% 23-15.01.44	900 000.00	1 066 315.14	0.05
EUR PEARSON FUNDING FIVE PLC-REG-S 1.37500% 15-06.05.25	1 000 000.00	1 051 996.19	0.05
EUR PROLOGIS EURO FINANCE 1.50000% 22-08.02.34	900 000.00	793 115.87	0.03
EUR SEB SA-REG-S 1.50000% 17-31.05.24	1 900 000.00	2 045 382.68	0.09
EUR SELP FINANCE SARL-REG-S 0.87500% 21-27.05.29	1 100 000.00	1 015 249.44	0.04
EUR SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-REG-S 4.00000% 22-09.11.26	1 500 000.00	1 651 733.28	0.07
EUR SLOVENIA, REPUBLIC OF-REG-S 3.62500% 23-11.03.33	1 850 000.00	2 111 727.26	0.09
EUR SOCIETE NATIONALE SNCF SA-REG-S 3.12500% 22-02.11.27	2 400 000.00	2 628 664.17	0.12
EUR SOCIETE NATIONALE SNCF SA-REG-S 3.37500% 23-25.05.33	2 000 000.00	2 230 071.25	0.10
EUR SPAIN, KINGDOM OF-144A-REG-S 1.00000% 21-30.07.42	5 600 000.00	3 969 887.46	0.17
EUR SPAREBANK 1 SMN-REG-S 0.01000% 21-18.02.28	2 300 000.00	2 193 648.20	0.10
EUR VIA OUTLETS BV-REG-S 1.75000% 21-15.11.28	200 000.00	191 800.48	0.01
ユーロ合計		149 269 493.99	6.54
GBP			
GBP BERKELEY GROUP PLC/THE-REG-S 2.50000% 21-11.08.31	200 000.00	194 862.81	0.01
GBP DERWENT LONDON PLC-REG-S 1.87500% 21-17.11.31	200 000.00	199 678.49	0.01
GBP ENW FINANCE PLC-REG-S 4.89300% 23-24.11.32	900 000.00	1 151 617.76	0.05
GBP VMED 02 UK FINANCING I PLC-REG-S 4.50000% 21-15.07.31	200 000.00	218 748.14	0.01
GBP WEIR GROUP PLC-REG-S 6.87500% 23-14.06.28	1 900 000.00	2 527 339.41	0.11
英ポンド合計		4 292 246.61	0.19
USD			
USD ASIAN INFRTSTRUCTURE INVESTMENT BANK/THE 4.87500% 23-14.09.26	3 200 000.00	3 250 229.34	0.14
USD BANK RAKYAT INDONESIA-REG-S 3.95000% 19-28.03.24	2 500 000.00	2 489 325.00	0.11
USD CENTERPOINT ENERGY HOUSTON ELEC LLC 5.30000% 23-01.04.53	2 100 000.00	2 150 869.58	0.09
USD COLOMBIA, REPUBLIC OF 5.62500% 14-26.02.44	4 300 000.00	3 412 050.00	0.15
USD COUNCIL OF EUROPE DEVELOPMENT BANK 3.75000% 23-25.05.26	4 000 000.00	3 955 978.44	0.17
USD DTE ELECTRIC CO 1.90000% 21-01.04.28	900 000.00	816 110.03	0.04
USD DTE ELECTRIC CO 3.65000% 22-01.03.52	350 000.00	271 704.60	0.01
USD DTE ELECTRIC CO 4.05000% 18-15.05.48	3 285 000.00	2 754 876.78	0.12
USD DUKE ENERGY CAROLINAS LLC 3.95000% 18-15.11.28	1 500 000.00	1 470 990.44	0.06
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.12500% 16-13.04.26	2 800 000.00	2 676 482.73	0.12
USD EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.62500% 19-09.10.29	7 900 000.00	6 955 268.79	0.31
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.62500% 20-22.04.25	18 200 000.00	17 342 227.81	0.76
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 0.87500% 20-14.05.30	1 600 000.00	1 319 518.71	0.06
USD INTL BK FOR RECONSTR & DEVT WORLD BANK 1.12500% 21-13.09.28	20 000 000.00	17 575 358.20	0.77
USD JAPAN INTERNATIONAL COOPERATION AGENCY 4.00000% 23-23.05.28	3 000 000.00	2 944 680.00	0.13
USD KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 0.75000% 20-30.09.30	6 300 000.00	5 114 804.12	0.22
USD MIDAMERICAN ENERGY CO 3.95000% 17-01.08.47	2 000 000.00	1 647 904.58	0.07

