

## 【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 2019年9月11日

【発行者名】 ブラックロック・ジャパン株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役会長 井澤 吉幸

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目8番3号

【事務連絡者氏名】 猪浦 純子

【電話番号】 03-6703-7940

【届出の対象とした募集(売出)内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】 ブラックロック・アメリカ大陸ロング・ショート・ファンド  
(ダイワ投資一任専用)

【届出の対象とした募集(売出)内国投資信託受益証券の金額】 600億円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

(注) 本書において文中および表中の数字は四捨五入された数値として表示されている場合があり、従って合計として表示された数字はかかる数値の総和と必ずしも一致するとは限りません。

## 第一部【証券情報】

### (1)【ファンドの名称】

ブラックロック・アメリカ大陸ロング・ショート・ファンド（ダイワ投資一任専用）

（以下「当ファンド」または「ファンド」といいます。）

### (2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

当初元本は、1口当り1円です。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社であるブラックロック・ジャパン株式会社は、やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

当ファンドについて、委託会社の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

### (3)【発行（売出）価額の総額】

600億円を上限とします。

当ファンドの運用戦略に適した運用規模・運用効率を勘案し、市場環境や資金流入の動向に応じて信託金の限度額を下回る段階で購入申込の受付を停止する場合があります。

### (4)【発行（売出）価格】

購入受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額につきましては、販売会社または下記にお問い合わせください。

ブラックロック・ジャパン株式会社

電話番号： 03-6703-4300（受付時間 営業日の9：00～17：00）

ホームページアドレス： [www.blackrock.com/jp/](http://www.blackrock.com/jp/)

### (5)【申込手数料】

購入時の申込手数料（以下「購入時手数料」といいます。）は、販売会社が独自に定めることができます。

（販売会社につきましては、「(8)申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。）

なお、購入時手数料には消費税に相当する金額および地方消費税に相当する金額（以下「消費税等相当額」といいます。）が含まれています（以下同じ。）。

購入時手数料を徴収している販売会社はありません。

分配金の受取方法により、「分配金支払いコース」、「分配金再投資コース」の2つのコースがあります。「分配金再投資コース」を選択した投資者が、分配金を再投資する場合は、無手数料とします。

### (6)【申込単位】

分配金の受取方法により、収益の分配時に分配金を受け取る「分配金支払いコース」と、分配金が税引き後、無手数料で再投資される「分配金再投資コース」の2つの購入方法があります。

取扱いを行なうコースおよび購入の申込単位（以下「購入単位」といいます。）は、各販売会社により異なりますので、詳細は販売会社にお問い合わせください。

## (7)【申込期間】

2019年9月12日から2020年3月10日まで

申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

## (8)【申込取扱場所】

ファンドの申込取扱場所（以下「販売会社」といいます。）については下記にお問い合わせください。

ブラックロック・ジャパン株式会社

電話番号： 03-6703-4300（受付時間 営業日の9：00～17：00）

ホームページアドレス： [www.blackrock.com/jp/](http://www.blackrock.com/jp/)

## (9)【払込期日】

ファンドの投資者は、販売会社が定める日までに購入代金（購入受付日の翌営業日の基準価額に購入口数を乗じた金額に、購入時手数料を加算した金額をいいます。）を販売会社に支払うものとします。

振替受益権に係る各購入受付日の発行価額の総額は、販売会社によって追加信託が行なわれる日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

購入時手数料を徴収している販売会社はありません。

## (10)【払込取扱場所】

上記「(8)申込取扱場所」でお払い込みください。

## (11)【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構です。

## (12)【その他】

購入代金の利息

購入代金には利息をつけません。

日本以外の地域における発行

行ないません。

購入不可日

販売会社の営業日であっても、ルクセンブルクの銀行の休業日、12月24日、その他実質的な主要投資対象ファンドの受付不可日のいずれかに該当する場合は、購入は受けません。

振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。

ファンドの分配金、償還金、換金代金は、社振法および上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

## (参考)

投資信託振替制度とは、

- ・ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。
- ・ファンドの設定、換金、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行なわれますので、受益証券は発行されません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

「ブラックロック・アメリカ大陸ロング・ショート・ファンド（ダイワ投資一任専用）」（以下「当ファンド」または「ファンド」といいます。）は、市場動向に左右されない投資収益の達成を目標に運用を行ないます。

当ファンドは、追加型証券投資信託であり、追加型投信/海外/株式/特殊型（ロング・ショート型）に属しています。下記は、一般社団法人投資信託協会の「商品分類に関する指針」に基づき当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。

##### <商品分類表>

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）	補足分類
単位型投信 追加型投信	国内 海外 内外	株式 債券 不動産投信 その他資産（ ） 資産複合	インデックス型 特殊型 (ロング・ショート型)

##### <属性区分表>

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	特殊型
株式	年1回	グローバル	ファミリー	あり	ブル・ベア型
一般	年2回	日本	ファンド	(フルヘッジ)	
大型株	年4回	北米			条件付運用型
中小型株	年6回	欧州	ファンド・	なし	
債券	(隔月)	アジア	オブ・		ロング・ショ-
一般	年12回	オセアニア	ファンズ		ト型/絶対収益
公債	(毎月)	中南米			追求型
社債	日々	アフリカ			
その他債券	その他	中近東			その他
クレジット属性		(中東)			
不動産投信		エマージング			
その他資産					
(投資信託証券)					
資産複合					
資産配分固定型					
資産配分変更型					

## &lt;各分類および区分の定義&gt;

## ．商品分類

単位型投信・追加型投信の区分	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
投資対象地域による区分	海外	目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
投資対象資産による区分	株式	目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
補足分類	特殊型 (ロング・ショート型)	目論見書又は投資信託約款において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法(ロング・ショート戦略)の記載があるものをいう。

## ．属性区分

投資対象資産による属性区分	その他資産（投資信託証券）	目論見書又は投資信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいう。
決算頻度による属性区分	年1回	目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
投資対象地域による属性区分	北米 中南米	目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域および中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
投資形態による属性区分	ファミリーファンド	目論見書又は投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいう。
為替ヘッジによる属性区分	為替ヘッジあり (フルヘッジ)	目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行なう旨の記載があるものをいう。なお、「為替ヘッジ」とは、対円での為替リスクに対するヘッジの有無をいう。
特殊型による属性区分	ロング・ショート型	目論見書又は投資信託約款において、ロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用され、かつマザーファンドはファンド・オブ・ファンズ形式で運用されます。このため、組入れている資産を示す属性区分上の投資対象資産（その他資産（投資信託証券））と収益の源泉となる資産を示す商品分類上の投資対象資産（株式）とが異なります。

上記は、一般社団法人投資信託協会の定義を基に委託会社が作成したものを含まれます。なお、上記以外の商品分類・属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）をご参照ください。

信託金の限度額は、600億円です。ただし、委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

当ファンドの運用戦略に適した運用規模・運用効率を勘案し、市場環境や資金流入の動向に応じて信託金の限度額を下回る段階で購入申込の受付を停止する場合があります。

ファンドの特色 (当ファンドおよびマザーファンドの特色)

- a. 当ファンドは、投資者と販売会社が締結する投資一任契約に基づいて、資産を管理する口座の資金を運用するためのファンドです。

当ファンドは、ダイワファンドラップ アクティブ・シリーズを構成するファンドの1つです。

当ファンドの購入の申込みを行なう投資者は、販売会社と投資一任契約の資産を管理する口座に関する契約および投資一任契約を締結する必要があります。

- b. アメリカ大陸株式(米国、カナダおよびラテンアメリカ諸国の株式)等を投資対象として、ロングショート(買い建て・売り建て)ポジションを構築することにより、市場動向に左右されない投資収益の達成を目標に運用を行ないます。

アメリカズ・ロングショート・マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として米国、カナダおよびラテンアメリカ諸国の株式および株式関連の派生商品等に投資し、ロングショート(買い建て・売り建て)ポジションを構築する投資信託証券を実質的な主要投資対象とします。副次的な投資対象として、米国の短中期国債等に投資する投資信託証券にも投資を行ないます。通常、実質的な主要投資対象ファンドへの投資割合を高位に保ちます。

各投資信託証券への投資割合は、原則として市況動向および各投資信託証券の収益性等を勘案して委託会社が決定します。

実質的な主要投資対象ファンドは、米国、カナダおよびラテンアメリカ諸国の中小型株を含む約4,000の幅広い株式を投資候補銘柄とします。また、投資にあたってはデリバティブ取引(スワップなど)を活用します。

上記の投資候補銘柄数は、今後変更になる可能性があります。

買い建て額と売り建て額の合計であるグロスポジションは、実質的な主要投資対象ファンドの純資産総額の200~600%の範囲内とします。

実質的な主要投資対象ファンドの投資手法およびグロスポジションの割合は将来変更になる場合があります。

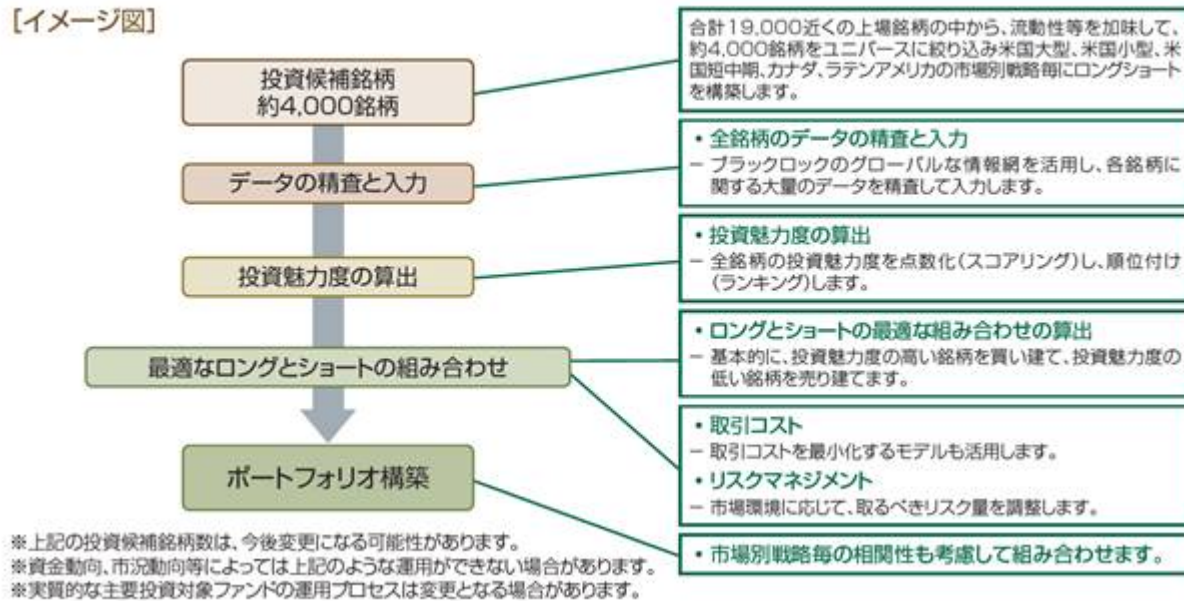
実質的な主要投資対象ファンドのロングショート戦略は、ブラックロック独自の計量モデルを活用することで運用を行ないます。

計量モデルとは、市場や株価の動きを計量的な数式で捉えようとするものです。大量の投資情報を活用し、リターン獲得を図るためのツールです。

## &lt;実質的な主要投資対象ファンドの運用プロセス&gt;

独自の計量モデルを活用し、ロングショート戦略によりポートフォリオを構築します。

## [イメージ図]



b. ファンドは、アメリカズ・ロングショート・マザーファンドをマザーファンドとするファミリーファンド方式で運用します。

ファンドは、マザーファンドを通じて、投資信託証券を投資対象とするファンド・オブ・ファンズです。

マザーファンドは「BSF ブラックロック・アメリカズ・ダイバーシファイド・エクイティ・アブソルート・リターン・ファンド<sup>\*1</sup>」と「ICS ブラックロック・ICS・USTレジャーリー・ファンド<sup>\*2</sup>」に投資します。

\*1 正式名称は、「ブラックロック・ストラテジック・ファンズ(ルクセンブルグ籍投資法人) ブラックロック・アメリカズ・ダイバーシファイド・エクイティ・アブソルート・リターン・ファンド クラスX投資証券」です。

\*2 正式名称は、「インスティテューショナル・キャッシュ・シリーズplc(アイルランド籍投資法人) ブラックロック・ICS・USTレジャーリー・ファンド エージェンシークラス投資証券」です。

## &lt;ファンドの仕組み&gt;



投資対象ファンドは、委託会社の判断により適宜見直しを行なうことがあります。

c. 実質外貨建資産については、為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図ることを基本とします。

当ファンドは、マザーファンドが投資する米ドル建て投資信託証券等(実質外貨建資産)に対して対円の為替ヘッジを行いません。

また、実質的な主要投資対象ファンドは現地通貨建てで投資を行なう場合があり、通常は現地通貨にかかる為替変動リスクは、ロングショート戦略において相殺されますが、ロングポジションとショートポジションの割合が一致しない等の場合には米ドルに対する現地通貨の為替レートの変動が、間接的に当ファンドの運用成果に影響を与えます。



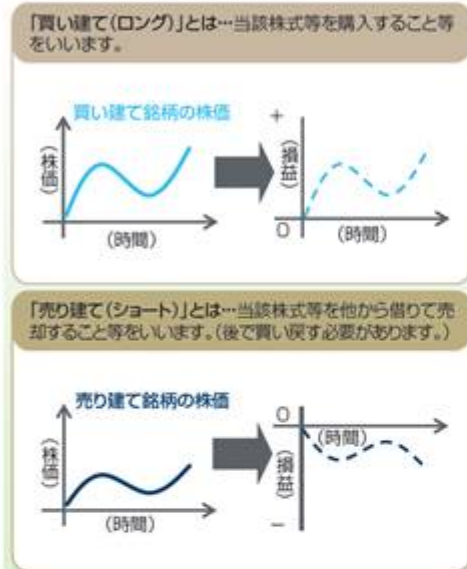
(追加的記載事項)

## ロングショート戦略とは

- ロングショート戦略とは、相対的に投資魅力度の高い資産を買い建て(ロング)、相対的に投資魅力度が低い資産を売り建て(ショート)する投資手法をいいます。  
「買い建て」銘柄の方が「売り建て」銘柄よりも良いパフォーマンスの場合にロングショート戦略全体としての損益はプラスになります(逆の場合には、損益はマイナスになります)。

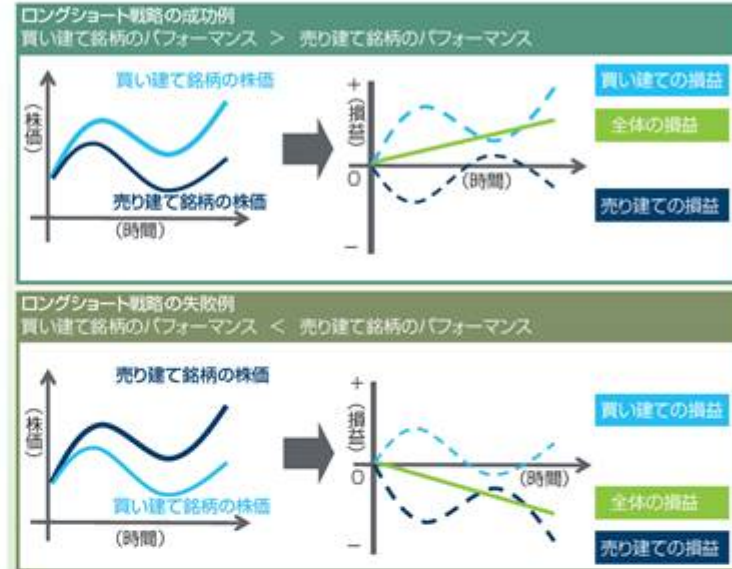
### 「買い建て」と「売り建て」について

[イメージ図]



### ロングショート戦略による損益①

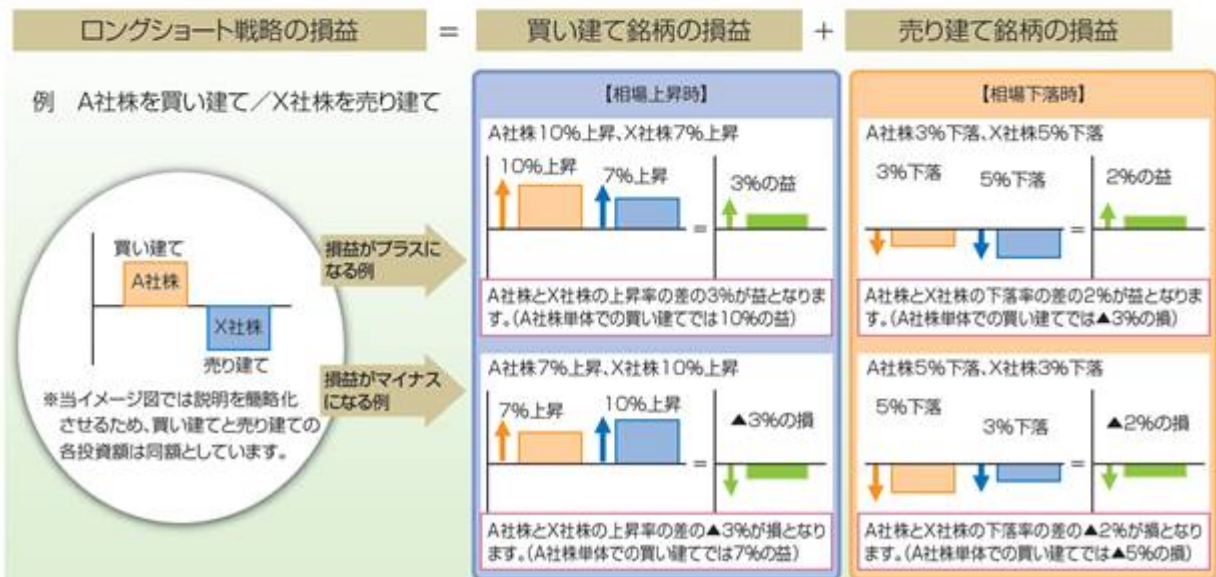
[イメージ図]



### ロングショート戦略による損益②

- 買い建てと売り建てを同時に実施することで、株式市場全体の上昇・下落による影響を軽減させ投資銘柄固有の価格変動から得られる収益を効率的に獲得することを目指します。

[イメージ図]



※上記のイメージ図は、ロングショート戦略をご理解頂くことを目的に作成したものであり、当ファンドの運用成果等を保証するものではありません。

※実質的な主要投資対象ファンドにおける買い建てと売り建てに際しては、デリバティブ取引を活用します。

※ロングとショート双方で損失した場合は、通常想定される以上に当ファンドの運用成果が影響を被る可能性があります。

## 実質的な主要投資対象ファンドの概要

ファンド名	ブラックロック・ストラテジック・ファンズ ブラックロック・アメリカズ・ダイバーシファイド・エクイティ・アブソルート・リターン・ファンド
形態	ルクセンブルグ籍(オープン・エンド型)会社型外国投資証券(米ドル建て)
投資目的および投資態度	ファンドは株式等に投資するロングショート(買い建ておよび売り建て)ポジションを構築することにより、市場動向に係わらずプラスのアブソルート・リターンの追求を目指します。ファンドの純資産の少なくとも70%を米国、カナダおよびラテンアメリカ諸国の株式もしくは株式関連の派生商品等へ投資を行いません。ファンドは、投資対象とする株式市場へのネットエクスポージャーを最小限にすることを旨として、広く分散投資を行いません。
設定日	2012年2月17日
管理会社	ブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エー
投資顧問会社	ブラックロック・インスティテューショナル・トラスト・カンパニー、エヌ・エイ、

## (2)【ファンドの沿革】

2016年9月26日

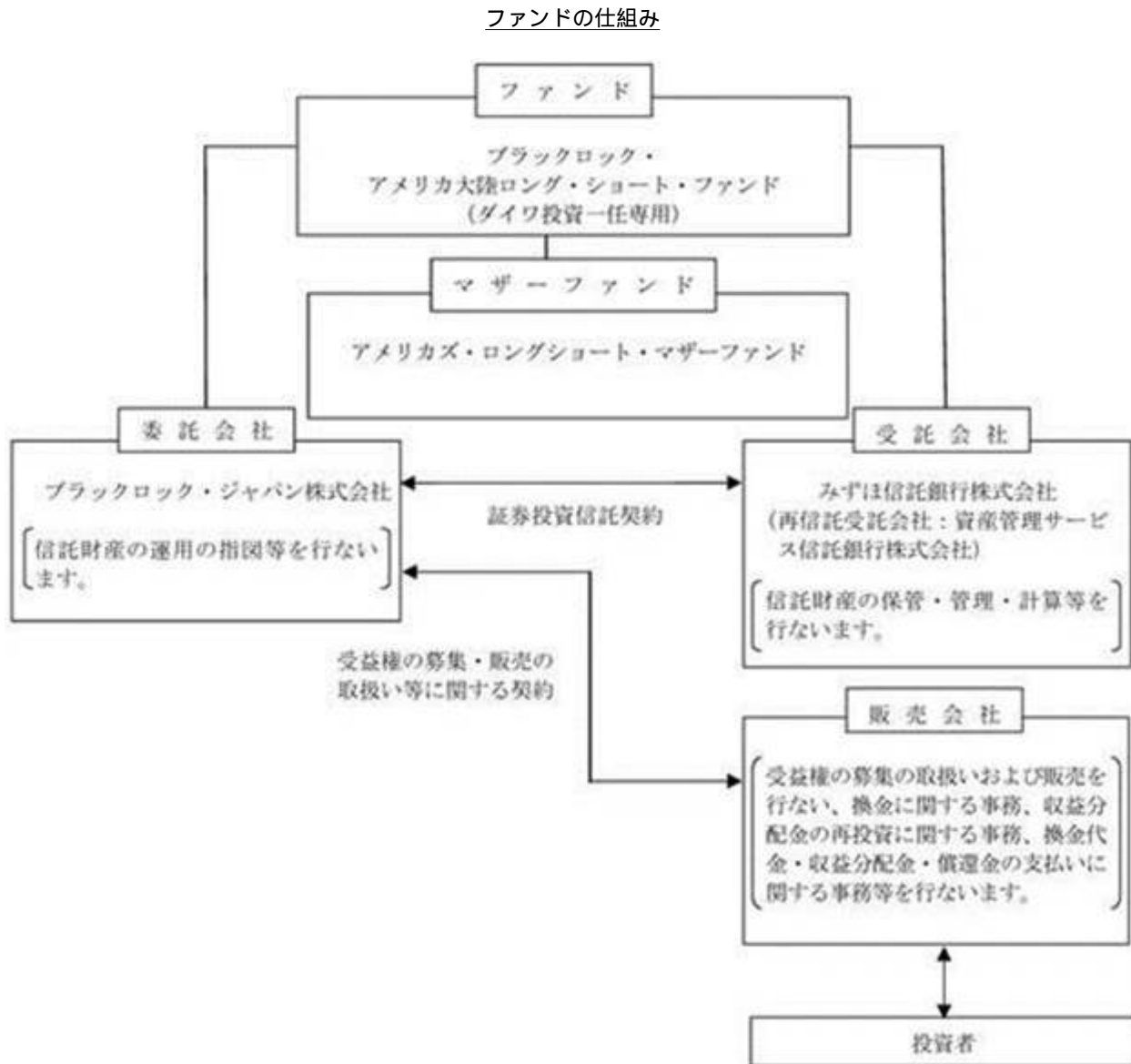
信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

2017年3月18日

マザーファンド名称を変更

「ブラックロック・アメリカズ・ロングショート・マザーファンド」から「アメリカズ・ロングショート・マザーファンド」に変更

## (3)【ファンドの仕組み】



## &lt; 契約等の概要 &gt;

## a. 「証券投資信託契約」

ファンドの設定・運営に関する事項、信託財産の運用・管理に関する事項、委託会社および受託会社の業務に関する事項、投資者に関する事項等について規定しています。

## b. 「受益権の募集・販売の取扱い等に関する契約」

委託会社が販売会社に委託する受益権の募集販売の取扱い、換金事務、投資者に対する収益分配金および換金代金の支払い、その他これらの業務に付随する業務等について規定しています。

## &lt; 委託会社の概況 &gt;

2019年6月末現在の委託会社の概況は、以下のとおりです。

a. 資本金 3,120百万円

## b. 沿革

1985年1月	メリルリンチ投資顧問株式会社 (後のメリルリンチ・インベストメント・マネジャーズ株式会社) 設立 1987年3月 証券投資顧問業者として登録 1987年6月 投資一任業務認可を取得 1997年12月 投資信託委託業務免許を取得
1988年3月	パークレイズ・デズート・ウェッド投資顧問株式会社 (後のパークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社) 設立 1988年6月 証券投資顧問業者として登録 1989年1月 投資一任業務認可を取得 1998年3月 投資信託委託業務免許を取得
1999年4月	野村ブラックロック・アセット・マネジメント株式会社 (後のブラックロック・ジャパン株式会社) 設立 1999年6月 証券投資顧問業者として登録 1999年8月 投資一任業務認可を取得
2006年10月	メリルリンチ・インベストメント・マネジャーズ株式会社を存続会社として、 ブラックロック・ジャパン株式会社と合併 新会社商号:「ブラックロック・ジャパン株式会社」
2009年12月	パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社を存続会社として、 ブラックロック・ジャパン株式会社と合併 新会社商号:「ブラックロック・ジャパン株式会社」

## c. 大株主の状況

株主名	住所	所有 株式数	所有比率
ブラックロック・ジャパン・ ホールディングス合同会社	東京都千代田区丸の内一丁目8番3号	15,000株	100%

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

アメリカズ・ロングショート・マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として米国、カナダおよびラテンアメリカ諸国の株式および株式関連の派生商品等に投資し、ロングショート（売建および買建）ポジションを構築することにより市場動向に左右されない投資収益を追求する投資信託証券に投資を行いません。副次的な投資対象として、短期債券等に投資する投資信託証券にも投資を行いません。投資対象とする投資信託証券は、別に定めるブラックロック・グループの運用会社が運用するものとします。

実質外貨建資産については、為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図ることを基本とします。

資金動向、市況動向、残存信託期間等によっては、上記のような運用ができない場合もあります。

委託会社は、自己又は第三者の利益を図るために投資者の利益を害することとなる潜在的なおそれのある取引を行ない又は行なうことがある場合、投資者の利益を害しないことを確保するため、売買執行管理規程等の社内規程により管理します。

**<参考> マザーファンドの運用の基本方針**

## アメリカズ・ロングショート・マザーファンド

## - 運用の基本方針 -

## 1. 基本方針

この投資信託は、市場動向に左右されない投資収益の達成を目標に運用を行ないます。

## 2. 運用方法

## (1) 投資対象

主として米国、カナダおよびラテンアメリカ諸国の株式および株式関連の派生商品等に投資し、ロング・ショート（売建および買建）ポジションを構築することにより市場動向に左右されない投資収益を追求する投資信託証券に投資を行ないます。副次的な投資対象として、短期債券等に投資する投資信託証券にも投資を行ないます。投資信託証券には、国内投資信託または外国投資信託の受益証券、投資証券、または外国投資証券が含まれます。

## (2) 投資態度

主として米国、カナダおよびラテンアメリカ諸国の株式および株式関連の派生商品等に投資し、ロング・ショート（売建および買建）ポジションを構築することにより市場動向に左右されない投資収益を追求する投資信託証券（以下、「主要投資対象ファンド」といいます。）に投資を行ないます。副次的な投資対象として、短期債券等に投資する投資信託証券にも投資を行ないます。投資対象とする投資信託証券は、別に定めるブラックロック・グループの運用会社が運用するものとします。

各投資信託証券への投資割合は、原則として市況動向および各投資信託証券の収益性等を勘案して委託会社が決定します。通常、主要投資対象ファンドへの投資割合を高位に保ちます。

別に定める投資信託証券は、委託会社の判断により、変更することがあります。

外貨建資産については、為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図ることを基本とします。

資金動向、市場動向、残存信託期間等によっては、上記のような運用ができない場合もあります。

## (3) 投資制限

投資信託証券および短期金融商品（短期運用の有価証券を含みます。）以外への直接投資は行ないません。

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に係る株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行ないます。

## (2) 【投資対象】

## 投資対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律（以下「投信法」といいます。）第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）とします。

- a. 有価証券
- b. 金銭債権
- c. 約束手形（手形割引市場において売買される手形に限ります。）

#### 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主としてアメリカズ・ロングショート・マザーファンド受益証券のほか、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- a．国債証券
- b．地方債証券
- c．特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債券を除きます。）
- d．短期社債等(社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、保険業法第61条の10第1項に規定する短期社債、資産の流動化に関する法律第2条第8項に関する特定短期社債、商工組合中央金庫法第33条の2に規定する短期商工債、信用金庫法第54条の4第1項に規定する短期債および農林中央金庫法第62条の2第1項に規定する短期農林債をいいます。)
- e．コマーシャル・ペーパー
- f．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
- g．外国法人が発行する譲渡性預金証書

なお、a．からc．の証券を以下「公社債」といい、公社債にかかる運用の指図は買い現先取引(売戻し条件付の買い入れ)および債券貸借取引(現金担保付き債券借入れ)に限り行なうことができるものとします。

#### 投資対象とする金融商品

このファンドの設定、換金、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用を指図することができます。

- a．預金
- b．指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- c．コール・ローン
- d．手形割引市場において売買される手形

## マザーファンドの投資対象ファンドの概要

## (a) B S F ブラックロック・アメリカズ・ダイバーシファイド・エクイティ・アブソルート・リターン・ファンド

形態	ルクセンブルグ籍（オープン・エンド型）会社型外国投資証券（米ドル建て）
投資目的および投資態度	ファンドは株式等に投資するロングショート（買い建ておよび売り建て）ポジションを構築することにより、市場動向に係わらずプラスのアブソルート・リターンの追求を目指します。ファンドの純資産の少なくとも70%を米国、カナダおよびラテンアメリカ諸国の株式もしくは株式関連の派生商品等へ投資を行いません。ファンドは、投資対象とする株式市場へのネットエクスポージャーを最小限にすることを旨として、広く分散投資を行いません。
設定日	2012年2月17日
存続期間	無期限
主な投資対象	米国、カナダおよびラテンアメリカ諸国の株式もしくは株式関連の派生商品等に投資します。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・同一発行体の譲渡性のある証券への投資は、原則としてファンドの純資産総額の10%以下とします。</li> <li>・純資産総額の5%を超えて投資しているすべての発行体について、ファンドが保有する譲渡性のある証券の総額は原則として純資産総額の40%を超えないものとします。</li> </ul>
管理報酬	ありません。(注)
その他費用	管理業務会社、保管会社および名義書換事務代行会社への報酬等および事務諸費に要する費用についてはファンドから差し引かれます。
決算日	年1回（原則として5月末日）に決算を行いません。
収益分配方針	原則として、分配を行いません。
申込手数料	ありません。
管理会社	ブラックロック（ルクセンブルグ）エス・エー
投資顧問会社	ブラックロック・インスティテューショナル・トラスト・カンパニー、エヌ・エイ。
保管会社	ステート・ストリート・バンク・ルクセンブルグ・エス・シー・エー

(注) 投資対象ファンドにかかる報酬相当額は、委託会社の信託報酬より支払われます。



## (b) ICS ブラックロック・ICS・USTレジャーリー・ファンド

形態	アイルランド籍(オープン・エンド型)会社型外国投資証券(米ドル建て)
投資目的および投資態度	ファンドは、流動性と元本の安定性を確保しつつ、安定的なインカム水準を追求します。ファンドは、米国短中期国債、米国政府によって発行されるその他債務権および現先取引に投資をします。現先取引の活用により流動性を確保します。
設定日	2008年9月29日
存続期間	無期限
主な投資対象	主としてファンドは、米国短中期国債、米国政府によって発行されるその他債務権および現先取引を主要投資対象とします。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 同一発行体の譲渡性のある証券もしくは短期金融商品への投資は原則としてファンドの純資産総額の10%以下とします。</li> <li>・ 純資産総額の10%を超えて資金の借り入れは行ないません。</li> </ul>
管理報酬 その他費用	管理報酬、保管報酬および事務の処理に要する諸費用がファンドから差し引かれます。
決算日	年1回(原則として9月30日)に決算を行ないます。
収益分配方針	原則として、分配を行ないません。
申込手数料	ありません。
管理会社	ブラックロック・アセット・マネジメント・アイルランド・リミテッド
投資顧問会社	ブラックロック・キャピタル・マネジメント・インク
保管会社	J Pモルガン・バンク(アイルランド)ピー・エル・シー

## (3) 【運用体制】

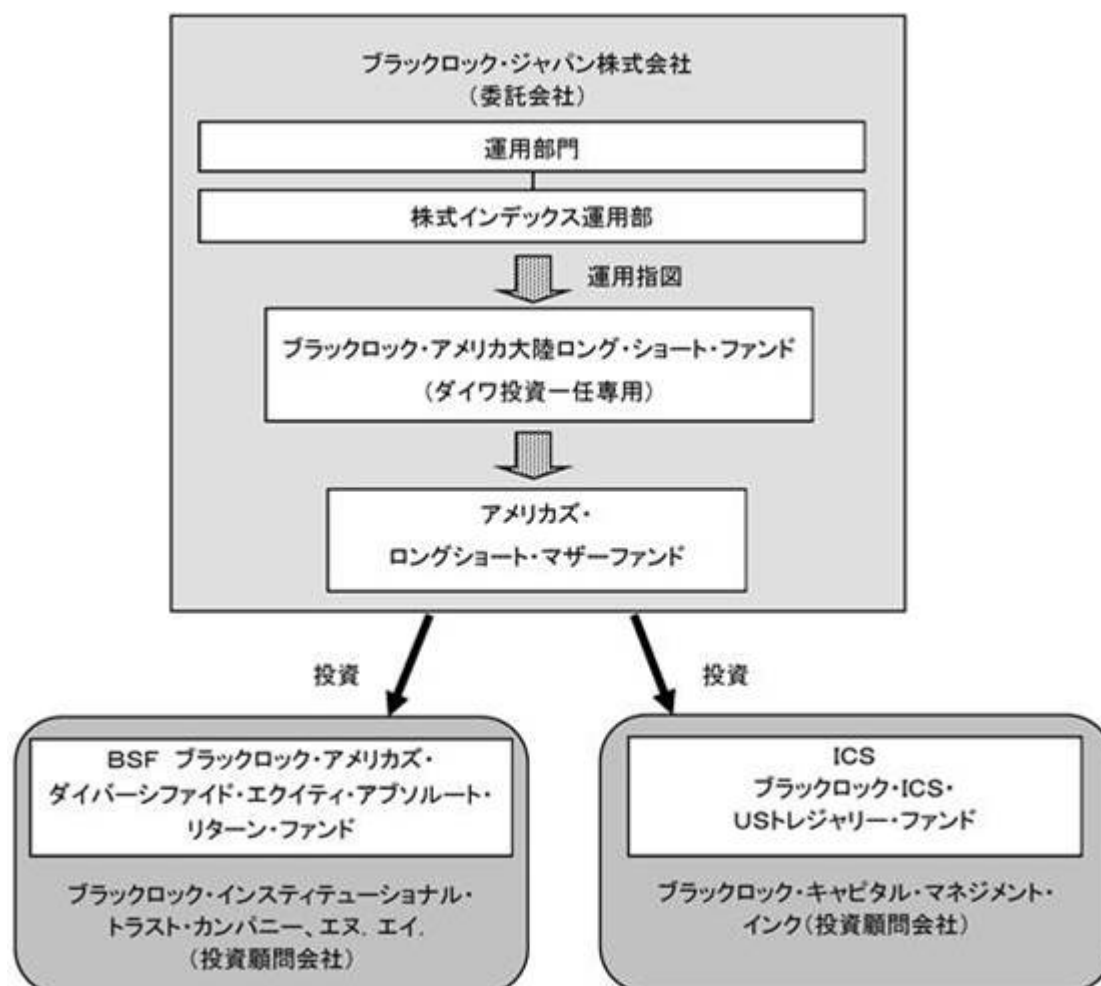
ファンドの運用・管理の各業務の役割分担を社内規程により定めております。

ファンドの運用については委託会社の運用部門が統括しています。

社内には内部監査を担当する部門、ファンドの運用状況やリスク状況等をモニターし、関連部署にフィードバックする部門、或いは投資委員会等開催により、各ファンドの投資方針等にしがって運用が行なわれているか確認する組織、機能が確立しています。

当ファンドの運用は、株式インデックス運用部（当ファンド担当：8名程度）が担当いたします。

## 運用体制図



運用体制等は、変更となる場合があります。

## ブラックロック・グループ

ブラックロック・グループは、運用資産残高約6.84兆ドル<sup>\*</sup>（約737兆円）を持つ世界最大級の独立系資産運用グループであり、当社はその日本法人です。

当グループは、世界各国の機関投資家および個人投資家のため、株式、債券、キャッシュ・マネジメントおよびオルタナティブ商品といった様々な資産クラスの運用を行なっております。また、機関投資家向けに、リスク管理、投資システム・アウトソーシングおよびファイナンシャル・アドバイザー・サービスの提供を行なっております。

\* 2019年6月末現在。(円換算レートは1ドル=107.74円を使用)

#### (4)【分配方針】

##### 収益分配方針

年1回の毎決算時(原則として6月15日。休業日の場合は翌営業日。)に、原則として以下の方針に基づき、分配を行いません。

##### a. 分配対象額の範囲

分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益および売買損益(繰越欠損補填後、評価損益を含みます。)等の全額とします。

##### b. 分配対象収益についての分配方針

分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。基準価額水準、市況動向等によっては分配を行わないことがあります。将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

##### c. 留保益の運用方針

留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行いません。

##### 収益の分配

a. 信託財産から生じる毎計算期末における利益は、次の方法により処理するものとします。

(a) 利子、配当金およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額(以下「配当等収益」といいます。)は、諸経費、諸費用(消費税に相当する金額および地方消費税に相当する金額(以下「消費税相当額」といいます。))を含みます。以下同じ。)、信託報酬(消費税等相当額を含みます。以下同じ。)を控除した後、その残額を投資者に分配することができます。なお、次期以降の分配に充てるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

(b) 売買損益に評価損益を加減した利益金額(以下「売買益」といいます。)は、諸経費、諸費用および信託報酬を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、投資者に分配することができます。なお、次期以降の分配に充てるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

b. 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越すものとします。

##### 収益分配金の支払い

##### a. 支払時期と支払場所

##### (a) 分配金支払いコースの場合

毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として5営業日以内)に、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている投資者にお支払いを開始します。収益分配金は販売会社の営業所等において支払います。

##### (b) 分配金再投資コースの場合

累積投資契約に基づき、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金が販売会社に支払われます。この場合、販売会社は投資者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売り付けを行いません。当該売り付けにより増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

##### b. 時効

投資者が、a.(a)に規定する支払開始日から5年間支払い請求を行わない場合はその権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は委託会社に帰属します。