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄		数量／額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 比率 （%）
USD	MIDAMERICAN ENERGY CO 3.65000% 18-01.08.48	750 000.00	589 671.08	0.03
USD	MIDAMERICAN ENERGY CO 2.70000% 21-01.08.52	4 000 000.00	2 551 038.08	0.11
USD	NORTHERN STATES POWER CO 2.25000% 21-01.04.31	500 000.00	427 072.81	0.02
USD	NORTHERN STATES POWER CO 3.20000%21-01.04.52	3 400 000.00	2 447 217.79	0.11
USD	PACIFIC GAS AND ELECTRIC CO 6.70000% 23-01.04.53	1 000 000.00	1 100 658.91	0.05
USD	PACIFICORP 5.35000% 22-01.12.53	800 000.00	756 684.93	0.03
USD	PACIFICORP 5.50000% 23-15.05.54	2 400 000.00	2 318 419.34	0.10
USD	PERU PENER SBSN INDO III-REG-S 2.30000% 20-23.06.25	1 800 000.00	1 730 448.00	0.08
USD	PERUSAHAAN PENERBIT SBSN IDN III-REG-S 3.55000% 21-09.06.51	3 400 000.00	2 541 874.00	0.11
USD	PUBLIC SERVICE CO OF COLORADO 3.20000% 19-01.03.50	1 200 000.00	840 534.98	0.04
USD	RENEW POWER PVT LTD-REG-S 5.87500% 20-05.03.27	840 000.00	811 188.00	0.04
USD	SAN DIEGO GAS & ELECTRIC CO 2.95000% 21-15.08.51	6 250 000.00	4 368 647.69	0.19
USD	SOUTHERN CALIFORNIA EDISON 2.75000% 22-01.02.32	5 100 000.00	4 381 816.42	0.19
米ドル合計			101 013 651.18	4.43
債券、固定利付債合計			260 475 414.47	11.42
債券、ゼロ・クーポン				
EUR				
EUR	GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 20-15.08.30	3 000 000.00	2 864 473.84	0.12
EUR	GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 21-15.08.31	9 840 000.00	9 191 854.45	0.40
EUR	GRAND-DUCHY OF LUXEMBOURG-REG-S 0.00000% 20-14.09.32	2 300 000.00	2 009 942.69	0.09
EUR	THERMO FISHER SCIENTIFIC FINANCE 0.00000% 21-18.11.25	800 000.00	821 027.72	0.04
ユーロ合計			14 887 298.70	0.65
債券、ゼロ・クーポン合計			14 887 298.70	0.65
債券、変動利付債				
EUR				
EUR	BANCO DE SABADELL SA-REG-S 1.125%/VAR 20-11.03.27	7 300 000.00	7 534 951.71	0.33
EUR	COMMERZBANK AG-REG-S 5.250%/VAR 23-25.03.29	1 000 000.00	1 140 942.68	0.05
EUR	COMMERZBANK AG-REG-S 3.000%/VAR 22-14.09.27	1 600 000.00	1 701 849.60	0.07
EUR	DEUTSCHE BANK AG-REG-S 3.250%/VAR 22-24.05.28	800 000.00	852 217.87	0.04
EUR	ERSTE GROUP BANK AG-REG-S 4.000%/VAR 23-16.01.31	1 500 000.00	1 689 824.81	0.07
EUR	MUENCHENER RUECKVERSICHERUN-REG-S-SUB 1.000%/VAR 21-26.05.42	3 600 000.00	3 081 474.00	0.14
EUR	SOCIETE GENERALE SA-REG-S 0.875%/VAR 20-22.09.28	3 700 000.00	3 652 299.45	0.16
EUR	SOCIETE GENERALE SA-REG-S 0.625%/VAR 21-02.12.27	7 100 000.00	7 083 693.03	0.31
EUR	SOCIETE GENERALE SA-REG-S 4.750%/VAR 23-28.09.29	4 200 000.00	4 743 909.67	0.21
EUR	STOREBRAND LIVSFORSIKRING-REG-S-SUB 1.875%/VAR 21-30.09.51	800 000.00	696 541.74	0.03
ユーロ合計			32 177 704.56	1.41
GBP				
GBP	YORKSHIRE BUILDING SOCIETY-REG-S 3.511%/VAR 22-11.10.30	2 400 000.00	2 725 469.86	0.12
英ポンド合計			2 725 469.86	0.12
USD				
USD	CEMEX SAB DE CV-REG-S-SUB 9.125%/VAR 23-PRP	3 500 000.00	3 702 825.00	0.16
USD	ING GROEP NV-REG-S-SUB 4.875%/VAR 20-PRP	250 000.00	210 625.00	0.01
USD	NWD FINANCE BVI LTD-REG-S 6.150%/VAR 22-PRP	1 700 000.00	1 358 675.70	0.06
米ドル合計			5 272 125.70	0.23
債券、変動利付債合計			40 175 300.12	1.76
財務省証券（T-note）、固定利付債				
EUR				
EUR	FRANCE, REPUBLIC OF-OAT-144A-REG-S 3.00000% 24-25.06.49	2 500 000.00	2 645 018.75	0.12
ユーロ合計			2 645 018.75	0.12
財務省証券（T-note）、固定利付債合計			2 645 018.75	0.12