## (5)【投資制限】

以下は当ファンドの約款で定める投資制限です。

投資信託証券および短期金融商品（短期運用の有価証券を含みます。）以外への直接投資は行ないません。

## 投資信託証券への投資制限

投資信託証券への実質投資割合には制限を設けません。

## 外貨建資産への投資制限

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

## 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により、特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

## 公社債の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行なうにあたり担保の提供が必要と認められた時は、担保の提供の指図を行なうものとします。
- b. a. の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- c. 信託財産の換金等の事由により、b. の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- d. a. の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

## 外国為替予約の指図および範囲

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

## 信用リスク集中回避のための投資制限

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に係る株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行いません。

## 資金の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、換金に伴う支払資金の手当て（換金に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。
- b. 換金に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、投資者への換金代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または投資者への換金代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の換金代金入金日までの間もしくは投資者への換金代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却または換金代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。  
ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

- c . 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、  
資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- d . 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

### 3【投資リスク】

#### (1) 投資リスク

ファンドの基準価額は、組入れられている有価証券の値動きの他、為替変動による影響を受けます。これらの信託財産の運用により生じた損益はすべて投資者の皆様へ帰属します。したがって、当ファンドは元金および元金からの収益の確保が保証されているものではなく、基準価額の下落により投資者は損失を被り、元金を割り込むことがあります。また、投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドにかかる主なリスクは以下の通りです。

##### 基準価額の変動要因

##### a．ロングショート戦略によるリスク

当ファンドの実質的な主要投資対象ファンドは、計量モデルを活用したロングショート戦略による運用を行なうことで投資収益を追求しますが、当戦略がその目的を達成できる保証はありません。ロング（買い建て）した銘柄の価格が下落した場合、もしくはショート（売り建て）した銘柄の価格が上昇した場合は損失が発生し、それに伴い当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。またロングとショートの双方で損失した場合は、通常想定される以上に当ファンドの運用成果に影響を被る可能性があります。

##### b．株式の価格変動リスク

当ファンドの実質的な主要投資対象ファンドは、米国、カナダおよびラテンアメリカ諸国の発行体が発行する株式および株式関連の派生商品に投資を行ないます。したがって、米国、カナダおよびラテンアメリカ諸国の経済・市場動向または投資対象企業の経営・財務状況に応じて、株式あるいは株式関連の派生商品の価格等が変動し、当ファンドの運用成果に影響を与えます。

##### (中小型株式投資のリスク)

当ファンドの実質的な主要投資対象ファンドは、株式市場平均に比べ時価総額の小さな企業の株式および株式関連の派生商品にも投資を行ないます。これらの企業への投資は、株式市場全体の平均に比べて結果としてより大きな値上がりもしくは値下がりとなる可能性があります。これは比較的小規模の企業は大規模の企業に比べ収益の変動が大きくなる傾向があることに加え、株式市場における需給関係の変動の影響を受けやすいためです。

##### (カンントリー・リスク)

当ファンドの実質的な主要投資対象ファンドはラテンアメリカ諸国の株式市場にも投資をします。ラテンアメリカ諸国のようなエマージング諸国の経済は、先進諸国に比べて不安定であり、その株式市場を取り巻く社会的・経済的環境はより不透明な場合が多く、エマージング諸国の政府は自国経済を規制または監督する上で大きな影響力を行使することがあります。したがって、主として先進国市場に投資する場合に比べて、投資先の国の政治・経済事情、通貨・資本規制等の要因により、より大幅に株価が変動することが考えられ、それに伴い当ファンドの運用成果に影響を与えます。

##### c．デリバティブ取引のリスク

当ファンドの実質的な主要投資対象ファンドは、株式関連の派生商品（先物・スワップなど）に投資を行ないます。先物・スワップなどのデリバティブ取引は、現物資産への投資に代わって投資目的を効率的に達成するために用いられ、あるいは価格変動による影響を回避するために用いられませんが、その目的が達成される保証はなく、損失が発生する可能性があります。デリバティブ取引はコストとリスクが伴い、当ファンドの運用成果に影響を与えます。

#### （レバレッジ・リスク）

デリバティブ取引では、一般的に想定元本に対して比較的小額の証拠金・担保金等を取引相手に差入れることで、より大きな金額の取引を行ないます。当ファンドの実質的な主要投資対象ファンドでは、ファンドの純資産規模を上回る金額のデリバティブ取引を行ないます。その結果として、いわゆる「てこ（レバレッジ）の原理」により市場価格の変動が増幅され、大きな影響を被る可能性があります。

#### （デリバティブ取引の取引先に関するリスク）

デリバティブ取引の相手方が倒産等の事態に陥った場合は、取引契約が不履行となり、取引の清算の遅延等により、大きな損失を被る可能性があります。このような事態が生じた場合には当ファンドの運用成果に影響を与えます。

#### d．為替変動リスク

当ファンドのマザーファンドは、為替変動リスクの低減を図ることを目指し、原則として外貨建資産に対して為替ヘッジを行ないますが、為替変動による影響の全てを回避することはできません。また、ヘッジ対象通貨の金利が円金利よりも高い場合、ヘッジ・コストがかかります。

なお、実質的な主要投資対象ファンドは現地通貨建てで投資を行なう場合があります。通常は現地通貨にかかる為替変動リスクは、ロングショート戦略において相殺されますが、ロングポジションとショートポジションの割合が一致しない等の場合には米ドルに対する現地通貨の為替レートの変動が、当ファンドの運用成果に影響を与えます。

#### e．債券投資のリスク

当ファンドの実質的な投資対象ファンドは、債券へも投資を行ないます。債券の価格は、政治、経済、社会情勢等の影響により金利が上昇すれば下落し、金利が低下すれば上昇します。したがって、金利の変動が当ファンドの運用成果に影響を与えます。また、投資した債券の発行体の財務状況により、債務不履行が生じることがあります。債務不履行が生じた場合には、債券価格が下落する等、当ファンドの運用成果に影響を与えます。

#### ファンド運営上のリスク

##### a．購入および換金の受付の中止・取消

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、受益権の購入および換金の受付を中止する場合があります。また、この場合、既に受付けた受益権の購入および換金の受付についても取り消す場合があります。

##### b．ファンドの繰上償還

当ファンドは換金により受益権の口数が20億口を下回ることとなった場合、または投資者のため有利と認められる場合、その他やむを得ない事情が発生したとき等は、ファンドを償還させる場合があります。

##### c．法令・税制・会計等の変更

法令・税制・会計方法等は今後変更される可能性があります。

## d．収益分配金に関する留意点

分配金は、預貯金の利息とは異なりファンドの純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

分配金は、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。計算期間中に運用収益があった場合においても、当該運用収益を超えて分配を行った場合、当期決算日の基準価額は前期決算日の基準価額と比べて下落することになります。したがって、分配金の水準は必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

投資者の個別元本の状況によっては、分配金の一部または全部が、実質的に元本の一部払戻しに相当する場合があります。個別元本とは、追加型投資信託を保有する投資者毎の取得元本のことで、投資者毎に異なります。

## (2) リスクの管理体制

委託会社ではリスク管理を重視しており、独自開発のシステムを用いてリスク管理を行なっております。具体的には、運用担当部門とは異なる部門においてファンドの投資リスクの計測・分析、投資制限のモニタリングなどを行なうことにより、ファンドの投資リスクが運用方針に合致していることを確認し、その結果を運用担当部門にフィードバックするほか、社内関係者で共有しております。また、委託会社の業務に関するリスクについて社内規程を定めて管理を行なっております。

その他、デリバティブ取引のリスク管理として、実質的な投資対象ファンドの投資顧問会社ではリスク管理部門内に取引先リスクの管理専任部署を設置、取引先の承認、財務状況のモニタリング、ならびに取引先毎の取引額のモニタリングを行なっています。

リスクの管理体制は、変更となる場合があります。



(参考情報)

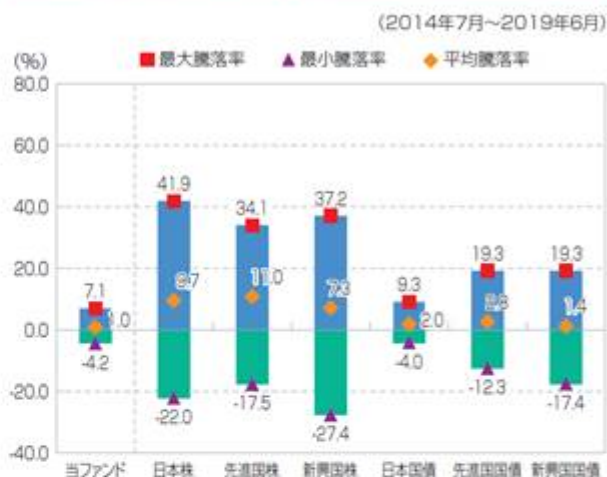
●下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

右のグラフは過去5年間における年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間における年間騰落率の推移を表示しています。

### ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



### 他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

※ファンドの年間騰落率は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※ファンドの年間騰落率において、過去5年間分のデータが算出できない場合は以下のルールで表示しています。

- ①年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。
- ②年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。

#### ※各資産クラスの指数

日本株……東証株価指数(配当込み)  
 先進国株……MSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)  
 新興国株……MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)  
 日本国債……NOMURA-BPI国債  
 先進国国債……FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)  
 新興国国債……J.P.モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)  
 (注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしております。

#### <各指数について>

東証株価指数(配当込み)は、東京証券取引所第一部に上場されている全銘柄を対象に時価総額を指数として算出したものです。東証株価指数(配当込み)は、株式会社東京証券取引所(株)東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利は、(株)東京証券取引所が有しています。(株)東京証券取引所は、東証株価指数(配当込み)の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数(配当込み)の算出もしくは公表の停止または東証株価指数(配当込み)の商標の変更もしくは使用の停止を行なう権利を有しています。

MSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)およびMSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCI Inc.が開発、計算した株価指数です。MSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)は日本を除く世界の主要先進国の株式を、また、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は新興国の株式を対象として算出した指数です。同指数に関する著作権、知的財産その他の一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が公表している指数で、日本国債の市場全体の動向を表す投資収益指数です。同指数に関する知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI国債を用いて行なわれるブラックロック・ジャパン株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利は、FTSE Fixed Income LLCが有しています。

J.P.モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)は、J.P.モルガン・セキュリティティーズ・エルエルシーが発表しており、新興国の現地通貨建ての国債を対象として算出した指数です。同指数に関する著作権はJ.P.モルガン・セキュリティティーズ・エルエルシーに帰属しています。

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

購入時の申込手数料（以下「購入時手数料」といいます。）は、販売会社が独自に定めることができます。

販売会社につきましては、下記にお問い合わせください。

ブラックロック・ジャパン株式会社

電話番号： 03-6703-4300（受付時間 営業日の9：00～17：00）

ホームページアドレス： [www.blackrock.com/jp/](http://www.blackrock.com/jp/)

なお、購入時手数料には消費税等相当額が含まれます（以下同じ。）。

購入時手数料は、購入時の商品説明、販売に関する事務手続き等の役務の対価として販売会社にお支払いいただくものです。

購入時手数料を徴収している販売会社はありません。

分配金の受取方法により、「分配金支払いコース」、「分配金再投資コース」の2つのコースがあります。「分配金再投資コース」を選択した投資者が、分配金を再投資する場合は、無手数料とします。

### (2)【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

### (3)【信託報酬等】

信託報酬の総額

計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年1.86624%（税抜1.728%）の率を乗じて得た金額とします。

信託報酬に係る委託会社、販売会社、受託会社間の配分および当該報酬を対価とする役務の内容は次の通りとします。

	信託報酬の配分	役務の内容
委託会社	年1.728% (税抜1.600%)	ファンドの運用、基準価額の計算、運用報告書等各種書類の作成等
販売会社	年0.108% (税抜0.100%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等
受託会社	年0.03024% (税抜0.028%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行等

実質的な投資対象ファンドにかかる報酬相当額は、委託会社の信託報酬より支払われます。

<消費税率が10%になった場合は、以下の通りとなります。>

計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年1.9008%（税抜1.728%）の率を乗じて得た金額とします。

信託報酬に係る委託会社、販売会社、受託会社間の配分および当該報酬を対価とする役務の内容は次の通りとします。

	信託報酬の配分	役務の内容
委託会社	年1.76% (税抜1.60)	ファンドの運用、基準価額の計算、運用報告書等各種書類の作成等
販売会社	年0.11% (税抜0.10%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等
受託会社	年0.0308% (税抜0.028%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行等

実質的な投資対象ファンドにかかる報酬相当額は、委託会社の信託報酬より支払われます。

#### 信託報酬の支払時期と支払方法等

信託報酬は、日々計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（当該終了日が休業日の場合はその翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとします。

委託会社および販売会社に対する信託報酬は、ファンドから委託会社に対して支弁されます。信託報酬の販売会社への配分は、ファンドから委託会社に支弁された後、委託会社より販売会社に対して支払われます。受託会社の報酬は、ファンドから受託会社に対して支弁されます。

#### (4)【その他の手数料等】

信託財産において換金代金等の支払資金に不足が生じるときに資金借入れの指図を行なった場合はその都度、当該借入金の利息は信託財産中より支弁します。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、投資者の負担とし、その都度、信託財産中から支弁します。

下記の諸費用（以下「諸費用」といいます。）および諸費用に係る消費税等相当額は、投資者の負担とし、信託財産中から支弁することができます。

1. 受益権の管理事務に関連する費用
2. 有価証券届出書、有価証券報告書等法定提出書類の作成、印刷および提出に係る費用
3. 目論見書の作成、印刷および交付に係る費用
4. 信託約款の作成、印刷および届出に係る費用
5. 運用報告書の作成、印刷、交付および提出に係る費用
6. 公告に係る費用
7. 他の信託との併合および信託約款の変更またはファンドの償還に係る事項を記載した書面の作成、印刷および交付に係る費用
8. この信託の監査人、法律顧問および税務顧問に対する報酬および費用

委託会社は、年0.108%<sup>\*</sup>（税抜0.10%）を上限とする、上記の諸費用の金額をあらかじめ合理的に見積もった上で算出する率を毎日純資産総額に対して乗じて得た額、または上記の諸費用の金額をあらかじめ合理的に見積もった上で算出する額を、上記の諸費用の支払の合計額とみなして、ファンドから受領することができます。諸費用および諸費用に係る消費税等相当額は、日々計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（当該終了日が休業日の場合はその翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支払われるものとします。

\* 消費税率が10%になった場合は、年0.11%となります。

外貨建資産の保管等に要する費用<sup>\*</sup>は、その都度、信託財産中より支弁します。

\* 海外における保管銀行等に支払う有価証券の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用

実質的な投資対象ファンドに係る保管報酬および事務処理に要する諸費用が別途投資対象ファンドから支払われます。

#### (5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

日本の居住者（法人を含む。）である投資者に対する課税については、以下のような取扱いとなります。

個別元本方式について

- a. 追加型株式投資信託について、投資者毎の信託時の受益権の価額等（購入時手数料は含まれません。）が当該投資者の元本（「個別元本」といいます。）にあたります。
- b. 投資者が同一ファンドの受益権を複数回購入した場合、個別元本は、当該投資者が追加信託を行なうつ当該投資者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

- c．同一ファンドを複数の販売会社で購入する場合には各販売会社毎に、個別元本の算出が行なわれま  
す。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを購入する場合は当該支店等毎に個別元本の算  
出が行なわれる場合があります。
- d．投資者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻  
金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該投資者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配  
金）」については、下記「収益分配金の課税について」を参照。）

#### 換金時および償還時の課税について

- a．個人の投資者の場合  
換金時および償還時の差益（譲渡益）が課税対象となります。
- b．法人の投資者の場合  
換金時および償還時の個別元本超過額が課税対象となります。

#### 収益分配金の課税について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金  
（特別分配金）」（投資者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

投資者が収益分配金を受け取る際、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本と同額の場合  
または当該投資者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、当該収益  
分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金  
（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となりま  
す。

なお、投資者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本  
払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該投資者の個別元本となります。

#### 個人、法人の課税の取扱いについて

- a．個人の投資者に対する課税
- (a) 収益分配金の課税について
- 支払いを受ける収益分配金のうち、課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として、20.315%  
（所得税15.315%（復興特別所得税を含む）、地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれます。原則と  
して、申告は不要です。
- また、確定申告を行なうことにより総合課税（配当控除なし）と申告分離課税（20.315%（所得税  
15.315%、地方税5%））のいずれかを選択することができます。

(b) 換金時および償還時の差益の課税について

換金時および償還時の差益（換金価額および償還価額から購入費用（購入時手数料および当該購入時手  
料にかかる消費税等相当額を含みます。）を控除した利益）は、譲渡益として課税対象（譲渡所得等）とな  
り、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含む）、地方税5%）の税率による申告分離課税が適用  
されます。原則として確定申告が必要ですが、特定口座（源泉徴収口座）の利用が可能な場合があります。

換金時および償還時に損失（譲渡損）が生じた場合には、確定申告することで、他の株式等の譲渡益、上  
場株式等の配当所得および特定公社債等の利子所得の金額（申告分離課税を選択したものに限りま  
す。）との損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。

また、換金時および償還時の差益（譲渡益）については、他の株式等の譲渡損と損益を相殺することがで  
きます。

b．法人の投資者に対する課税

法人の投資者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金時および償還時の  
個別元本超過額については、15.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含む）、地方税の源泉徴収はあり

ません。)の税率による源泉徴収が行なわれます。なお、当ファンドについては、法人税の課税対象となりますが、益金不算入制度の適用はありません。

上記は2019年6月末現在のもので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

以下の運用状況は2019年6月末現在のものです。

「ブラックロック・アメリカ大陸ロング・ショート・ファンド(ダイワ投資一任専用)」

## (1)【投資状況】

資産の種類	金額(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	628,687,665	100.06
内 日本	628,687,665	100.06
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	368,739	0.06
純資産総額	628,318,926	100.00

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

順位	銘柄	国/地域	種類	数量(口)	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
1	アメリカズ・ロングショート・マザーファンド	日本	親投資信託 受益証券	487,922,131	1.2816	625,340,371	1.2885	628,687,665	100.06

(注) 投資比率は、純資産総額に対する評価金額の比率です。

## 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.06

(注) 投資比率は、純資産総額に対する評価金額の比率です。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

2019年6月末現在、同日前1年以内における各月末および各計算期間末の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額(円)		1口当たりの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期(2017年6月15日)	335,768,321	(同左)	1.0180	(同左)
第2期(2018年6月15日)	384,997,062	(同左)	1.0737	(同左)
第3期(2019年6月17日)	616,292,931	(同左)	1.0402	(同左)
2018年6月末現在	389,388,129		1.0806	
2018年7月末現在	409,212,724		1.0723	
2018年8月末現在	447,120,325		1.0889	
2018年9月末現在	464,499,939		1.0932	
2018年10月末現在	478,851,748		1.0515	
2018年11月末現在	505,452,516		1.0158	
2018年12月末現在	540,749,614		1.0228	
2019年1月末現在	536,974,225		1.0290	
2019年2月末現在	553,808,493		1.0319	
2019年3月末現在	560,266,137		1.0237	
2019年4月末現在	555,393,189		1.0323	
2019年5月末現在	581,447,186		1.0369	
2019年6月末現在	628,318,926		1.0452	

## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1期	
第2期	
第3期	

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1期	1.8
第2期	5.5
第3期	3.1

(注) 収益率とは、計算期間末の基準価額(分配付の額)から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額(分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。)を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数です。なお、第1期計算期間については、前期末基準価額を10,000円(1万口当たり)として計算しています。

## (4)【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第1期	338,283,526	8,458,742	329,824,784
第2期	260,134,959	231,394,453	358,565,290
第3期	313,876,576	79,994,821	592,447,045



(参考情報)

「アメリカズ・ロングショート・マザーファンド」

## (1) 投資状況

資産の種類	金額(円)	投資比率(%)
投資証券	1,296,057,667	98.65
内 ルクセンブルグ	1,178,250,516	89.69
内 アイルランド	117,807,151	8.97
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	17,676,099	1.35
純資産総額	1,313,733,766	100.00

(注) 当ファンドは、ファミリーファンド方式による運用を行っているため、実質の運用はマザーファンドにおいて行っております。

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

順位	銘柄	国/地域	種類	投資口数	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	ブラックロック・ストラテジック・ファンズ ブラックロック・アメリカズ・ダイバーシファイド・エクイティ・アブソルート・リターン・ファンド クラスX投資証券	ルクセンブルグ	投資証券	68,978	17,003.87	1,172,897,198	17,081.48	1,178,250,516	89.69
2	インスティテューショナル・キャッシュ・シリーズplc ブラックロック・ICS・USトレジャリー・ファンド エージェンシークラス投資証券	アイルランド	投資証券	10,458	11,258.88	117,746,165	11,264.71	117,807,151	8.97

(注) 投資比率は、純資産総額に対する評価金額の比率です。

## 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.65

(注) 投資比率は、純資産総額に対する評価金額の比率です。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## （参考情報）運用実績

2019年6月28日現在

## 基準価額・純資産の推移



※基準価額および分配金再投資基準価額は信託報酬控除後の値です。信託報酬等については、後述の「ファンドの費用」をご覧ください。  
※分配金再投資基準価額は、税引前分配金を再投資したものととして算出しています。

## 分配の推移

設定来累計		0円
第1期	2017年6月	0円
第2期	2018年6月	0円
第3期	2019年6月	0円

※分配金は税引前、1万口当たり

## 主要な資産の状況

※ポジション数、ポジション構成比率、業種別グロスポジション上位10、市場別戦略配分比率は、当ファンドの実質的な主要投資対象である「BSFブラックロック・アメリカス・ダイバーシファイド・エクイティ・アブソルート・リターン・ファンド」の運用状況です。（2019年6月末時点）

## 資産構成比率(%)



※比率は対純資産総額、マザーファンドベース。四捨五入の関係で合計が100にならない場合があります。

## ポジション数\*

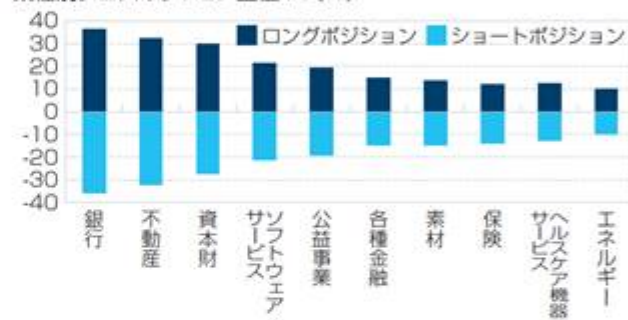
ロングポジション	1,714
ショートポジション	1,710
合計	3,424

## ポジション構成比率(%)\*

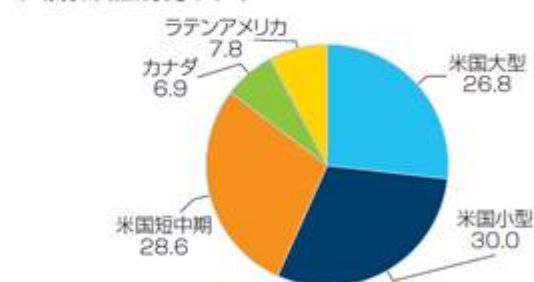
グロスポジション	581.0
ロングポジション	290.5
ショートポジション	-290.4
ネットポジション	0.1

※実質的な主要投資対象ファンドの運用状況です。比率は実質的な主要投資対象ファンドの純資産総額に対する割合です。

## 業種別グロスポジション上位10(%)\*



## 市場別戦略配分比率(%)\*



※比率は四捨五入の関係で合計が100にならない場合があります。

## 年間収益率の推移

※2016年は設定日(9月26日)から年末までの収益率を表示しています。  
※ファンドの収益率は、決算時の分配金を非課税で再投資したものととして算出しています。  
※当ファンドにはベンチマークはありません。



※運用実績・データ等は作成日現在および過去のものであり、今後の運用成果を保証するものではありません。  
※当ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページにて開示しております。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### (1) 申込方法

受益権の投資者は、販売会社と有価証券の取引に関する契約を締結します。このため、販売会社は有価証券の取引にかかわる約款を投資者に交付し、投資者は当該約款に基づく取引口座の設定を申込む旨の申込書を提出します。

分配金の受取方法により、収益の分配時に分配金を受け取る「分配金支払いコース」と分配金が税引き後無手数料で再投資される「分配金再投資コース」の2つの申込方法があります。

「分配金再投資コース」を選択する投資者は、当該販売会社との間で「累積投資約款」にしたがって契約を締結します。

取扱いを行なうコースは各販売会社により異なりますので、詳細は販売会社までお問い合わせください。

投資者は販売会社に、購入と同時にまたはあらかじめ当該投資者が受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該投資者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、販売会社は、当該購入の代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該投資者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。受託会社は、信託契約締結日に生じた受益権については信託契約締結時に、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行ないます。

#### (2) 申込期間

当ファンドの購入は、申込期間における販売会社の各営業日に、販売会社の本・支店、営業所等でお受けしています。なお、申込期間は、有価証券届出書を提出することによって更新されます。

#### (3) 受付時間

購入の受付は、申込期間中の午後3時までに受付けたもの（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を当日のお申込みとします。ただし、受付時間は販売会社によって異なることがあります。受付時間を過ぎての購入は翌営業日の取扱いとします。

販売会社につきましては、下記にお問い合わせください。

ブラックロック・ジャパン株式会社

電話番号： 03-6703-4300（受付時間 営業日の9：00～17：00）

ホームページアドレス： [www.blackrock.com/jp/](http://www.blackrock.com/jp/)

#### (4) 購入不可日

ルクセンブルグの銀行の休業日、12月24日、その他実質的な主要投資対象ファンドの受付不可日のいずれかに該当する場合は、販売会社の営業日であっても購入は受け付けません。詳細は販売会社にお問い合わせください。

#### (5) 購入単位

販売会社は、受益権の取得申込者に対し、最低単位を1円単位または1口単位として販売会社が定める単位をもって、取得の申込みに応じることができます。

#### (6) 購入価額

購入受付日の翌営業日の基準価額とします。なお、購入価額には、購入時手数料は含まれておりません。

## (7) 購入時手数料

a．販売会社が独自に定めることができます。

なお、購入時手数料には消費税等相当額が含まれます。

購入時手数料を徴収している販売会社はありません。

b．「分配金再投資コース」を選択した投資者が、分配金を再投資する場合は、無手数料となります。

## (8) 購入代金のお支払い

ファンドの受益権の投資者は、購入の販売会社が定める日までに当ファンドの購入代金を販売会社に支払うもの  
とします。

## (9) 購入の受付の中止、既に受付けた購入の受付の取消

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託会社の判断により、受益権の購入の受付を中止することおよび既に受付けた購入の受付を取り消すことがあります。

## 2【換金（解約）手続等】

### (1) 換金の申込と受付

投資者は、自己に帰属する受益権について、委託会社に換金を申込することができます。投資者が換金の申込をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。委託会社の各営業日の午後3時までに受付けた換金の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを）、当日の受付分として取扱います。ただし、受付時間は販売会社によって異なることがあります。受付時間を過ぎての換金の申込は翌営業日のお取扱いとします。

### (2) 換金単位

投資者は、自己に帰属する受益権について、最低単位を1口単位として販売会社が定める単位をもって、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。

### (3) 換金不可日

ルクセンブルグの銀行の休業日、12月24日、その他実質的な主要投資対象ファンドの受付不可日のいずれかに該当する場合は、販売会社の営業日であっても換金の申込は受けません。詳細は販売会社にお問い合わせください。

### (4) 換金価額

換金価額は、換金受付日の翌営業日の基準価額とします。なお手取額は、換金受付日の翌営業日の基準価額から所得税および地方税を差し引いた金額となります。

当ファンドの換金価額等につきましては販売会社または下記にお問い合わせることにより知ることができます。

ブラックロック・ジャパン株式会社

電話番号： 03-6703-4300（受付時間 営業日の9：00～17：00）

### (5) 換金受付の制限

信託財産の資金管理を円滑に行なうため、大口の換金の申込には制限があります。

### (6) 換金代金の支払い

換金代金は原則として換金受付日から起算して6営業日目から販売会社においてお支払いします。

### (7) 換金の申込の受付中止および取消

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、換金の申込の受付を中止することおよび既に受付けた換金の申込の受付を取り消すことができます。換金の申込の受付が中止された場合には、投資者は当該受付中止以前に行なった当日の換金の申込を撤回できます。ただし、投資者がその換金の申込を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に換金の申込を受付けたものとします。

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。また、予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

基準価額（1万口当り）は委託会社の営業日に毎日算出されます。投資者は、販売会社または下記に問い合わせることにより知ることができます。

また、日々の基準価額（1万口当り）は翌日の日本経済新聞に掲載されております。ファンド名は「Fアメ大L S」と省略されて記載されております。

当ファンドの主たる投資対象の評価方法は以下の通りです。

マザーファンドの受益証券：原則として計算日の基準価額で評価するものとします。

（参考）マザーファンドの主たる投資対象の評価方法

投資信託証券：金融商品取引所（海外取引所を含む）に上場されているものは、当該取引所における計算日の最終相場（海外取引所に上場されているものについては、計算日に知りうる直近の最終相場）で評価します。金融商品取引所に上場されていないものは、第一種金融商品取引業者、銀行等の提示する価格（原則として、計算日に知りうる直近の日の純資産価格）で評価します。

ブラックロック・ジャパン株式会社

電話番号： 03-6703-4300（受付時間 営業日の9：00～17：00）

ホームページアドレス： [www.blackrock.com/jp/](http://www.blackrock.com/jp/)

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

#### (3)【信託期間】

この信託の期間は、無期限とします。

#### (4)【計算期間】

毎年6月16日から翌年の6月15日までとすることを原則とします。計算期間終了日に該当する日が休業日のときは該当日の翌営業日を計算期間の終了日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

#### (5)【その他】

ファンドの償還条件等

- a. 委託会社は、信託期間中において、このファンドを償還することが投資者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、このファンドを償還させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、償還しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は換金により、受益権の口数が20億口を下回ることとなった場合には、受託会社と合意のうえ、このファンドを償還させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、償還しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- c . a . および b . の場合において、委託会社は、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行いません。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびにファンドの償還の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約に係る知っている投資者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- d . c . の書面決議において、投資者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る投資者としての受託会社を除きます。以下 d . において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている投資者が議決権を行行使しないときは、当該知っている投資者は書面決議について賛成するものとみなします。
- e . c . の書面決議は議決権を行行使することができる投資者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行ないます。
- f . c . ~ e . までの規定は、委託会社がファンドの償還について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約に係るすべての投資者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、c . ~ e . までの手続を行なうことが困難な場合も同じとします。
- g . 委託会社は、監督官庁よりこのファンドの償還の命令を受けたときはその命令にしたがい、ファンドを償還させます。
- h . 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社はこのファンドを償還させます。
- i . h . にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、「信託約款の変更 b . 」に規定する書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- j . 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または投資者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、信託約款の変更の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこのファンドを償還させます。

#### 信託約款の変更

- a . 委託会社は、投資者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は以下に定める以外の方法によって変更することができないものとします。
- b . 委託会社は、a . の事項（a . の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあつてはその併合が投資者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款に係る知っている投資者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

- c . b . の書面決議において、投資者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る投資者としての受託会社を除きます。以下c . において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている投資者が議決権を行行使しないときは、当該知っている投資者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d . b . の書面決議は議決権を行行使することができる投資者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行ないます。
- e . 書面決議の効力は、この信託のすべての投資者に対してその効力を生じます。
- f . b . ~ e . までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての投資者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- g . a . ~ f . までの規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行なうことはできません。
- h . 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときはa . ~ f . の規定にしたがいます。

#### 信託事務の委託

受託会社は、当ファンドにかかる信託事務の処理の一部について資産管理サービス信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託にかかる契約書類に基づいて所定の事務を行ないます。

#### 運用報告書の作成

毎決算時および償還時に、委託会社が期間中の運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した「交付運用報告書」を作成し、販売会社を通じて知っている受益者にお届けいたします。

#### 関係法人との契約の更改等に関する手続

「受益権の募集・販売の取扱い等に関する契約」の期間は1年とし、委託会社、販売会社いずれからも別段の意思表示のないときは、自動的に1年間延長されるものとし、自動延長後の取扱いについてもこれと同様です。

#### 公告

委託会社が投資者に対してする公告は、電子公告により行ない、次のアドレスに掲載します。

[www.blackrock.com/jp/](http://www.blackrock.com/jp/)

但し、当該公告方法に支障がある場合には、日本経済新聞による公告を行ないます。



#### 4【受益者の権利等】

ファンドの受益者（投資者）の有する主な権利は次の通りです。

##### (1) 収益分配金受領権

投資者は、委託会社の決定した収益分配金を、持ち分に応じて委託会社から受領する権利を有します。

###### <分配金支払いコース>

毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として5営業日以内）に、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている投資者（当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において換金が行なわれた受益権にかかる投資者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で購入代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として投資者とします。）にお支払いを開始します。

投資者が、収益分配金について支払開始日から5年間支払い請求を行わない場合はその権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は委託会社に帰属します。

###### <分配金再投資コース>

受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌日に、収益分配金が販売会社に交付されます。

販売会社は、累積投資契約に基づき、投資者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行いません。当該売付けにより増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

##### (2) 償還金受領権

投資者は、委託会社の決定した償還金を、持ち分に応じて委託会社から受領する権利を有します。

償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日から起算して5営業日以内）に償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている投資者（償還日以前において換金が行なわれた受益権にかかる投資者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で購入代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として投資者とします。）にお支払いを開始します。なお、当該投資者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託会社がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

償還金の支払いは、販売会社において行ないます。

投資者が、償還金について支払開始日から10年間支払いの請求を行わない場合はその権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は委託会社に帰属するものとします。

##### (3) 受益権の換金請求権

投資者は、自己に帰属する受益権について、委託会社に換金を請求する権利を有します。

換金代金は、換金受付日から起算して、原則として6営業日目から投資者に支払います。

換金の請求を行なう投資者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該投資者の請求に係るこの換金を委託会社が行なうのと引き換えに、当該換金に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

##### (4) 反対受益者の買取請求の不適用

当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権の買取請求の規定の適用を受けません。

##### (5) 帳簿書類の閲覧または謄写の請求権

投資者は、委託会社に対し、その営業時間内に当ファンドの信託財産に関する帳簿書類の閲覧または謄写を請求することができます。

### 第3【ファンドの経理状況】

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)及び同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間(2018年6月16日から2019年6月17日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

(3) 当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行っておりますので、参考情報として「アメリカズ・ロングショート・マザーファンド」の貸借対照表、注記表及び附属明細表を記載しております。

なお、当該参考情報は監査意見の対象外となっております。

## 1【財務諸表】

## 【ブラックロック・アメリカ大陸ロング・ショート・ファンド(ダイワ投資一任専用)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 (2018年6月15日現在)	第3期 (2019年6月17日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
親投資信託受益証券	388,263,003	621,769,005
未収入金	-	1,019,836
流動資産合計	388,263,003	622,788,841
資産合計	388,263,003	622,788,841
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	1,019,836
未払受託者報酬	49,988	83,840
未払委託者報酬	3,037,345	5,092,717
その他未払費用	178,608	299,517
流動負債合計	3,265,941	6,495,910
負債合計	3,265,941	6,495,910
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	358,565,290	592,447,045
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	26,431,772	23,845,886
(分配準備積立金)	13,048,347	11,190,762
元本等合計	384,997,062	616,292,931
純資産合計	384,997,062	616,292,931
負債純資産合計	388,263,003	622,788,841

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

	(単位：円)	
	第2期 (自 2017年6月16日 至 2018年6月15日)	第3期 (自 2018年6月16日 至 2019年6月17日)
営業収益		
有価証券売買等損益	29,564,769	6,096,262
営業収益合計	29,564,769	6,096,262
営業費用		
受託者報酬	105,473	153,253
委託者報酬	6,408,814	9,310,090
その他費用	376,872	547,533
営業費用合計	6,891,159	10,010,876
営業利益又は営業損失( )	22,673,610	16,107,138
経常利益又は経常損失( )	22,673,610	16,107,138
当期純利益又は当期純損失( )	22,673,610	16,107,138
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )	8,487,511	3,008,928
期首剰余金又は期首欠損金( )	5,943,537	26,431,772
剰余金増加額又は欠損金減少額	10,916,984	15,960,202
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	10,916,984	15,960,202
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,614,848	5,447,878
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,614,848	5,447,878
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金( )	26,431,772	23,845,886

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

## 1 有価証券の評価基準及び評価方法

親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、当該親投資信託受益証券の基準価額で時価評価しております。

## 2 収益及び費用の計上基準

有価証券売買等損益の計上基準

約定日基準で計上しております。

## 3 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

計算期間末日の取扱い

第3期計算期間は当計算期間末が休業日であったため、2018年6月16日から2019年6月17日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第2期 (2018年6月15日現在)	第3期 (2019年6月17日現在)
1 当該計算期間の末日における 受益権総数	358,565,290口	592,447,045口
2 1口当たり純資産額	1.0737円	1.0402円

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第2期 (自 2017年6月16日 至 2018年6月15日)	第3期 (自 2018年6月16日 至 2019年6月17日)
分配金の計算過程	第2期計算期末における、費用控除後の配当等収益(101円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(13,048,246円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(13,383,421円)、収益調整金(その他収益調整金)(4円)、分配準備積立金(0円)により、分配対象収益は26,431,772円となりましたが、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、当期は分配を見合わせました。	第3期計算期末における、費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(2,286,330円)、収益調整金(その他収益調整金)(10,368,794円)、分配準備積立金(11,190,762円)により、分配対象収益は23,845,886円となりましたが、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、当期は分配を見合わせました。

## (金融商品に関する注記)

### 金融商品の状況に関する事項

#### 1 金融商品に対する取組方針

当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

#### 2 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク

当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券は親投資信託受益証券であります。

当ファンドの主な投資リスクとして、「ロングショート戦略によるリスク」、「株式の価格変動のリスク」、「デリバティブ取引のリスク」、「為替変動リスク」、「債券投資のリスク」等があります。

#### 3 金融商品に係るリスク管理体制

##### (1) 市場リスクの管理

ブラックロックソリューション・グリーンパッケージプロダクションチームが日次で計測し、運用部、その他の関係部署等にレポートをイントラネットで配信しております。また、運用ガイドラインのモニタリングはポートフォリオ・コンプライアンスチームが行っており、ガイドライン等を逸脱していた場合、関係部署へ報告され、適切な調整を行います。

##### (2) 信用リスクの管理

ファンダメンタル債券運用部により、国内債券の個別信用リスク及び銘柄間の相対価値については独自の定量・定性分析等を行っております。外国債券銘柄等については、社内のリサーチ・データベースによりグローバル・クレジット・チームとの情報・分析結果を共有しております。

##### (3) 取引先リスクの管理

リスク・クオンツ分析部は当社の親会社である米国のBlackRock, Inc.のRQA Counterparty & Concentration Riskチームと共に既存の承認済み取引先の信用悪化のモニタリングを行っており、取引先のデフォルトに対する取引先リスク、発行体リスクのファンドへの影響を分析しております。また、新規取引先の承認に際しては、リスク・クオンツ分析部が新規取引先申請の内容に問題がないかどうか確認を行い、当社の親会社である米国のBlackRock, Inc.のRQA Counterparty & Concentration Riskチームへ申請を行っております。