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量／額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 比率 （%）
財務省証券（T-note）、変動利付債			
USD			
USD AMERICA, UNITED STATES OF 0.625%/CPI LINKED 22-15.07.32	4 250 000.00	4 128 403.66	0.18
米ドル合計		4 128 403.66	0.18
財務省証券（T-note）、変動利付債合計		4 128 403.66	0.18
公認の証券取引所に上場されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
合計		2 077 951 743.69	91.12

他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品

ノート、固定利付債

USD			
USD AES CORP-SUB 2.45000% 21-15.01.31	9 902 000.00	8 264 055.32	0.36
USD AES CORPORATION 1.37500% 21-15.01.26	5 000 000.00	4 637 370.90	0.20
USD AMDOCS LTD 2.53800% 20-15.06.30	400 000.00	345 575.58	0.02
USD AUTODESK INC 2.40000% 21-15.12.31	1 400 000.00	1 185 127.30	0.05
USD BMW US CAPITAL LLC-144A 1.95000% 21-12.08.31	300 000.00	247 888.55	0.01
USD CLEAN RENEWABLE POWER MAURITIUS-144A 4.25000% 21-25.03.27	250 000.00	208 125.00	0.01
USD COOPERATIEVE RADOBANK UA-144A 1.00400% 20-24.09.26	4 100 000.00	3 820 947.07	0.17
USD ELECTRICITE DE FRANCE SA-144A 3.62500% 15-13.10.25	2 229 000.00	2 185 520.30	0.10
USD ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV-144A 1.87500% 21-12.07.28	2 800 000.00	2 458 813.92	0.11
USD GOODMAN US FINANCE FIVE LLC-144A 4.62500% 22-04.05.32	2 800 000.00	2 596 164.23	0.11
USD HAT HOLDINGS I LLC-144A 8.00000% 23-15.06.27	3 000 000.00	3 106 842.21	0.14
USD JDE PEET ' S NV-144A 2.25000% 21-24.09.31	1 200 000.00	959 505.97	0.04
USD LIBERTY UTILITIES FIN GP 1-144A 2.05000% 20-15.09.30	1 400 000.00	1 132 477.94	0.05
USD METALSA S A P I DE CV-144A 3.75000% 21-04.05.31	600 000.00	489 187.50	0.02
USD NEW YORK STATE ELECTRIC & GAS CORP-144A 2.15000% 21-01.10.31	3 750 000.00	3 013 412.25	0.13
USD NIAGARA MOHAWK POWER CORP-144A 1.96000% 20-27.06.30	8 000 000.00	6 660 843.68	0.29
USD NIAGARA MOHAWK POWER-144A 5.78300% 22-16.09.52	1 020 000.00	1 054 380.73	0.05
USD NXP BV / NXP FUNDING LLC / NXP USA 2.50000% 22-11.05.31	4 300 000.00	3 598 197.00	0.16
USD PUBLIC SERVICE CO OF OKLAHOMA 2.20000% 21-15.08.31	2 700 000.00	2 231 870.11	0.10
USD SCENTRE GROUP TRUST 1 / 2-144A 4.37500% 20-28.05.30	5 400 000.00	5 135 848.96	0.23
USD SOLAR STAR FUNDING LLC-144A 5.37500% 13-30.06.35	2 000 000.00	1 470 859.43	0.06
USD WEIR GROUP PLC/THE-144A 2.20000% 21-13.05.26	2 300 000.00	2 139 049.68	0.09
USD WISCONSIN ELECTRIC POWER CO 4.75000% 22-30.09.32	900 000.00	905 095.86	0.04
米ドル合計		57 847 159.49	2.54
ノート、固定利付債合計		57 847 159.49	2.54

ノート、変動利付債

USD			
USD BANK OF IRELAND GROUP-144A 6.253%/VAR 22-16.09.26	4 400 000.00	4 445 748.87	0.20
USD BNP PARIBAS SA-144A 1.675%/VAR 21-30.06.27	14 000 000.00	12 858 556.20	0.56
USD ING GROEP NV-144A 1.400%/VAR 20-01.07.26	6 200 000.00	5 870 351.52	0.26
USD RABOBANK NEDERLAND NV-144A 1.106%/VAR 21-24.02.27	8 100 000.00	7 449 536.63	0.33
USD SANTANDER HOLDINGS USA INC 5.807%/VAR 22-09.09.26	3 500 000.00	3 523 636.76	0.15
米ドル合計		34 147 829.98	1.50
ノート、変動利付債合計		34 147 829.98	1.50

中期債券、固定利付債

AUD			
AUD WORLEY FINANCIAL SERVICES PTY LTD-REG-S 5.95000% 23-13.10.28	800 000.00	533 694.75	0.02
豪ドル合計		533 694.75	0.02

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量／額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 比率 （%）
USD			
USD SHRIRAM FINANCE LTD-144A 6.62500% 24-22.04.27	1 300 000.00	1 308 125.00	0.06
米ドル合計		1 308 125.00	0.06
中期債券、固定利付債合計		1 841 819.75	0.08
中期債券、変動利付債			
USD			
USD BB&T CORP 1.267%/VAR 21-02.03.27	2 700 000.00	2 487 915.78	0.11
米ドル合計		2 487 915.78	0.11
中期債券、変動利付債合計		2 487 915.78	0.11
債券、固定利付債			
EUR			
EUR ARDAGH METAL PACKAGING FINANCE-144A 2.00000% 21-01.09.28	500 000.00	469 640.18	0.02
ユーロ合計		469 640.18	0.02
USD			
USD ANDREW W MELLON FOUNDATION/THE 0.94700% 20-01.08.27	600 000.00	531 050.53	0.02
USD NATIONAL RURAL UTILITIES COOPERATIVE 1.35000% 20-15.03.31	300 000.00	237 481.91	0.01
USD NORTHERN STATES POWER CO 4.50000% 22-01.06.52	550 000.00	496 571.27	0.02
USD SCE RECOVERY FUNDING LLC 4.69700% 23-15.06.40	1 350 000.00	1 282 559.46	0.06
USD SOUTHWESTERN PUBLIC SERVICE 3.75000% 19-15.06.49	500 000.00	377 170.40	0.02
米ドル合計		2 924 833.57	0.13
債券、固定利付債合計		3 394 473.75	0.15
他の規制ある市場で取引されている譲渡性のある有価証券および短期金融商品 合計		99 719 198.75	4.38
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されていない譲渡性のある有価証券 および短期金融商品			
中期債券、固定利付債			
AUD			
AUD VICINITY CENTRES TRUST-REG-S 4.92700% 22-02.06.28	1 500 000.00	982 591.33	0.04
豪ドル合計		982 591.33	0.04
中期債券、固定利付債合計		982 591.33	0.04
地方債、固定利付債			
USD			
USD CALIFORNIA HEALTH FACILITIES FINANCING 4.19000% 22-01.06.37	2 900 000.00	2 683 425.10	0.12
米ドル合計		2 683 425.10	0.12
地方債、固定利付債合計		2 683 425.10	0.12
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されて いない譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		3 666 016.43	0.16
最近発行された譲渡性のある有価証券および短期金融商品			
ノート、固定利付債			
USD			
USD AP MOLLER - MAERSK A/S-144A 5.87500% 23-14.09.33	4 100 000.00	4 265 316.06	0.19
USD NEW YORK STATE ELECTRIC & GAS CORP-144A 5.65000% 23-15.08.28	300 000.00	310 056.83	0.01
USD NEW YORK STATE ELECTRIC & GAS CORP-144A 5.85000% 23-15.08.33	2 000 000.00	2 091 578.42	0.09
米ドル合計		6 666 951.31	0.29
ノート、固定利付債合計		6 666 951.31	0.29
最近発行された譲渡性のある有価証券および短期金融商品合計		6 666 951.31	0.29