また、毎月開催される投資委員会では、リスク管理・運用分析手法等について審議を行っております。

## 金融商品の時価等に関する事項

第2期 (2018年6月15日現在)	第3期 (2019年6月17日現在)
<p>1 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2 時価の算定方法 (1) 有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>3 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>4 金銭債権の計算期間末日後の償還予定額 金銭債権については全て1年以内に償還予定であります。</p>	<p>1 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2 時価の算定方法 (1) 有価証券 同左  (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左</p> <p>3 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 同左</p> <p>4 金銭債権の計算期間末日後の償還予定額 同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。



(その他の注記)

## 1 期中元本変動額

項目	第2期 (2018年6月15日現在)	第3期 (2019年6月17日現在)
期首元本額	329,824,784円	358,565,290円
期中追加設定元本額	260,134,959円	313,876,576円
期中一部解約元本額	231,394,453円	79,994,821円

## 2 有価証券関係

第2期(2018年6月15日現在)

売買目的有価証券

種類	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	19,472,061
合計	19,472,061

第3期(2019年6月17日現在)

売買目的有価証券

種類	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	3,827,166
合計	3,827,166

## 3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	アメリカズ・ロングショート・マザー ファンド	485,150,597	621,769,005	
親投資信託受益証券	合計	485,150,597	621,769,005	
合計		485,150,597	621,769,005	

(注) 親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考情報)

当ファンドは、「アメリカズ・ロングショート・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。同マザーファンドの2019年6月17日現在(以下「計算日」という)の状況は次の通りであります。

なお、以下に記載した情報は監査意見の対象外であります。

## 「アメリカズ・ロングショート・マザーファンド」の状況

## (1) 貸借対照表

項目	(2019年6月17日現在)
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	24,203,678
投資証券	1,298,638,943
流動資産合計	1,322,842,621
資産合計	1,322,842,621
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,203,187
未払解約金	3,090,811
流動負債合計	5,293,998
負債合計	5,293,998
純資産の部	
元本等	
元本	1,028,011,346
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	289,537,277
元本等合計	1,317,548,623
純資産合計	1,317,548,623
負債純資産合計	1,322,842,621

(注)親投資信託の計算期間は、原則として、毎年6月21日から翌年6月20日までであります。

## (2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

## 1 有価証券の評価基準及び評価方法

投資証券は移動平均法に基づき、原則として以下の通り時価評価しております。

## (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券

金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として当該取引所等における計算日において知りうる直近の最終相場で評価しております。

## (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券

当該有価証券については、原則として、金融機関の提示する価額又は価格情報会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。

## (3) 時価が入手できなかった有価証券

適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

## 2 デリバティブの評価基準及び評価方法

為替予約取引

個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。

## 3 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準

外貨建資産・負債の円換算については原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。

## 4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

外貨建資産等の会計処理

外貨建資産等については、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2019年6月17日現在)
1 当該計算日における 受益権総数	1,028,011,346口
2 1口当たり純資産額	1.2816円

## （金融商品に関する注記）

### 金融商品の状況に関する事項

#### 1 金融商品に対する取組方針

当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

#### 2 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク

当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券は投資証券であります。

当ファンドの主な投資リスクとして、「ロングショート戦略によるリスク」、「株式の価格変動のリスク」、「デリバティブ取引のリスク」、「為替変動リスク」、「債券投資のリスク」等があります。

当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。

為替予約取引は、外貨建資産の時価総額の為替変動リスクの低減を目的としており、投機を目的とする為替予約は行わない方針であります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変化により損失が発生する信用リスクであります。

#### 3 金融商品に係るリスク管理体制

##### (1) 市場リスクの管理

ブラックロックソリューション・グリーンパッケージプロダクションチームが日次で計測し、運用部、その他の関係部署等にレポートをイントラネットで配信しております。また、運用ガイドラインのモニタリングはポートフォリオ・コンプライアンスチームが行っており、ガイドライン等を逸脱していた場合、関係部署へ報告され、適切な調整を行います。

##### (2) 信用リスクの管理

ファンダメンタル債券運用部により、国内債券の個別信用リスク及び銘柄間の相対価値については独自の定量・定性分析等を行っております。外国債券銘柄等については、社内のリサーチ・データベースによりグローバル・クレジット・チームとの情報・分析結果を共有しております。

##### (3) 取引先リスクの管理

リスク・クオンツ分析部は当社の親会社である米国のBlackRock, Inc.のRQA Counterparty & Concentration Riskチームと共に既存の承認済み取引先の信用悪化のモニタリングを行っており、取引先のデフォルトに対する取引先リスク、発行体リスクのファンドへの影響を分析しております。また、新規取引先の承認に際しては、リスク・クオンツ分析部が新規取引先申請の内容に問題がないかどうか確認を行い、当社の親会社である米国のBlackRock, Inc.のRQA Counterparty & Concentration Riskチームへ申請を行っております。

また、毎月開催される投資委員会では、リスク管理・運用分析手法等について審議を行っております。

## 金融商品の時価等に関する事項

(2019年6月17日現在)

- 1 貸借対照表計上額、時価及び差額  
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額は  
ありません。
- 2 時価の算定方法
  - (1) 有価証券  
「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。
  - (2) デリバティブ取引  
デリバティブ取引については、「(その他の注記)」の「3 デリバティブ取引関係」に記載しております。
  - (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務  
これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によって  
おります。
- 3 金融商品の時価等に関する事項の補足説明  
金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含ま  
れております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によ  
った場合、当該価額が異なることもあります。  
また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計  
算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
- 4 金銭債権の計算日後の償還予定額  
金銭債権はすべて1年以内に償還予定であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 本報告書における開示対象ファンドの当該計算期間における当該親投資信託の元本額の変動及び  
計算日における元本の内訳

(2019年6月17日現在)	
同計算期間の期首元本額	1,014,233,778円
同計算期間中の追加設定元本額	260,526,031円
同計算期間中の一部解約元本額	246,748,463円
同計算期間末日の元本額	1,028,011,346円
当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託の元本額は次の通りです。	
サイエンティフィック・エクイティ・ファンド	542,860,749円
ブラックロック・アメリカ大陸ロング・ショート・ファンド (ダイワ投資一任専用)	485,150,597円
合計	1,028,011,346円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	(2019年6月17日現在)
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
投資証券	19,859,066
合計	19,859,066

(注) 「当計算期間の損益に含まれた評価差額」の欄には、当該親投資信託の期首から計算日までの評価差額を記載しております。

## 3 デリバティブ取引関係

## 取引の時価等に関する事項

## 通貨関連

区分	種類	(2019年6月17日現在)			
		契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超 (円)		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 アメリカドル	1,299,727,453	-	1,301,930,640	2,203,187
合計		1,299,727,453	-	1,301,930,640	2,203,187

(注1) 時価の算定方法

為替予約取引

- 1 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。  
 計算日において為替予約の受渡日(以下「当該日」という)の対顧客先物相場が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。  
 計算日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
  - ・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
  - ・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。
- 2 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客相場の仲値で評価しております。

(注2) 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。



## (3) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ブラックロック・ストラテジック・ファンズ ブラックロック・アメリカズ・ダイバーシファイド・エクイティ・アブソルート・リターン・ファンド クラスX 投資証券	68,978.240	10,859,244.320	
		インスティテューショナル・キャッシュ・シリーズplc ブラックロック・ICS・USトレジャーリー・ファンド エージェンシークラス投資証券	10,458.070	1,092,154.020	
	アメリカドル小計	79,436.310	11,951,398.340 (1,298,638,943)		
投資証券	合計			1,298,638,943 (1,298,638,943)	
合計				1,298,638,943 (1,298,638,943)	

(注1) 投資証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

(注2) 1 各種通貨毎の小計の欄における( )内の金額は、邦貨換算額であります。

2 合計欄における( )内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

3 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入投資証券時価比率	合計金額に対する比率
アメリカドル	投資証券 2 銘柄	100.0%	100.0%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はデリバティブ取引関係の注記事項として記載しております。

## (参考情報)

当ファンドは、「ブラックロック・ストラテジック・ファンズ ブラックロック・アメリカズ・ダイバーシファイド・エクイティ・アブソルート・リターン・ファンド クラスX投資証券」及び「インスティテューショナル・キャッシュ・シリーズplc ブラックロック・ICS・USTレジャーリー・ファンド エージェンシークラス投資証券」(以下、両者を併せて「同ファンド」という。)を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された投資証券は、すべて同ファンドの投資証券であります。同ファンドの状況は以下のとおりであります。

なお、以下に記載した情報は監査意見の対象外です。

## 同ファンドの状況

- (1) 「ブラックロック・ストラテジック・ファンズ ブラックロック・アメリカズ・ダイバーシファイド・エクイティ・アブソルート・リターン・ファンド クラスX投資証券」は、ルクセンブルグにおいて設立されたオープンエンド型投資法人が発行するファンドであり、当該ファンドの現時点で日本語に翻訳された直近の情報は、2018年11月30日に終了する中間計算期間(2018年6月1日から2018年11月30日まで)に係る中間財務書類であります。

当該中間財務書類は、当該ファンドを含む「ブラックロック・ストラテジック・ファンズ」の2018年11月30日現在の中間財務書類のうち、当該ファンドにかかる部分を、委託会社において抜粋し、その原文を翻訳したものです。なお、中間財務書類に含まれる「投資有価証券明細表」の銘柄については原文通り英語表記で行っております。なお、ルクセンブルグにおける独立監査人の監査を受けておりません。

- (2) 「インスティテューショナル・キャッシュ・シリーズplc ブラックロック・ICS・USTレジャーリー・ファンド エージェンシークラス投資証券」は、アイルランドにおいて設立されたオープンエンド型投資法人が発行するファンドであり、当該ファンドの現時点で日本語に翻訳された直近の情報は、2018年9月30日に終了する計算期間(2017年10月1日から2018年9月30日まで)に係る財務書類であります。

当該財務書類は、当該ファンドを含む「インスティテューショナル・キャッシュ・シリーズplc」の2018年9月30日現在の財務書類のうち、当該ファンドにかかる部分を、委託会社において抜粋し、その原文を翻訳したものです。なお、財務書類に含まれる「投資有価証券明細表」の銘柄については原文通り英語表記で行っております。

なお、「インスティテューショナル・キャッシュ・シリーズplc インスティテューショナル・USTレジャーリー・ファンド エージェンシークラス投資証券」は、2019年1月14日付で「インスティテューショナル・キャッシュ・シリーズplc ブラックロック・ICS・USTレジャーリー・ファンド エージェンシークラス投資証券」へ名称変更いたしました。

純資産計算書 2018年11月30日現在(未監査)

	注記	ブラックロック・アメリカズ・ダイバーシファイド・エクイティ・アブソルート・リターン・ファンド 米ドル
<b>資産</b>		
投資有価証券 - 取得原価		1,167,591,161
未実現評価損		(226,580)
投資有価証券 - 時価	2 (a)	1,167,364,581
銀行預金	2 (a)	57,496,963
ブローカーに対する債権	14	52,450,777
未収利息および未収配当金	2 (a)、2 (d)	785,659
売却投資有価証券未収金	2 (a)、2 (d)	384,309,378
販売投資証券未収金	2 (a)	1,939,300
スワップの時価	2 (d)	584,747
<b>資産合計</b>		<b>1,664,931,405</b>
<b>負債</b>		
未払利息および未払配当金	2 (a)、2 (d)	5,088,160
購入投資有価証券未払金	2 (a)、2 (d)	460,210,645
買戻し投資証券未払金	2 (a)	16,808,492
以下に係る未実現純評価損:		
未決済先渡為替予約	2 (d)	2,383,759
差金決済契約	2 (d)	35,355,579
未払費用およびその他の負債	4、5、6、7、8	12,366,776
<b>負債合計</b>		<b>532,213,411</b>
<b>純資産合計</b>		<b>1,132,717,994</b>

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

## 3 会計年度末および当中間会計期間末における純資産価額の概要 2018年11月30日現在(未監査)

ブラックロック・アメリカズ・ダイバーシファイド・  
エクイティ・アブソルート・リターン・ファンド

	通貨	2018年	2018年	2017年	2016年
		11月30日現在	5月31日現在	5月31日現在	5月31日現在
純資産合計	米ドル	1,132,717,994	934,604,752	664,750,490	620,900,487
以下の1口当たり純資産価額:					
クラスA無分配投資証券	米ドル	126.05	134.30	125.91	124.09
クラスA無分配投資証券(豪ドル)	豪ドル	174.18	178.46	170.57	172.06
クラスAユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	118.99	128.43	122.99	123.05
クラスAスウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	スウェーデン・クローネ	120.44	129.93	124.73	125.06
クラスA無分配英国報告型投資証券(英ポンド)	英ポンド	157.03	160.17	155.06	134.72
クラスD無分配投資証券	米ドル	107.25	113.90	106.35	104.46
クラスDスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	スイス・フラン	99.29	107.08	102.39	102.32
クラスD英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	英ポンド	105.98	113.49	107.32	105.96
クラスDユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	ユーロ	121.97	131.30	125.28	124.57
クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	96.49	104.40	100.37	101.01
クラスI無分配投資証券	米ドル	101.30	107.42	-	-
クラスIユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	99.01	106.44	101.34	10.01
クラスI日本円・ヘッジ無分配投資証券	日本円	9,514.91	10,209.24	-	-
クラスIスウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券 <sup>(1)</sup>	スウェーデン・クローネ	91.27	-	-	-
クラスX無分配投資証券	米ドル	147.78	155.83	141.86	137.11

(1) 新規投資証券クラスの設定。詳細についてはAppendix Iを参照のこと。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

## 損益および純資産変動計算書 2018年11月30日に終了した会計期間（未監査）

ブラックロック・アメリカズ・  
ダイバーシファイド・エクイ  
ティ・アブソルート・リター  
ン・ファンド

	注記	米ドル
期首純資産		934,604,752
収益		
預金利息	2 (c)	3,013,935
債券利息	2 (c)	10,041,840
スワップに係る受取利息および受取配当金	2 (c)	232,281
差金決済契約に係る受取配当金、源泉徴収税控除後	2 (d)	32,995,235
その他の収益		278,869
収益合計		46,562,160
費用		
差金決済契約に係る支払利息	2 (d)	15,105,786
差金決済契約に係る支払配当金、源泉徴収税控除後	2 (d)	39,404,873
管理事務代行報酬	5	1,211,741
預託報酬	2 (i)、6	490,866
税金	8	201,970
パフォーマンス・フィー	7	182,333
販売報酬	4	74,283
ローン・コミットメント・フィー	13	3,645
投資運用報酬および外部の副投資顧問会社に対する報酬	4	6,747,320
費用合計		63,422,817
投資純損失		(16,860,657)
以下に係る実現純利益 / (損失) :		
投資有価証券	2 (a)、2 (b)	1,425,479
差金決済契約	2 (d)	(19,703,758)
外貨および先渡為替予約	2 (d)、 2 (e)、2 (j)	(45,990,680)
スワップ取引	2 (d)	2,190,958
当期実現純損失		(62,078,001)
以下に係る未実現評価益 / (損) の純変動額 :		
投資有価証券	2 (a)	(290,427)
差金決済契約	2 (d)	(37,869,448)
外貨および先渡為替予約	2 (d)、 2 (e)、2 (j)	7,343,989
スワップ取引	2 (d)	(461,376)
当期末実現評価益 / (損) の純変動		(31,277,262)
運用成績による純資産の減少		(110,215,920)
資本の変動		
投資証券発行による正味受取額		728,370,701
投資証券買戻しによる正味支払額		(420,041,539)
資本の変動による純資産の増加		308,329,162
期末純資産		1,132,717,994

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

発行済投資証券口数変動表 2018年11月30日現在（未監査）

ブラックロック・アメリカズ・ダイバーシファイド・エクイティ・  
アブソルート・リターン・ファンド

	期首発行済 投資証券口数	当期発行 投資証券口数	当期買戻し 投資証券口数	期末発行済 投資証券口数
クラスA無分配投資証券	193,966	423,242	139,610	477,598
クラスA無分配投資証券（豪ドル）	352	-	-	352
クラスAユーロ・ヘッジ無分配投資証券	1,332,257	986,560	383,623	1,935,194
クラスAスウェーデン・クローネ・ヘッジ 無分配投資証券	9,962,052	1,472,182	1,165,448	10,268,786
クラスA無分配英国報告型投資証券（英ポ ンド）	94	29	-	123
クラスD無分配投資証券	1,101,963	837,036	1,158,557	780,442
クラスDスイス・フラン・ヘッジ無分配投 資証券	41,963	6,017	4,911	43,069
クラスD英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	1,705	-	75	1,630
クラスDユーロ・ヘッジ無分配英国報告型 投資証券	1,193,411	718,535	587,929	1,324,017
クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券	169,200	185,495	29,876	324,819
クラスI無分配投資証券 <sup>(1)</sup>	313,984	1,748,204	664,124	1,398,064
クラスIユーロ・ヘッジ無分配投資証券	596,551	352,275	304,251	644,575
クラスI日本円・ヘッジ無分配投資証券	1,143,554	304,100	43,000	1,404,654
クラスIスウェーデン・クローネ・ヘッジ 無分配投資証券 <sup>(1)</sup>	-	1,915,301	-	1,915,301
クラスX無分配投資証券	101,035	9,952	7,450	103,537

(1) 新規投資証券クラスの設定。詳細についてはAppendix Iを参照のこと。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

## ブラックロック・アメリカズ・ダイバーシファイド・エクイティ・アブソルート・リターン・ファンド

投資有価証券明細表 2018年11月30日現在(未監査)

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
<b>普通株式</b>			
	米国		
16,313	GreenSky Inc 'A'	150,569	0.01
		150,569	0.01
<b>普通株式合計</b>		150,569	0.01
<b>債券</b>			
	米国		
USD 2,500,000	Federal Home Loan Banks 1.375% 18/3/2019	2,492,325	0.22
USD 8,000,000	United States Treasury Bill 18/12/2018 (Zero Coupon)	7,991,740	0.71
USD 27,000,000	United States Treasury Bill 20/12/2018 (Zero Coupon)	26,969,633	2.38
USD 50,000,000	United States Treasury Bill 26/12/2018 (Zero Coupon)	49,921,493	4.41
USD 53,000,000	United States Treasury Bill 22/1/2019 (Zero Coupon)	52,823,310	4.66
USD 50,000,000	United States Treasury Bill 31/1/2019 (Zero Coupon)	49,805,774	4.40
		190,004,275	16.78
<b>債券合計</b>		190,004,275	16.78
<b>譲渡性預金証書</b>			
	カナダ		
USD 10,000,000	Bank of Montreal 2.516% 7/5/2019	10,000,000	0.88
USD 3,300,000	Royal Bank of Canada/New York 3.07% 27/11/2019	3,300,000	0.29
USD 7,000,000	Toronto-Dominion Bank/New York 2.62% 14/6/2019	7,000,000	0.62
USD 3,000,000	Toronto-Dominion Bank/New York 2.73% 7/8/2019	3,000,000	0.27
		23,300,000	2.06
	日本		
USD 15,150,000	Mizuho Bank Ltd/New York 2.45% 31/1/2019	15,150,000	1.34
USD 30,000,000	Mizuho Bank Ltd/New York 2.508% 9/4/2019	30,000,000	2.65
USD 6,500,000	Norinchukin Bank/New York 2.30% 12/12/2018	6,500,000	0.57
USD 13,000,000	Sumitomo Mitsui Banking Corp/New York 2.51% 1/3/2019	12,999,994	1.15
USD 14,000,000	Sumitomo Mitsui Banking Corp/New York 2.75% 4/3/2019	14,000,000	1.23
		78,649,994	6.94
	米国		
USD 10,000,000	Citibank NA/New York 2.70% 21/2/2019	10,000,000	0.88
USD 4,000,000	Wells Fargo Bank NA 2.658% 5/4/2019	4,000,000	0.35
USD 8,000,000	Wells Fargo Bank NA 3.08% 1/11/2019	8,000,000	0.71
		22,000,000	1.94
<b>譲渡性預金証書合計</b>		123,949,994	10.94
<b>コマーシャル・ペーパー</b>			
	オーストラリア		
USD 6,200,000	Westpac Banking Corp 1/11/2019 (Zero Coupon)	6,026,340	0.53
		6,026,340	0.53

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
カナダ			
USD 15,400,000	Total Capital Canada Ltd 4/12/2018 (Zero Coupon)	15,397,138	1.36
		15,397,138	1.36
フランス			
USD 10,000,000	Natixis 18/12/2018 (Zero Coupon)	9,989,139	0.88
USD 5,000,000	Natixis 19/12/2018 (Zero Coupon)	4,993,850	0.44
		14,982,989	1.32
アイルランド			
USD 6,000,000	Matchpoint Finance Plc 8/1/2019 (Zero Coupon)	5,984,610	0.53
USD 14,200,000	Matchpoint Finance Plc '144A' 19/2/2019 (Zero Coupon)	14,115,431	1.25
		20,100,041	1.78
日本			
USD 6,750,000	Mizuho Corporate Bank/New York 30/5/2019 (Zero Coupon)	6,652,125	0.59
		6,652,125	0.59
ジャージー			
USD 9,450,000	Cancara Asset Secur LLC 18/12/2018 (Zero Coupon)	9,439,602	0.84
USD 19,400,000	Cancara Asset Secur LLC 3/5/2019 (Zero Coupon)	19,164,193	1.69
		28,603,795	2.53
ルクセンブルグ			
USD 2,500,000	Banque et Caisse d' Epargne de l' Etat 14/2/2019 (Zero Coupon)	2,487,448	0.22
		2,487,448	0.22
シンガポール			
USD 12,000,000	DBS Bank Ltd 5/4/2019 (Zero Coupon)	11,890,625	1.05
USD 2,500,000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd 20/2/2019 (Zero Coupon)	2,484,644	0.22
		14,375,269	1.27
スウェーデン			
USD 7,050,000	Nordea Bank AB 14/12/2018 (Zero Coupon)	7,044,043	0.62
USD 5,000,000	Swedbank AB 3/12/2018 (Zero Coupon)	4,999,362	0.44
USD 460,000	Swedbank AB 26/12/2018 (Zero Coupon)	459,249	0.04
USD 5,000,000	Swedbank AB 4/3/2019 (Zero Coupon)	4,967,192	0.44
		17,469,846	1.54
英国			
USD 18,300,000	Standard Chartered Bank 17/12/2018 (Zero Coupon)	18,280,561	1.61
		18,280,561	1.61
米国			
USD 14,550,000	Barton Capital SA 12/12/2018 (Zero Coupon)	14,539,597	1.28
USD 1,790,000	Bedford Row Funding Corp 25/4/2019 (Zero Coupon)	1,771,255	0.16
USD 6,500,000	Bedford Row Funding Corp 30/7/2019 (Zero Coupon)	6,371,634	0.56
USD 21,000,000	Cafco LLC 12/12/2018 (Zero Coupon)	20,985,370	1.85
USD 7,700,000	Cafco LLC 13/12/2018 (Zero Coupon)	7,694,122	0.68
USD 25,000,000	Cafco LLC 19/12/2018 (Zero Coupon)	24,971,375	2.20
USD 2,400,000	Cafco LLC 25/3/2019 (Zero Coupon)	2,379,100	0.21



公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 2,000,000	Caisse Des Depots Et Consignations 24/1/2019 (Zero Coupon)	1,992,830	0.18
USD 36,300,000	Ciesco LLC 18/3/2019 (Zero Coupon)	36,005,456	3.18
USD 24,900,000	Coca-Cola Co/The 19/12/2018 (Zero Coupon)	24,872,361	2.20
USD 10,000,000	CRC Funding LLC 9/5/2019 (Zero Coupon)	9,875,450	0.87
USD 12,250,000	Crown Point Capital Co LLC 4/3/2019 (Zero Coupon)	12,168,987	1.07
USD 46,500,000	Crown Point Capital Co LLC 7/12/2018 (Zero Coupon)	46,482,175	4.10
USD 7,950,000	HSBC Bank Plc 2.65% 11/4/2019	7,950,000	0.70
USD 10,000,000	ING US Funding LLC 21/2/2019 (Zero Coupon)	9,944,194	0.88
USD 2,100,000	ING US Funding LLC 16/8/2019 (Zero Coupon)	2,056,054	0.18
USD 9,250,000	JP Morgan Securities LLC 22/2/2019 (Zero Coupon)	9,197,111	0.81
USD 15,200,000	JP Morgan Securities LLC 20/3/2019 (Zero Coupon)	15,082,643	1.33
USD 21,450,000	Jupiter Securitization Company LLC 4/12/2018 (Zero Coupon)	21,445,871	1.89
USD 9,000,000	La Fayette Asset Securitization LLC 17/12/2018 (Zero Coupon)	8,990,400	0.79
USD 27,700,000	LMA Americas LLC 4/12/2018 (Zero Coupon)	27,694,760	2.45
USD 15,000,000	LMA Americas LLC 6/12/2018 (Zero Coupon)	14,995,375	1.32
USD 5,000,000	LMA Americas LLC 1/2/2019 (Zero Coupon)	4,978,472	0.44
USD 18,527,000	Macquarie Bank Ltd 6/12/2018 (Zero Coupon)	18,521,030	1.64
USD 18,400,000	Macquarie Bank Ltd 12/2/2019 (Zero Coupon)	18,298,514	1.62
USD 5,750,000	Metlife Short Term Fund 17/12/2018 (Zero Coupon)	5,744,199	0.51
USD 25,100,000	Metlife Short Term Fund 26/12/2018 (Zero Coupon)	25,059,735	2.21
USD 28,800,000	Metlife Short Term Fund 28/1/2019 (Zero Coupon)	28,683,536	2.53
USD 25,000,000	Mitsubishi UFJ Trust And Banking Corp 6/12/2018 (Zero Coupon)	24,992,014	2.21
USD 14,000,000	Mont Blanc Capital Corp 11/12/2018 (Zero Coupon)	13,990,978	1.24
USD 12,000,000	Mont Blanc Capital Corp 15/1/2019 (Zero Coupon)	11,963,850	1.06
USD 9,000,000	National Securities Clearing Corp 28/1/2019 (Zero Coupon)	8,963,125	0.79
USD 16,050,000	Nieuw Amsterdam Receivables Corp 22/1/2019 (Zero Coupon)	15,991,114	1.41
USD 399,000	Nieuw Amsterdam Receivables Corp 25/1/2019 (Zero Coupon)	397,446	0.04
USD 30,000,000	Nieuw Amsterdam Receivables Corp 21/2/2019 (Zero Coupon)	29,815,500	2.63
USD 3,800,000	Old Line Funding LLC 5/6/2019 (Zero Coupon)	3,746,990	0.33
USD 2,175,000	Ontario Teacher ' ' s Finance Trusts 24/4/2019 (Zero Coupon)	2,152,815	0.19
USD 34,150,000	Regency Markets No1 LLC 5/12/2018 (Zero Coupon)	34,141,235	3.01
USD 5,500,000	Ridgefield Funding Co LLC 5/12/2018 (Zero Coupon)	5,498,558	0.49
USD 5,850,000	Ridgefield Funding Co LLC 10/12/2018 (Zero Coupon)	5,846,549	0.52
USD 15,000,000	Thunder Bay Funding LLC 4/12/2018 (Zero Coupon)	14,997,150	1.32
USD 13,000,000	Toronto-Dominion Bank/The 2.866% 13/6/2019	13,000,000	1.15
USD 7,500,000	Toyota Motor Credit Corp 21/12/2018 (Zero Coupon)	7,490,333	0.66
USD 16,500,000	Toyota Motor Credit Corp 24/12/2018 (Zero Coupon)	16,475,543	1.45
USD 12,600,000	Toyota Motor Credit Corp 13/6/2019 (Zero Coupon)	12,420,065	1.10
USD 7,000,000	UBS AG/London 2.738% 4/4/2019	7,000,000	0.62

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 9,450,000	United Overseas Bank Ltd 17/5/2019 (Zero Coupon)	9,323,748	0.82
USD 19,950,000	Victory Receivables Corp 20/12/2018 (Zero Coupon)	19,925,572	1.76
USD 12,000,000	Westpac Banking Corp 2.483% 19/8/2019	12,000,000	1.06
USD 10,000,000	Westpac Banking Corp 2.762% 31/10/2019	10,000,000	0.88
		708,884,191	62.58
コマーシャル・ペーパー合計		853,259,743	75.33
公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品合計		1,167,364,581	103.06
投資有価証券(時価)合計		1,167,364,581	103.06
その他の純負債		(34,646,587)	(3.06)
純資産合計(米ドル)		1,132,717,994	100.00

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

差金決済契約 2018年11月30日現在

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益 / (損) (米ドル)
	ブラジル		
573,988	AES Tiete Energia SA (Unit)	Morgan Stanley	(23,984)
219,074	AES Tiete Energia SA (Unit)	Goldman Sachs	(19,558)
13,100	Agrenco Ltd	Morgan Stanley	(550)
(254,145)	Aliansce Shopping Centers SA	Goldman Sachs	56,354
(238,100)	Aliansce Shopping Centers SA	Morgan Stanley	9,764
(205,166)	Alliar Medicos A Frente SA	Goldman Sachs	(50,092)
(378,517)	Alliar Medicos A Frente SA	Morgan Stanley	(69,778)
(38,300)	Alpargatas SA (Pref)	Goldman Sachs	3,566
(50,900)	Alpargatas SA (Pref)	Morgan Stanley	(3,430)
(64,379)	Alupar Investimento SA (Unit)	Goldman Sachs	25,178
(800,435)	Alupar Investimento SA (Unit)	Morgan Stanley	36,623
271,600	Ambev SA	Morgan Stanley	(3,468)
(53,714)	Anima Holding SA	Goldman Sachs	16,369
(50,950)	Anima Holding SA	Morgan Stanley	12,307
(27,500)	Arezzo Industria e Comercio SA	Goldman Sachs	4,855
(95,191)	Arezzo Industria e Comercio SA	Morgan Stanley	29,661
(332,200)	Atacadao Distribuicao Comercio e Industria Ltda	Goldman Sachs	(5,442)
(217,200)	Atacadao Distribuicao Comercio e Industria Ltda	Morgan Stanley	(21,985)
(123,700)	B2W Cia Digital	Goldman Sachs	(70,555)
(163,000)	B2W Cia Digital	Morgan Stanley	(63,064)
(109,400)	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	Morgan Stanley	(37,203)
(199,400)	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	Goldman Sachs	(7,406)
115,156	Banco ABC Brasil SA (Pref)	Goldman Sachs	(22,336)
73,075	Banco ABC Brasil SA (Pref)	Morgan Stanley	2,629
203,100	Banco BTG Pactual SA (Unit)	Goldman Sachs	(40,787)
248,314	Banco BTG Pactual SA (Unit)	Morgan Stanley	(14,145)
275,200	Banco do Brasil SA	Morgan Stanley	(17,288)
223,400	Banco do Estado do Rio Grande do Sul SA (Pref)	Goldman Sachs	42,570
165,699	Banco do Estado do Rio Grande do Sul SA (Pref)	Morgan Stanley	25,073
(10,200)	Banco Inter SA (Pref)	Goldman Sachs	(8,540)
(12,800)	Banco Inter SA (Pref)	Morgan Stanley	(15,170)
98,900	Banco Santander Brasil SA (Unit)	Goldman Sachs	(17,272)
82,400	Banco Santander Brasil SA (Unit)	Morgan Stanley	28,127
(694,400)	BB Seguridade Participacoes SA	Goldman Sachs	(40,984)
(485,300)	BB Seguridade Participacoes SA	Morgan Stanley	(163,221)
(184,743)	BK Brasil Operacao e Assessoria a Restaurantes SA	Goldman Sachs	7,252
(255,069)	BK Brasil Operacao e Assessoria a Restaurantes SA	Morgan Stanley	(29,075)
(993,811)	BR Malls Participacoes SA	Goldman Sachs	14,744
(204,060)	BR Malls Participacoes SA	Morgan Stanley	(24,200)
(75,743)	BR Properties SA	Goldman Sachs	5,709

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	ブラジル(続き)		
(325,468)	BR Properties SA	Morgan Stanley	14,979
38,000	Braskem SA (Pref)	Goldman Sachs	(1,463)
44,900	Braskem SA (Pref)	Morgan Stanley	(2,074)
(385,200)	BRF SA	Morgan Stanley	29,963
(3,100)	BRF SA	Goldman Sachs	(1,272)
94,100	Camil Alimentos SA	Goldman Sachs	(31,021)
196,200	Camil Alimentos SA	Morgan Stanley	(29,645)
68,800	CCR SA	Goldman Sachs	23,041
(241,300)	Centrais Eletricas Brasileiras SA	Morgan Stanley	26,279
(2,900)	Centrais Eletricas Brasileiras SA	Goldman Sachs	876
14,200	Cia Brasileira de Distribuicao (Pref)	Goldman Sachs	(7,375)
26,800	Cia Brasileira de Distribuicao (Pref)	Morgan Stanley	7,125
16,809	Cia de Gas de Sao Paulo - COMGAS (Pref)	Goldman Sachs	(9,481)
10,600	Cia de Gas de Sao Paulo - COMGAS (Pref)	Morgan Stanley	(4,129)
(13,800)	Cia de Locacao das Americas	Morgan Stanley	(13,396)
96,200	Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo	Goldman Sachs	(18,812)
185,500	Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo	Morgan Stanley	7,813
159,100	Cia de Saneamento de Minas Gerais-COPASA	Morgan Stanley	(77,730)
145,322	Cia de Saneamento de Minas Gerais-COPASA	Goldman Sachs	(31,282)
248,539	Cia de Saneamento do Parana (Pref)	Morgan Stanley	8,156
336,193	Cia de Saneamento do Parana (Pref)	Goldman Sachs	(22,876)
118,000	Cia de Saneamento do Parana (Unit)	Morgan Stanley	86,056
141,331	Cia de Saneamento do Parana (Unit)	Goldman Sachs	66,513
242,375	Cia Ferro Ligas da Bahia - FERBASA (Pref)	Morgan Stanley	26,366
173,574	Cia Ferro Ligas da Bahia - FERBASA (Pref)	Goldman Sachs	4,192
276,500	Cia Hering	Goldman Sachs	(54,952)
156,519	Cia Hering	Morgan Stanley	(5,435)
(449,100)	Cia Siderurgica Nacional SA	Goldman Sachs	123,121
(219,400)	Cia Siderurgica Nacional SA	Morgan Stanley	10,614
(113,700)	Cielo SA	Goldman Sachs	26,300
(380,952)	Cielo SA	Morgan Stanley	23,921
245,100	Construtora Tenda SA	Goldman Sachs	(41,895)
184,239	Construtora Tenda SA	Morgan Stanley	4,792
(361,046)	Cosan Logistica SA	Goldman Sachs	16,276
(284,077)	Cosan Logistica SA	Morgan Stanley	28,628
5,300	Cosan SA	Morgan Stanley	1,136
(280,200)	CVC Brasil Operadora e Agencia de Viagens SA	Goldman Sachs	(48,033)
(37,100)	CVC Brasil Operadora e Agencia de Viagens SA	Morgan Stanley	(18,204)
(28,500)	Cyrela Brazil Realty SA Empreendimentos e Participacoes	Morgan Stanley	5,789
(119,700)	Cyrela Brazil Realty SA Empreendimentos e Participacoes	Goldman Sachs	32,139
(846,493)	Direcional Engenharia SA	Goldman Sachs	13,136
(1,144,073)	Direcional Engenharia SA	Morgan Stanley	(9,671)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	ブラジル(続き)		
(4,000)	Duratex SA	Goldman Sachs	1,027
(284,500)	Duratex SA	Morgan Stanley	46,676
785,100	EcoRodovias Infraestrutura e Logistica SA	Morgan Stanley	5,759
848,900	EcoRodovias Infraestrutura e Logistica SA	Goldman Sachs	22,088
(44,100)	Embraer SA	Goldman Sachs	(5,598)
(10,500)	Embraer SA	Morgan Stanley	(627)
13,934	Energisa SA (Right)	Goldman Sachs	12,984
13,520	Energisa SA (Right)	Morgan Stanley	4,266
276,580	Energisa SA (Unit)	Goldman Sachs	16,377
270,400	Energisa SA (Unit)	Morgan Stanley	72,529
8,100	Eneva SA	Goldman Sachs	(238)
8,000	Eneva SA	Morgan Stanley	699
(136,769)	Engie Brasil Energia SA	Goldman Sachs	(12,566)
(203,300)	Engie Brasil Energia SA	Morgan Stanley	(88,330)
(363,113)	Equatorial Energia SA	Goldman Sachs	40,019
(79,451)	Equatorial Energia SA	Morgan Stanley	(8,604)
407,700	Estacio Participacoes SA	Goldman Sachs	113,810
396,900	Estacio Participacoes SA	Morgan Stanley	152,402
(268,800)	Even Construtora e Incorporadora SA	Goldman Sachs	(209)
(205,522)	Even Construtora e Incorporadora SA	Morgan Stanley	18,028
(40,100)	Ez Tec Empreendimentos e Participacoes SA	Goldman Sachs	10,402
(65,600)	Ez Tec Empreendimentos e Participacoes SA	Morgan Stanley	15,708
14,300	Fleury SA	Goldman Sachs	723
314,400	Fleury SA	Morgan Stanley	91,485
261,400	Gerdau SA (Pref)	Morgan Stanley	(42,969)
225,000	Gerdau SA (Pref)	Goldman Sachs	(103,110)
(48,300)	Gol Linhas Aereas Inteligentes SA (Pref)	Goldman Sachs	(4,071)
183,771	Grendene SA	Goldman Sachs	(10,608)
710,184	Grendene SA	Morgan Stanley	(6,990)
(3,700)	Guararapes Confecoes SA	Morgan Stanley	(1,065)
48,000	Hapvida Participacoes e Investimentos SA '144A'	Morgan Stanley	13,386
42,000	Hapvida Participacoes e Investimentos SA '144A'	Goldman Sachs	(973)
78,900	Hypera SA	Morgan Stanley	31,005
270,000	Hypera SA	Goldman Sachs	108,167
(29,900)	Iguatemi Empresa de Shopping Centers SA	Goldman Sachs	13,926
(241,200)	Iguatemi Empresa de Shopping Centers SA	Morgan Stanley	66,964
(122,700)	Instituto Hermes Pardini SA	Goldman Sachs	17,484
(158,800)	Instituto Hermes Pardini SA	Morgan Stanley	47,607
192,171	International Meal Co Alimentacao SA	Goldman Sachs	(17,256)
169,108	International Meal Co Alimentacao SA	Morgan Stanley	(23,786)
198,387	Ioche Maxion SA	Goldman Sachs	7,359
121,814	Ioche Maxion SA	Morgan Stanley	35,992
41,718	IRB Brasil Resseguros S/A	Goldman Sachs	7,418
346,530	Itausa - Investimentos Itau SA (Pref)	Goldman Sachs	3,685

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	ブラジル(続き)		
501,720	Itausa - Investimentos Itau SA (Pref)	Morgan Stanley	51,381
471,500	JBS SA	Morgan Stanley	75,345
701,500	JBS SA	Goldman Sachs	64,799
(600,512)	Klabin SA (Unit)	Morgan Stanley	140,559
(141,100)	Klabin SA (Unit)	Goldman Sachs	49,500
536,100	Kroton Educacional SA	Goldman Sachs	(129,583)
13,700	Laep Investments Ltd	Goldman Sachs	(1,023)
24,300	Laep Investments Ltd	Morgan Stanley	(1,784)
(151,500)	Linx SA	Goldman Sachs	(60,158)
(149,698)	Linx SA	Morgan Stanley	(40,544)
(611,300)	Localiza Rent a Car SA	Goldman Sachs	214,288
(124,200)	Localiza Rent a Car SA	Morgan Stanley	31,401
(1,227,000)	Lojas Americanas SA (Pref)	Morgan Stanley	(378,958)
(33,400)	Lojas Americanas SA (Pref)	Goldman Sachs	(8,469)
140,000	Lojas Renner SA	Morgan Stanley	(12,542)
(4,700)	M Dias Branco SA	Goldman Sachs	3,669
(7,200)	M Dias Branco SA	Morgan Stanley	5,054
13,100	Magazine Luiza SA	Morgan Stanley	10,446
38,843	Magnesita Refratarios SA	Morgan Stanley	15,841
75,076	Magnesita Refratarios SA	Goldman Sachs	(18,483)
(142,100)	Mahle-Metal Leve SA	Goldman Sachs	32,106
(92,100)	Mahle-Metal Leve SA	Morgan Stanley	(2,363)
(680,500)	Marcopolo SA (Pref)	Goldman Sachs	47,325
(1,446,900)	Marcopolo SA (Pref)	Morgan Stanley	43,691
(497,400)	Marfrig Global Foods SA	Goldman Sachs	39,220
(345,100)	Marfrig Global Foods SA	Morgan Stanley	22,183
(122,800)	Marisa Lojas SA	Goldman Sachs	23,794
(109,354)	Marisa Lojas SA	Morgan Stanley	16,623
76,900	Metalurgica Gerdau SA (Pref)	Morgan Stanley	(6,293)
1,297,500	Metalurgica Gerdau SA (Pref)	Goldman Sachs	(338,152)
276,700	Minerva SA/Brazil	Goldman Sachs	(43,516)
136,100	Minerva SA/Brazil	Morgan Stanley	(11,111)
(240,900)	Movida Participacoes SA	Goldman Sachs	33,705
(225,600)	Movida Participacoes SA	Morgan Stanley	12,815
504,813	MRV Engenharia e Participacoes SA	Morgan Stanley	(32,468)
544,600	MRV Engenharia e Participacoes SA	Goldman Sachs	(85,983)
(433,940)	Multiplan Empreendimentos Imobiliarios SA	Morgan Stanley	9,216
(274,709)	Multiplan Empreendimentos Imobiliarios SA	Goldman Sachs	36,456
(84,900)	Natura Cosméticos SA	Goldman Sachs	(68,872)
(307,400)	Natura Cosméticos SA	Morgan Stanley	(178,835)
(11,900)	Notre Dame Intermedica Participacoes SA	Goldman Sachs	1,889
(52,200)	Notre Dame Intermedica Participacoes SA	Morgan Stanley	(11,018)
(80,700)	Odontoprev SA	Morgan Stanley	14,639
(155,800)	Odontoprev SA	Goldman Sachs	10,822
402,700	Oi SA	Goldman Sachs	(84,862)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	ブラジル(続き)		
623,458	Oi SA (Right)	Goldman Sachs	35,307
(301,942)	Omega Geracao SA	Goldman Sachs	46,017
(184,109)	Omega Geracao SA	Morgan Stanley	15,176
(19,851)	Petro Rio SA	Morgan Stanley	42,480
(5,000)	Petro Rio SA	Goldman Sachs	17,847
134,000	Petrobras Distribuidora SA	Morgan Stanley	17,495
251,700	Petrobras Distribuidora SA	Goldman Sachs	104,188
120,000	Porto Seguro SA	Goldman Sachs	(96,651)
139,600	Porto Seguro SA	Morgan Stanley	(55,532)
310,500	QGEP Participacoes SA	Goldman Sachs	(103,142)
194,500	QGEP Participacoes SA	Morgan Stanley	(36,481)
493,700	Qualicorp Consultoria e Corretora de Seguros SA	Goldman Sachs	(85,309)
321,100	Qualicorp Consultoria e Corretora de Seguros SA	Morgan Stanley	(1,720)
(153,200)	Raia Drogasil SA	Goldman Sachs	234,195
(213,600)	Raia Drogasil SA	Morgan Stanley	93,794
(28,783)	Randon SA Implementos e Participacoes (Pref)	Morgan Stanley	(46)
(18,900)	Randon SA Implementos e Participacoes (Pref)	Goldman Sachs	1,347
(694,438)	Rumo SA	Goldman Sachs	115,804
(1,080,841)	Rumo SA	Morgan Stanley	148,256
(85,400)	Santos Brasil Participacoes SA	Goldman Sachs	11
(389,925)	Santos Brasil Participacoes SA	Morgan Stanley	(11,763)
358,046	Sao Martinho SA	Goldman Sachs	(151,616)
546,217	Sao Martinho SA	Morgan Stanley	(89,556)
(86,500)	Ser Educacional SA '144A'	Goldman Sachs	14,678
(123,500)	Ser Educacional SA '144A'	Morgan Stanley	10,587
143,216	SLC Agricola SA	Morgan Stanley	(155,101)
159,800	SLC Agricola SA	Goldman Sachs	(290,568)
94,200	Smiles Fidelidade SA	Morgan Stanley	76,175
75,288	Smiles Fidelidade SA	Goldman Sachs	75,222
(56,785)	Somos Educacao SA	Goldman Sachs	12,761
23,921	Sonae Sierra Brasil SA	Goldman Sachs	654
5,300	Sonae Sierra Brasil SA	Morgan Stanley	1,109
1,254,624	Sul America SA (Unit)	Morgan Stanley	414,607
6,000	Suzano Papel e Celulose SA	Goldman Sachs	927
151,000	Suzano Papel e Celulose SA	Morgan Stanley	75,737
177,987	Tegma Gestao Logistica SA	Morgan Stanley	(60,264)
367,765	Tegma Gestao Logistica SA	Goldman Sachs	(205,589)
41,400	Telefonica Brasil SA (Pref)	Morgan Stanley	1,082
29,700	Telefonica Brasil SA (Pref)	Goldman Sachs	(6,354)
103,100	TIM Participacoes SA	Goldman Sachs	(8,059)
538,700	TIM Participacoes SA	Morgan Stanley	52,205
60,400	TOTVS SA	Morgan Stanley	37,319
41,200	TOTVS SA	Goldman Sachs	26,136

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	ブラジル(続き)		
670,321	Transmissora Alianca de Energia Eletrica SA (Unit)	Morgan Stanley	(121,970)
711,100	Transmissora Alianca de Energia Eletrica SA (Unit)	Goldman Sachs	(209,620)
16,300	Tupy SA	Morgan Stanley	(4,295)
6,200	Tupy SA	Goldman Sachs	(2,306)
(180,200)	Ultrapar Participacoes SA	Goldman Sachs	(133,943)
(82,400)	Unipar Carbocloro SA (Pref)	Morgan Stanley	3,845
(15,600)	Unipar Carbocloro SA (Pref)	Goldman Sachs	13,707
(1,777,800)	Usinas Siderurgicas de Minas Gerais SA (Pref)	Goldman Sachs	375,267
(63,560)	Valid Solucoes e Servicos de Seguranca em Meios de Pagamento e Identificacao SA	Goldman Sachs	1,816
(145,223)	Valid Solucoes e Servicos de Seguranca em Meios de Pagamento e Identificacao SA	Morgan Stanley	10,585
(26,100)	Via Varejo SA	Morgan Stanley	(881)
48,958	Vulcabras Azaleia SA	Morgan Stanley	(6,980)
24,200	Vulcabras Azaleia SA	Goldman Sachs	(3,374)
(419,179)	WEG SA	Morgan Stanley	(4,250)
(86,100)	Wiz Solucoes e Corretagem de Seguros SA	Goldman Sachs	12,727
(269,300)	Wiz Solucoes e Corretagem de Seguros SA	Morgan Stanley	24,746
			120,877
	カナダ		
(115,052)	Advantage Oil & Gas Ltd	Morgan Stanley	54,841
(39,062)	Advantage Oil & Gas Ltd	Goldman Sachs	23,248
38,714	Aecon Group Inc	Goldman Sachs	(10,028)
141,779	Aecon Group Inc	Morgan Stanley	(17,426)
(2,776)	Ag Growth International Inc	Goldman Sachs	2,052
(30,198)	Ag Growth International Inc	Morgan Stanley	(2,635)
(50,772)	AGF Management Ltd ' B '	Morgan Stanley	5,784
2,583	Agnico Eagle Mines Ltd	Goldman Sachs	(2,231)
5,918	Agnico Eagle Mines Ltd	Morgan Stanley	(20,514)
5,980	AGT Food & Ingredients Inc	Morgan Stanley	(1,479)
6,116	AGT Food & Ingredients Inc	Goldman Sachs	(8,139)
(2,287)	Aimia Inc	Goldman Sachs	440
(57,557)	Aimia Inc	Morgan Stanley	11,690
(2,165)	Air Canada	Goldman Sachs	(4,836)
(47,276)	Air Canada	Morgan Stanley	(128,584)
(43,124)	AirBoss of America Corp	Morgan Stanley	(25,169)
33,473	AKITA Drilling Ltd ' A '	Morgan Stanley	(10,221)
93,984	Alacer Gold Corp	Goldman Sachs	(9,115)
17,546	Alacer Gold Corp	Morgan Stanley	(769)
50,383	Alamos Gold Inc ' A '	Morgan Stanley	(19,584)
45,984	Alamos Gold Inc ' A '	Goldman Sachs	(19,893)
6,012	Alaris Royalty Corp	Goldman Sachs	4,076
84,374	Alaris Royalty Corp	Morgan Stanley	(12,989)
14,880	Alcanna Inc	Morgan Stanley	(5,270)



保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
カナダ(続き)			
(49,088)	Algonquin Power & Utilities Corp	Morgan Stanley	(242)
36,876	Alimentation Couche-Tard Inc 'B'	Goldman Sachs	98,641
60,414	Alimentation Couche-Tard Inc 'B'	Morgan Stanley	185,402
(30,358)	Allied Properties Real Estate Investment Trust (Reit)	Goldman Sachs	(14,758)
(50,369)	Allied Properties Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	12,701
(26,766)	AltaGas Ltd	Goldman Sachs	35,777
(141,751)	AltaGas Ltd	Morgan Stanley	234,153
22,733	Altius Minerals Corp	Goldman Sachs	(4,027)
108,307	Altius Minerals Corp	Morgan Stanley	438
(27,638)	Altus Group Ltd/Canada	Goldman Sachs	(39,235)
(79,121)	Altus Group Ltd/Canada	Morgan Stanley	(42,592)
4,531	Aphria Inc	Morgan Stanley	(4,234)
(57,810)	ARC Resources Ltd	Goldman Sachs	68,363
(37,979)	ARC Resources Ltd	Morgan Stanley	49,259
58,091	Aritzia Inc	Morgan Stanley	(47,136)
46,318	Aritzia Inc	Goldman Sachs	(37,948)
56	Arrow Exploration Corp	Morgan Stanley	(11)
(3,136)	Artis Real Estate Investment Trust (Reit)	Goldman Sachs	545
(73,003)	Artis Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	12,721
(19,793)	Atco Ltd/Canada 'I'	Goldman Sachs	(1,325)
(79,307)	Atco Ltd/Canada 'I'	Morgan Stanley	27,211
2,333	Atlantic Power Corp	Goldman Sachs	70
154,390	Atlantic Power Corp	Morgan Stanley	8,937
7,325	ATS Automation Tooling Systems Inc	Goldman Sachs	(2,764)
1,584	Aurinia Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	987
(5,449)	Aurora Cannabis Inc	Goldman Sachs	5,449
(5,295)	Aurora Cannabis Inc	Morgan Stanley	2,327
(21,554)	AutoCanada Inc	Goldman Sachs	(13,958)
(26,294)	AutoCanada Inc	Morgan Stanley	(481)
(29,695)	B2Gold Corp	Morgan Stanley	9,585
7,542	Badger Daylighting Ltd	Goldman Sachs	9,414
9,214	Badger Daylighting Ltd	Morgan Stanley	2,115
17,455	Bank of Montreal	Goldman Sachs	(15,280)
49,453	Bank of Montreal	Morgan Stanley	21,634
16,703	Bank of Nova Scotia/The	Goldman Sachs	14,228
18,984	Bank of Nova Scotia/The	Morgan Stanley	30,032
(37,392)	Barrick Gold Corp	Goldman Sachs	9,586
(27,823)	Barrick Gold Corp	Morgan Stanley	28,359
(2,150)	Bausch Health Cos Inc	Goldman Sachs	2,807
(13,548)	Bausch Health Cos Inc	Morgan Stanley	(19,018)
56,006	Baytex Energy Corp	Goldman Sachs	(1,152)
59,987	Baytex Energy Corp	Morgan Stanley	(4,984)
4,152	BCE Inc	Goldman Sachs	5,130
4,841	BCE Inc	Morgan Stanley	4,085

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	カナダ(続き)		
22,299	Bellatrix Exploration Ltd	Morgan Stanley	(2,335)
10,145	Birchcliff Energy Ltd	Goldman Sachs	(3,566)
110,819	Birchcliff Energy Ltd	Morgan Stanley	(51,887)
(204,509)	Bird Construction Inc	Morgan Stanley	57,719
(10,026)	BlackBerry Ltd	Goldman Sachs	(431)
(30,997)	BlackBerry Ltd	Morgan Stanley	2,000
11,546	Boardwalk Real Estate Investment Trust (Reit)	Goldman Sachs	(28,755)
18,605	Boardwalk Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	(119,460)
(202,462)	Bombardier Inc 'B'	Morgan Stanley	40,339
(25,580)	Bombardier Inc 'B'	Goldman Sachs	(1,211)
240,475	Bonavista Energy Corp	Morgan Stanley	(16,373)
(34,096)	Bonterra Energy Corp	Goldman Sachs	73,479
(29,914)	Bonterra Energy Corp	Morgan Stanley	58,141
(150,292)	Boralex Inc 'A'	Morgan Stanley	(2,941)
(37,207)	Boralex Inc 'A'	Goldman Sachs	(15,598)
3,683	Brookfield Asset Management Inc 'A'	Goldman Sachs	301
66,381	Brookfield Asset Management Inc 'A'	Morgan Stanley	64,128
15,975	Brookfield Business Partners LP	Morgan Stanley	(13,750)
4,486	Brookfield Business Partners LP	Goldman Sachs	(8,982)
49,194	Brookfield Infrastructure Partners LP	Morgan Stanley	(76,523)
59,416	Brookfield Property Partners LP	Morgan Stanley	(46,731)
76,319	Brookfield Renewable Partners LP	Morgan Stanley	15,776
17,095	BRP Inc	Morgan Stanley	25,150
12,507	BRP Inc	Goldman Sachs	(24,462)
32,351	CAE Inc	Goldman Sachs	(1,166)
85,845	CAE Inc	Morgan Stanley	933
(30,814)	Cameco Corp	Goldman Sachs	3,498
(45,368)	Cameco Corp	Morgan Stanley	3,658
1,533	Canaccord Genuity Group Inc	Goldman Sachs	(459)
18,128	Canaccord Genuity Group Inc	Morgan Stanley	(3,741)
(225,587)	Canacol Energy Ltd	Morgan Stanley	32,906
(6,630)	Canada Goose Holdings Inc	Morgan Stanley	(1,309)
24,748	Canadian Apartment Properties REIT (Reit)	Goldman Sachs	(4,959)
92,586	Canadian Apartment Properties REIT (Reit)	Morgan Stanley	(6,881)
5,408	Canadian Imperial Bank of Commerce	Goldman Sachs	(16,389)
24,548	Canadian Imperial Bank of Commerce	Morgan Stanley	(52,144)
(36,463)	Canadian National Railway Co	Morgan Stanley	(36,601)
(11,882)	Canadian National Railway Co	Goldman Sachs	(9,470)
44,220	Canadian Natural Resources Ltd	Goldman Sachs	(107,680)
40,487	Canadian Natural Resources Ltd	Morgan Stanley	(100,975)
1,380	Canadian Pacific Railway Ltd	Goldman Sachs	3,282
11,611	Canadian Pacific Railway Ltd	Morgan Stanley	77,155
(10,520)	Canadian Tire Corp Ltd 'A'	Morgan Stanley	(2,878)
(127,038)	Canadian Utilities Ltd 'A'	Morgan Stanley	98,102

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	カナダ(続き)		
(45,356)	Canadian Utilities Ltd 'A'	Goldman Sachs	24,274
(5,813)	Canadian Western Bank	Goldman Sachs	7,007
(86,829)	Canadian Western Bank	Morgan Stanley	58,144
42,205	Canfor Corp	Goldman Sachs	5,718
72,061	Canfor Corp	Morgan Stanley	(37,028)
568	Canfor Pulp Products Inc	Goldman Sachs	(156)
11,310	Canfor Pulp Products Inc	Morgan Stanley	2,968
(3,446)	Canopy Growth Corp	Goldman Sachs	8,122
(3,666)	Canopy Growth Corp	Morgan Stanley	2,840
4,529	CanWel Building Materials Group Ltd	Morgan Stanley	73
118,319	Capital Power Corp	Morgan Stanley	(31,232)
2,871	Cargojet Inc	Goldman Sachs	(1,996)
14,611	Cargojet Inc	Morgan Stanley	11,341
(30,047)	Cascades Inc	Morgan Stanley	(25,428)
(42,874)	CCL Industries Inc 'B'	Morgan Stanley	(84,738)
(31,729)	CCL Industries Inc 'B'	Goldman Sachs	(439)
(27,617)	Celestica Inc	Goldman Sachs	(11,343)
(36,016)	Celestica Inc	Morgan Stanley	(13,872)
(141,646)	Cenovus Energy Inc	Morgan Stanley	69,374
(12,201)	Centerra Gold Inc	Goldman Sachs	(2,240)
(23,905)	Centerra Gold Inc	Morgan Stanley	7,647
(23,299)	Ceridian HCM Holdings Inc	Goldman Sachs	(64,381)
(46,616)	CES Energy Solutions Corp	Morgan Stanley	4,042
16,174	CGI Group Inc 'A'	Morgan Stanley	15,960
1,802	CGI Group Inc 'A'	Goldman Sachs	3,396
85,713	Chartwell Retirement Residences (Unit)	Morgan Stanley	18,027
(62,159)	Chesswood Group Ltd	Morgan Stanley	8,708
13,595	Choice Properties Real Estate Investment Trust (Reit)	Goldman Sachs	(2,013)
34,321	Choice Properties Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	(1,783)
55,957	CI Financial Corp	Goldman Sachs	(16,969)
9,904	CI Financial Corp	Morgan Stanley	(3,747)
26,270	Cineplex Inc	Goldman Sachs	(54,703)
17,249	Cineplex Inc	Morgan Stanley	(679)
(8,273)	Cogeco Communications Inc	Goldman Sachs	(3,647)
(50,523)	Cogeco Communications Inc	Morgan Stanley	(29,603)
7,784	Cogeco Inc	Goldman Sachs	3,521
29,394	Cogeco Inc	Morgan Stanley	28,529
750	Colliers International Group Inc	Goldman Sachs	2,358
10,834	Colliers International Group Inc	Morgan Stanley	20,882
(59,047)	Cominar Real Estate Investment Trust (Reit)	Goldman Sachs	17,164
(425,808)	Cominar Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	114,591
(25,907)	Computer Modelling Group Ltd	Goldman Sachs	5,607
(71,640)	Computer Modelling Group Ltd	Morgan Stanley	10,473
1,061	Concordia International Corp	Goldman Sachs	357

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	カナダ(続き)		
2,674	Concordia International Corp	Morgan Stanley	(2,592)
63	Constellation Software Inc/Canada	Goldman Sachs	1,140
28	Constellation Software Inc/Canada	Morgan Stanley	41
(20,613)	Continental Gold Inc	Morgan Stanley	573
11,140	Corby Spirit and Wine Ltd	Morgan Stanley	2,438
116,084	Corus Entertainment Inc 'B'	Morgan Stanley	12,231
126,043	Corus Entertainment Inc 'B'	Goldman Sachs	7,100
(18,386)	Cott Corp	Goldman Sachs	1,362
(35,321)	Cott Corp	Morgan Stanley	(3,246)
83,063	Crescent Point Energy Corp	Goldman Sachs	(75,668)
159,055	Crescent Point Energy Corp	Morgan Stanley	(74,908)
138,377	Crew Energy Inc	Morgan Stanley	(15,654)
61,278	Crius Energy Trust (Unit)	Morgan Stanley	(11,271)
25,392	Crombie Real Estate Investment Trust (Reit)*	Goldman Sachs	5,075
273,052	Crombie Real Estate Investment Trust (Reit)*	Morgan Stanley	111,592
55,035	CT Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	(7,451)
6,180	Descartes Systems Group Inc/The	Morgan Stanley	7,140
25,730	Descartes Systems Group Inc/The	Goldman Sachs	11,230
(7,533)	Detour Gold Corp	Goldman Sachs	3,519
(10,020)	Detour Gold Corp	Morgan Stanley	7,720
16,729	DHX Media Ltd	Goldman Sachs	2,089
4,466	DHX Media Ltd	Morgan Stanley	844
(5,732)	DIRTT Environmental Solutions	Goldman Sachs	(606)
(125,500)	DIRTT Environmental Solutions	Morgan Stanley	(7,880)
(18,185)	Dollarama Inc	Goldman Sachs	(4,715)
(13,862)	Dollarama Inc	Morgan Stanley	(8,877)
7,802	Domtar Corp	Goldman Sachs	(20,987)
7,414	Domtar Corp	Morgan Stanley	(6,559)
13,073	Dorel Industries Inc 'B'	Goldman Sachs	(8,108)
10,838	Dorel Industries Inc 'B'	Morgan Stanley	(8,095)
42,019	Dream Global Real Estate Investment Trust (Reit)	Goldman Sachs	(16,325)
46,928	Dream Global Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	(10,287)
1,188	Dream Industrial Real Estate Investment Trust (Reit)	Goldman Sachs	(10)
216,345	Dream Industrial Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	(3,582)
(25,698)	Dream Office Real Estate Investment Trust (Reit)	Goldman Sachs	1,751
(91,249)	Dream Office Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	(7,219)
28,872	Dundee Corp 'A'	Morgan Stanley	(449)
24,348	Dundee Precious Metals Inc	Goldman Sachs	(605)
48,424	Dundee Precious Metals Inc	Morgan Stanley	(3,894)
(280,655)	ECN Capital Corp	Goldman Sachs	(38,329)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	カナダ(続き)		
(187,502)	ECN Capital Corp	Morgan Stanley	(39,235)
(72,693)	Element Fleet Management Corp	Morgan Stanley	(6,212)
(71,297)	Emera Inc	Goldman Sachs	(32,553)
(53,197)	Emera Inc	Morgan Stanley	(39,328)
54,564	Empire Co Ltd 'A'	Morgan Stanley	(16,698)
1,706	Enbridge Inc	Goldman Sachs	669
77,731	Enbridge Inc	Morgan Stanley	(58,627)
(48,062)	Encana Corp	Goldman Sachs	47,100
(74,204)	Encana Corp	Morgan Stanley	57,975
(21,135)	Endeavour Mining Corp	Goldman Sachs	22,632
(24,275)	Endeavour Mining Corp	Morgan Stanley	45,997
(5,883)	Endeavour Silver Corp	Goldman Sachs	656
(20,561)	Endeavour Silver Corp	Morgan Stanley	3,269
6,386	Enerflex Ltd	Goldman Sachs	(2,066)
35,658	Enerflex Ltd	Morgan Stanley	(31,120)
31,773	Enerplus Corp	Goldman Sachs	(8,145)
82,538	Enerplus Corp	Morgan Stanley	(44,498)
5,991	Enghouse Systems Ltd	Goldman Sachs	(16,555)
43,753	Enghouse Systems Ltd	Morgan Stanley	(38,991)
(26,763)	Ensign Energy Services Inc	Goldman Sachs	7,795
(44,293)	Ensign Energy Services Inc	Morgan Stanley	13,091
(5,095)	Equitable Group Inc	Goldman Sachs	2,273
(5,936)	Equitable Group Inc	Morgan Stanley	(4,882)
(44,004)	ERO Copper Corp	Goldman Sachs	3,537
(16,842)	ERO Copper Corp	Morgan Stanley	11,168
67,346	Essential Energy Services Trust	Morgan Stanley	(151)
(13,273)	Extendicare Inc	Goldman Sachs	3,388
(65,965)	Extendicare Inc	Morgan Stanley	8,996
(1,536)	Fairfax Financial Holdings Ltd	Goldman Sachs	(6,090)
(6,722)	Fairfax Financial Holdings Ltd	Morgan Stanley	(155)
(10,812)	Fairfax India Holdings Corp '144A'	Morgan Stanley	(10,163)
62,506	Fiera Capital Corp	Morgan Stanley	(21,397)
11,495	Finning International Inc	Morgan Stanley	(5,473)
(35,072)	First Capital Realty Inc	Goldman Sachs	(11,644)
(160,301)	First Capital Realty Inc	Morgan Stanley	(13,124)
(34,795)	First Majestic Silver Corp	Goldman Sachs	22,135
(34,619)	First Majestic Silver Corp	Morgan Stanley	27,256
8,608	First National Financial Corp	Morgan Stanley	2,888
(19,642)	First Quantum Minerals Ltd	Goldman Sachs	18,463
(54,735)	First Quantum Minerals Ltd	Morgan Stanley	30,065
2,472	FirstService Corp	Goldman Sachs	5,954
13,186	FirstService Corp	Morgan Stanley	39,429
38,448	Fortis Inc/Canada	Goldman Sachs	(32,480)
121,626	Fortis Inc/Canada	Morgan Stanley	(58,863)
54,694	Fortuna Silver Mines Inc	Goldman Sachs	(12,817)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	カナダ(続き)		
133,526	Fortuna Silver Mines Inc	Morgan Stanley	(40,870)
2,075	Franco-Nevada Corp	Goldman Sachs	3,016
6,533	Franco-Nevada Corp	Morgan Stanley	(18,652)
66,187	Freehold Royalties Ltd	Goldman Sachs	(35,017)
115,004	Freehold Royalties Ltd	Morgan Stanley	(72,998)
60,279	Frontera Energy Corp	Goldman Sachs	(68,312)
61,919	Frontera Energy Corp	Morgan Stanley	(55,441)
(24,559)	Genworth MI Canada Inc	Goldman Sachs	12,438
(70,179)	Genworth MI Canada Inc	Morgan Stanley	19,362
54,064	George Weston Ltd	Morgan Stanley	126,344
10,491	George Weston Ltd	Goldman Sachs	18,178
104,049	Gibson Energy Inc	Goldman Sachs	(62,020)
24,387	Gibson Energy Inc	Morgan Stanley	(9,853)
26,669	Gildan Activewear Inc	Morgan Stanley	31,278
38,738	Gluskin Sheff + Associates Inc	Morgan Stanley	(9,960)
60,185	Gluskin Sheff + Associates Inc	Goldman Sachs	(24,116)
1,501	goeasy Ltd	Morgan Stanley	2,541
7,300	Goldcorp Inc	Goldman Sachs	19
19,776	Goldcorp Inc	Morgan Stanley	(12,713)
(3,000)	Golden Star Resources Ltd	Goldman Sachs	694
(56,746)	Golden Star Resources Ltd	Morgan Stanley	3,854
63,835	Gran Tierra Energy Inc	Goldman Sachs	(14,427)
156,683	Gran Tierra Energy Inc	Morgan Stanley	(15,714)
(8,451)	Granite Real Estate Investment Trust (Reit)	Goldman Sachs	8,982
(8,060)	Granite Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	3,437
8,663	Great Canadian Gaming Corp	Goldman Sachs	2,221
9,209	Great Canadian Gaming Corp	Morgan Stanley	(1,217)
107,336	Great-West Lifeco Inc	Goldman Sachs	(61,948)
62,323	Great-West Lifeco Inc	Morgan Stanley	(20,527)
(45,891)	Green Organic Dutchman Holdings	Goldman Sachs	10,859
25,794	Guyana Goldfields Inc	Goldman Sachs	(1,740)
70,639	Guyana Goldfields Inc	Morgan Stanley	(4,310)
68,282	H&R Real Estate Investment Trust (Reit)	Goldman Sachs	1,275
3,192	H&R Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	(116)
48,788	High Arctic Energy Services Inc	Morgan Stanley	(6,205)
(25,202)	High Liner Foods Inc	Morgan Stanley	7,891
(31,761)	Home Capital Group Inc	Goldman Sachs	562
(17,286)	Home Capital Group Inc	Morgan Stanley	(1,677)
(248,931)	Horizon North Logistics Inc	Morgan Stanley	48,557
52,919	Hudbay Minerals Inc	Goldman Sachs	(13,853)
156,916	Hudbay Minerals Inc	Morgan Stanley	(14,628)
(72,399)	Husky Energy Inc	Goldman Sachs	117,503
(57,602)	Husky Energy Inc	Morgan Stanley	23,020
(31,648)	Hydro One Ltd '144A'	Goldman Sachs	(645)
(167,111)	Hydro One Ltd '144A'	Morgan Stanley	10,574

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	カナダ(続き)		
234,016	IAMGOLD Corp	Goldman Sachs	(12,094)
260,627	IAMGOLD Corp	Morgan Stanley	(97,156)
4,730	iAnthus Capital Holdings Inc	Morgan Stanley	(357)
(61,706)	IGM Financial Inc	Goldman Sachs	3,349
(59,694)	IGM Financial Inc	Morgan Stanley	(14,115)
(8,345)	Imperial Oil Ltd	Goldman Sachs	17,845
(37,648)	Imperial Oil Ltd	Morgan Stanley	33,908
5,900	Industrial Alliance Insurance & Financial Services Inc	Goldman Sachs	(3,432)
31,720	Industrial Alliance Insurance & Financial Services Inc	Morgan Stanley	(13,685)
(16,996)	Innergex Renewable Energy Inc	Goldman Sachs	(1,047)
(192,670)	Innergex Renewable Energy Inc	Morgan Stanley	(1,216)
(43,394)	Intact Financial Corp	Morgan Stanley	(41,937)
61,753	Inter Pipeline Ltd	Goldman Sachs	(75,416)
59,700	Inter Pipeline Ltd	Morgan Stanley	(41,921)
46,501	Interfor Corp	Goldman Sachs	6,476
67,330	Interfor Corp	Morgan Stanley	(39,312)
1,409	Interrent Real Estate Invest (Reit)	Goldman Sachs	(22)
(47,551)	Intertape Polymer Group Inc	Goldman Sachs	55,258
(68,620)	Intertape Polymer Group Inc	Morgan Stanley	26,187
(171,007)	Ivanhoe Mines Ltd ' A '	Morgan Stanley	16,879
(139,113)	Ivanhoe Mines Ltd ' A '	Goldman Sachs	6,077
579	Jamieson Wellness Inc	Goldman Sachs	1,019
18,156	Jamieson Wellness Inc	Morgan Stanley	22,760
1,624	Just Energy Group Inc	Goldman Sachs	577
51,175	Just Energy Group Inc	Morgan Stanley	8,686
(168,956)	Kelt Exploration Ltd	Morgan Stanley	99,012
(26,174)	Keyera Corp	Goldman Sachs	19,432
(79,879)	Keyera Corp	Morgan Stanley	49,701
41,517	Killam Apartment Real Estate Investment Trust (Reit)	Goldman Sachs	(1,749)
177,402	Killam Apartment Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	34,346
(9,756)	Kinaxis Inc	Goldman Sachs	(54,937)
(14,475)	Kinaxis Inc	Morgan Stanley	(79,027)
61,421	Kinder Morgan Canada Ltd ' 144A '	Goldman Sachs	(17,322)
36,762	Kinder Morgan Canada Ltd ' 144A '	Morgan Stanley	(8,508)
32,019	Kinross Gold Corp	Goldman Sachs	6,532
66,097	Kinross Gold Corp	Morgan Stanley	(2,196)
(8,128)	Kirkland Lake Gold Ltd	Goldman Sachs	(11,806)
12,319	Knight Therapeutics Inc	Goldman Sachs	744
74,067	Knight Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(5,553)
(6,972)	Labrador Iron Ore Royalty Corp	Goldman Sachs	24,747
(24,529)	Labrador Iron Ore Royalty Corp	Morgan Stanley	92,682
55,356	Largo Resources Ltd	Morgan Stanley	8,342
(21,829)	Laurentian Bank of Canada	Goldman Sachs	2,983

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
カナダ(続き)			
(89,205)	Laurentian Bank of Canada	Morgan Stanley	50,653
(2,039)	Linamar Corp	Goldman Sachs	3,243
(35,030)	Linamar Corp	Morgan Stanley	63,450
11,162	Lithium Americas Corp	Goldman Sachs	(2,328)
24,270	Lithium Americas Corp	Morgan Stanley	(574)
(53,080)	Loblaw Cos Ltd	Goldman Sachs	(63,097)
(37,742)	Loblaw Cos Ltd	Morgan Stanley	(10,462)
349,517	Lucara Diamond Corp	Morgan Stanley	(19,880)
78,026	Lundin Mining Corp	Goldman Sachs	(14,396)
124,609	Lundin Mining Corp	Morgan Stanley	(9,418)
(2,869)	MAG Silver Corp	Goldman Sachs	1,566
(19,755)	MAG Silver Corp	Morgan Stanley	10,485
(4,273)	Magna International Inc	Goldman Sachs	1,524
(27,990)	Magna International Inc	Morgan Stanley	(384)
(17,607)	Major Drilling Group International Inc	Morgan Stanley	3,047
60,109	Manulife Financial Corp	Goldman Sachs	(16,980)
103,974	Manulife Financial Corp	Morgan Stanley	(13,106)
8,100	Maple Leaf Foods Inc	Goldman Sachs	(1,692)
109,897	Maple Leaf Foods Inc	Morgan Stanley	(3,479)
34,700	Martinrea International Inc	Goldman Sachs	(34,483)
60,470	Martinrea International Inc	Morgan Stanley	(60,663)
(3,517)	Maxar Technologies Ltd	Goldman Sachs	6,273
(4,335)	Maxar Technologies Ltd	Morgan Stanley	1,392
19,197	McCoy Global Inc	Morgan Stanley	887
(36,985)	McEwen Mining Inc	Morgan Stanley	6,122
9,873	Medical Facilities Corp	Goldman Sachs	1,324
6,120	Medical Facilities Corp	Morgan Stanley	(229)
16,604	Methanex Corp	Goldman Sachs	(73,577)
9,299	Methanex Corp	Morgan Stanley	(27,821)
(11,293)	Metro Inc	Goldman Sachs	(15,447)
(86,122)	Metro Inc	Morgan Stanley	(15,748)
(23,753)	Morguard Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	3,970
115,346	Morneau Shepell Inc	Morgan Stanley	(64,748)
(1,807)	MTY Food Group Inc	Goldman Sachs	4,673
(11,207)	MTY Food Group Inc	Morgan Stanley	6,104
(6,996)	Mullen Group Ltd	Goldman Sachs	5,739
(52,505)	Mullen Group Ltd	Morgan Stanley	46,404
(18,897)	National Bank of Canada	Goldman Sachs	11,202
(71,855)	National Bank of Canada	Morgan Stanley	(1,468)
(7,392)	Nexa Resources SA	Morgan Stanley	(2,484)
29,244	NexGen Energy Ltd	Goldman Sachs	(1,332)
18,418	NexGen Energy Ltd	Morgan Stanley	(324)
10,036	NFI Group Inc	Goldman Sachs	3,593
21,225	NFI Group Inc	Morgan Stanley	(11,501)
23,344	Norbord Inc	Goldman Sachs	17,064



保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	カナダ(続き)		
28,010	Norbord Inc	Morgan Stanley	(8,314)
4,254	North American Construction Group Ltd	Goldman Sachs	(1,090)
29,868	North American Construction Group Ltd	Morgan Stanley	(5,850)
(65,066)	North West Co Inc/The	Morgan Stanley	27,485
44,811	Northland Power Inc	Goldman Sachs	32,990
236,860	Northland Power Inc	Morgan Stanley	3,691
(16,021)	Northview Apartment Real Estate Investment Trust (Reit)	Goldman Sachs	(3,928)
(61,205)	Northview Apartment Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	(2,160)
26,264	NorthWest Healthcare Properties Real Estate Investment Trust (Reit)	Goldman Sachs	(7,227)
90,532	NorthWest Healthcare Properties Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	(16,103)
(22,502)	Novagold Resources Inc	Goldman Sachs	4,241
(25,476)	Novagold Resources Inc	Morgan Stanley	8,954
(18,200)	Nutrien Ltd	Goldman Sachs	37,715
(14,572)	Nutrien Ltd	Morgan Stanley	7,309
2,809	NuVista Energy Ltd	Goldman Sachs	(1,163)
134,453	NuVista Energy Ltd	Morgan Stanley	(52,090)
30,446	OceanaGold Corp	Goldman Sachs	305
40,720	OceanaGold Corp	Morgan Stanley	(8,651)
17,196	Onex Corp	Morgan Stanley	(29,026)
28,213	Open Text Corp	Goldman Sachs	33,292
14,316	Open Text Corp	Morgan Stanley	8,271
(10,973)	Osisko Gold Royalties Ltd	Goldman Sachs	1,151
(50,878)	Osisko Gold Royalties Ltd	Morgan Stanley	21,910
(37,965)	Painted Pony Energy Ltd	Morgan Stanley	10,447
16,740	Pan American Silver Corp	Goldman Sachs	(4,643)
29,460	Pan American Silver Corp	Morgan Stanley	(23,397)
(72,310)	Paramount Resources Ltd 'A'	Morgan Stanley	67,130
(30,943)	Paramount Resources Ltd 'A'	Goldman Sachs	28,992
9,885	Parex Resources Inc	Morgan Stanley	(7,555)
(13,699)	Park Lawn Corp	Goldman Sachs	(4,525)
(17,496)	Park Lawn Corp	Morgan Stanley	(4,552)
11,665	Parkland Fuel Corp	Goldman Sachs	9,694
16,043	Parkland Fuel Corp	Morgan Stanley	6,876
19,101	Pason Systems Inc	Goldman Sachs	(30,001)
126,299	Pason Systems Inc	Morgan Stanley	(212,012)
(21,800)	Pattern Energy Group Inc 'A'	Morgan Stanley	(31,379)
(3,186)	Pattern Energy Group Inc 'A'	Goldman Sachs	(5,182)
(14,265)	Pembina Pipeline Corp	Goldman Sachs	6,583
(61,536)	Pembina Pipeline Corp	Morgan Stanley	12,420
(37,567)	Peyto Exploration & Development Corp	Morgan Stanley	38,186
(50,546)	Peyto Exploration & Development Corp	Goldman Sachs	44,417
(26,058)	Poseidon Concepts Corp*	Morgan Stanley	43
(78,248)	Power Corp of Canada	Goldman Sachs	40,115