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量／額面	米ドル建評価額 先物／先渡し為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 比率 （%）
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されていない派生商品			
金利スワップに係るオプション、従来型			
EUR			
EUR BARCLAYS/SWAPTION IRS CALL 2.27000% 24-05.02.24	-300 000.00	-1.37	0.00
EUR BARCLAYS/SWAPTION IRS PUT 2.68000% 24-05.02.24	-300 000.00	-169.36	0.00
EUR BARCLAYS/SWAPTION IRS CALL 2.40000% 24-12.02.24	-500 000.00	-338.02	0.00
EUR BARCLAYS/SWAPTION IRS PUT 2.77000% 24-12.02.24	-500 000.00	-1 023.82	0.00
EUR MORGAN STANLEY/SWAPTION IRS CALL 2.42000% 24-16.02.24	-800 000.00	-651.19	0.00
EUR MORGAN STANLEY/SWAPTION IRS PUT 2.80000% 24-16.02.24	-800 000.00	-869.78	0.00
EUR BARCLAYS/SWAPTION IRS PUT 2.87000% 24-23.02.24	-300 000.00	-256.48	0.00
EUR BARCLAYS/SWAPTION IRS CALL 2.53000% 24-23.02.24	-300 000.00	-2 018.34	0.00
ユーロ合計		-5 328.36	0.00
USD			
USD GS/SWAPTION IRS CALL 3.27500% 24-05.02.24	-300 000.00	-11.97	0.00
USD GS/SWAPTION IRS PUT 3.72500% 24-05.02.24	-300 000.00	-95.49	0.00
USD MORGAN STANLEY/SWAPTION IRS PUT 3.80000% 24-05.02.24	-1 400 000.00	-104.27	0.00
USD MORGAN STANLEY/SWAPTION IRS CALL 3.35000% 24-05.02.24	-1 400 000.00	-289.24	0.00
USD MORGAN STANLEY/SWAPTION IRS CALL 3.40000% 24-12.02.24	-1 400 000.00	-2 734.40	0.00
USD MORGAN STANLEY/SWAPTION IRS PUT 3.85000% 24-12.02.24	-1 400 000.00	-530.07	0.00
USD GOLDMAN SACHS/SWAPTION IRS CALL 3.46000% 24-16.02.24	-700 000.00	-3 019.11	0.00
USD GOLDMAN SACHS/SWAPTION IRS PUT 3.86000% 24-16.02.24	-700 000.00	-436.73	0.00
USD GOLDMAN SACHS/SWAPTION IRS CALL 3.49000% 24-20.02.24	-2 000 000.00	-7 357.82	0.00
USD GOLDMAN SACHS/SWAPTION IRS PUT 3.94000% 24-20.02.24	-2 000 000.00	-966.92	0.00
USD GOLDMAN SACHS/SWAPTION IRS PUT 4.03000% 24-20.02.24	-400 000.00	-93.30	0.00
USD GOLDMAN SACHS/SWAPTION IRS CALL 3.58000% 24-20.02.24	-400 000.00	-3 945.65	0.00
USD GOLDMAN SACHS/SWAPTION IRS CALL 3.52000% 24-23.02.24	-700 000.00	-3 312.90	0.00
USD GS/SWAPTION IRS PUT 3.97000% 24-23.02.24	-700 000.00	-344.76	0.00
USD GOLDMAN SACHS/SWAPTION IRS CALL 3.51000% 24-26.02.24	-400 000.00	-3 241.70	0.00
USD GOLDMAN SACHS/SWAPTION IRS PUT 3.91000% 24-26.02.24	-400 000.00	-430.02	0.00
米ドル合計		-26 914.35	0.00
金利スワップに係るオプション、従来型合計		-32 242.71	0.00
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されて いない派生商品合計			
		-32 242.71	0.00
投資有価証券合計		2 187 971 667.47	95.95