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	カナダ(続き)		
(128,172)	Power Corp of Canada	Morgan Stanley	31,813
132,027	Power Financial Corp	Goldman Sachs	(41,719)
129,522	Power Financial Corp	Morgan Stanley	(275,070)
(26,748)	PrairieSky Royalty Ltd	Goldman Sachs	21,275
(124,113)	PrairieSky Royalty Ltd	Morgan Stanley	175,671
20,410	Premier Gold Mines Ltd	Goldman Sachs	(2,631)
66,144	Premier Gold Mines Ltd	Morgan Stanley	(7,612)
(2,244)	Premium Brands Holdings Corp	Goldman Sachs	(15,202)
(12,628)	Premium Brands Holdings Corp	Morgan Stanley	(36,480)
8,037	Pretium Resources Inc	Goldman Sachs	(5,507)
15,452	Pretium Resources Inc	Morgan Stanley	(16,306)
139,758	Quebecor Inc 'B'	Morgan Stanley	76,796
29,565	Quebecor Inc 'B'	Goldman Sachs	7,884
(1,601)	Recipe Unlimited Corp	Goldman Sachs	(2,621)
(7,151)	Recipe Unlimited Corp	Morgan Stanley	(3,672)
(3,625)	Resolute Forest Products Inc	Goldman Sachs	3,220
12,803	Restaurant Brands International Inc	Goldman Sachs	56,603
2,692	Restaurant Brands International Inc	Morgan Stanley	10,606
8,764	Richelieu Hardware Ltd	Morgan Stanley	(1,090)
(131,639)	RioCan Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	37,759
(22,462)	Ritchie Bros Auctioneers Inc	Morgan Stanley	(8,269)
(46,670)	Rogers Communications Inc 'B'	Goldman Sachs	(7,935)
(101,860)	Rogers Sugar Inc	Goldman Sachs	(9,272)
(448,286)	Rogers Sugar Inc	Morgan Stanley	(11,711)
(32,682)	Roots Corp	Goldman Sachs	(7,844)
(13,535)	Roots Corp	Morgan Stanley	(1,768)
1,045	Royal Bank of Canada	Morgan Stanley	1,494
19,248	Russel Metals Inc	Goldman Sachs	(26,974)
32,322	Russel Metals Inc	Morgan Stanley	(38,847)
26,963	Sandstorm Gold Ltd	Goldman Sachs	6,953
85,112	Sandstorm Gold Ltd	Morgan Stanley	(6,742)
(36,822)	Saputo Inc	Goldman Sachs	(21,387)
(98,568)	Saputo Inc	Morgan Stanley	(23,430)
(14,680)	Savaria Corp	Goldman Sachs	(1,289)
(38,798)	Savaria Corp	Morgan Stanley	1,982
(5,870)	Seabridge Gold Inc	Goldman Sachs	2,920
(5,211)	Seabridge Gold Inc	Morgan Stanley	1,850
12,100	Sears Canada Inc	Morgan Stanley	(5,633)
89,655	Secure Energy Services Inc	Morgan Stanley	(61,632)
(71,285)	SEMAFO Inc	Goldman Sachs	9,309
(203,099)	SEMAFO Inc	Morgan Stanley	45,401
6,924	Seven Generations Energy Ltd 'A'	Goldman Sachs	(12,011)
46,030	Seven Generations Energy Ltd 'A'	Morgan Stanley	(71,935)
(120,365)	Shaw Communications Inc 'B'	Morgan Stanley	34,946
(98,845)	Shaw Communications Inc 'B'	Goldman Sachs	5,025

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	カナダ(続き)		
(41,764)	ShawCor Ltd	Goldman Sachs	48,279
(42,422)	ShawCor Ltd	Morgan Stanley	21,922
(4,549)	Shopify Inc 'A'	Morgan Stanley	(78,122)
(1,552)	Shopify Inc 'A'	Goldman Sachs	(1,734)
6,552	Sienna Senior Living Inc	Goldman Sachs	(93)
26,745	Sienna Senior Living Inc	Morgan Stanley	679
(3,561)	Sierra Wireless Inc	Goldman Sachs	1,026
(16,016)	Sierra Wireless Inc	Morgan Stanley	(4,197)
47,859	Silvercorp Metals Inc	Goldman Sachs	(2,101)
171,575	Silvercorp Metals Inc	Morgan Stanley	(16,978)
(82,173)	Slate Office REIT (Reit)	Morgan Stanley	9,798
49,531	Slate Retail REIT (Unit)	Morgan Stanley	(10,433)
21,677	Sleep Country Canada Holdings Inc '144A'	Goldman Sachs	15,065
30,172	Sleep Country Canada Holdings Inc '144A'	Morgan Stanley	14,126
(18,645)	SmartCentres Real Estate Investment Trust (Reit)	Goldman Sachs	3,387
(99,281)	SmartCentres Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	(5,027)
(7,270)	SNC-Lavalin Group Inc	Goldman Sachs	(11,535)
(102,762)	SNC-Lavalin Group Inc	Morgan Stanley	41,364
4,496	Spin Master Corp '144A'	Morgan Stanley	(7,617)
10,495	Spin Master Corp '144A'	Goldman Sachs	(45,987)
198,514	Sprott Inc	Goldman Sachs	(49,180)
159,362	Sprott Inc	Morgan Stanley	(74,053)
(21,214)	SSR Mining Inc	Morgan Stanley	16,596
(4,660)	Stantec Inc	Goldman Sachs	(2,035)
(110,718)	Stantec Inc	Morgan Stanley	(2,050)
7,210	Stars Group Inc/The	Goldman Sachs	16,934
11,021	Stars Group Inc/The	Morgan Stanley	6,085
(25,536)	Stelco Holdings Inc	Goldman Sachs	33,270
(53,258)	Stelco Holdings Inc	Morgan Stanley	96,863
(30,170)	Stella-Jones Inc	Goldman Sachs	22
(25,696)	Stella-Jones Inc	Morgan Stanley	4,172
14,872	STEP Energy Services Ltd '144A'	Goldman Sachs	(4,252)
26,849	STEP Energy Services Ltd '144A'	Morgan Stanley	(31,842)
1,782	Summit Industrial Income REIT (Reit)	Goldman Sachs	(82)
153,897	Summit Industrial Income REIT (Reit)	Morgan Stanley	(15,191)
11,844	Sun Life Financial Inc	Goldman Sachs	(4,565)
25,452	Sun Life Financial Inc	Morgan Stanley	1,712
(23,422)	Suncor Energy Inc	Goldman Sachs	26,265
(34,333)	SunOpta Inc	Morgan Stanley	(25,401)
234,601	Superior Plus Corp	Goldman Sachs	(37,931)
172,423	Superior Plus Corp	Morgan Stanley	(17,600)
1,849	Supremex Inc	Morgan Stanley	(501)
(187,938)	Surge Energy Inc	Morgan Stanley	30,198
68,813	Tamarack Valley Energy Ltd	Goldman Sachs	(17,458)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	カナダ(続き)		
19,718	Tamarack Valley Energy Ltd	Morgan Stanley	(1,909)
(7,056)	Teck Resources Ltd 'B'	Morgan Stanley	1,939
(29,456)	Teck Resources Ltd 'B'	Goldman Sachs	58,776
70,866	TELUS Corp	Goldman Sachs	63,905
71,846	TELUS Corp	Morgan Stanley	3,407
20,280	Teranga Gold Corp	Goldman Sachs	(1,663)
39,704	Teranga Gold Corp	Morgan Stanley	(3,515)
31,787	Tervita Corp	Morgan Stanley	(2,065)
6,843	TFI International Inc	Goldman Sachs	(2,480)
52,706	TFI International Inc	Morgan Stanley	(32,530)
(24,392)	Thomson Reuters Corp	Goldman Sachs	44,708
(52,684)	Thomson Reuters Corp	Morgan Stanley	165,378
143,157	Timbercreek Financial Corp	Morgan Stanley	(9,199)
(6,531)	TMAC Resources Inc	Morgan Stanley	(114)
(19,826)	TMX Group Ltd	Goldman Sachs	28,753
(21,047)	TMX Group Ltd	Morgan Stanley	15,929
330,835	TORC Oil & Gas Ltd	Morgan Stanley	(82,288)
125,912	TORC Oil & Gas Ltd	Goldman Sachs	(15,578)
(7,838)	Torex Gold Resources Inc	Morgan Stanley	7,848
11,637	Toromont Industries Ltd	Goldman Sachs	(10,684)
44,775	Toromont Industries Ltd	Morgan Stanley	(37,773)
61,146	Toronto-Dominion Bank/The	Goldman Sachs	(3,837)
36,208	Toronto-Dominion Bank/The	Morgan Stanley	48,770
79,398	Tourmaline Oil Corp	Morgan Stanley	(154,065)
(74,213)	TransAlta Corp	Morgan Stanley	17,488
43,192	TransAlta Renewables Inc	Goldman Sachs	(7,457)
99,337	TransAlta Renewables Inc	Morgan Stanley	(18,047)
(29,305)	TransCanada Corp	Goldman Sachs	(27,663)
(29,794)	TransCanada Corp	Morgan Stanley	3,339
(45,258)	Transcontinental Inc 'A'	Morgan Stanley	10,930
(12,510)	Transcontinental Inc 'A'	Goldman Sachs	170
238,872	Trican Well Service Ltd	Morgan Stanley	(5,462)
(234,652)	Tricon Capital Group Inc	Morgan Stanley	27,172
2,477	Tucows Inc 'A'	Morgan Stanley	9,559
812	Tucows Inc 'A'	Goldman Sachs	2,197
(26,232)	Turquoise Hill Resources Ltd	Goldman Sachs	712
(236,053)	Turquoise Hill Resources Ltd	Morgan Stanley	29,144
(57,603)	Uni-Select Inc	Goldman Sachs	47,932
(17,449)	Uni-Select Inc	Morgan Stanley	13,775
(162,197)	Uranium Participation Corp	Morgan Stanley	26,871
(119,316)	Valener Inc	Morgan Stanley	(34,868)
(60,015)	Valener Inc	Goldman Sachs	(18,484)
36,038	Valeura Energy Inc	Goldman Sachs	12,103
(27,907)	Vermilion Energy Inc	Morgan Stanley	28,265
(10,288)	Vermilion Energy Inc	Goldman Sachs	1,272

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
カナダ(続き)			
1,245	Wajax Corp	Goldman Sachs	(2,203)
7,303	Wajax Corp	Morgan Stanley	(11,717)
9,990	Waste Connections Inc	Goldman Sachs	26,825
14,789	Waste Connections Inc	Morgan Stanley	49,142
47,581	Wesdome Gold Mines Ltd	Morgan Stanley	(7,031)
(5,158)	West Fraser Timber Co Ltd	Goldman Sachs	(9,056)
(6,684)	West Fraser Timber Co Ltd	Morgan Stanley	11,482
13,594	Western Forest Products Inc	Goldman Sachs	(342)
74,237	Western Forest Products Inc	Morgan Stanley	(9,283)
(132,873)	WestJet Airlines Ltd	Morgan Stanley	(119,119)
(400)	Westport Fuel Systems Inc	Goldman Sachs	36
(14,973)	Westport Fuel Systems Inc	Morgan Stanley	595
(35,612)	Westshore Terminals Investment Corp	Morgan Stanley	30,476
(35,983)	Wheaton Precious Metals Corp	Goldman Sachs	18,089
(10,450)	Wheaton Precious Metals Corp	Morgan Stanley	3,322
171,066	Whitecap Resources Inc	Morgan Stanley	(121,288)
(14,453)	Winpak Ltd	Goldman Sachs	12,405
(50,120)	Winpak Ltd	Morgan Stanley	(9,933)
96,956	WPT Industrial Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	28,117
29,055	WSP Global Inc	Goldman Sachs	(4,226)
17,332	WSP Global Inc	Morgan Stanley	(16,096)
39,557	Yamana Gold Inc	Goldman Sachs	(3,269)
101,135	Yamana Gold Inc	Morgan Stanley	(50,814)
5,084	Zymeworks Inc	Goldman Sachs	3,282
30,971	Zymeworks Inc	Morgan Stanley	40,831
			<u>(533,462)</u>
チリ			
1,976,581	AES Gener SA	Morgan Stanley	(34,740)
673,262	Aguas Andinas SA 'A'	Morgan Stanley	6,119
7,410,843	Banco de Chile	Morgan Stanley	5,706
2,780	Banco de Credito e Inversiones SA	Morgan Stanley	(6,438)
213	BCI (Right)	Morgan Stanley	793
47,828	CAP SA	Morgan Stanley	(28,229)
139,845	Cia Cervecerias Unidas SA	Morgan Stanley	(28,981)
3,155,407	Colbun SA	Morgan Stanley	2,392
246,902	Embotelladora Andina SA (Pref)	Morgan Stanley	7,916
725,398	Empresas CMPC SA	Morgan Stanley	(131,619)
52,074	Empresas COPEC SA	Morgan Stanley	(36,515)
12,445	Engie Energia Chile SA	Morgan Stanley	(193)
176,170	Inversiones Aguas Metropolitanas SA	Morgan Stanley	372
90,764	Inversiones La Construccion SA	Morgan Stanley	(17,247)
1,010,678	Parque Arauco SA	Morgan Stanley	27,017
2,335,816	Ripley Corp SA	Morgan Stanley	(26,680)
500,321	Salfacorp SA	Morgan Stanley	17,912
123,558	Sociedad Matriz del Banco de Chile SA 'B'	Morgan Stanley	(438)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	チリ(続き)		
1,193,855	SONDA SA	Morgan Stanley	870
			(241,983)
	コロンビア		
499,610	Avianca Holdings SA (Pref)	Morgan Stanley	(18,244)
3,899,763	Ecopetrol SA	Morgan Stanley	(142,654)
			(160,898)
	メキシコ		
1,938,375	Alfa SAB de CV 'A'	Goldman Sachs	(59,182)
4,662,864	Alfa SAB de CV 'A'	Morgan Stanley	(270,959)
1,301,533	Alpek SAB de CV	Morgan Stanley	(125,633)
863,641	Alpek SAB de CV	Goldman Sachs	(128,151)
808,860	America Movil SAB de CV 'L'	Goldman Sachs	15,039
196,539	America Movil SAB de CV 'L'	Morgan Stanley	3,388
(362,476)	Arca Continental SAB de CV	Goldman Sachs	(45,205)
(869,762)	Arca Continental SAB de CV	Morgan Stanley	11,251
(453,751)	Axtel SAB de CV (Unit)	Goldman Sachs	(884)
(3,211,328)	Axtel SAB de CV (Unit)	Morgan Stanley	(4,162)
(145,830)	Banco del Bajio SA '144A'	Goldman Sachs	7,972
(892,674)	Banco del Bajio SA '144A'	Morgan Stanley	51,569
242,300	Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand 'B	Morgan Stanley	(87,124)
719,075	Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand 'B	Goldman Sachs	(202,042)
(127,301)	Becle SAB de CV	Goldman Sachs	(13,048)
(5,571,067)	Becle SAB de CV	Morgan Stanley	(445,541)
(459,842)	Bolsa Mexicana de Valores SAB de CV	Goldman Sachs	(48,694)
(22,907)	Bolsa Mexicana de Valores SAB de CV	Morgan Stanley	(1,651)
2,321,847	Cemex SAB de CV (Unit)	Goldman Sachs	26,111
636,249	Cemex SAB de CV (Unit)	Morgan Stanley	34,989
(29,539)	Coca-Cola Femsa SAB de CV 'L'	Morgan Stanley	(1,136)
(70,672)	Coca-Cola Femsa SAB de CV 'L'	Goldman Sachs	(21,506)
526,408	Concentradora Fibra Danhos SA de CV (Reit)	Goldman Sachs	(29,005)
465,688	Concentradora Fibra Danhos SA de CV (Reit)	Morgan Stanley	2,632
(279,937)	Concentradora Fibra Hotelera Mexicana SA de CV (Reit) '144A'	Goldman Sachs	(4,110)
(340,449)	Concentradora Fibra Hotelera Mexicana SA de CV (Reit) '144A'	Morgan Stanley	(1,616)
(331,879)	Concentradora Hipotecaria SAPI de CV (Reit)	Morgan Stanley	16,959
1,129,471	Consortio ARA SAB de CV	Goldman Sachs	(583)
969,388	Consortio ARA SAB de CV	Morgan Stanley	15,118
(169,600)	Controladora Vuela Cia de Aviacion SAB de CV 'A'	Goldman Sachs	(3,321)
(653,900)	Controladora Vuela Cia de Aviacion SAB de CV 'A'	Morgan Stanley	(35,254)
43,500	Corp Inmobiliaria Vesta SAB de CV	Goldman Sachs	572
147,600	Corp Inmobiliaria Vesta SAB de CV	Morgan Stanley	5,895

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	メキシコ(続き)		
242,400	Credito Real SAB de CV SOFOM ER	Goldman Sachs	(17,397)
490,960	Credito Real SAB de CV SOFOM ER	Morgan Stanley	(26,741)
27,500	Fibra Uno Administracion SA de CV (Reit)	Goldman Sachs	(1,070)
124,300	Fomento Economico Mexicano SAB de CV (Unit)	Morgan Stanley	(6,346)
81,957	Fomento Economico Mexicano SAB de CV (Unit)	Goldman Sachs	23,675
(295,562)	Genomma Lab Internacional SAB de CV ' B '	Goldman Sachs	(854)
(554,199)	Genomma Lab Internacional SAB de CV ' B '	Morgan Stanley	(19,006)
(287,202)	Genera SAB de CV	Goldman Sachs	17,362
(1,230,820)	Genera SAB de CV	Morgan Stanley	(19,294)
(542,620)	GMexico Transportes SAB de CV ' 144A '	Goldman Sachs	39,753
(1,123,591)	GMexico Transportes SAB de CV ' 144A '	Morgan Stanley	(55,229)
116,557	Gruma SAB de CV ' B '	Morgan Stanley	(29,196)
79,119	Gruma SAB de CV ' B '	Goldman Sachs	(4,510)
194,395	Grupo Aeromexico SAB de CV	Morgan Stanley	5,144
172,203	Grupo Aeromexico SAB de CV	Goldman Sachs	6,576
147,815	Grupo Aeroportuario del Centro Norte SAB de CV	Morgan Stanley	2,728
243,815	Grupo Aeroportuario del Centro Norte SAB de CV	Goldman Sachs	(40,043)
215,834	Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV ' B '	Morgan Stanley	(41,386)
72,433	Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV ' B '	Goldman Sachs	(16,227)
(3,040)	Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV ' B '	Goldman Sachs	2,437
(29,600)	Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV ' B '	Morgan Stanley	9,281
(655,263)	Grupo Bimbo SAB de CV ' A '	Goldman Sachs	(61,973)
(2,573,294)	Grupo Bimbo SAB de CV ' A '	Morgan Stanley	(121,686)
198,368	Grupo Carso SAB de CV	Goldman Sachs	44,352
64,445	Grupo Carso SAB de CV	Morgan Stanley	13,686
(7,400)	Grupo Cementos de Chihuahua SAB de CV	Goldman Sachs	(44)
(18,500)	Grupo Cementos de Chihuahua SAB de CV	Morgan Stanley	965
461,897	Grupo Comercial Chedraui SA de CV	Goldman Sachs	35,522
571,374	Grupo Comercial Chedraui SA de CV	Morgan Stanley	(11,254)
(9,732)	Grupo Elektra SAB DE CV	Goldman Sachs	(33,730)
(64,988)	Grupo Elektra SAB DE CV	Morgan Stanley	(144,153)
339,480	Grupo Financiero Banorte SAB de CV ' O '	Goldman Sachs	(72,979)
606,621	Grupo Financiero Banorte SAB de CV ' O '	Morgan Stanley	(149,325)
(1,339,764)	Grupo Financiero Inbursa SAB de CV ' O '	Goldman Sachs	(53,115)
(56,492)	Grupo Financiero Inbursa SAB de CV ' O '	Morgan Stanley	(369)
(124,157)	Grupo GICSA SAB de CV	Goldman Sachs	3,478
(330,808)	Grupo GICSA SAB de CV	Morgan Stanley	5,392
(670,944)	Grupo Herdez SAB de CV	Goldman Sachs	(148,437)
(4,098)	Grupo Herdez SAB de CV	Morgan Stanley	(293)
(1,995,312)	Grupo Lala SAB de CV	Goldman Sachs	(163,430)
(2,360,431)	Grupo Lala SAB de CV	Morgan Stanley	(152,427)
(326,300)	Grupo Mexico SAB de CV ' B '	Goldman Sachs	36,908

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	メキシコ(続き)		
(994,300)	Grupo Mexico SAB de CV ' B '	Morgan Stanley	(100,517)
(277,315)	Grupo Rotoplas SAB de CV	Goldman Sachs	(4,467)
(410,550)	Grupo Rotoplas SAB de CV	Morgan Stanley	7,498
(31,100)	Grupo Televisa SAB (Unit)	Goldman Sachs	1,642
(559,153)	Grupo Televisa SAB (Unit)	Morgan Stanley	61,950
(1,415,871)	Hoteles City Express SAB de CV	Morgan Stanley	(175,568)
(180,465)	Hoteles City Express SAB de CV	Goldman Sachs	(13,713)
226,044	Industrias Bachoco SAB de CV ' B '	Goldman Sachs	20,348
454,077	Industrias Bachoco SAB de CV ' B '	Morgan Stanley	33,693
61,268	Industrias Penoles SAB de CV	Goldman Sachs	(37,967)
34,258	Industrias Penoles SAB de CV	Morgan Stanley	7,622
(1,889,046)	Infraestructura Energetica Nova SAB de CV	Morgan Stanley	(384,795)
(73,354)	Infraestructura Energetica Nova SAB de CV	Goldman Sachs	(14,848)
211,700	Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV ' A '	Goldman Sachs	7,454
314,900	Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV ' A '	Morgan Stanley	18,294
(92,774)	La Comer SAB de CV	Goldman Sachs	2,241
(1,653,140)	La Comer SAB de CV	Morgan Stanley	18,748
2,238,922	Macquarie Mexico Real Estate Management SA de CV (Reit)	Goldman Sachs	(169,468)
1,022,695	Macquarie Mexico Real Estate Management SA de CV (Reit)	Morgan Stanley	(55,923)
535,117	Megacable Holdings SAB de CV (Unit)	Morgan Stanley	(86,609)
358,711	Megacable Holdings SAB de CV (Unit)	Goldman Sachs	(80,283)
172,800	Mexichem SAB de CV	Goldman Sachs	(23,453)
567,351	Mexichem SAB de CV	Morgan Stanley	(24,550)
(941,948)	Nemak SAB de CV ' 144A '	Morgan Stanley	25,228
(37,100)	Nemak SAB de CV ' 144A '	Goldman Sachs	1,059
794,960	PLA Administradora Industrial S de RL de CV (Reit)	Goldman Sachs	5,373
1,054,616	PLA Administradora Industrial S de RL de CV (Reit)	Morgan Stanley	36,958
454,059	Prologis Property Mexico SA de CV (Reit)	Goldman Sachs	(34,178)
813,601	Prologis Property Mexico SA de CV (Reit)	Morgan Stanley	(32,426)
214,874	Promotora y Operadora de Infraestructura SAB de CV	Goldman Sachs	(72,335)
218,247	Promotora y Operadora de Infraestructura SAB de CV	Morgan Stanley	(27,875)
(117,276)	Qualitas Controladora SAB de CV	Goldman Sachs	(6,944)
(382,479)	Qualitas Controladora SAB de CV	Morgan Stanley	(21,127)
23,693	Rassini SAB de CV	Morgan Stanley	1,683
101,945	Rassini SAB de CV	Goldman Sachs	1,213
(996,259)	Regional SAB de CV	Morgan Stanley	93,019
(275,901)	Regional SAB de CV	Goldman Sachs	52,804
(2,713,868)	Telesites SAB de CV	Morgan Stanley	42,258
(1,500,328)	Telesites SAB de CV	Goldman Sachs	(57,368)
(463,125)	TV Azteca SAB de CV (Unit)	Goldman Sachs	(4,543)
(2,083,554)	TV Azteca SAB de CV (Unit)	Morgan Stanley	(18,500)
(55,688)	Unifin Financiera SAB de CV SOFOM ENR	Morgan Stanley	(3,413)



保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	メキシコ(続き)		
530,700	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	Goldman Sachs	37,660
2,534,514	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	Morgan Stanley	(142,245)
			<u>(3,596,937)</u>
	ペルー		
447	Credicorp Ltd	Morgan Stanley	(134)
7,452	Tahoe Resources Inc*	Morgan Stanley	(149)
537,685	Volcan Cia Minera SAA 'B'	Morgan Stanley	2,816
			<u>2,533</u>
	米国		
(112,086)	1-800-Flowers.com Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	23,538
(12,376)	1st Source Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,599)
(3,828)	1st Source Corp	Goldman Sachs	(1,089)
1,985	2U Inc	Goldman Sachs	8,158
9,300	2U Inc	Morgan Stanley	68,076
(16,518)	2U Inc	Bank of America Merrill Lynch	(67,889)
(8,791)	3D Systems Corp	Morgan Stanley	(1,582)
(2,626)	3M Co	Morgan Stanley	(22,925)
8,412	8x8 Inc	Bank of America Merrill Lynch	7,234
6,345	8x8 Inc	Morgan Stanley	10,342
3,104	8x8 Inc	Goldman Sachs	2,669
(126,670)	A. Schulman Inc CVR COM*	Bank of America Merrill Lynch	(241,940)
357,433	A10 Networks Inc	Bank of America Merrill Lynch	14,297
(21,135)	AAON Inc	Goldman Sachs	61,080
(11,365)	AAON Inc	Morgan Stanley	(6,705)
(93,450)	AAON Inc	Bank of America Merrill Lynch	270,071
10,086	Aaron's Inc	Morgan Stanley	(2,483)
17,415	Aaron's Inc	Bank of America Merrill Lynch	(34,482)
16,633	Aaron's Inc	Goldman Sachs	(7,742)
29,186	Abbott Laboratories	Bank of America Merrill Lynch	92,520
17,610	AbbVie Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,465
(27,602)	Abeona Therapeutics Inc	Morgan Stanley	4,692
(31,888)	Abeona Therapeutics Inc	Goldman Sachs	4,464
(8,368)	Abeona Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,172
(2,155)	Abercrombie & Fitch Co 'A'	Goldman Sachs	(7,133)
(69,893)	Abercrombie & Fitch Co 'A'	Morgan Stanley	(336,185)
(62,869)	Abercrombie & Fitch Co 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(208,096)
2,653	Abiomed Inc	Morgan Stanley	83,959
(28,913)	ABM Industries Inc	Morgan Stanley	(36,720)
(146,330)	ABM Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(79,018)
(18,299)	ABM Industries Inc	Goldman Sachs	(9,881)
7,404	Abraxas Petroleum Corp	Goldman Sachs	(963)
15,984	Abraxas Petroleum Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,078)
(3,872)	Acacia Communications Inc	Goldman Sachs	10,958
(11,162)	Acacia Communications Inc	Bank of America Merrill Lynch	31,588
(21,934)	Acacia Communications Inc	Morgan Stanley	33,120

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(37,756)	Acacia Research Corp	Bank of America Merrill Lynch	(378)
(2,401)	Acacia Research Corp	Goldman Sachs	(24)
(9,042)	Acacia Research Corp	Morgan Stanley	(633)
3,492	Acadia Healthcare Co Inc	Goldman Sachs	(14,247)
25,734	Acadia Realty Trust (Reit)	Goldman Sachs	12,638
18,754	Acadia Realty Trust (Reit)	Morgan Stanley	12,391
(2,002)	Accelerate Diagnostics Inc	Bank of America Merrill Lynch	921
(20,090)	Accelerate Diagnostics Inc	Morgan Stanley	(9,643)
(36,321)	Acceleron Pharma Inc	Bank of America Merrill Lynch	(87,897)
3,553	Accenture Plc 'A'	Goldman Sachs	11,704
5,089	Accenture Plc 'A'	Morgan Stanley	22,327
(5,497)	Accenture Plc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	2,144
(123,063)	Access National Corp	Bank of America Merrill Lynch	13,537
(11,311)	Access National Corp	Goldman Sachs	1,244
(9,719)	Access National Corp	Morgan Stanley	(4,762)
31,989	ACCO Brands Corp	Goldman Sachs	(5,758)
15,237	ACCO Brands Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,743)
108,777	ACCO Brands Corp	Morgan Stanley	8,702
88,641	Accuray Inc	Bank of America Merrill Lynch	(46,980)
219,266	Accuray Inc	Goldman Sachs	(116,211)
(8,813)	Acer Therapeutics Inc	Morgan Stanley	17,273
(11,442)	ACI Worldwide Inc	Goldman Sachs	2,746
(1,659)	ACI Worldwide Inc	Bank of America Merrill Lynch	398
(32,874)	ACI Worldwide Inc	Morgan Stanley	(27,943)
11,908	Aclaris Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,406
61,655	Aclaris Therapeutics Inc	Goldman Sachs	22,635
5,711	Aclaris Therapeutics Inc	Morgan Stanley	3,055
38,078	Acorda Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	61,306
12,803	Acorda Therapeutics Inc	Goldman Sachs	20,613
6,471	Acorda Therapeutics Inc	Morgan Stanley	9,901
(2,288)	Activision Blizzard Inc	Goldman Sachs	(1,342)
1,323	Actua Corp	Bank of America Merrill Lynch	(198)
(153,691)	Actuant Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	53,792
(85,973)	Actuant Corp 'A'	Morgan Stanley	(5,158)
(36,210)	Acushnet Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	49,608
(25,416)	Acushnet Holdings Corp	Goldman Sachs	34,820
13,991	Adamas Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(12,872)
41,655	Adamas Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(38,141)
15,036	Adamas Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(5,112)
(1,187)	Adams Resources & Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	297
(1,505)	Adams Resources & Energy Inc	Goldman Sachs	376
(727)	Addus HomeCare Corp	Goldman Sachs	(4,763)
8,512	Adesto Technologies Corp	Goldman Sachs	(1,700)
(48,952)	Adient Plc	Goldman Sachs	1,958
(16,988)	Adient Plc	Morgan Stanley	20,900

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(2,452)	Adobe Inc	Goldman Sachs	(24,692)
9,729	ADT Inc	Goldman Sachs	(97)
70,516	ADT Inc	Bank of America Merrill Lynch	(705)
178,401	ADT Inc	Morgan Stanley	42,816
(105,661)	Adtalem Global Education Inc	Bank of America Merrill Lynch	(20,604)
72,873	Aduro Biotech Inc	Bank of America Merrill Lynch	(49,554)
57,244	Aduro Biotech Inc	Goldman Sachs	(39,443)
56,108	Aduro Biotech Inc	Morgan Stanley	(14,027)
3,478	Advance Auto Parts Inc	Goldman Sachs	(7,826)
(22,591)	Advanced Disposal Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(23,495)
(25,029)	Advanced Disposal Services Inc	Morgan Stanley	(501)
(54,399)	Advanced Disposal Services Inc	Goldman Sachs	(56,575)
36,245	Advanced Drainage Systems Inc	Morgan Stanley	45,669
(213,168)	Advanced Emissions Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	(193,983)
(82,063)	Advanced Emissions Solutions Inc	Morgan Stanley	(58,265)
(9,742)	Advanced Energy Industries Inc	Goldman Sachs	(34,487)
(40,885)	Advanced Energy Industries Inc	Morgan Stanley	(130,014)
(154,184)	Advanced Energy Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(545,811)
(24,316)	Advanced Micro Devices Inc	Bank of America Merrill Lynch	19,453
(35,049)	Advanced Micro Devices Inc	Morgan Stanley	(45,914)
(10,649)	Advanced Micro Devices Inc	Goldman Sachs	(550)
8,754	AdvanSix Inc	Goldman Sachs	10,067
8,773	AdvanSix Inc	Morgan Stanley	12,984
32,645	AdvanSix Inc	Bank of America Merrill Lynch	37,542
(31,476)	Aecom	Goldman Sachs	67,956
(500)	Aecom	Morgan Stanley	(60)
(12,442)	Aegion Corp	Goldman Sachs	(7,795)
(80,090)	Aegion Corp	Bank of America Merrill Lynch	5,606
229,221	Aegon NV	Goldman Sachs	(138,679)
149,036	Aegon NV	Morgan Stanley	745
(74,070)	AerCap Holdings NV	Goldman Sachs	(97,772)
(146,864)	AerCap Holdings NV	Morgan Stanley	(406,813)
(55,166)	Aerie Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	103,712
286,061	Aerohive Networks Inc	Bank of America Merrill Lynch	(102,982)
34,795	Aerohive Networks Inc	Goldman Sachs	(12,526)
63,621	Aerohive Networks Inc	Morgan Stanley	(9,543)
(17,461)	Aerovironment Inc	Morgan Stanley	185,436
(8,923)	Aerovironment Inc	Bank of America Merrill Lynch	164,183
5,835	AES Corp/VA	Morgan Stanley	2,451
(115,492)	AES Corp/VA	Bank of America Merrill Lynch	-
21,355	Affiliated Managers Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(39,934)
(82,901)	Aflac Inc	Goldman Sachs	(109,429)
(18,155)	Aflac Inc	Bank of America Merrill Lynch	(23,965)
(47,796)	Aflac Inc	Morgan Stanley	(53,532)
52,052	AGCO Corp	Bank of America Merrill Lynch	101,501

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
114,934	Agenus Inc	Bank of America Merrill Lynch	12,643
48,900	Agenus Inc	Goldman Sachs	5,379
126,236	Agenus Inc	Morgan Stanley	11,361
(1,994)	AgeX Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,161)
(8,503)	AgeX Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(26,274)
34,477	Agilent Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	263,749
56,268	Agilent Technologies Inc	Morgan Stanley	234,075
(46,546)	Agilysys Inc	Bank of America Merrill Lynch	(19,549)
(11,998)	Agios Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	39,833
(204,132)	AGNC Investment Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(88,797)
2,659	Agree Realty Corp (Reit)	Morgan Stanley	1,914
15,901	Agree Realty Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	22,897
9,050	Agree Realty Corp (Reit)	Goldman Sachs	10,187
(10,144)	Agree Realty Corp (Reit)	Morgan Stanley	(7,304)
(121,976)	AgroFresh Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	50,010
(8,672)	AgroFresh Solutions Inc	Goldman Sachs	3,556
1,507	AH Belo Corp 'A'	Morgan Stanley	60
9,752	AH Belo Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	195
32,189	Air Lease Corp	Goldman Sachs	16,139
29,617	Air Lease Corp	Morgan Stanley	29,577
30,518	Air Products & Chemicals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,545)
38,041	Air Transport Services Group Inc	Morgan Stanley	951
(72,086)	Air Transport Services Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	50,100
2,437	Aircastle Ltd	Goldman Sachs	(1,633)
27,485	Aircastle Ltd	Morgan Stanley	(12,643)
(92,700)	AK Steel Holding Corp	Goldman Sachs	48,537
(31,730)	AK Steel Holding Corp	Morgan Stanley	8,250
(10,070)	Akamai Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	11,077
(4,143)	Akamai Technologies Inc	Goldman Sachs	1,344
126,538	Akebia Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10,123)
36,770	Akebia Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(2,942)
28,140	Akebia Therapeutics Inc	Morgan Stanley	9,568
18,927	Akoustis Technologies Inc	Goldman Sachs	(4,409)
7,141	Alamo Group Inc	Goldman Sachs	(17,210)
38,734	Alamo Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(93,349)
6,144	Alamo Group Inc	Morgan Stanley	10,138
(774)	Alarm.com Holdings Inc	Goldman Sachs	(3,309)
(12,890)	Alarm.com Holdings Inc	Morgan Stanley	(72,957)
(6,822)	Alaska Air Group Inc	Goldman Sachs	2,006
(6,434)	Albemarle Corp	Bank of America Merrill Lynch	38,379
(37,755)	Albireo Pharma Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,663)
(28,391)	Alcoa Corp	Bank of America Merrill Lynch	138,690
2,258	Alder Biopharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	455
(6,950)	Aldeyra Therapeutics Inc	Morgan Stanley	-
(25,555)	Aldeyra Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,278