派生商品

公認の証券取引所に上場されている派生商品

債券に係る金融先物

EUR EURO BTP ITALY GOVERNMENT FUTURE 07.03.24	-169.00	-507 159.26	-0.02
EUR EURO-BUND FUTURE 07.03.24	-1 073.00	-1 645 310.28	-0.07
EUR EURO-BOBL FUTURE 07.03.24	-193.00	-119 498.36	0.00
EUR EURO-SCHATZ FUTURE 07.03.24	-408.00	27 998.09	0.00
EUR EURO-BUXL FUTURE 07.03.24	-282.00	-1 770 761.29	-0.08
EUR EURO-OAT FUTURE 07.03.24	47.00	78 112.24	0.00
GBP LONG GILT FUTURE 26.03.24	-118.00	-412 343.11	-0.02
AUD AUSTRALIA 10YR BOND FUTURE 15.03.24	131.00	241 506.76	0.01
USD US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 19.03.24	343.00	1 448 319.33	0.06
USD US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 19.03.24	128.00	8 968.94	0.00
USD US LONG BOND FUTURE 19.03.24	16.00	100 751.92	0.00
USD US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.03.24	330.00	845 202.52	0.04
USD US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 28.03.24	298.00	319 518.30	0.01
JPY JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (OSE) FUTURE 13.03.24	-11.00	-91 807.76	0.00
USD US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 28.03.24	1 462.00	2 469 466.95	0.11
債券に係る金融先物合計		992 964.99	0.04
公認の証券取引所に上場されている派生商品合計		992 964.99	0.04

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄	数量／額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 比率 （%）
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されていない派生商品			
金利に係るスワップおよびフォワード・スワップ			
USD CITIGROUP/INTEREST RATE SWAP TP PAY 1.75000% 22-15.06.32	-11 100 000.00	1 686 940.41	0.07
USD CITIGROUP/INTEREST RATE SWAP TP REC SOFR 0/N 22-15.06.32			
USD CITIGROUP/INTEREST RATE SWAP TP PAY 1.75000% 22-15.06.52	-5 600 000.00	1 859 271.80	0.08
USD CITIGROUP/INTEREST RATE SWAP TP REC SOFR 0/N 22-15.06.52			
EUR LCH/INTEREST RATE SWAP PAY TP 2.75000% 23-20.03.54	-5 900 000.00	-542 437.53	-0.02
EUR LCH/INTEREST RATE SWAP RECEIVE TP 6MEIB 23-30.06.24			
USD LCH/INTEREST RATE SWAP TP PAY 4.03000% 23-15.12.33	-800 000.00	-30 455.36	0.00
USD LCH/INTEREST RATE SWAP TP REC SOFR 0/N 23-15.12.33			
EUR LCH/INTEREST RATE SWAP PAY TP 2.97000% 23-15.12.33	-700 000.00	-25 909.41	0.00
EUR LCH/INTEREST RATE SWAP RECEIVE TP 6MEIB 23-15.12.33			
USD LCH/INTEREST RATE SWAP PAYER TP 3.95000% 23-19.12.33	-700 000.00	-22 073.31	0.00
USD LCH/INTEREST RATE SWAP REC TP SOFR 23-19.12.2033			
EUR LCH/INTEREST RATE SWAP PAY TP 2.89000% 23-22.12.33	-600 000.00	-17 791.97	0.00
EUR LCH/INTEREST RATE SWAP RECEIVE TP 6MEIB 23-22.12.33			
USD LCH/INTEREST RATE SWAP PAYER TP 3.85400% 23-29.12.33	-700 000.00	-16 761.10	0.00
USD LCH/INTEREST RATE SWAP TP REC SOFR 23-29.12.33			
USD LCH/INTEREST RATE SWAP TP PAY 3.81000% 24-02.01.34	-400 000.00	-8 181.08	0.00
USD LCH/INTEREST RATE SWAP TP REC 24-02.01.34			
USD LCH/INTEREST RATE SWAP TP PAY 3.75000% 24-02.01.34	-400 000.00	-6 166.28	0.00
USD LCH/INTEREST RATE SWAP TP REC SOFR 24-02.01.34			
USD LCH/INTEREST RATE SWAP TP PAY 3.68400% 24-03.01.34	-300 000.00	-2 978.06	0.00
USD LCH/INTEREST RATE SWAP TP REC SOFR 24-03.01.34			
EUR LCH/INTEREST RATE SWAP PAY TP 2.65000% 24-08.01.34	-700 000.00	-5 218.69	0.00
EUR LCH/INTEREST RATE SWAP TP REC 24-08.01.34			
USD LCH/INTEREST RATE SWAP TP PAY 3.64750% 24-08.01.34	-700 000.00	-4 974.41	0.00
USD LCH/INTEREST RATE SWAP TP REC SOFR 24-08.01.34			
USD LCH/INTEREST RATE SWAP TP PAY 3.59400% 24-09.01.34	-700 000.00	-1 870.51	0.00
USD LCH/INTEREST RATE SWAP TP REC SOFR 24-09.01.34			
USD LCH/INTEREST RATE SWAP TP REC 3.80000% 23-10.03.28	900 000.00	-6 632.80	0.00
USD LCH/INTEREST RATE SWAP TP PAY SOFR 0/N 23-10.03.28			
USD LCH/INTEREST RATE SWAP TP REC 3.50000% 23-22.06.30	2 500 000.00	-36 284.34	0.00
USD LCH/INTEREST RATE SWAP TP PAY SOFR 0/N 23-22.06.30			
USD LCH/INTEREST RATE SWAP TP REC 3.80000% 23-22.08.30	400 000.00	2 944.96	0.00
USD LCH/INTEREST RATE SWAP TP PAY SOFR 0/N 23-22.08.30			
EUR LCH/INTEREST RATE SWAP REC TP 3.25000% 23-20.03.29	16 700 000.00	701 370.52	0.03
EUR LCH/INTEREST RATE SWAP PAY TP 6MEIB 23-20.03.29			
金利に係るスワップおよびフォワード・スワップ合計		3 522 792.84	0.16
公認の証券取引所に上場されておらず、また他の規制ある市場でも取引されて いない派生商品合計		3 522 792.84	0.16
派生商品合計		4 515 757.83	0.20

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

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

2024年1月31日現在の投資有価証券その他の純資産明細表

銘柄			数量／額面	米ドル建評価額 先物／先渡為替契約／ スワップに係る 未実現（損）益 （注1）	純資産 比率 （％）
先渡為替契約					
購入通貨	購入額	売却通貨	売却額	満期日	
EUR	28 944 487.51	GBP	24 992 508.49	2.2.2024	-385 760.38 -0.01
USD	267 818 468.40	EUR	244 199 471.13	2.2.2024	2 556 792.93 0.11
USD	395 000.00	EUR	361 611.90	2.2.2024	2 199.07 0.00
JPY	34 520 030.00	EUR	219 122.64	2.2.2024	-1 866.47 0.00
USD	194 705 467.49	EUR	178 184 193.44	2.2.2024	1 152 887.40 0.05
EUR	1 383 319.90	AUD	2 260 000.00	2.2.2024	8 658.24 0.00
USD	513 602 476.68	EUR	469 550 000.00	7.2.2024	3 455 193.35 0.15
USD	1 700 000.00	EUR	1 549 206.58	2.2.2024	17 174.35 0.00
EUR	76 468.15	AUD	125 000.00	2.2.2024	432.28 0.00
GBP	111 915 198.03	USD	141 580 000.00	22.2.2024	962 148.88 0.04
EUR	516 228 112.83	USD	562 700 000.00	22.2.2024	-1 451 019.89 -0.06
CHF	691 610 934.90	USD	806 900 000.00	22.2.2024	1 137 194.50 0.05
JPY	2 004 670 122.00	USD	13 740 000.00	22.2.2024	19 568.85 0.00
USD	3 000 000.00	EUR	2 754 965.14	22.2.2024	4 771.08 0.00
EUR	4 017 873.25	USD	4 377 000.00	2.2.2024	-12 585.18 0.00
USD	3 000 000.00	EUR	2 760 163.84	22.2.2024	-881.01 0.00
USD	150 000.00	JPY	22 120 395.00	22.2.2024	-1 829.02 0.00
EUR	5 615 296.74	USD	6 118 000.00	2.2.2024	-18 383.92 0.00
USD	3 000 000.00	EUR	2 752 712.04	2.2.2024	9 866.55 0.00
EUR	2 700 000.00	USD	2 941 803.90	2.2.2024	-8 928.90 0.00
USD	5 448 332.00	EUR	5 000 000.00	7.2.2024	16 032.10 0.00
EUR	36 377.90	AUD	60 000.00	2.2.2024	-147.51 0.00
USD	3 500 000.00	EUR	3 212 299.10	2.2.2024	10 640.10 0.00
USD	6 000 000.00	EUR	5 512 446.18	22.2.2024	6 806.84 0.00
USD	1 200 000.00	EUR	1 108 673.77	2.2.2024	-4 296.88 0.00
EUR	9 265 153.95	USD	10 023 000.00	2.2.2024	41 273.48 0.00
USD	1 401 667.10	CAD	1 883 000.00	29.2.2024	-8 191.62 0.00
USD	1 134 664.71	GBP	894 000.00	29.2.2024	-4 060.07 0.00
USD	4 462 353.54	DKK	30 700 000.00	29.2.2024	-18 331.73 0.00
USD	505 248 430.17	EUR	467 056 000.00	29.2.2024	-2 702 738.65 -0.12