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(230,899)	Alexander & Baldwin Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11,545)
(2,683)	Alexander & Baldwin Inc	Goldman Sachs	(134)
15,626	Alexandria Real Estate Equities Inc (Reit)	Goldman Sachs	45,261
6,865	Alexandria Real Estate Equities Inc (Reit)	Morgan Stanley	20,978
(12,618)	Alexion Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(58,342)
(18,529)	Alico Inc	Bank of America Merrill Lynch	(371)
(2,429)	Alico Inc	Goldman Sachs	(316)
(17,896)	Alico Inc	Morgan Stanley	1,611
(4,791)	Align Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(18,924)
(3,635)	Align Technology Inc	Goldman Sachs	(49,845)
(20,772)	Alkermes Plc	Goldman Sachs	(62,108)
(6,631)	Allakos Inc	Morgan Stanley	(18,235)
(6,733)	Alleghany Corp	Morgan Stanley	(87,125)
(291)	Alleghany Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,173)
(10,103)	Allegheny Technologies Inc	Morgan Stanley	(6,264)
(76,124)	Allegheny Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	89,065
(91,003)	Allegiance Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	31,851
(16,330)	Allegiance Bancshares Inc	Morgan Stanley	(7,185)
(7,389)	Allegiance Bancshares Inc	Goldman Sachs	2,586
(218)	Allegiant Travel Co	Goldman Sachs	(1,550)
(8,073)	Allegiant Travel Co	Bank of America Merrill Lynch	(57,399)
(467)	Allegiant Travel Co	Morgan Stanley	(2,396)
2,706	Allegiant Travel Co	Bank of America Merrill Lynch	19,240
1,132	Allegiant Travel Co	Goldman Sachs	8,049
6,131	Allegion Plc	Bank of America Merrill Lynch	18,143
3,971	Allegion Plc	Morgan Stanley	6,589
22,539	Allegion Plc	Goldman Sachs	63,441
(3,789)	Allergan Plc	Goldman Sachs	14,588
10,664	Allete Inc	Bank of America Merrill Lynch	21,328
(58,489)	Allete Inc	Morgan Stanley	(87,149)
4,253	Allete Inc	Goldman Sachs	8,506
(15,979)	Allete Inc	Goldman Sachs	(29,692)
7,160	Alliance Data Systems Corp	Bank of America Merrill Lynch	(5,871)
3,032	Alliance Data Systems Corp	Morgan Stanley	6,974
906	Alliance Data Systems Corp	Goldman Sachs	(743)
136,612	Alliant Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	(32,787)
11,482	Allstate Corp/The	Goldman Sachs	260
54,528	Allstate Corp/The	Bank of America Merrill Lynch	(41,987)
5,672	Allstate Corp/The	Morgan Stanley	4,109
(12,827)	Ally Financial Inc	Goldman Sachs	(13,212)
1,511	Ally Financial Inc	Morgan Stanley	2,251
93,538	Ally Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	96,344
7,742	Ally Financial Inc	Goldman Sachs	7,974
(28,707)	Ally Financial Inc	Morgan Stanley	(42,773)
(5,146)	Alnylam Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(67,052)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
46,481	Alpha & Omega Semiconductor Ltd	Bank of America Merrill Lynch	10,226
(3,745)	Alphabet Inc 'A'	Goldman Sachs	(67,373)
(3,431)	Alphabet Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(61,724)
13,499	Alta Mesa Resources Inc 'A'	Goldman Sachs	(9,517)
32,096	Alta Mesa Resources Inc 'A'	Morgan Stanley	(12,517)
(16,732)	Altair Engineering Inc 'A'	Morgan Stanley	(34,468)
(34,683)	Altair Engineering Inc 'A'	Goldman Sachs	(4,731)
(7,000)	Alteryx Inc 'A'	Goldman Sachs	(1,207)
(10,316)	Alteryx Inc 'A'	Morgan Stanley	(63,134)
5,676	Alteryx Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(3,633)
6,479	Alteryx Inc 'A'	Goldman Sachs	(4,147)
55,972	Altice USA Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(39,180)
53,014	Altice USA Inc 'A'	Morgan Stanley	36,580
(18,381)	Altisource Portfolio Solutions SA	Morgan Stanley	(26,836)
(56,223)	Altisource Portfolio Solutions SA	Bank of America Merrill Lynch	(58,526)
(7,439)	Altra Industrial Motion Corp	Goldman Sachs	14,696
12,428	Altria Group Inc	Goldman Sachs	(15,143)
42,747	Altria Group Inc	Morgan Stanley	85,921
(4,254)	Amalgamated Bank Of New York 'A'	Goldman Sachs	(2,178)
(77,227)	Ambac Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	32,435
(33,212)	Ambac Financial Group Inc	Morgan Stanley	(19,927)
28,714	Ambarella Inc	Bank of America Merrill Lynch	106,816
8,153	Ambarella Inc	Goldman Sachs	30,329
27,252	Amber Road Inc	Goldman Sachs	(8,993)
18,451	Amber Road Inc	Morgan Stanley	3,321
58,364	Amber Road Inc	Bank of America Merrill Lynch	(19,260)
258,961	Ambev SA ADR	Morgan Stanley	27,191
139,674	Ambev SA ADR	Goldman Sachs	6,285
(5,482)	AMC Entertainment Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	277
78,293	AMC Entertainment Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	(61,851)
45,268	AMC Entertainment Holdings Inc 'A'	Morgan Stanley	3,169
12,077	AMC Entertainment Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(9,541)
3,541	AMC Networks Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,593)
10,182	AMC Networks Inc 'A'	Morgan Stanley	12,392
28,351	AMC Networks Inc 'A'	Goldman Sachs	6,612
(26,119)	Amedisys Inc	Bank of America Merrill Lynch	(415,553)
(719)	AMERCO	Goldman Sachs	(4,375)
(6,726)	AMERCO	Bank of America Merrill Lynch	(58,651)
(9,196)	AMERCO	Morgan Stanley	(8,001)
41,665	Ameren Corp	Goldman Sachs	(56,664)
7,727	Ameren Corp	Bank of America Merrill Lynch	(10,509)
5,573	America Movil SAB de CV ADR	Morgan Stanley	2,452
30,131	America's Car-Mart Inc/TX	Bank of America Merrill Lynch	92,502
8,874	America's Car-Mart Inc/TX	Goldman Sachs	27,243
78,988	American Assets Trust Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	176,933

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
6,350	American Assets Trust Inc (Reit)	Goldman Sachs	14,224
7,567	American Assets Trust Inc (Reit)	Morgan Stanley	11,956
(67,049)	American Axle & Manufacturing Holdings Inc	Morgan Stanley	(34,865)
(129,068)	American Axle & Manufacturing Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	47,755
(130,994)	American Axle & Manufacturing Holdings Inc	Goldman Sachs	6,468
6,047	American Campus Communities Inc (Reit)	Goldman Sachs	18,564
75,331	American Campus Communities Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	231,266
2,333	American Campus Communities Inc (Reit)	Morgan Stanley	1,843
244,848	American Eagle Outfitters Inc	Bank of America Merrill Lynch	(37,951)
19,123	American Eagle Outfitters Inc	Morgan Stanley	23,617
4,354	American Equity Investment Life Holding Co	Morgan Stanley	(2,529)
(2,526)	American Equity Investment Life Holding Co	Goldman Sachs	(355)
4,847	American Equity Investment Life Holding Co	Goldman Sachs	(223)
(4,948)	American Express Co	Morgan Stanley	(27,610)
13,680	American Express Co	Bank of America Merrill Lynch	23,530
1,054	American Express Co	Goldman Sachs	1,813
56,659	American Financial Group Inc/OH	Bank of America Merrill Lynch	(2,266)
23,882	American Financial Group Inc/OH	Morgan Stanley	3,343
(34,624)	American International Group Inc	Goldman Sachs	(15,276)
(107,403)	American International Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(64,442)
(8,094)	American International Group Inc	Morgan Stanley	648
24,356	American National Bankshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	(13,883)
4,100	American National Bankshares Inc	Goldman Sachs	(2,337)
6,055	American National Insurance Co	Bank of America Merrill Lynch	22,464
(1,032)	American Public Education Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,187
(5,641)	American Railcar Industries Inc	Morgan Stanley	(1,410)
1,420	American Renal Associates Holdings Inc	Goldman Sachs	2,002
1,236	American Renal Associates Holdings Inc	Morgan Stanley	766
85,795	American Software Inc/GA 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(42,898)
43,123	American Software Inc/GA 'A'	Goldman Sachs	(21,562)
34,086	American Software Inc/GA 'A'	Morgan Stanley	4,090
(17,607)	American States Water Co	Goldman Sachs	(22,889)
(14,166)	American States Water Co	Morgan Stanley	1,983
(166,460)	American Superconductor Corp	Morgan Stanley	(239,702)
2,668	American Tower Corp (Reit)	Goldman Sachs	(4,323)
13,034	American Tower Corp (Reit)	Morgan Stanley	44,967
(15,140)	American Tower Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(25,889)
(2,141)	American Tower Corp (Reit)	Goldman Sachs	(3,661)
4,786	American Water Works Co Inc	Morgan Stanley	3,063
611	American Water Works Co Inc	Goldman Sachs	403
93,517	American Water Works Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	61,721
(10,276)	American Woodmark Corp	Bank of America Merrill Lynch	(24,097)
(248,071)	Americold Realty Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(167,952)
(55,469)	Americold Realty Trust (Reit)	Morgan Stanley	(555)
9,775	Ameriprise Financial Inc	Morgan Stanley	57,282

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(11,486)	Ameris Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	18,607
(16,073)	Ameris Bancorp	Morgan Stanley	(6,590)
(10,227)	Ameris Bancorp	Goldman Sachs	15,327
30,881	AmerisourceBergen Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,544
27,116	AmerisourceBergen Corp	Morgan Stanley	41,759
(15,013)	AMETEK Inc	Morgan Stanley	(27,174)
64,965	AMETEK Inc	Bank of America Merrill Lynch	(60,417)
4,665	Amgen Inc	Bank of America Merrill Lynch	54,067
337	Amgen Inc	Morgan Stanley	3,865
13,194	Amgen Inc	Goldman Sachs	152,918
712,440	Amkor Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	64,120
113,700	Amkor Technology Inc	Goldman Sachs	10,233
36,940	Amkor Technology Inc	Morgan Stanley	15,145
4,653	AMN Healthcare Services Inc	Morgan Stanley	20,520
(8,441)	AMN Healthcare Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(39,926)
(30,783)	Amneal Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11,082)
1,369	Amphastar Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	890
1,385	Amphastar Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	1,967
(136,315)	Amyris Inc	Bank of America Merrill Lynch	(120,639)
(3,797)	Amyris Inc	Morgan Stanley	(3,076)
37,799	Anadarko Petroleum Corp	Goldman Sachs	(53,272)
57,798	Anadarko Petroleum Corp	Bank of America Merrill Lynch	(178,596)
49,873	Anadarko Petroleum Corp	Morgan Stanley	7,702
35,909	Analog Devices Inc	Goldman Sachs	25,876
9,015	Analog Devices Inc	Morgan Stanley	5,021
(11,773)	AnaptysBio Inc	Bank of America Merrill Lynch	(106,546)
(34,396)	ANGI Homeservices Inc 'A'	Morgan Stanley	(1,376)
(144,382)	AngioDynamics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,888)
(29,572)	ANI Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(65,354)
734	Anika Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(580)
59,913	Anixter International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(377,452)
5,680	Anixter International Inc	Goldman Sachs	(35,784)
8,005	Anixter International Inc	Morgan Stanley	(3,362)
(22,719)	Annaly Capital Management Inc (Reit)	Goldman Sachs	(5,112)
(300,751)	Annaly Capital Management Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(67,669)
(25,789)	ANSYS Inc	Bank of America Merrill Lynch	23,726
(302,730)	Antares Pharma Inc	Bank of America Merrill Lynch	(48,437)
(80,274)	Antares Pharma Inc	Goldman Sachs	(12,844)
121,122	Antero Resources Corp	Bank of America Merrill Lynch	(118,700)
83,869	Anworth Mortgage Asset Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	13,419
30,037	Anworth Mortgage Asset Corp (Reit)	Goldman Sachs	4,806
42,671	Anworth Mortgage Asset Corp (Reit)	Morgan Stanley	1,707
(47,997)	AO Smith Corp	Goldman Sachs	(38,769)
(18,217)	AO Smith Corp	Morgan Stanley	(19,857)
(3,506)	Aon Plc	Goldman Sachs	(11,907)



保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(35,631)	Aon Plc	Morgan Stanley	(130,053)
8,861	Apache Corp	Bank of America Merrill Lynch	(22,507)
27,091	Apache Corp	Goldman Sachs	(68,811)
6,743	Apache Corp	Morgan Stanley	(2,765)
28,290	Apergy Corp	Bank of America Merrill Lynch	(66,199)
(421,263)	Apollo Commercial Real Estate Finance Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(176,930)
(148,045)	Apollo Commercial Real Estate Finance Inc (Reit)	Morgan Stanley	(68,101)
17,551	Appfolio Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	54,935
1,657	Appfolio Inc 'A'	Goldman Sachs	5,186
2,283	Appfolio Inc 'A'	Morgan Stanley	10,342
(875)	Appian Corp	Goldman Sachs	(2,231)
(6,847)	Appian Corp	Bank of America Merrill Lynch	(17,460)
(2,530)	Appian Corp	Morgan Stanley	(8,172)
(743)	Apple Inc	Morgan Stanley	(4,510)
42,676	Applied Genetic Technologies Corp/DE	Bank of America Merrill Lynch	(19,204)
31,839	Applied Genetic Technologies Corp/DE	Morgan Stanley	(8,915)
138,041	Applied Industrial Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(190,497)
8,634	Applied Industrial Technologies Inc	Goldman Sachs	(11,915)
55,943	Applied Materials Inc	Goldman Sachs	100,977
100,625	Applied Materials Inc	Bank of America Merrill Lynch	181,628
12,471	Applied Materials Inc	Morgan Stanley	22,136
(7,560)	Applied Optoelectronics Inc	Goldman Sachs	(5,233)
150,507	Approach Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10,535)
51,799	Approach Resources Inc	Goldman Sachs	(3,626)
100,532	Approach Resources Inc	Morgan Stanley	(4,021)
(16,391)	AptarGroup Inc	Morgan Stanley	(6,720)
(32,020)	Aptiv Plc	Goldman Sachs	115,912
(20,951)	Aqua America Inc	Bank of America Merrill Lynch	(14,875)
(17,749)	Aqua America Inc	Morgan Stanley	7,455
(43,231)	Aqua America Inc	Goldman Sachs	(30,694)
2,136	Aquestive Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(16,938)
(8,550)	Aramark	Bank of America Merrill Lynch	(10,004)
2,519	Aravive Inc	Bank of America Merrill Lynch	(529)
5,723	Aravive Inc	Goldman Sachs	(1,202)
16,342	Aravive Inc	Morgan Stanley	1,307
371,716	Arbor Realty Trust Inc (Reit)	Morgan Stanley	(18,586)
422,881	Arbor Realty Trust Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(29,602)
(108,797)	Arbutus Biopharma Corp	Bank of America Merrill Lynch	(10,880)
330,608	ARC Document Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	(109,101)
64,773	ARC Document Solutions Inc	Goldman Sachs	(21,375)
131,114	ARC Document Solutions Inc	Morgan Stanley	(3,933)
(16,351)	ArcBest Corp	Bank of America Merrill Lynch	15,860
(10,282)	Arch Capital Group Ltd	Goldman Sachs	(3,393)
(70,725)	Arch Capital Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(23,339)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(52,522)	Arch Capital Group Ltd	Morgan Stanley	(33,089)
7,118	Archer-Daniels-Midland Co	Goldman Sachs	2,226
1,273	Archer-Daniels-Midland Co	Morgan Stanley	1,082
78,208	Archer-Daniels-Midland Co	Bank of America Merrill Lynch	(6,257)
49,952	Archrock Inc	Bank of America Merrill Lynch	(14,986)
6,247	Archrock Inc	Morgan Stanley	625
(6,050)	Archrock Inc	Morgan Stanley	(605)
27,511	Archrock Inc	Goldman Sachs	(8,253)
(1,705)	Arconic Inc	Goldman Sachs	(1,273)
(62,439)	Arconic Inc	Bank of America Merrill Lynch	(32,468)
(108,097)	Arconic Inc	Morgan Stanley	(73,506)
18,995	Arcosa Inc	Goldman Sachs	(68,574)
3,088	Arcus Biosciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	(679)
28,238	Arcus Biosciences Inc	Goldman Sachs	(2,366)
98,245	Ardelyx Inc	Bank of America Merrill Lynch	(18,667)
119,226	Ardelyx Inc	Goldman Sachs	(22,653)
83,282	Ardelyx Inc	Morgan Stanley	(9,161)
3,951	Ardmore Shipping Corp	Morgan Stanley	316
57,029	Ardmore Shipping Corp	Goldman Sachs	(22,292)
(12,267)	Arena Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(14,598)
137,721	Ares Commercial Real Estate Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(1,377)
8,460	Ares Commercial Real Estate Corp (Reit)	Goldman Sachs	(85)
(89,734)	Argan Inc	Bank of America Merrill Lynch	(37,688)
(139,307)	Argo Group International Holdings Ltd	Goldman Sachs	(162,989)
3,060	Arista Networks Inc	Bank of America Merrill Lynch	(21,695)
30,213	Arlington Asset Investment Corp 'A'	Goldman Sachs	3,181
11,636	Arlo Technologies Inc	Goldman Sachs	(16,523)
30,200	Arlo Technologies Inc	Morgan Stanley	(7,550)
18,437	Armstrong Flooring Inc	Morgan Stanley	(4,056)
90,108	Armstrong Flooring Inc	Bank of America Merrill Lynch	(81,097)
19,627	Armstrong Flooring Inc	Goldman Sachs	(17,664)
(4,126)	Armstrong World Industries Inc	Morgan Stanley	(10,893)
(20,692)	Armstrong World Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10,967)
(6,733)	Armstrong World Industries Inc	Goldman Sachs	(3,568)
(10,052)	ArQule Inc	Morgan Stanley	(804)
(36,982)	ArQule Inc	Bank of America Merrill Lynch	7,027
(48,937)	Array BioPharma Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,447
(14,485)	Arrow Electronics Inc	Morgan Stanley	(41,862)
(17,286)	Arrow Electronics Inc	Goldman Sachs	(19,241)
(56,621)	Arrow Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(43,032)
(30,559)	Arrowhead Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(51,645)
2,497	Artesian Resources Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,373)
715	Artesian Resources Corp 'A'	Goldman Sachs	(393)
884	Artesian Resources Corp 'A'	Morgan Stanley	248
75,861	Arthur J Gallagher & Co	Bank of America Merrill Lynch	78,137

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
14,676	Arthur J Gallagher & Co	Morgan Stanley	25,389
(47,575)	Artisan Partners Asset Management Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(23,788)
838	Asbury Automotive Group Inc	Goldman Sachs	(327)
144,161	Asbury Automotive Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(56,223)
(242,748)	Ascena Retail Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	222,114
25,726	ASGN Inc	Bank of America Merrill Lynch	21,610
5,631	ASGN Inc	Goldman Sachs	8,758
13,556	ASGN Inc	Morgan Stanley	3,118
10,728	Ashford Hospitality Trust Inc (Reit)	Goldman Sachs	(43)
(6,470)	Ashford Inc	Bank of America Merrill Lynch	(40,243)
(298)	Ashford Inc	Goldman Sachs	(1,854)
(14,515)	Ashford Inc	Morgan Stanley	(108,863)
(42,194)	Ashland Global Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	20,253
899	ASML Holding NV	Morgan Stanley	4,747
87,124	Aspen Aerogels Inc	Morgan Stanley	8,712
1,326	Aspen Aerogels Inc	Bank of America Merrill Lynch	(265)
(74,962)	Aspen Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(164,167)
1,290	Aspen Technology Inc	Morgan Stanley	8,591
28,939	Assembly Biosciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	34,148
5,991	Assembly Biosciences Inc	Goldman Sachs	7,069
10,187	Assembly Biosciences Inc	Morgan Stanley	2,852
(76,184)	Assertio Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	72,375
(22,221)	Associated Capital Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	46,886
(830)	Associated Capital Group Inc 'A'	Goldman Sachs	1,751
8,802	Assurant Inc	Goldman Sachs	(20,421)
(16,179)	Assurant Inc	Bank of America Merrill Lynch	37,535
45,804	Assurant Inc	Morgan Stanley	14,657
35,440	Assured Guaranty Ltd	Goldman Sachs	28,588
1,150	Assured Guaranty Ltd	Bank of America Merrill Lynch	868
20,741	Assured Guaranty Ltd	Morgan Stanley	14,208
6,468	Astec Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	5,174
3,500	Astec Industries Inc	Goldman Sachs	2,800
(434)	Astronics Corp 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(278)
(1,792)	Astronics Corp 'B'	Morgan Stanley	(1,165)
(29,216)	At Home Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	12,271
(16,710)	At Home Group Inc	Morgan Stanley	(23,394)
(14,755)	At Home Group Inc	Goldman Sachs	(868)
(184,440)	AT&T Inc	Goldman Sachs	(225,017)
(134,207)	AT&T Inc	Morgan Stanley	(265,730)
(80,706)	AT&T Inc	Bank of America Merrill Lynch	(98,461)
13,364	Athene Holding Ltd 'A'	Goldman Sachs	(23,788)
21,845	Athene Holding Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(38,884)
(76,063)	Athenex Inc	Bank of America Merrill Lynch	(130,828)
(20,605)	Athenex Inc	Morgan Stanley	(10,509)
281,877	Athersys Inc	Bank of America Merrill Lynch	8,456

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
292,290	Athersys Inc	Goldman Sachs	8,769
109,693	Athersys Inc	Morgan Stanley	(8,775)
31,588	Atkore International Group Inc	Morgan Stanley	66,019
116,867	Atkore International Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	93,494
7,427	Atlantic Capital Bancshares Inc	Goldman Sachs	3,482
84,187	Atlantic Power Corp	Morgan Stanley	1,684
65,920	Atlantic Power Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,978
68,306	Atlantic Power Corp	Goldman Sachs	2,049
4,046	Atlas Air Worldwide Holdings Inc	Goldman Sachs	(11,248)
2,717	Atlas Air Worldwide Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,553)
6,406	Atlas Financial Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,548)
5,972	Atlas Financial Holdings Inc	Goldman Sachs	(4,240)
4,204	Atlas Financial Holdings Inc	Morgan Stanley	(1,513)
12,878	Atlassian Corp Plc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	135,090
(1,018)	Atlassian Corp Plc 'A'	Morgan Stanley	(13,275)
26,432	Atmos Energy Corp	Goldman Sachs	(119,617)
98,864	Atmos Energy Corp	Morgan Stanley	(288,683)
(33,719)	ATN International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(63,392)
6,771	AtriCure Inc	Bank of America Merrill Lynch	9,479
(1,076)	Atrion Corp	Bank of America Merrill Lynch	(54,521)
(2,276)	Atrion Corp	Goldman Sachs	(116,498)
7,687	aTyr Pharma Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,153
1,272	Audentes Therapeutics Inc	Goldman Sachs	1,170
(10,106)	Autodesk Inc	Morgan Stanley	(108,235)
(21,485)	Autodesk Inc	Bank of America Merrill Lynch	(195,728)
(15,289)	Autoliv Inc	Goldman Sachs	(6,727)
76,090	Automatic Data Processing Inc	Morgan Stanley	416,212
17,719	Automatic Data Processing Inc	Goldman Sachs	(15,770)
7,586	Automatic Data Processing Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,752)
58,104	AutoNation Inc	Bank of America Merrill Lynch	(51,132)
22,789	AutoNation Inc	Morgan Stanley	(1,367)
184	AutoZone Inc	Goldman Sachs	(499)
346	AutoZone Inc	Morgan Stanley	(4,380)
(150)	AutoZone Inc	Bank of America Merrill Lynch	(724)
(478)	AutoZone Inc	Goldman Sachs	(2,309)
2,293	Avalara Inc	Bank of America Merrill Lynch	275
1,233	Avalara Inc	Morgan Stanley	949
22,708	Avalara Inc	Goldman Sachs	11,372
(114)	AvalonBay Communities Inc (Reit)	Goldman Sachs	(808)
(1,796)	AvalonBay Communities Inc (Reit)	Morgan Stanley	(7,004)
1,942	Avangrid Inc	Goldman Sachs	756
4,703	Avangrid Inc	Morgan Stanley	993
(159,251)	Avangrid Inc	Bank of America Merrill Lynch	(49,368)
884	Avangrid Inc	Bank of America Merrill Lynch	(699)
10,802	Avanos Medical Inc	Morgan Stanley	(6,157)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(45,017)	Avanos Medical Inc	Bank of America Merrill Lynch	56,721
(32,212)	Avanos Medical Inc	Goldman Sachs	40,204
23,076	Avery Dennison Corp	Bank of America Merrill Lynch	86,073
(127,037)	Avid Bioservices Inc	Goldman Sachs	(54,626)
(28,938)	Avid Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	10,707
(65,884)	Avis Budget Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	145,933
(31,513)	Avnet Inc	Bank of America Merrill Lynch	(22,374)
1,374	Avon Products Inc	Goldman Sachs	(14)
(4,141)	Avrobio Inc	Goldman Sachs	8,779
64,221	AVX Corp	Goldman Sachs	(7,064)
8,057	AVX Corp	Morgan Stanley	1,370
255,602	AVX Corp	Bank of America Merrill Lynch	(28,116)
33,286	Axa Equitable Holdings Inc	Morgan Stanley	10,652
31,073	Axalta Coating Systems Ltd	Morgan Stanley	5,593
23,675	Axalta Coating Systems Ltd	Goldman Sachs	(1,894)
79,347	Axalta Coating Systems Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(6,348)
6,567	Axcelis Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	16,943
6,088	Axcelis Technologies Inc	Morgan Stanley	10,350
(22,345)	Axis Capital Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(31,060)
(9,012)	Axis Capital Holdings Ltd	Morgan Stanley	(14,870)
(54,534)	Axis Capital Holdings Ltd	Goldman Sachs	(75,802)
(47,954)	AxoGen Inc	Bank of America Merrill Lynch	26,854
(14,823)	AxoGen Inc	Morgan Stanley	(21,345)
(5,393)	Axon Enterprise Inc	Bank of America Merrill Lynch	32,574
(14,002)	Axon Enterprise Inc	Morgan Stanley	43,966
2,791	Axos Financial Inc	Goldman Sachs	2,239
(81,655)	Axos Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(34,295)
(47,938)	Axos Financial Inc	Goldman Sachs	(20,134)
(27,594)	Axos Financial Inc	Morgan Stanley	(43,047)
1,325	Axos Financial Inc	Morgan Stanley	2,067
(5,901)	AZZ Inc	Goldman Sachs	4,308
(7,926)	AZZ Inc	Morgan Stanley	(2,140)
(2,022)	B. Riley Financial Inc	Goldman Sachs	(1,415)
(327,506)	B. Riley Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(229,254)
(11,773)	B. Riley Financial Inc	Morgan Stanley	(4,238)
(23,667)	Babcock & Wilcox Enterprises Inc	Bank of America Merrill Lynch	(286)
(235,730)	Babcock & Wilcox Enterprises Inc	Goldman Sachs	(2,852)
29,864	Baker Hughes a GE Co	Goldman Sachs	(11,946)
(5,238)	Baker Hughes a GE Co	Bank of America Merrill Lynch	2,095
3,156	Balchem Corp	Bank of America Merrill Lynch	(12,592)
842	Balchem Corp	Morgan Stanley	1,507
763	Balchem Corp	Goldman Sachs	(429)
(34,607)	Ball Corp	Bank of America Merrill Lynch	26,301
(30,996)	Banc of California Inc	Goldman Sachs	(18,288)
(130,008)	Banc of California Inc	Bank of America Merrill Lynch	(76,705)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
117,557	Banco Bradesco SA ADR	Morgan Stanley	36,443
16,161	Banco de Chile ADR	Morgan Stanley	8,081
19,891	Banco Santander Brasil SA ADR	Goldman Sachs	(1,193)
166,574	Banco Santander Brasil SA ADR	Morgan Stanley	33,315
(5,889)	Banco Santander Chile ADR	Goldman Sachs	(707)
(62,612)	Banco Santander Chile ADR	Morgan Stanley	(51,968)
(20,300)	Banco Santander SA ADR	Morgan Stanley	(1,320)
(22,485)	Bancolumbia SA ADR	Morgan Stanley	19,562
(28,226)	Bancolumbia SA ADR	Goldman Sachs	64,638
29,324	Bancorp Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	(14,369)
27,646	Bancorp Inc/The	Goldman Sachs	(13,547)
28,683	Bancorp Inc/The	Morgan Stanley	(574)
6,372	BancorpSouth Bank	Morgan Stanley	5,098
262,386	BancorpSouth Bank	Bank of America Merrill Lynch	257,138
62,137	BancorpSouth Bank	Goldman Sachs	60,894
227,066	Bank of America Corp	Goldman Sachs	52,225
158,451	Bank of Commerce Holdings	Bank of America Merrill Lynch	(80,810)
60,250	Bank of Commerce Holdings	Goldman Sachs	(30,728)
40,396	Bank of Commerce Holdings	Morgan Stanley	(9,291)
6,259	Bank of Hawaii Corp	Goldman Sachs	4,028
7,876	Bank of Hawaii Corp	Bank of America Merrill Lynch	5,119
13,098	Bank of Hawaii Corp	Morgan Stanley	5,370
11,322	Bank of Marin Bancorp	Goldman Sachs	4,925
26,642	Bank of Marin Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	11,589
2,000	Bank of Marin Bancorp	Morgan Stanley	1,360
(12,306)	Bank of New York Mellon Corp/The	Morgan Stanley	(14,767)
(47,747)	Bank of New York Mellon Corp/The	Bank of America Merrill Lynch	(87,854)
(57,472)	Bank of New York Mellon Corp/The	Goldman Sachs	(105,394)
(4,047)	Bank of Princeton/The	Bank of America Merrill Lynch	931
(8,614)	Bank of Princeton/The	Morgan Stanley	(603)
30,400	Bank OZK	Goldman Sachs	21,888
25,407	Bank OZK	Morgan Stanley	14,736
32,486	BankFinancial Corp	Bank of America Merrill Lynch	14,944
38,868	BankFinancial Corp	Goldman Sachs	14,932
31,015	BankFinancial Corp	Morgan Stanley	620
(7,491)	BankUnited Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,547)
(4,797)	BankUnited Inc	Goldman Sachs	(1,631)
(2,343)	Bankwell Financial Group Inc	Morgan Stanley	633
(1,153)	Bankwell Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	127
(1,252)	Bankwell Financial Group Inc	Goldman Sachs	70
143,129	Banner Corp	Bank of America Merrill Lynch	(131,679)
(13,095)	Bar Harbor Bankshares	Bank of America Merrill Lynch	(11,000)
(2,021)	Bar Harbor Bankshares	Goldman Sachs	(1,698)
4,677	Barnes & Noble Education Inc	Goldman Sachs	399
121,981	Barnes & Noble Inc	Goldman Sachs	25,606

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益 / (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(49,882)	Barnes Group Inc	Morgan Stanley	(3,492)
(45,534)	Barnes Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	32,329
(22,257)	Barnes Group Inc	Goldman Sachs	15,802
4,500	Basic Energy Services Inc	Morgan Stanley	(315)
91,133	Basic Energy Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(95,690)
9,643	Bassett Furniture Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	6,943
4,282	Bassett Furniture Industries Inc	Goldman Sachs	3,083
4,196	Bassett Furniture Industries Inc	Morgan Stanley	1,385
5,750	Bausch Health Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,338)
10,576	Bausch Health Cos Inc	Goldman Sachs	(15,335)
(7,878)	Baxter International Inc	Goldman Sachs	(22,956)
(3,374)	Baxter International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,187)
4,381	Baycom Corp	Bank of America Merrill Lynch	(6,747)
5,517	Baycom Corp	Goldman Sachs	(8,496)
7,103	Baycom Corp	Morgan Stanley	(9,021)
117,880	BB&T Corp	Bank of America Merrill Lynch	(55,404)
14,836	BB&T Corp	Goldman Sachs	(6,973)
9,547	Beacon Roofing Supply Inc	Goldman Sachs	71,507
19,401	Beacon Roofing Supply Inc	Morgan Stanley	40,160
(10,570)	Beasley Broadcast Group Inc 'A'	Morgan Stanley	5,074
57,585	Beazer Homes USA Inc	Bank of America Merrill Lynch	82,347
(7,276)	Becton Dickinson and Co	Goldman Sachs	(84,944)
(7,173)	Becton Dickinson and Co	Morgan Stanley	(73,882)
(29,939)	Becton Dickinson and Co	Bank of America Merrill Lynch	(367,651)
(73,919)	Bed Bath & Beyond Inc	Bank of America Merrill Lynch	51,743
(2,999)	Belden Inc	Bank of America Merrill Lynch	840
17,597	Bellicum Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(662)
(3,773)	Belmond Ltd 'A'	Goldman Sachs	2,867
(105,173)	Benchmark Electronics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,259)
21,831	Benefitfocus Inc	Bank of America Merrill Lynch	132,653
9,616	Benefitfocus Inc	Morgan Stanley	71,255
(3,444)	Berkshire Hathaway Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(2,893)
(139,011)	Berkshire Hills Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	22,242
(36,935)	Berry Global Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,495)
(11,537)	Best Buy Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	40,495
(63,133)	BG Staffing Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,157
(903)	BG Staffing Inc	Goldman Sachs	45
(274,747)	BGC Partners Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	50,828
(218,434)	BGC Partners Inc 'A'	Morgan Stanley	(22,936)
(83,333)	BGC Partners Inc 'A'	Goldman Sachs	(2,108)
(32,427)	Big 5 Sporting Goods Corp	Bank of America Merrill Lynch	9,404
(7,312)	Big 5 Sporting Goods Corp	Goldman Sachs	2,120
(7,462)	Big 5 Sporting Goods Corp	Morgan Stanley	(75)
(2,980)	Big Lots Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,619)
87	Biglari Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(2,349)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
85	Biglari Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	(2,295)
56	Biglari Holdings Inc 'A'	Morgan Stanley	(1,400)
5,279	Biglari Holdings Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	2,323
2,155	Biglari Holdings Inc 'B'	Goldman Sachs	948
1,873	Biglari Holdings Inc 'B'	Morgan Stanley	4,701
(13,801)	Bio-Techne Corp	Bank of America Merrill Lynch	26,222
(5,765)	Bio-Techne Corp	Morgan Stanley	(9,628)
(94,222)	BioCryst Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(161,120)
(79,817)	BioCryst Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(136,487)
(14,294)	BioMarin Pharmaceutical Inc	Bank of America Merrill Lynch	(16,724)
(91,265)	BioScrip Inc	Morgan Stanley	(67,536)
4,318	BioSpecifics Technologies Corp	Bank of America Merrill Lynch	4,793
804	BioSpecifics Technologies Corp	Goldman Sachs	892
(2,693)	BioTelemetry Inc	Goldman Sachs	(26,203)
1,214	BioTelemetry Inc	Morgan Stanley	12,516
(1,617)	BioTelemetry Inc	Morgan Stanley	(16,671)
3,998	BioTelemetry Inc	Bank of America Merrill Lynch	38,901
4,270	BioTelemetry Inc	Goldman Sachs	41,547
(19,946)	BioTime Inc	Bank of America Merrill Lynch	7,779
(85,028)	BioTime Inc	Morgan Stanley	24,658
45,416	BJ's Restaurants Inc	Bank of America Merrill Lynch	(367,870)
84,711	BJ's Wholesale Club Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	125,372
29,445	BJ's Wholesale Club Holdings Inc	Goldman Sachs	43,978
23,553	BJ's Wholesale Club Holdings Inc	Morgan Stanley	28,028
22,021	Black Hills Corp	Goldman Sachs	50,428
76,744	Black Hills Corp	Bank of America Merrill Lynch	175,744
94,846	Black Hills Corp	Morgan Stanley	166,929
(4,126)	Blackbaud Inc	Goldman Sachs	(14,027)
(66,383)	Blackbaud Inc	Bank of America Merrill Lynch	(148,698)
(504)	Blackbaud Inc	Morgan Stanley	(1,406)
(6,406)	Blackline Inc	Morgan Stanley	(24,151)
(2,714)	Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (Reit)	Goldman Sachs	940
36,395	Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	14,922
39,315	Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (Reit)	Goldman Sachs	16,119
16,265	Bloom Energy Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	16,916
15,565	Bloomin' Brands Inc	Goldman Sachs	(12,141)
80,467	Bloomin' Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	(62,764)
(54,696)	Blucora Inc	Bank of America Merrill Lynch	(81,497)
(8,325)	Blucora Inc	Goldman Sachs	(13,157)
(10,245)	Blue Bird Corp	Bank of America Merrill Lynch	4,200
(4,967)	Blue Bird Corp	Goldman Sachs	2,036
(108,081)	Blue Bird Corp	Morgan Stanley	605,241
(136,559)	Blue Hills Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(19,118)
(56,343)	Blue Hills Bancorp Inc	Goldman Sachs	(8,956)
(18,156)	Bluebird Bio Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,715)



保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(36,014)	BlueLinx Holdings Inc	Goldman Sachs	(90,755)
(13,793)	BlueLinx Holdings Inc	Morgan Stanley	(42,069)
(7,359)	BlueLinx Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(18,545)
(26,026)	Blueprint Medicines Corp	Bank of America Merrill Lynch	(135,856)
(8,273)	Blueprint Medicines Corp	Goldman Sachs	(43,185)
3,541	BMC Stock Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,762
4,135	Boeing Co/The	Goldman Sachs	31,270
9,199	Boeing Co/The	Morgan Stanley	243,774
28,022	Boingo Wireless Inc	Bank of America Merrill Lynch	18,495
24,094	Boingo Wireless Inc	Goldman Sachs	15,902
15,776	Boise Cascade Co	Bank of America Merrill Lynch	(5,364)
28,729	Boise Cascade Co	Goldman Sachs	(11,104)
22,646	Boise Cascade Co	Morgan Stanley	(8,205)
3,300	BOK Financial Corp	Goldman Sachs	(5,181)
8,040	BOK Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(12,623)
(248)	Booking Holdings Inc	Goldman Sachs	(12,112)
(8,732)	Boot Barn Holdings Inc	Goldman Sachs	(6,695)
85,508	Booz Allen Hamilton Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	(118,856)
86,970	BorgWarner Inc	Bank of America Merrill Lynch	(53,052)
43,042	BorgWarner Inc	Morgan Stanley	(13,343)
(526)	Boston Beer Co Inc/The 'A'	Bank of America Merrill Lynch	14,044
201,329	Boston Private Financial Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(106,704)
38,401	Boston Private Financial Holdings Inc	Morgan Stanley	(2,304)
17,396	Boston Properties Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	110,291
50,859	Boston Properties Inc (Reit)	Morgan Stanley	249,209
5,355	Boston Scientific Corp	Goldman Sachs	16,573
(8,915)	Bottomline Technologies DE Inc	Goldman Sachs	(14,558)
101,280	Box Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	57,730
27,138	Box Inc 'A'	Goldman Sachs	15,469
150,448	Boyd Gaming Corp	Bank of America Merrill Lynch	(48,143)
21,393	Boyd Gaming Corp	Morgan Stanley	38,080
48,587	Boyd Gaming Corp	Goldman Sachs	(15,548)
(79,146)	Braemar Hotels & Resorts Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(12,663)
96,566	Brandywine Realty Trust (Reit)	Goldman Sachs	(2,787)
645,062	Brandywine Realty Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(6,451)
297,590	Brandywine Realty Trust (Reit)	Morgan Stanley	12,591
24,512	Braskem SA ADR	Goldman Sachs	31,866
16,853	Braskem SA ADR	Morgan Stanley	1,348
(144,106)	BRF SA ADR	Goldman Sachs	(72,053)
(231,759)	BRF SA ADR	Morgan Stanley	(23,176)
(194,911)	Bridge Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	91,608
(10,864)	Bridge Bancorp Inc	Goldman Sachs	5,106
62,727	Bridgepoint Education Inc	Bank of America Merrill Lynch	(16,309)
67,767	Bridgepoint Education Inc	Goldman Sachs	(17,619)
30,205	Bridgepoint Education Inc	Morgan Stanley	6,041

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
137,034	Bridgewater Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	25,351
30,016	Bridgewater Bancshares Inc	Goldman Sachs	5,553
22,425	Bridgewater Bancshares Inc	Morgan Stanley	9,082
51,749	Briggs & Stratton Corp	Bank of America Merrill Lynch	(52,784)
2,955	Bright Horizons Family Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	13,091
3,029	Bright Horizons Family Solutions Inc	Goldman Sachs	13,418
(7,621)	Brightcove Inc	Goldman Sachs	2,058
(74,359)	Brighthouse Financial Inc	Morgan Stanley	(156,897)
(48,936)	Brighthouse Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	16,149
2,161	BrightSphere Investment Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	598
34,677	BrightView Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(13,871)
61,481	BrightView Holdings Inc	Goldman Sachs	(19,754)
35,423	BrightView Holdings Inc	Morgan Stanley	31,526
(69,570)	Brink's Co/The	Bank of America Merrill Lynch	(188,535)
(3,053)	Brinker International Inc	Goldman Sachs	(4,549)
(90,364)	Brinker International Inc	Morgan Stanley	(279,225)
11,774	Brinker International Inc	Morgan Stanley	36,382
33,552	Bristol-Myers Squibb Co	Bank of America Merrill Lynch	(28,519)
(71,245)	Bristow Group Inc	Goldman Sachs	151,394
(26,204)	Bristow Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	89,094
(4,384)	Bristow Group Inc	Morgan Stanley	2,192
165,595	Brixmor Property Group Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	164,767
181,374	Brixmor Property Group Inc (Reit)	Morgan Stanley	171,398
(1,565)	Broadcom Inc	Bank of America Merrill Lynch	783
4,225	Broadridge Financial Solutions Inc	Goldman Sachs	17,014
2,913	Broadridge Financial Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9,030)
15,368	Brookdale Senior Living Inc	Goldman Sachs	(3,381)
22,160	Brookdale Senior Living Inc	Morgan Stanley	5,983
(2,911)	Brookfield Property REIT Inc (Reit) 'A'	Bank of America Merrill Lynch	2,678
(486,604)	Brookline Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(136,249)
7,475	Brooks Automation Inc	Goldman Sachs	26,638
(63,381)	Brooks Automation Inc	Bank of America Merrill Lynch	(101,410)
600	Brooks Automation Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,298
4,662	Brooks Automation Inc	Morgan Stanley	24,802
95,232	Brown & Brown Inc	Morgan Stanley	70,472
45,233	Brown-Forman Corp 'B'	Goldman Sachs	(7,065)
99,276	Brown-Forman Corp 'B'	Morgan Stanley	106,157
8,450	Bruker Corp	Goldman Sachs	7,098
29,153	Bruker Corp	Bank of America Merrill Lynch	24,489
26,539	Bruker Corp	Morgan Stanley	28,131
7,511	Brunswick Corp/DE	Goldman Sachs	(8,037)
55,989	Brunswick Corp/DE	Morgan Stanley	(20,716)
(6,984)	Brunswick Corp/DE	Bank of America Merrill Lynch	7,473
(24,788)	Bryn Mawr Bank Corp	Bank of America Merrill Lynch	14,129
830	BSB Bancorp Inc/MA	Bank of America Merrill Lynch	3,187