EUR	12 832 831.00	GBP	10 950 537.01	4.3.2024	9 342.02 0.00
GBP	10 939 019.55	EUR	12 832 831.00	2.2.2024	-9 368.23 0.00
EUR	1 496 165.94	AUD	2 454 962.64	4.3.2024	2 815.16 0.00
AUD	2 454 326.17	EUR	1 496 165.94	2.2.2024	-2 777.94 0.00
JPY	20 000 000.00	EUR	125 234.09	2.2.2024	786.77 0.00
USD	8 150 000.00	EUR	7 542 423.12	2.2.2024	-42 957.11 0.00
JPY	34 868 915.00	EUR	219 122.64	4.3.2024	1 368.95 0.00
EUR	219 122.64	JPY	34 992 579.00	2.2.2024	-1 366.29 0.00
USD	1 800 000.00	EUR	1 666 273.86	2.2.2024	-9 989.98 0.00
AUD	120 000.00	EUR	73 156.97	2.2.2024	-140.76 0.00
GBP	620 000.00	EUR	727 209.43	2.2.2024	-392.24 0.00
EUR	74 962.66	GBP	64 000.00	2.2.2024	-72.61 0.00
EUR	15 384 447.08	GBP	13 160 594.49	4.3.2024	-30 451.63 0.00
GBP	13 146 763.87	EUR	15 384 447.08	2.2.2024	30 390.81 0.00
EUR	125 234.09	JPY	20 004 868.00	2.2.2024	-820.07 0.00
JPY	19 934 326.00	EUR	125 234.09	4.3.2024	822.66 0.00
EUR	36 478.49	AUD	60 000.00	2.2.2024	-38.24 0.00
EUR	74 962.66	GBP	64 129.51	4.3.2024	-152.01 0.00
AUD	60 381.94	EUR	36 678.47	4.3.2024	62.25 0.00
USD	265 892 071.82	EUR	244 710 539.31	4.3.2024	-269 548.80 -0.01
USD	189 810 703.36	EUR	174 268 001.69	4.3.2024	266 542.80 0.01
EUR	58 470.05	GBP	50 000.00	4.3.2024	-92.70 0.00
先渡為替契約合計					4 726 581.58 0.21
現金預金、要求払預金および預託金勘定ならびにその他の流動資産					69 991 994.62* 3.07
当座借越およびその他の短期負債					-2 730 665.60 -0.12
その他の資産および負債					15 906 966.44 0.69
純資産総額					2 280 382 302.34 100.00

* 2024年1月31日現在、412,775.00米ドルの現金が取引相手方であるゴールドマン・サックスに対する担保および10,862.50米ドルの現金が取引相手方であるモルガン・スタンレーに対する担保となっている。

添付の注記は当財務書類と不可分のものである。

[次へ](#)

5 販売及び買戻しの実績

2024年2月末日までの1年間における販売および買戻しの実績ならびに2024年2月末日現在の発行済口数は以下のとおりである。

（グリーン・ソーシャル・アンド・サステナブル・ボンド）
（クラスF－a c c投資証券）

販売口数	買戻し口数	発行済口数
651,803.2410 (24,660)	1,830,030.1210 (20,370)	7,558,147.8060 (193,235)

（クラスF－a c c円ヘッジ投資証券）

販売口数	買戻し口数	発行済口数
300 (300)	31,790 (39,010)	209,565 (209,565)

（注1）（ ）内の数字は本邦内における販売、買戻しおよび発行済口数であり、受渡日を基準として算出している。一方、（ ）の上段の数字は約定日を基準として算出している。
（注2）サブ・ファンドは2022年3月10日に設立され、サブ・ファンドのクラスF－a c c投資証券は2022年3月10日に運用を開始し、クラスF－a c c円ヘッジ投資証券は2022年5月13日に運用を開始した。