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(64,562)	Buckle Inc/The	Morgan Stanley	(2,582)
(21,309)	Buckle Inc/The	Goldman Sachs	14,064
(3,177)	Build-A-Bear Workshop Inc	Bank of America Merrill Lynch	5,020
(15,019)	Build-A-Bear Workshop Inc	Morgan Stanley	21,027
(12,795)	Builders FirstSource Inc	Goldman Sachs	(13,819)
(111,505)	Builders FirstSource Inc	Bank of America Merrill Lynch	(120,425)
(73,177)	Builders FirstSource Inc	Morgan Stanley	(39,516)
(5,272)	Bunge Ltd	Goldman Sachs	3,707
17,939	Bunge Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(26,370)
1,881	Burlington Stores Inc	Goldman Sachs	40,848
5,819	Burlington Stores Inc	Morgan Stanley	123,426
(14,316)	BWX Technologies Inc	Goldman Sachs	(16,469)
(57,277)	BWX Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(54,986)
(9,344)	BWX Technologies Inc	Morgan Stanley	(14,483)
(1,279)	Byline Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	691
(5,633)	Byline Bancorp Inc	Goldman Sachs	936
(4,478)	C&F Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	15,628
(2,577)	C&F Financial Corp	Goldman Sachs	8,994
(5,445)	C&J Energy Services Inc	Morgan Stanley	272
(1,317)	Cable One Inc	Bank of America Merrill Lynch	(27,420)
(379)	Cable One Inc	Morgan Stanley	(14,171)
33,603	Cabot Corp	Goldman Sachs	(61,830)
32,956	Cabot Corp	Bank of America Merrill Lynch	(60,639)
34,242	Cabot Corp	Morgan Stanley	45,199
(15,758)	Cabot Oil & Gas Corp	Goldman Sachs	3,316
(28,784)	Cabot Oil & Gas Corp	Bank of America Merrill Lynch	28,352
1,537	CACI International Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(19,950)
(28,040)	CACI International Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	363,959
(794)	CACI International Inc 'A'	Goldman Sachs	6,010
30,486	Cactus Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(112,188)
18,674	Cactus Inc 'A'	Goldman Sachs	(68,720)
(19,802)	Cadence BanCorp	Goldman Sachs	14,155
194,729	Cadence BanCorp	Bank of America Merrill Lynch	(151,889)
46,520	Cadence BanCorp	Goldman Sachs	(33,847)
29,242	Cadence BanCorp	Morgan Stanley	4,386
9,105	Cadence Design Systems Inc	Goldman Sachs	(12,656)
27,613	Cadence Design Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(38,382)
5,884	Cadiz Inc	Bank of America Merrill Lynch	(824)
6,300	Cadiz Inc	Goldman Sachs	(2,003)
2,420	Cadiz Inc	Morgan Stanley	(702)
(215,413)	Caesars Entertainment Corp	Goldman Sachs	(11,848)
(5,442)	CAI International Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,354
397	Calavo Growers Inc	Bank of America Merrill Lynch	798
(2,522)	Caleres Inc	Goldman Sachs	8,146
16,761	Caleres Inc	Goldman Sachs	(54,138)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
1,475	Caleres Inc	Morgan Stanley	2,404
(18,430)	California Resources Corp	Morgan Stanley	1,081
(2,787)	California Resources Corp	Bank of America Merrill Lynch	3,121
(3,236)	California Water Service Group	Bank of America Merrill Lynch	(4,498)
29,180	Calithera Biosciences Inc	Morgan Stanley	1,167
65,202	Calithera Biosciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	(13,040)
93,443	Calithera Biosciences Inc	Goldman Sachs	(18,689)
79,438	Calix Inc	Bank of America Merrill Lynch	(82,616)
30,836	Calix Inc	Morgan Stanley	(8,326)
52,683	Calix Inc	Goldman Sachs	(51,153)
38,890	Callaway Golf Co	Bank of America Merrill Lynch	(160,616)
(454,072)	Callon Petroleum Co	Bank of America Merrill Lynch	563,049
(34,798)	Cambrex Corp	Bank of America Merrill Lynch	(29,230)
(2,500)	Cambrex Corp	Morgan Stanley	(700)
(5,601)	Cambrex Corp	Goldman Sachs	(4,705)
(16,717)	Camden National Corp	Bank of America Merrill Lynch	19,893
(56,059)	Camden National Corp	Goldman Sachs	66,710
(59,287)	Campbell Soup Co	Goldman Sachs	3,557
(16,317)	Campbell Soup Co	Bank of America Merrill Lynch	979
(1,259)	Canada Goose Holdings Inc	Goldman Sachs	1,575
(3,105)	Canada Goose Holdings Inc	Morgan Stanley	7,763
30,860	Cantel Medical Corp	Bank of America Merrill Lynch	41,352
14,399	Cantel Medical Corp	Morgan Stanley	18,287
21,347	Cantel Medical Corp	Goldman Sachs	28,605
57,647	Capital City Bank Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	91,082
22,174	Capital City Bank Group Inc	Goldman Sachs	35,216
22,819	Capital City Bank Group Inc	Morgan Stanley	36,054
5,485	Capital One Financial Corp	Goldman Sachs	(2,797)
32,682	Capital One Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(16,668)
(88,000)	Capital Senior Living Corp	Bank of America Merrill Lynch	(77,440)
(201,102)	Capstead Mortgage Corp (Reit)	Goldman Sachs	(35,193)
(547,423)	Capstead Mortgage Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(95,799)
(4,063)	Capstead Mortgage Corp (Reit)	Morgan Stanley	(345)
8,886	Cara Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,199)
5,616	Cara Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(2,022)
7,751	Cara Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(1,395)
5,197	Carbon Black Inc	Goldman Sachs	(3,898)
1,868	Carbon Black Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,401)
6,654	Carbon Black Inc	Morgan Stanley	(5,456)
(2,883)	Carbonite Inc	Goldman Sachs	(634)
16,998	Cardinal Health Inc	Morgan Stanley	37,056
51,173	Cardinal Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	(131,515)
36,121	Cardinal Health Inc	Goldman Sachs	(76,945)
105,302	Cardiovascular Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	76,870
10,729	Cardiovascular Systems Inc	Goldman Sachs	7,832

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
5,752	Cardiovascular Systems Inc	Morgan Stanley	1,323
(9,204)	Cardlytics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,694)
(20,037)	Cardlytics Inc	Morgan Stanley	12,423
27,142	Care.com Inc	Goldman Sachs	(24,971)
44,379	Care.com Inc	Bank of America Merrill Lynch	(40,829)
11,783	Care.com Inc	Morgan Stanley	825
(76,357)	Career Education Corp	Bank of America Merrill Lynch	(41,233)
60,126	CareTrust REIT Inc (Reit)	Morgan Stanley	31,867
585,096	CareTrust REIT Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	608,500
27,644	Cargurus Inc	Bank of America Merrill Lynch	34,831
39,977	Cargurus Inc	Goldman Sachs	53,545
5,626	Cargurus Inc	Morgan Stanley	9,395
(10,110)	CarMax Inc	Bank of America Merrill Lynch	(26,387)
63,077	Carnival Corp	Bank of America Merrill Lynch	23,969
45,390	Carolina Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	31,319
11,172	Carolina Financial Corp	Goldman Sachs	7,709
5,830	Carolina Financial Corp	Morgan Stanley	(1,807)
3,215	Carpenter Technology Corp	Goldman Sachs	(4,662)
22,344	Carpenter Technology Corp	Morgan Stanley	32,175
18,261	Carpenter Technology Corp	Bank of America Merrill Lynch	(26,478)
14,959	Carriage Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,244
33,876	Carriage Services Inc	Goldman Sachs	5,081
96,857	Carrols Restaurant Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	6,780
69,047	Carrols Restaurant Group Inc	Goldman Sachs	4,833
738	Cars.com Inc	Goldman Sachs	443
8,159	Cars.com Inc	Morgan Stanley	6,119
(16,603)	Carter 's Inc	Goldman Sachs	(72,042)
(3,553)	Carter 's Inc	Morgan Stanley	(8,207)
(22,525)	Carter 's Inc	Bank of America Merrill Lynch	(98,209)
(46,276)	Carvana Co	Goldman Sachs	43,676
(18,843)	Carvana Co	Morgan Stanley	(66,704)
(11,949)	Casa Systems Inc	Morgan Stanley	358
4,838	Casa Systems Inc	Goldman Sachs	570
(30,542)	Casella Waste Systems Inc ' A '	Bank of America Merrill Lynch	(72,690)
281,812	Castlight Health Inc ' B '	Bank of America Merrill Lynch	(64,817)
164,737	Castlight Health Inc ' B '	Goldman Sachs	(33,049)
82,846	Castlight Health Inc ' B '	Morgan Stanley	(12,427)
(30,908)	Catalent Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,654)
(31,824)	Catalent Inc	Morgan Stanley	(20,367)
(43,544)	Catalent Inc	Goldman Sachs	(25,136)
(33,293)	Catalyst Biosciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	16,979
(3,684)	Caterpillar Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9,247)
(1,447)	Caterpillar Inc	Morgan Stanley	(13,906)
267,366	Cathay General Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	2,674
48,110	Cathay General Bancorp	Morgan Stanley	30,406

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
35,648	Cathay General Bancorp	Goldman Sachs	356
151,450	Cato Corp/The 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(374,082)
19,195	Cato Corp/The 'A'	Goldman Sachs	(47,412)
(9,624)	Cavco Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	45,040
(9,360)	Cavco Industries Inc	Morgan Stanley	(6,552)
(480)	Cavco Industries Inc	Goldman Sachs	(309)
218,823	CBIZ Inc	Bank of America Merrill Lynch	(26,259)
23,118	CBIZ Inc	Goldman Sachs	(2,774)
13,200	CBIZ Inc	Morgan Stanley	7,524
(118,808)	CBL & Associates Properties Inc (Reit)	Morgan Stanley	11,881
(718,753)	CBL & Associates Properties Inc (Reit)	Goldman Sachs	143,751
(3,005)	Cboe Global Markets Inc	Bank of America Merrill Lynch	8,114
(7,872)	CBRE Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(3,779)
2,100	CBS Corp 'B'	Morgan Stanley	1,832
20,833	CBS Corp 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(51,666)
5,647	CBS Corp 'B'	Goldman Sachs	(14,005)
30,789	CDK Global Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,463)
830	CDK Global Inc	Morgan Stanley	(100)
33,400	CDW Corp/DE	Goldman Sachs	157,314
40,074	CDW Corp/DE	Bank of America Merrill Lynch	188,749
45,481	CDW Corp/DE	Morgan Stanley	245,597
176,925	CECO Environmental Corp	Bank of America Merrill Lynch	12,385
41,325	CECO Environmental Corp	Goldman Sachs	2,893
(6,286)	Celanese Corp	Goldman Sachs	12,601
36,396	Celanese Corp	Bank of America Merrill Lynch	(90,626)
(3,690)	Celanese Corp	Morgan Stanley	10,480
(700)	Celcuity Inc	Goldman Sachs	(1,379)
38,751	Celgene Corp	Bank of America Merrill Lynch	-
112,228	Cemex SAB de CV ADR	Goldman Sachs	6,173
215,325	Cemex SAB de CV ADR	Morgan Stanley	63,521
(5,077)	Centennial Resource Development Inc/DE 'A'	Goldman Sachs	7,717
(116,207)	Centennial Resource Development Inc/DE 'A'	Bank of America Merrill Lynch	176,635
(89,455)	Centennial Resource Development Inc/DE 'A'	Morgan Stanley	38,466
104,662	CenterPoint Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	34,538
5,060	CenterState Bank Corp	Morgan Stanley	3,643
33,204	CenterState Bank Corp	Goldman Sachs	7,307
243,668	CenterState Bank Corp	Bank of America Merrill Lynch	46,297
195,694	Central European Media Enterprises Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	-
40,060	Central European Media Enterprises Ltd 'A'	Goldman Sachs	-
10,799	Central Garden & Pet Co 'A'	Morgan Stanley	21,274
21,604	Central Garden & Pet Co 'A'	Bank of America Merrill Lynch	36,727
156,086	Central Pacific Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(29,656)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
118,937	Central Pacific Financial Corp	Morgan Stanley	7,136
(5,746)	Central Valley Community Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	(7,183)
(5,616)	Central Valley Community Bancorp	Goldman Sachs	(7,020)
(19,049)	Centric Brands Inc	Morgan Stanley	1,524
(22,678)	Century Aluminum Co	Bank of America Merrill Lynch	(907)
(2,419)	Century Bancorp Inc/MA 'A'	Goldman Sachs	(1,814)
(2,719)	Century Bancorp Inc/MA 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(2,039)
53,979	Century Casinos Inc	Bank of America Merrill Lynch	16,733
(32,873)	Century Communities Inc	Goldman Sachs	(10,412)
(26,598)	CenturyLink Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,990
(31,264)	Cerecor Inc	Morgan Stanley	1,876
(11,297)	Ceridian HCM Holding Inc	Morgan Stanley	(35,924)
(1,189)	Cerner Corp	Goldman Sachs	(143)
(77,620)	CEVA Inc	Bank of America Merrill Lynch	101,682
1,869	CF Industries Holdings Inc	Goldman Sachs	(7,794)
(24,553)	CF Industries Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	102,386
12,829	CF Industries Holdings Inc	Morgan Stanley	(10,007)
(6,985)	CH Robinson Worldwide Inc	Goldman Sachs	(9,958)
(4,512)	CH Robinson Worldwide Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,219)
(3,009)	Champions Oncology Inc	Goldman Sachs	(662)
(35,660)	Champions Oncology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,845)
278	ChannelAdvisor Corp	Goldman Sachs	(214)
6,874	ChannelAdvisor Corp	Bank of America Merrill Lynch	(5,293)
7,122	Charah Solutions Inc	Goldman Sachs	142
3,472	Charah Solutions Inc	Morgan Stanley	(1,007)
2,917	Charles River Laboratories International Inc	Goldman Sachs	18,297
2,969	Charles River Laboratories International Inc	Morgan Stanley	15,309
98,377	Charles Schwab Corp/The	Bank of America Merrill Lynch	(291,196)
50,119	Charles Schwab Corp/The	Morgan Stanley	14,033
(17,184)	Chart Industries Inc	Goldman Sachs	69,026
(49,076)	Chart Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	207,101
(5,767)	Chart Industries Inc	Morgan Stanley	(173)
(2,096)	Charter Communications Inc 'A'	Goldman Sachs	(36,923)
(18,218)	Charter Communications Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(228,818)
(27,774)	Charter Communications Inc 'A'	Morgan Stanley	(600,196)
(13,504)	Chase Corp	Bank of America Merrill Lynch	(105,871)
(1,295)	Chase Corp	Goldman Sachs	(9,902)
19,747	Chatham Lodging Trust (Reit)	Morgan Stanley	3,752
84,861	Chatham Lodging Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	11,881
10,151	Chatham Lodging Trust (Reit)	Goldman Sachs	1,421
2,498	CHC Group Ltd	Morgan Stanley	(1,124)
(12,418)	Check Point Software Technologies Ltd	Morgan Stanley	(26,326)
(9,725)	Check Point Software Technologies Ltd	Bank of America Merrill Lynch	22,173
114,750	Cheesecake Factory Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	(267,368)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
86,796	Cheesecake Factory Inc/The	Morgan Stanley	(191,819)
8,787	Chefs' Warehouse Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	15,641
(49,412)	Chegg Inc	Bank of America Merrill Lynch	(67,200)
8,150	Chegg Inc	Bank of America Merrill Lynch	11,084
38,169	Chegg Inc	Goldman Sachs	69,309
3,819	Chemed Corp	Morgan Stanley	49,303
16,919	Chemed Corp	Bank of America Merrill Lynch	44,328
(8,592)	Chemical Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,406)
79,240	ChemoCentryx Inc	Bank of America Merrill Lynch	11,886
(300)	Chemung Financial Corp	Goldman Sachs	(381)
(5,167)	Chemung Financial Corp	Morgan Stanley	1,705
14,050	Cheniere Energy Inc	Goldman Sachs	422
(51,638)	Chesapeake Energy Corp	Goldman Sachs	33,775
2,261	Chesapeake Lodging Trust (Reit)	Morgan Stanley	327
4,912	Chesapeake Utilities Corp	Goldman Sachs	(1,867)
2,398	Chesapeake Utilities Corp	Morgan Stanley	1,799
130,990	Chesapeake Utilities Corp	Bank of America Merrill Lynch	(49,776)
(15,693)	Chevron Corp	Goldman Sachs	(39,391)
(9,117)	Chevron Corp	Morgan Stanley	(38,747)
10,398	Chico's FAS Inc	Bank of America Merrill Lynch	(27,139)
(2,180)	Children's Place Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	11,925
(2,986)	Children's Place Inc/The	Goldman Sachs	16,333
63,211	Chimera Investment Corp (Reit)	Goldman Sachs	33,827
14,580	Chimera Investment Corp (Reit)	Morgan Stanley	6,124
162,363	Chimerix Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,118)
63,237	Chimerix Inc	Goldman Sachs	(3,162)
49,709	Chimerix Inc	Morgan Stanley	3,977
(810)	Chipotle Mexican Grill Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,519
(16,928)	Choice Hotels International Inc	Morgan Stanley	(17,605)
(11,314)	Chubb Ltd	Goldman Sachs	(25,206)
(200)	Chubb Ltd	Morgan Stanley	(602)
3,067	Church & Dwight Co Inc	Morgan Stanley	184
50,287	Church & Dwight Co Inc	Goldman Sachs	10,882
57,281	Church & Dwight Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	10,883
4,550	Churchill Downs Inc	Goldman Sachs	74,096
11,690	Churchill Downs Inc	Morgan Stanley	172,778
(1,235)	Churchill Downs Inc	Bank of America Merrill Lynch	(20,106)
(630)	Churchill Downs Inc	Goldman Sachs	(10,256)
16,172	Chuy's Holdings Inc	Goldman Sachs	13,584
9,308	Chuy's Holdings Inc	Morgan Stanley	(652)
46,381	Chuy's Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	38,960
14,757	Cia Brasileira de Distribuicao ADR	Goldman Sachs	2,361
33,620	Cia Brasileira de Distribuicao ADR	Morgan Stanley	10,422
58,268	Cia Cervecerias Unidas SA ADR	Goldman Sachs	56,520
24,937	Cia Cervecerias Unidas SA ADR	Morgan Stanley	-



保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(144,387)	Cia de Minas Buenaventura SAA ADR	Goldman Sachs	63,530
(319,184)	Cia Siderurgica Nacional SA ADR	Morgan Stanley	(14,363)
(166,118)	Cia Siderurgica Nacional SA ADR	Goldman Sachs	49,005
32,409	Cidara Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(25,279)
90,309	Cidara Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(70,441)
35,025	Ciena Corp	Bank of America Merrill Lynch	(52,187)
19,919	Ciena Corp	Morgan Stanley	25,496
39,783	Ciena Corp	Goldman Sachs	(59,277)
(1,563)	Cigna Corp	Bank of America Merrill Lynch	(14,208)
(2,898)	Cimarex Energy Co	Goldman Sachs	7,922
(25,920)	Cimpress NV	Morgan Stanley	(133,747)
(86,784)	Cincinnati Bell Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,678)
2,635	Cincinnati Financial Corp	Goldman Sachs	5,211
5,510	Cincinnati Financial Corp	Morgan Stanley	8,327
50,235	Cinemark Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(57,268)
3,356	Cintas Corp	Goldman Sachs	22,552
21,761	Cintas Corp	Morgan Stanley	193,455
(12,304)	Cirrus Logic Inc	Goldman Sachs	38,758
154,280	Cirrus Logic Inc	Bank of America Merrill Lynch	(485,982)
(20,856)	Cirrus Logic Inc	Morgan Stanley	31,284
(63,660)	Cisco Systems Inc	Goldman Sachs	(65,429)
6,856	Cision Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(7,679)
10,569	Cision Ltd	Goldman Sachs	(11,837)
6,318	Cision Ltd	Morgan Stanley	(505)
77,310	CIT Group Inc	Morgan Stanley	176,267
(75,715)	CIT Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(42,400)
23,393	Citi Trends Inc	Morgan Stanley	(1,170)
31,224	Citi Trends Inc	Bank of America Merrill Lynch	(96,794)
10,557	Citi Trends Inc	Goldman Sachs	(32,727)
5,294	Citigroup Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,165
(54,170)	Citizens & Northern Corp	Morgan Stanley	(37,919)
(70,923)	Citizens & Northern Corp	Bank of America Merrill Lynch	4,965
130,570	Citizens Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(43,088)
(6,319)	Citizens Inc/TX	Bank of America Merrill Lynch	(2,315)
(14,819)	Citrix Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(40,456)
(37,049)	City Holding Co	Bank of America Merrill Lynch	20,377
(6,191)	City Holding Co	Goldman Sachs	2,157
(117,653)	Civeo Corp	Bank of America Merrill Lynch	51,767
(15,824)	Civeo Corp	Morgan Stanley	4,589
(11,457)	Civeo Corp	Goldman Sachs	2,508
14,721	Civista Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	147
1,104	Civista Bancshares Inc	Goldman Sachs	11
7,982	Civista Bancshares Inc	Morgan Stanley	399
13,351	Civitas Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,545)
6,755	Civitas Solutions Inc	Goldman Sachs	(4,323)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
5,135	Civitas Solutions Inc	Morgan Stanley	308
28,314	Clarus Corp	Bank of America Merrill Lynch	(849)
32,643	Clarus Corp	Goldman Sachs	(979)
25,189	Clarus Corp	Morgan Stanley	9,320
17,713	Clean Harbors Inc	Goldman Sachs	(10,628)
13,621	Clean Harbors Inc	Morgan Stanley	8,581
50,923	Clean Harbors Inc	Bank of America Merrill Lynch	(30,554)
30,132	Clear Channel Outdoor Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(6,026)
(3,068)	Clearfield Inc	Bank of America Merrill Lynch	767
(51,663)	Clearfield Inc	Morgan Stanley	3,100
(7,629)	Clearwater Paper Corp	Bank of America Merrill Lynch	(32,576)
75,362	Clearway Energy Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	128,869
40,506	Clearway Energy Inc 'A'	Goldman Sachs	69,265
30,408	Clearway Energy Inc 'A'	Morgan Stanley	608
289,262	Clearway Energy Inc 'C'	Bank of America Merrill Lynch	468,604
30,183	Clearway Energy Inc 'C'	Goldman Sachs	33,278
69,562	Clearway Energy Inc 'C'	Morgan Stanley	(1,391)
(27,008)	Cleveland-Cliffs Inc	Morgan Stanley	(16,745)
75,702	Cleveland-Cliffs Inc	Bank of America Merrill Lynch	(47,692)
(88,297)	Cleveland-Cliffs Inc	Bank of America Merrill Lynch	55,627
646	Clorox Co/The	Bank of America Merrill Lynch	3,430
2,847	Clorox Co/The	Goldman Sachs	15,118
26,716	Cloudera Inc	Morgan Stanley	29,922
89,515	Cloudera Inc	Bank of America Merrill Lynch	26,855
84,683	Cloudera Inc	Goldman Sachs	28,870
67,229	Clovis Oncology Inc	Goldman Sachs	94,121
7,890	CME Group Inc	Goldman Sachs	(19,094)
10,415	CME Group Inc	Morgan Stanley	(1,265)
108,919	CMS Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	103,473
2,709	CMS Energy Corp	Morgan Stanley	2,492
4,447	CNA Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	311
5,954	CNA Financial Corp	Goldman Sachs	417
61,744	CNA Financial Corp	Morgan Stanley	46,308
(25,534)	CNB Financial Corp/PA	Bank of America Merrill Lynch	1,787
(58,545)	CNH Industrial NV	Morgan Stanley	(11,124)
147,087	CNO Financial Group Inc	Goldman Sachs	(89,723)
89,104	CNO Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(54,353)
18,984	CNO Financial Group Inc	Morgan Stanley	6,834
4,283	CNX Resources Corp	Goldman Sachs	(543)
(23,191)	CNX Resources Corp	Bank of America Merrill Lynch	14,378
10,472	CNX Resources Corp	Morgan Stanley	3,456
814	Coca-Cola Bottling Co Consolidated	Bank of America Merrill Lynch	13,431
(25,346)	Coca-Cola Bottling Co Consolidated	Bank of America Merrill Lynch	(418,209)
1,271	Coca-Cola Bottling Co Consolidated	Morgan Stanley	12,990
(98,953)	Coca-Cola Co/The	Goldman Sachs	66,299

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(164,724)	Coca-Cola Co/The	Bank of America Merrill Lynch	110,365
(91,604)	Coca-Cola Co/The	Morgan Stanley	(4,580)
63,198	Coca-Cola European Partners Plc	Bank of America Merrill Lynch	10,744
10,120	Coca-Cola European Partners Plc	Goldman Sachs	1,720
50,105	Coca-Cola European Partners Plc	Morgan Stanley	(15,533)
(3,688)	Coca-Cola Femsa SAB de CV ADR	Goldman Sachs	(10,548)
(95,773)	Codexis Inc	Bank of America Merrill Lynch	(444,387)
(14,308)	Codorus Valley Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	48,237
(8,696)	Codorus Valley Bancorp Inc	Goldman Sachs	39,035
132,306	Coeur Mining Inc	Bank of America Merrill Lynch	(70,122)
158,686	Coeur Mining Inc	Goldman Sachs	(84,104)
55,079	Coeur Mining Inc	Morgan Stanley	(15,973)
120,030	Cogent Communications Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	56,414
87,882	Cogent Communications Holdings Inc	Morgan Stanley	34,274
30,468	Cogent Communications Holdings Inc	Goldman Sachs	14,320
(15,342)	Cognex Corp	Bank of America Merrill Lynch	(12,887)
(19,928)	Cohbar Inc	Morgan Stanley	(15,743)
(17,705)	Cohen & Steers Inc	Bank of America Merrill Lynch	23,548
(11,080)	Coherent Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9,861)
(13,265)	Coherent Inc	Morgan Stanley	(111,161)
35,263	Coherus Biosciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	(41,610)
7,005	Coherus Biosciences Inc	Goldman Sachs	(8,266)
9,216	Coherus Biosciences Inc	Morgan Stanley	(8,110)
(5,703)	Cohu Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,129)
(34,416)	Cohu Inc	Goldman Sachs	(47,424)
8,603	Colfax Corp	Goldman Sachs	3,283
23,772	Colfax Corp	Morgan Stanley	15,646
(12,266)	Colfax Corp	Bank of America Merrill Lynch	35,939
(112,018)	Collectors Universe Inc	Bank of America Merrill Lynch	80,653
(38,186)	Collegium Pharmaceutical Inc	Goldman Sachs	(82,100)
143,326	Colony Capital Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	2,867
(7,254)	Columbia Banking System Inc	Goldman Sachs	(10,226)
(383,557)	Columbia Banking System Inc	Bank of America Merrill Lynch	(533,144)
(45,139)	Columbia Banking System Inc	Morgan Stanley	(47,847)
(17,394)	Columbia Property Trust Inc (Reit)	Goldman Sachs	8,697
(44,540)	Columbia Property Trust Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	22,270
(8,279)	Columbia Property Trust Inc (Reit)	Morgan Stanley	2,235
50,059	Columbia Sportswear Co	Goldman Sachs	(1,502)
31,260	Columbia Sportswear Co	Morgan Stanley	61,270
50,992	Columbia Sportswear Co	Bank of America Merrill Lynch	(1,530)
12,251	Comcast Corp 'A'	Goldman Sachs	11,148
33,345	Comfort Systems USA Inc	Goldman Sachs	(118,708)
87,740	Comfort Systems USA Inc	Bank of America Merrill Lynch	(312,354)
110,301	Comfort Systems USA Inc	Morgan Stanley	99,271
(115,027)	Commerce Bancshares Inc/MO	Bank of America Merrill Lynch	(16,072)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(74,531)	Commerce Bancshares Inc/MO	Morgan Stanley	(48,049)
(40,507)	Commerce Bancshares Inc/MO	Goldman Sachs	(5,611)
(22,609)	Commercial Metals Co	Goldman Sachs	(3,150)
(5,619)	Commercial Metals Co	Morgan Stanley	(2,866)
(269,302)	Commercial Metals Co	Bank of America Merrill Lynch	(21,544)
23,295	CommScope Holding Co Inc	Goldman Sachs	(23,602)
69,013	CommScope Holding Co Inc	Morgan Stanley	(10,749)
(24,432)	Community Bank System Inc	Morgan Stanley	(29,807)
(30,781)	Community Bank System Inc	Goldman Sachs	(41,596)
154,423	Community Health Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	128,171
30,065	Community Health Systems Inc	Goldman Sachs	24,954
(183,872)	Community Healthcare Trust Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(476,228)
1,179	CommVault Systems Inc	Morgan Stanley	1,792
(82,564)	CommVault Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(18,990)
(14,493)	Compass Minerals International Inc	Bank of America Merrill Lynch	42,544
(17,419)	Compass Minerals International Inc	Goldman Sachs	55,218
(7,948)	Compass Minerals International Inc	Morgan Stanley	(556)
(101,406)	comScore Inc	Bank of America Merrill Lynch	114,589
117,999	Conagra Brands Inc	Morgan Stanley	(108,559)
(37,490)	Conagra Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	5,624
108,483	Conatus Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(15,188)
72,037	Conatus Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(10,085)
(52,335)	Concert Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(140,519)
(28,655)	Concert Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(66,486)
(9,602)	Conduent Inc	Goldman Sachs	2,451
(108,729)	Conduent Inc	Bank of America Merrill Lynch	40,230
(15,161)	Conduent Inc	Morgan Stanley	6,064
124,376	CONMED Corp	Bank of America Merrill Lynch	(201,489)
4,759	CONMED Corp	Goldman Sachs	(7,710)
7,289	CONMED Corp	Morgan Stanley	(4,228)
(9,657)	Conn ' s Inc	Morgan Stanley	(14,486)
10,698	ConnectOne Bancorp Inc	Goldman Sachs	(6,791)
37,601	ConocoPhillips	Bank of America Merrill Lynch	25,569
9,994	CONSOL Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(48,771)
153,029	Consolidated Communications Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	192,817
64,422	Consolidated Communications Holdings Inc	Morgan Stanley	37,365
14,072	Consolidated Communications Holdings Inc	Goldman Sachs	17,731
(55,712)	Consolidated Edison Inc	Goldman Sachs	(156,551)
(60,628)	Consolidated Edison Inc	Morgan Stanley	(121,862)
75,122	Consolidated Edison Inc	Bank of America Merrill Lynch	211,093
51,349	Consolidated Water Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(44,160)
32,045	Consolidated Water Co Ltd	Goldman Sachs	(26,793)
18,234	Consolidated Water Co Ltd	Morgan Stanley	(912)
(19,885)	Consolidated-Tomoka Land Co	Goldman Sachs	16,902
(12,491)	Consolidated-Tomoka Land Co	Bank of America Merrill Lynch	10,617

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(7,076)	Consolidated-Tomoka Land Co	Morgan Stanley	2,052
2,484	Constellation Brands Inc 'A'	Goldman Sachs	(3,825)
481	Constellation Brands Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(741)
10,749	Constellation Brands Inc 'A'	Morgan Stanley	32,892
17,122	Constellium NV 'A'	Goldman Sachs	(514)
2,543	Constellium NV 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(76)
25,881	Constellium NV 'A'	Morgan Stanley	19,152
148,983	Construction Partners Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	29,797
14,285	Construction Partners Inc 'A'	Goldman Sachs	2,857
20,214	Construction Partners Inc 'A'	Morgan Stanley	(1,011)
190,627	Consumer Portfolio Services Inc	Morgan Stanley	(26,688)
13,791	Consumer Portfolio Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(827)
(13,839)	Contango Oil & Gas Co	Goldman Sachs	2,403
56,720	Continental Building Products Inc	Bank of America Merrill Lynch	(53,317)
36,477	Continental Building Products Inc	Goldman Sachs	(24,815)
23,852	Continental Building Products Inc	Morgan Stanley	239
6,075	Continental Resources Inc/OK	Goldman Sachs	(17,107)
37,270	Continental Resources Inc/OK	Bank of America Merrill Lynch	(104,729)
52,762	Continental Resources Inc/OK	Morgan Stanley	26,909
37,104	Control4 Corp	Bank of America Merrill Lynch	(21,520)
(18,212)	Cooper Cos Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	(446,558)
(13,645)	Cooper Cos Inc/The	Morgan Stanley	(158,964)
7,245	Cooper Tire & Rubber Co	Goldman Sachs	(805)
(2,183)	Cooper Tire & Rubber Co	Bank of America Merrill Lynch	240
(1,977)	Cooper-Standard Holdings Inc	Goldman Sachs	5,707
(27,210)	Cooper-Standard Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	77,276
(2,816)	Cooper-Standard Holdings Inc	Morgan Stanley	3,802
(2,278)	Copa Holdings SA 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1,731
(1,648)	Copa Holdings SA 'A'	Goldman Sachs	1,252
(963)	Copa Holdings SA 'A'	Morgan Stanley	(1,117)
3,742	Copart Inc	Goldman Sachs	3,181
(15,394)	Copart Inc	Bank of America Merrill Lynch	(13,085)
21,009	Copart Inc	Morgan Stanley	61,346
(29,174)	Corbus Pharmaceuticals Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(16,337)
39,598	Corcept Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	47,122
22,413	Corcept Therapeutics Inc	Goldman Sachs	26,671
5,096	Corcept Therapeutics Inc	Morgan Stanley	7,593
(6,089)	Corcept Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(9,073)
639	Core Laboratories NV	Goldman Sachs	(1,738)
(4,654)	Core Laboratories NV	Bank of America Merrill Lynch	12,659
1,269	Core Laboratories NV	Morgan Stanley	2,644
46,093	Core-Mark Holding Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(47,476)
32,475	Core-Mark Holding Co Inc	Goldman Sachs	(33,449)
(6,575)	CoreCivic Inc (Reit)	Goldman Sachs	(1,052)
(36,202)	CoreCivic Inc (Reit)	Morgan Stanley	(12,671)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(100,382)	CoreCivic Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(16,061)
(42,807)	CoreLogic Inc/United States	Bank of America Merrill Lynch	5,565
70,800	CorePoint Lodging Inc (Reit)	Goldman Sachs	(23,364)
48,187	CorePoint Lodging Inc (Reit)	Morgan Stanley	(2,409)
24,408	CoreSite Realty Corp (Reit)	Morgan Stanley	89,928
24,362	CoreSite Realty Corp (Reit)	Goldman Sachs	53,847
8,823	CoreSite Realty Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	15,176
12,580	Cornerstone OnDemand Inc	Bank of America Merrill Lynch	37,740
11,902	Cornerstone OnDemand Inc	Goldman Sachs	35,706
20,421	Cornerstone OnDemand Inc	Morgan Stanley	99,859
(12,104)	Corporate Office Properties Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	4,600
67,968	Corvus Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(51,656)
25,170	Corvus Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(19,129)
9,862	Corvus Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(3,846)
168,859	Cosan Ltd 'A'	Morgan Stanley	195,876
112,232	Cosan Ltd 'A'	Goldman Sachs	118,966
(1,000)	Costamare Inc	Goldman Sachs	90
(22,395)	Costamare Inc	Morgan Stanley	(2,687)
1,009	CoStar Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	13,864
2,328	Costco Wholesale Corp	Goldman Sachs	22,537
20,157	Costco Wholesale Corp	Bank of America Merrill Lynch	41,120
(72,045)	Coty Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	26,657
(4,681)	County Bancorp Inc	Goldman Sachs	(2,106)
(5,730)	Coupa Software Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,699)
(2,669)	Coupa Software Inc	Morgan Stanley	(23,300)
(431)	Coupa Software Inc	Goldman Sachs	(4,825)
(30,018)	Cousins Properties Inc (Reit)	Goldman Sachs	(2,401)
(11,793)	Cousins Properties Inc (Reit)	Morgan Stanley	(1,887)
(3,672)	Covanta Holding Corp	Goldman Sachs	(2,644)
(190,267)	Covanta Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	(136,992)
20,963	Covenant Transportation Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(34,589)
1,678	Covenant Transportation Group Inc 'A'	Goldman Sachs	(2,769)
5,613	Covenant Transportation Group Inc 'A'	Morgan Stanley	(1,516)
(12,429)	Covia Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	17,649
(61,358)	Covia Holdings Corp	Morgan Stanley	17,180
(48,344)	Cowen Inc	Goldman Sachs	(29,248)
(11,283)	Cowen Inc	Morgan Stanley	169
8,163	CRA International Inc	Goldman Sachs	29,387
2,411	CRA International Inc	Morgan Stanley	3,110
56,197	CRA International Inc	Bank of America Merrill Lynch	202,309
(9,678)	Cracker Barrel Old Country Store Inc	Goldman Sachs	(97,457)
(6,995)	Cracker Barrel Old Country Store Inc	Bank of America Merrill Lynch	(70,440)
(46,696)	Cracker Barrel Old Country Store Inc	Morgan Stanley	(379,172)
7,442	Craft Brew Alliance Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,028)
5,750	Craft Brew Alliance Inc	Goldman Sachs	(4,658)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
4,136	Craft Brew Alliance Inc	Morgan Stanley	(538)
14,894	Crane Co	Goldman Sachs	(92,492)
109,495	Crane Co	Bank of America Merrill Lynch	(679,964)
72,073	Crane Co	Morgan Stanley	(41,802)
(3,835)	Crawford & Co 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(690)
(12,412)	Crawford & Co 'B'	Goldman Sachs	-
43,563	Cray Inc	Bank of America Merrill Lynch	40,078
22,979	Cray Inc	Goldman Sachs	21,141
9,325	Cray Inc	Morgan Stanley	14,267
(3,329)	Credicorp Ltd	Morgan Stanley	(13,849)
3,562	Credicorp Ltd	Morgan Stanley	14,818
(4,956)	Credit Acceptance Corp	Goldman Sachs	39,450
(4,743)	Credit Acceptance Corp	Morgan Stanley	(40,221)
(107,766)	Cree Inc	Bank of America Merrill Lynch	37,718
(23,077)	Cree Inc	Morgan Stanley	(23,308)
16,346	Crocs Inc	Morgan Stanley	28,115
13,957	Crocs Inc	Goldman Sachs	10,850
(100,745)	Cross Country Healthcare Inc	Bank of America Merrill Lynch	(50,373)
37,109	Crown Castle International Corp (Reit)	Morgan Stanley	229,334
(71,251)	Crown Castle International Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(252,941)
(58,475)	Crown Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(107,594)
(89,841)	Crown Holdings Inc	Morgan Stanley	(326,123)
(3,933)	CryoPort Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,242)
61,059	CSG Systems International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(136,162)
16,678	CSG Systems International Inc	Morgan Stanley	(11,007)
13,578	CSG Systems International Inc	Goldman Sachs	(30,279)
19,647	CSS Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(19,254)
11,217	CSS Industries Inc	Goldman Sachs	(10,993)
4,151	CSS Industries Inc	Morgan Stanley	(4,442)
(3,697)	CSW Industrials Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,514
(39,168)	CTI BioPharma Corp	Bank of America Merrill Lynch	(783)
(82,296)	CTI BioPharma Corp	Goldman Sachs	(1,646)
(42,866)	CTI BioPharma Corp	Morgan Stanley	(1,286)
(135,529)	CTS Corp	Bank of America Merrill Lynch	(136,884)
4,660	CubeSmart (Reit)	Goldman Sachs	4,352
46,601	CubeSmart (Reit)	Morgan Stanley	26,007
(44,210)	Cubic Corp	Bank of America Merrill Lynch	242,713
2,524	Cullen/Frost Bankers Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,246)
3,573	Cullen/Frost Bankers Inc	Goldman Sachs	(3,180)
16,338	Cumberland Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	980
15,930	Curis Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,971)
14,576	Curis Inc	Goldman Sachs	(7,294)
19,593	Curis Inc	Morgan Stanley	(5,886)
(10,609)	Curo Group Holdings Corp	Goldman Sachs	15,807
(19,920)	Curo Group Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	29,681

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
65,959	Curtiss-Wright Corp	Bank of America Merrill Lynch	(122,684)
26,980	Curtiss-Wright Corp	Morgan Stanley	19,965
2,080	Curtiss-Wright Corp	Goldman Sachs	(3,869)
10,623	Customers Bancorp Inc	Goldman Sachs	(5,849)
8,986	Cutera Inc	Goldman Sachs	(4,928)
(1,613)	CVB Financial Corp	Goldman Sachs	(374)
36,197	CVR Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	5,068
23,815	CVR Energy Inc	Goldman Sachs	3,259
869	CVR Energy Inc	Morgan Stanley	1,382
1,946	CVS Health Corp	Goldman Sachs	(1,810)
24,041	CVS Health Corp	Morgan Stanley	69,340
(4,588)	CyberArk Software Ltd	Morgan Stanley	(32,345)
(1,941)	CyberOptics Corp	Goldman Sachs	(2,543)
(20,677)	CyberOptics Corp	Bank of America Merrill Lynch	(27,087)
(3,823)	CyberOptics Corp	Morgan Stanley	(4,129)
(52,875)	Cymbay Therapeutics Inc	Goldman Sachs	30,139
(11,242)	Cypress Semiconductor Corp	Goldman Sachs	(4,828)
(76,312)	Cypress Semiconductor Corp	Bank of America Merrill Lynch	(21,367)
(2,167)	Cypress Semiconductor Corp	Morgan Stanley	(585)
(801)	CyrusOne Inc (Reit)	Goldman Sachs	(999)
(6,862)	CyrusOne Inc (Reit)	Morgan Stanley	(20,792)
3,275	CytomX Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(1,932)
1,548	CytomX Therapeutics Inc	Morgan Stanley	480
271,970	Dana Inc	Bank of America Merrill Lynch	(135,985)
142,517	Dana Inc	Morgan Stanley	(44,180)
165,437	Dana Inc	Goldman Sachs	(80,286)
46,986	Danaher Corp	Bank of America Merrill Lynch	324,203
30,725	Darden Restaurants Inc	Morgan Stanley	(23,966)
20,990	Darden Restaurants Inc	Bank of America Merrill Lynch	(21,620)
(20,974)	Darling Ingredients Inc	Goldman Sachs	(34,607)
(314,886)	Darling Ingredients Inc	Bank of America Merrill Lynch	(519,562)
(220,680)	Darling Ingredients Inc	Morgan Stanley	(187,578)
(25,537)	DASAN Zhong Solutions Inc	Morgan Stanley	511
(8,553)	DASAN Zhong Solutions Inc	Goldman Sachs	13,001
28,545	Daseke Inc	Morgan Stanley	(14,558)
46,024	Daseke Inc	Bank of America Merrill Lynch	(43,263)
66,269	Daseke Inc	Goldman Sachs	(62,293)
1,958	Dave & Buster's Entertainment Inc	Morgan Stanley	(2,839)
(5,309)	Dave & Buster's Entertainment Inc	Goldman Sachs	(5,936)
(15,490)	DaVita Inc	Goldman Sachs	(15,800)
179,653	Dawson Geophysical Co	Morgan Stanley	(73,658)
8,114	Deciphera Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	24,784
905	Deciphera Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	2,643
(932)	Deere & Co	Goldman Sachs	(3,900)
7,345	Deere & Co	Bank of America Merrill Lynch	37,166



保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
1,076	Deere & Co	Goldman Sachs	5,445
15,071	Del Frisco's Restaurant Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	5,275
21,276	Del Frisco's Restaurant Group Inc	Goldman Sachs	7,447
70,839	Del Taco Restaurants Inc	Bank of America Merrill Lynch	(29,752)
9,189	Delek US Holdings Inc	Goldman Sachs	8,454
300	Delek US Holdings Inc	Morgan Stanley	867
(108,692)	Delek US Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(99,997)
8,308	Dell Technologies Inc 'V'	Bank of America Merrill Lynch	10,551
11,574	Delphi Technologies Plc	Goldman Sachs	(5,903)
32,830	Delphi Technologies Plc	Bank of America Merrill Lynch	(16,743)
22,375	Delphi Technologies Plc	Morgan Stanley	(12,306)
16,289	Delta Air Lines Inc	Bank of America Merrill Lynch	78,839
(12,468)	Delta Air Lines Inc	Morgan Stanley	(47,129)
136,488	Deluxe Corp	Bank of America Merrill Lynch	(114,650)
43,947	Deluxe Corp	Morgan Stanley	57,571
(13,589)	Denbury Resources Inc	Goldman Sachs	2,290
11,261	Denny's Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,464)
7,834	Denny's Corp	Goldman Sachs	(1,018)
(6,878)	Dentsply Sirona Inc	Bank of America Merrill Lynch	757
(3,376)	Dentsply Sirona Inc	Goldman Sachs	371
84,416	Dermira Inc	Bank of America Merrill Lynch	106,364
77,047	Despegar.com Corp	Morgan Stanley	19,262
(13,071)	Deutsche Bank AG	Morgan Stanley	1,176
63,781	Devon Energy Corp	Goldman Sachs	(282,550)
1,630	DexCom Inc	Bank of America Merrill Lynch	(12,192)
16,976	DexCom Inc	Morgan Stanley	67,734
3,658	DexCom Inc	Goldman Sachs	(23,358)
25,737	DHI Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,088
12,266	DHI Group Inc	Goldman Sachs	1,472
8,243	DHI Group Inc	Morgan Stanley	989
(204,307)	DHT Holdings Inc	Goldman Sachs	14,301
(2,890)	Diamond Hill Investment Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	16,907
42,773	Diamond Offshore Drilling Inc	Morgan Stanley	(1,283)
56,683	Diamond Offshore Drilling Inc	Goldman Sachs	(78,789)
62,385	Diamond Offshore Drilling Inc	Bank of America Merrill Lynch	(86,715)
(3,821)	Diamondback Energy Inc	Morgan Stanley	(14,787)
(25,553)	Diamondback Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	89,180
(13,415)	DiamondRock Hospitality Co (Reit)	Morgan Stanley	(1,610)
109,037	DiamondRock Hospitality Co (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	10,904
(3,124)	Dicerna Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(1,843)
39,231	Dick's Sporting Goods Inc	Goldman Sachs	(23,700)
32,910	Dick's Sporting Goods Inc	Morgan Stanley	23,156
(42,384)	Diebold Nixdorf Inc	Goldman Sachs	14,199
(25,696)	Digimarc Corp	Bank of America Merrill Lynch	23,640
(119,282)	Digimarc Corp	Goldman Sachs	109,739

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(34,630)	Digimarc Corp	Morgan Stanley	6,926
(10,391)	Digital Realty Trust Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(27,328)
(24,539)	Digital Realty Trust Inc (Reit)	Morgan Stanley	(109,935)
(4,179)	Digital Realty Trust Inc (Reit)	Goldman Sachs	(10,991)
8,250	Dillard's Inc 'A'	Morgan Stanley	38,198
(3,270)	Dine Brands Global Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,766
32,095	Diodes Inc	Bank of America Merrill Lynch	(27,923)
77,323	Diodes Inc	Goldman Sachs	(48,111)
13,173	Diodes Inc	Morgan Stanley	9,485
(12,189)	Diplomat Pharmacy Inc	Goldman Sachs	2,941
(5,882)	Diplomat Pharmacy Inc	Morgan Stanley	(2,235)
1,908	Discovery Inc 'A'	Morgan Stanley	706
(53,871)	DISH Network Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	4,848
(128,141)	DISH Network Corp 'A'	Morgan Stanley	(302,413)
(40,488)	DMC Global Inc	Bank of America Merrill Lynch	9,312
(25,220)	DMC Global Inc	Morgan Stanley	(36,065)
(784)	DMC Global Inc	Goldman Sachs	180
(529)	DocuSign Inc	Bank of America Merrill Lynch	(915)
(1,488)	DocuSign Inc	Morgan Stanley	(1,905)
(5,325)	DocuSign Inc	Goldman Sachs	(9,212)
9,660	Dolby Laboratories Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	5,216
3,448	Dolby Laboratories Inc 'A'	Morgan Stanley	7,034
14,705	Dollar General Corp	Bank of America Merrill Lynch	(22,940)
3,808	Dollar General Corp	Morgan Stanley	14,246
6,192	Dollar General Corp	Goldman Sachs	8,061
(21,556)	Dollar Tree Inc	Bank of America Merrill Lynch	(65,099)
627	Dominion Energy Inc	Morgan Stanley	(12)
2,581	Domino's Pizza Inc	Goldman Sachs	54,485
7,085	Domino's Pizza Inc	Bank of America Merrill Lynch	149,564
3,810	Domino's Pizza Inc	Morgan Stanley	69,456
7,212	Domtar Corp	Bank of America Merrill Lynch	(20,194)
1,986	Donaldson Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	953
40,108	Donaldson Co Inc	Goldman Sachs	19,252
2,293	Donegal Group Inc 'A'	Goldman Sachs	1,238
41,544	Donegal Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	22,434
9,186	Donegal Group Inc 'A'	Morgan Stanley	184
(76,104)	Donnelley Financial Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	7,610
2,274	Dorman Products Inc	Goldman Sachs	1,728
1,709	Dorman Products Inc	Morgan Stanley	2,854
8,384	Douglas Emmett Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	10,396
(77,342)	Dover Corp	Bank of America Merrill Lynch	134,575
(134,201)	DowDuPont Inc	Bank of America Merrill Lynch	183,855
(120,695)	DowDuPont Inc	Morgan Stanley	(112,246)
43,214	DR Horton Inc	Goldman Sachs	163,781
69,752	DR Horton Inc	Bank of America Merrill Lynch	264,360

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
225,619	DR Horton Inc	Morgan Stanley	351,966
(51,882)	Dril-Quip Inc	Bank of America Merrill Lynch	100,651
(12,999)	Dropbox Inc 'A'	Morgan Stanley	(20,798)
12,768	Dropbox Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(8,299)
28,373	Dropbox Inc 'A'	Goldman Sachs	7,443
(10,320)	DSP Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,477
(4,045)	DSW Inc 'A'	Goldman Sachs	(6,284)
15,334	DTE Energy Co	Goldman Sachs	(13,187)
20,338	DTE Energy Co	Morgan Stanley	36,202
13,889	Ducommun Inc	Bank of America Merrill Lynch	(34,028)
11,441	Ducommun Inc	Goldman Sachs	(25,099)
1,276	Ducommun Inc	Morgan Stanley	(778)
(38,428)	Duke Energy Corp	Morgan Stanley	(38,428)
16,476	Duke Realty Corp (Reit)	Goldman Sachs	1,648
330,403	Duke Realty Corp (Reit)	Morgan Stanley	13,216
(46,921)	Duluth Holdings Inc 'B'	Goldman Sachs	(79,296)
(10,646)	Duluth Holdings Inc 'B'	Morgan Stanley	(55,040)
18,074	Dunkin' Brands Group Inc	Morgan Stanley	41,784
25,993	Dunkin' Brands Group Inc	Goldman Sachs	62,436
76,443	Durect Corp	Bank of America Merrill Lynch	3,593
128,447	Durect Corp	Goldman Sachs	6,037
(42,719)	DXC Technology Co	Bank of America Merrill Lynch	(14,524)
(31,989)	DXC Technology Co	Morgan Stanley	(148,429)
3,323	DXP Enterprises Inc/TX	Bank of America Merrill Lynch	(9,770)
6,674	DXP Enterprises Inc/TX	Goldman Sachs	(19,622)
2,655	DXP Enterprises Inc/TX	Morgan Stanley	106
(6,808)	Dycom Industries Inc	Goldman Sachs	66,387
(12,232)	Dycom Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	119,751
(18,002)	Dycom Industries Inc	Morgan Stanley	(4,861)
(6,463)	Dynavax Technologies Corp	Morgan Stanley	6,269
(5,928)	Dynavax Technologies Corp	Bank of America Merrill Lynch	5,846
24,397	E*TRADE Financial Corp	Goldman Sachs	8,729
(23,767)	E*TRADE Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	13,547
6,298	E*TRADE Financial Corp	Morgan Stanley	6,961
95,464	Eagle Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	411,450
12,638	Eagle Bancorp Inc	Goldman Sachs	54,470
1,461	Eagle Bancorp Inc	Morgan Stanley	7,159
30,382	Eagle Materials Inc	Goldman Sachs	(21,571)
5,499	Eagle Materials Inc	Morgan Stanley	19,356
1,713	Eagle Materials Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,216)
(11,516)	Eagle Pharmaceuticals Inc/DE	Bank of America Merrill Lynch	(576)
(2,327)	Eagle Pharmaceuticals Inc/DE	Morgan Stanley	(4,677)
7,329	East West Bancorp Inc	Goldman Sachs	8,127
124,422	East West Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,488)
4,369	East West Bancorp Inc	Morgan Stanley	10,748

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
165,005	Easterly Government Properties Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	66,002
(3,868)	Eastern Co/The	Bank of America Merrill Lynch	7,697
(26,989)	EastGroup Properties Inc (Reit)	Morgan Stanley	(34,546)
16,220	EastGroup Properties Inc (Reit)	Goldman Sachs	40,694
127,442	EastGroup Properties Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	322,428
317	EastGroup Properties Inc (Reit)	Morgan Stanley	406
41,985	Eastman Chemical Co	Bank of America Merrill Lynch	(159,123)
93,442	Eastman Chemical Co	Morgan Stanley	129,884
27,796	Eastman Chemical Co	Goldman Sachs	(105,326)
7,546	Eaton Corp Plc	Bank of America Merrill Lynch	13,356
46,940	Eaton Vance Corp	Goldman Sachs	(114,064)
56,944	Eaton Vance Corp	Morgan Stanley	(55,236)
5,512	Ebix Inc	Goldman Sachs	(20,460)
(34,738)	Ebix Inc	Goldman Sachs	134,089
(1,065)	Ebix Inc	Morgan Stanley	3,035
2,166	Ebix Inc	Morgan Stanley	(6,173)
(23,594)	EchoStar Corp 'A'	Goldman Sachs	1,560
(9,847)	EchoStar Corp 'A'	Morgan Stanley	2,560
28,085	EchoStar Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	-
18,925	Ecolab Inc	Bank of America Merrill Lynch	23,846
12,692	Ecolab Inc	Morgan Stanley	80,340
20,135	Ecolab Inc	Goldman Sachs	48,206
12,072	Edgewell Personal Care Co	Morgan Stanley	(21,247)
(132,274)	Edgewell Personal Care Co	Bank of America Merrill Lynch	99,206
(26,863)	Edgewell Personal Care Co	Goldman Sachs	27,823
101	Edison International	Goldman Sachs	790
(72,520)	Edison International	Bank of America Merrill Lynch	(567,106)
38,409	Edison International	Morgan Stanley	67,600
1,258	eHealth Inc	Goldman Sachs	1,240
24,894	Eiger BioPharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	23,400
28,498	Eiger BioPharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	26,788
24,313	Eiger BioPharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	11,427
(56,433)	El Paso Electric Co	Bank of America Merrill Lynch	78,442
1,014	El Paso Electric Co	Bank of America Merrill Lynch	(331)
73,824	El Pollo Loco Holdings Inc	Goldman Sachs	(24,763)
2,795	El Pollo Loco Holdings Inc	Morgan Stanley	(1,216)
98	Elah Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(465)
87	Elah Holdings Inc	Morgan Stanley	(326)
26,139	Elanco Animal Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	261
(8,468)	Eldorado Resorts Inc	Goldman Sachs	(48,606)
(4,760)	Eldorado Resorts Inc	Morgan Stanley	(35,414)
(3,281)	Eldorado Resorts Inc	Bank of America Merrill Lynch	(18,833)
16,596	Electronic Arts Inc	Bank of America Merrill Lynch	(35,515)
(18,050)	Electronics For Imaging Inc	Morgan Stanley	(6,859)
84,381	elf Beauty Inc	Bank of America Merrill Lynch	(47,253)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
31,582	elf Beauty Inc	Morgan Stanley	19,897
18,829	elf Beauty Inc	Goldman Sachs	(10,544)
9,233	Eli Lilly & Co	Bank of America Merrill Lynch	51,243
7,743	Eli Lilly & Co	Morgan Stanley	37,786
(2,966)	Ellie Mae Inc	Goldman Sachs	(2,612)
(1,741)	Ellie Mae Inc	Bank of America Merrill Lynch	(339)
(2,200)	Ellie Mae Inc	Morgan Stanley	(1,639)
(189,537)	Ellington Residential Mortgage REIT (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(113,722)
(1,500)	Ellington Residential Mortgage REIT (Reit)	Goldman Sachs	(900)
(40,004)	Ellington Residential Mortgage REIT (Reit)	Morgan Stanley	(6,001)
(17,447)	Embraer SA ADR	Goldman Sachs	(9,421)
(78,739)	Embraer SA ADR	Morgan Stanley	(62,204)
(23,643)	EMC Insurance Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(194,818)
34,041	EMCOR Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(49,700)
5,856	EMCOR Group Inc	Goldman Sachs	(8,550)
1,477	Emerald Expositions Events Inc	Morgan Stanley	546
186,743	Emerald Expositions Events Inc	Bank of America Merrill Lynch	89,637
39,069	Emerald Expositions Events Inc	Goldman Sachs	18,753
(3,480)	Emergent BioSolutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	(13,711)
(1,266)	Emergent BioSolutions Inc	Goldman Sachs	(3,429)
69,696	Emergent Capital Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,997)
133,935	Emergent Capital Inc	Morgan Stanley	(4,420)
(104,352)	Emerson Electric Co	Bank of America Merrill Lynch	218,096
70,471	Empire State Realty Trust Inc 'A' (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	31,712
74,959	Employers Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(122,933)
10,070	Employers Holdings Inc	Goldman Sachs	(16,515)
6,455	Employers Holdings Inc	Morgan Stanley	4,131
(125,125)	Empresas ICA SAB de CV ADR*	Morgan Stanley	(3,754)
(593)	Enanta Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(1,632)
(2,382)	Enbridge Inc	Bank of America Merrill Lynch	(715)
887	Encompass Health Corp	Goldman Sachs	1,916
887	Encompass Health Corp	Morgan Stanley	2,714
(32,033)	Encore Capital Group Inc	Morgan Stanley	(4,805)
(43,116)	Encore Capital Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(58,207)
49,163	Encore Wire Corp	Bank of America Merrill Lynch	10,816
7,720	Encore Wire Corp	Goldman Sachs	1,698
6,768	Encore Wire Corp	Morgan Stanley	15,566
36,819	Endo International Plc	Bank of America Merrill Lynch	(18,778)
(24,951)	Endo International Plc	Goldman Sachs	12,725
14,560	Endo International Plc	Goldman Sachs	(7,426)
(46,442)	Enel Americas SA ADR	Goldman Sachs	(21,828)
(105,402)	Enel Americas SA ADR	Morgan Stanley	(49,539)
12,833	Energizer Holdings Inc	Goldman Sachs	(75,715)
28,003	Energizer Holdings Inc	Morgan Stanley	(48,445)
3,468	Energous Corp	Goldman Sachs	673

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(271,026)	Energy Recovery Inc	Morgan Stanley	(46,074)
(30,618)	Energy Recovery Inc	Bank of America Merrill Lynch	9,185
(1,041)	EnerSys	Goldman Sachs	(718)
(36,865)	EnerSys	Bank of America Merrill Lynch	(25,437)
(17,644)	EnerSys	Morgan Stanley	(72,693)
35,059	Engility Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,402)
16,007	Engility Holdings Inc	Goldman Sachs	(640)
145,819	Ennis Inc	Bank of America Merrill Lynch	(80,200)
8,408	Ennis Inc	Goldman Sachs	(4,624)
7,959	Ennis Inc	Morgan Stanley	1,512
81,802	Enova International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(80,984)
9,023	Enova International Inc	Goldman Sachs	(8,933)
(17,869)	EnPro Industries Inc	Morgan Stanley	(46,817)
(24,528)	Ensco Plc 'A'	Goldman Sachs	9,321
(63,223)	Ensco Plc 'A'	Morgan Stanley	21,496
31,543	Ensign Group Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	9,463
10,630	Ensign Group Inc/The	Goldman Sachs	3,189
8,768	Ensign Group Inc/The	Morgan Stanley	12,538
(8,840)	Enstar Group Ltd	Goldman Sachs	31,470
(6,539)	Enstar Group Ltd	Morgan Stanley	8,893
(8,553)	Entegris Inc	Goldman Sachs	(12,060)
(205,819)	Entegris Inc	Bank of America Merrill Lynch	(290,205)
(40,230)	Entegris Inc	Morgan Stanley	(52,299)
(6,275)	Entercom Communications Corp 'A'	Goldman Sachs	4,706
(14,378)	Entercom Communications Corp 'A'	Morgan Stanley	1,438
(82,630)	Entergy Corp	Bank of America Merrill Lynch	(31,399)
(16,714)	Entravision Communications Corp 'A'	Goldman Sachs	(134)
44,861	Enzo Biochem Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,346
13,109	Enzo Biochem Inc	Goldman Sachs	393
11,610	Enzo Biochem Inc	Morgan Stanley	581
(5,074)	EPAM Systems Inc	Goldman Sachs	(28,553)
9,606	EPAM Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	10,855
(1,217)	EPAM Systems Inc	Morgan Stanley	(8,422)
26,815	Epizyme Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,877
44,964	Epizyme Inc	Goldman Sachs	3,147
31,642	Epizyme Inc	Morgan Stanley	4,746
(3,270)	ePlus Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,605)
(2,155)	ePlus Inc	Goldman Sachs	(4,353)
(132,244)	EPR Properties (Reit)	Morgan Stanley	(35,706)
29,011	EQT Corp	Bank of America Merrill Lynch	39,745
(28,098)	Equifax Inc	Bank of America Merrill Lynch	(70,526)
(163)	Equinix Inc (Reit)	Goldman Sachs	(614)
23,208	Equitrans Midstream Corp	Bank of America Merrill Lynch	3,713
(30,064)	Equity Bancshares Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	3,908
(2,979)	Equity Bancshares Inc 'A'	Goldman Sachs	(937)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(96,502)	Equity Commonwealth (Reit)	Morgan Stanley	(47,286)
(164,694)	Equity Commonwealth (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(113,639)
26,749	Equity LifeStyle Properties Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	56,330
(20,126)	Equity Residential (Reit)	Goldman Sachs	(36,589)
(105,582)	Equity Residential (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(338,918)
(5,137)	Equity Residential (Reit)	Morgan Stanley	(9,658)
197	Erie Indemnity Co 'A'	Bank of America Merrill Lynch	621
1,613	Erie Indemnity Co 'A'	Goldman Sachs	5,081
47,952	ESCO Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	268,052
(40,015)	Escrow New York (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	4,802
(39,940)	Escrow New York (Reit)	Goldman Sachs	4,793
(21,172)	Escrow New York (Reit)	Morgan Stanley	1,694
(4,956)	Esperion Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(25,870)
(4,419)	Esperion Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(6,717)
(863)	Esperion Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(4,505)
52,324	Essendant Inc	Bank of America Merrill Lynch	(523)
126,064	Essent Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(214,309)
41,804	Essent Group Ltd	Goldman Sachs	(8,688)
36,965	Essential Properties Realty Trust Inc (Reit)	Goldman Sachs	11,958
(234)	Essex Property Trust Inc (Reit)	Goldman Sachs	(808)
(1,106)	Essex Property Trust Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(12,033)
(1,719)	Essex Property Trust Inc (Reit)	Morgan Stanley	(8,698)
10,910	Estee Lauder Cos Inc/The 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(32,730)
20,701	Estee Lauder Cos Inc/The 'A'	Goldman Sachs	(62,103)
37,556	Estee Lauder Cos Inc/The 'A'	Morgan Stanley	65,347
12,207	Etsy Inc	Bank of America Merrill Lynch	70,556
(6,682)	Euronet Worldwide Inc	Goldman Sachs	(45,237)
(2,793)	Euronet Worldwide Inc	Morgan Stanley	(21,450)
(205)	Euronet Worldwide Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,388)
(3,568)	Evans Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	11,917
(11,107)	Evans Bancorp Inc	Morgan Stanley	44,539
(5,678)	Everbridge Inc	Goldman Sachs	(23,963)
(8,123)	Everbridge Inc	Bank of America Merrill Lynch	(22,582)
30,403	Evercore Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	16,418
2,364	Evercore Inc 'A'	Goldman Sachs	1,277
7,829	Evercore Inc 'A'	Morgan Stanley	10,413
7,384	Everest Re Group Ltd	Goldman Sachs	40,637
4,579	Everest Re Group Ltd	Morgan Stanley	29,397
(12,442)	Everest Re Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(76,643)
2,242	Evergy Inc	Goldman Sachs	465
96,203	EverQuote Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	27,418
48,565	EverQuote Inc 'A'	Goldman Sachs	13,841
7,479	EverQuote Inc 'A'	Morgan Stanley	1,795
16,266	Eversource Energy	Bank of America Merrill Lynch	20,495
5,083	Everspin Technologies Inc	Goldman Sachs	(240)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
16,222	EVERTEC Inc	Goldman Sachs	(2,086)
4,699	Evolent Health Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	7,941
118,353	Evolution Petroleum Corp	Bank of America Merrill Lynch	(151,492)
109,155	Evolution Petroleum Corp	Goldman Sachs	(139,718)
145,365	Evolution Petroleum Corp	Morgan Stanley	(59,600)
34,545	Evoqua Water Technologies Corp	Goldman Sachs	(15,412)
101,050	Evoqua Water Technologies Corp	Bank of America Merrill Lynch	(48,504)
4,620	Evoqua Water Technologies Corp	Morgan Stanley	924
19,633	EW Scripps Co/The 'A'	Bank of America Merrill Lynch	9,031
16,990	EW Scripps Co/The 'A'	Goldman Sachs	7,815
102,644	EW Scripps Co/The 'A'	Morgan Stanley	80,062
(5,928)	Exact Sciences Corp	Bank of America Merrill Lynch	(52,107)
25,300	Exelixis Inc	Bank of America Merrill Lynch	60,720
(202,448)	Exelon Corp	Morgan Stanley	(202,448)
(9,285)	Exelon Corp	Goldman Sachs	(2,979)
(41,860)	ExlService Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	14,651
(1,008)	ExlService Holdings Inc	Morgan Stanley	(827)
(1,031)	ExlService Holdings Inc	Goldman Sachs	361
(31,979)	ExOne Co/The	Bank of America Merrill Lynch	72,273
(23,693)	ExOne Co/The	Goldman Sachs	53,546
(4,488)	Expedia Group Inc	Goldman Sachs	(15,714)
(791)	Expedia Group Inc	Morgan Stanley	(5,751)
(47,489)	Expeditors International of Washington Inc	Goldman Sachs	(113,024)
(13,398)	Expeditors International of Washington Inc	Morgan Stanley	(36,845)
(23,075)	Exponent Inc	Goldman Sachs	63,020
(35,223)	Exponent Inc	Morgan Stanley	11,976
8,291	Exponent Inc	Bank of America Merrill Lynch	(28,770)
1,189	Exponent Inc	Goldman Sachs	(4,126)
(208,791)	Express Inc	Bank of America Merrill Lynch	494,835
67,413	Extended Stay America Inc (Unit)	Bank of America Merrill Lynch	(11,123)
41,943	Extended Stay America Inc (Unit)	Morgan Stanley	(9,454)
63,312	Extended Stay America Inc (Unit)	Goldman Sachs	(10,446)
37,568	Extra Space Storage Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	61,987
1,788	Extra Space Storage Inc (Reit)	Morgan Stanley	2,951
3,181	Extra Space Storage Inc (Reit)	Goldman Sachs	5,249
(21,656)	Extraction Oil & Gas Inc	Morgan Stanley	16,025
86,799	Extreme Networks Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,604
68,079	Extreme Networks Inc	Goldman Sachs	6,569
59,434	Extreme Networks Inc	Morgan Stanley	18,425
(23,667)	Exxon Mobil Corp	Goldman Sachs	(13,254)
(33,812)	Exxon Mobil Corp	Morgan Stanley	(110,227)
(44,416)	Exxon Mobil Corp	Bank of America Merrill Lynch	(24,873)
(41,292)	EyePoint Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,607)
(18,113)	EyePoint Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(181)
(6,736)	F5 Networks Inc	Goldman Sachs	39,473



保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(15,540)	F5 Networks Inc	Bank of America Merrill Lynch	91,064
(5,351)	F5 Networks Inc	Morgan Stanley	(27,932)
(2,427)	Fabrinet	Goldman Sachs	(2,670)
(8,798)	Fabrinet	Morgan Stanley	(12,581)
13,247	Facebook Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(74,316)
(4,727)	FactSet Research Systems Inc	Goldman Sachs	(29,686)
(7,354)	FactSet Research Systems Inc	Morgan Stanley	(42,947)
186	Fair Isaac Corp	Goldman Sachs	3,331
(3,708)	Fair Isaac Corp	Bank of America Merrill Lynch	(15,314)
58	Fair Isaac Corp	Bank of America Merrill Lynch	305
2,365	Fair Isaac Corp	Morgan Stanley	41,695
(61,383)	Farmer Brothers Co	Bank of America Merrill Lynch	(15,960)
13,485	Farmers National Banc Corp	Morgan Stanley	4,180
44,321	Farmers National Banc Corp	Bank of America Merrill Lynch	8,864
26,359	Farmers National Banc Corp	Goldman Sachs	5,469
(29,663)	Fastenal Co	Bank of America Merrill Lynch	(66,148)
(1,813)	FB Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(471)
4,504	FBL Financial Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(5,270)
1,544	FBL Financial Group Inc 'A'	Goldman Sachs	(1,806)
6,083	FCB Financial Holdings Inc 'A'	Morgan Stanley	11,193
121,874	FCB Financial Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	12,187
9,035	FCB Financial Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	904
9,092	Federal Agricultural Mortgage Corp 'C'	Goldman Sachs	(9,910)
39,706	Federal Agricultural Mortgage Corp 'C'	Bank of America Merrill Lynch	(43,280)
5,351	Federal Agricultural Mortgage Corp 'C'	Morgan Stanley	(1,552)
(332)	Federal Realty Investment Trust (Reit)	Goldman Sachs	(741)
22,475	Federal Signal Corp	Morgan Stanley	2,023
128,163	Federal Signal Corp	Bank of America Merrill Lynch	(105,094)
10,460	Federal Signal Corp	Goldman Sachs	(8,577)
56,700	Federated Investors Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	70,875
2,319	Federated Investors Inc 'B'	Goldman Sachs	(493)
1,986	FedEx Corp	Goldman Sachs	695
2,604	FedEx Corp	Bank of America Merrill Lynch	911
19,445	Ferrari NV	Goldman Sachs	(44,162)
770	Ferrari NV	Bank of America Merrill Lynch	(233)
11,371	Ferrari NV	Morgan Stanley	23,765
15,983	Ferroglobe Plc	Goldman Sachs	(51,785)
58,894	Ferroglobe Plc	Morgan Stanley	(143,701)
194,479	FGL Holdings	Bank of America Merrill Lynch	44,730
98,371	FGL Holdings	Morgan Stanley	19,674
11,346	FGL Holdings	Goldman Sachs	2,610
(27,377)	Fibria Celulose SA ADR	Morgan Stanley	(6,297)
(22,758)	FibroGen Inc	Bank of America Merrill Lynch	(42,557)
(622)	Fidelity D&D Bancorp Inc	Morgan Stanley	(2,469)
34,116	Fidelity National Financial Inc	Goldman Sachs	28,316

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
4,538	Fidelity National Financial Inc	Morgan Stanley	4,674
29,086	Fidelity National Information Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,144)
(63,560)	Fidelity Southern Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,271
21,725	Fiesta Restaurant Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10,428)
2,941	Fiesta Restaurant Group Inc	Goldman Sachs	(1,412)
10,634	Fiesta Restaurant Group Inc	Morgan Stanley	(4,892)
22,353	First American Financial Corp	Goldman Sachs	67,506
17,673	First American Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	53,372
51,328	First American Financial Corp	Morgan Stanley	86,231
(17,227)	First BanCorp/Puerto Rico	Goldman Sachs	(189)
46,004	First Bancorp/Southern Pines NC	Bank of America Merrill Lynch	31,743
(1,180)	First Bancshares Inc/The	Goldman Sachs	1,521
60,172	First Bank/Hamilton NJ	Bank of America Merrill Lynch	(2,407)
4,653	First Bank/Hamilton NJ	Morgan Stanley	512
18,139	First Bank/Hamilton NJ	Goldman Sachs	(726)
837	First Citizens BancShares Inc/NC 'A'	Goldman Sachs	(10,144)
(2,576)	First Citizens BancShares Inc/NC 'A'	Bank of America Merrill Lynch	31,221
(249)	First Citizens BancShares Inc/NC 'A'	Goldman Sachs	3,018
1,617	First Citizens BancShares Inc/NC 'A'	Morgan Stanley	4,026
339	First Citizens BancShares Inc/NC 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(4,109)
(3,163)	First Community Bankshares Inc	Goldman Sachs	(1,740)
(2,883)	First Community Bankshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,586)
3,070	First Community Corp/SC	Bank of America Merrill Lynch	215
397	First Community Corp/SC	Goldman Sachs	28
57,874	First Data Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	43,695
285,388	First Defiance Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	71,347
10,320	First Defiance Financial Corp	Morgan Stanley	4,438
(25,534)	First Financial Bancorp	Goldman Sachs	(12,129)
(52,723)	First Financial Bancorp	Morgan Stanley	(26,098)
(54,463)	First Financial Bankshares Inc	Morgan Stanley	(19,062)
82,486	First Financial Corp/IN	Bank of America Merrill Lynch	(6,599)
2,452	First Financial Corp/IN	Morgan Stanley	1,913
17,606	First Financial Corp/IN	Goldman Sachs	(1,408)
104,064	First Financial Northwest Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11,447)
39,521	First Financial Northwest Inc	Goldman Sachs	(4,347)
33,749	First Financial Northwest Inc	Morgan Stanley	(8,437)
(224,705)	First Foundation Inc	Goldman Sachs	67,412
(12,994)	First Hawaiian Inc	Goldman Sachs	(7,923)
(18,417)	First Hawaiian Inc	Morgan Stanley	(15,470)
(21,505)	First Horizon National Corp	Goldman Sachs	(3,625)
(9,292)	First Horizon National Corp	Morgan Stanley	(2,044)
13,748	First Horizon National Corp	Goldman Sachs	1,237
169,723	First Horizon National Corp	Bank of America Merrill Lynch	15,275
15,772	First Horizon National Corp	Morgan Stanley	3,470
(5,482)	First Industrial Realty Trust Inc (Reit)	Goldman Sachs	(2,851)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
75,950	First Industrial Realty Trust Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	39,494
(36,354)	First Industrial Realty Trust Inc (Reit)	Morgan Stanley	(18,177)
(90,503)	First Mid-Illinois Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	(42,536)
(31,422)	First Mid-Illinois Bancshares Inc	Goldman Sachs	(14,768)
(3,696)	First Mid-Illinois Bancshares Inc	Morgan Stanley	(3,659)
10,973	First Northwest Bancorp	Goldman Sachs	768
837	First Northwest Bancorp	Morgan Stanley	42
106,524	First Northwest Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	7,457
11,493	First of Long Island Corp/The	Morgan Stanley	4,942
74,852	First of Long Island Corp/The	Bank of America Merrill Lynch	17,964
12,715	First of Long Island Corp/The	Goldman Sachs	3,052
30,553	First Republic Bank/CA	Bank of America Merrill Lynch	78,521
32,595	First Republic Bank/CA	Goldman Sachs	83,780
(12,947)	First Solar Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,295)
(4,519)	First Solar Inc	Goldman Sachs	(452)
(15,011)	FirstCash Inc	Bank of America Merrill Lynch	(40,229)
(625)	FirstCash Inc	Goldman Sachs	(1,675)
(114,090)	FirstEnergy Corp	Bank of America Merrill Lynch	148,317
(42,097)	Fiserv Inc	Bank of America Merrill Lynch	43,360
239,109	Fitbit Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(59,777)
216,664	Fitbit Inc 'A'	Goldman Sachs	(54,166)
26,522	Five Below Inc	Bank of America Merrill Lynch	(417,191)
20,592	Five Below Inc	Morgan Stanley	47,362
39,788	Five Prime Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	41,380
(938)	Five9 Inc	Goldman Sachs	(1,457)
187,365	Flagstar Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	172,376
(12)	FleetCor Technologies Inc	Goldman Sachs	58
(13,022)	FleetCor Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	62,766
(1,750)	FleetCor Technologies Inc	Morgan Stanley	(16,240)
(20,593)	Flex Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(7,002)
(38,204)	Flex Ltd	Goldman Sachs	(12,989)
1,327	FLIR Systems Inc	Goldman Sachs	(2,919)
14,780	FLIR Systems Inc	Morgan Stanley	(4,730)
(20,595)	Floor & Décor Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	(3,276)
(12,090)	Floor & Décor Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(2,176)
(22,509)	Floor & Décor Holdings Inc 'A'	Morgan Stanley	(24,310)
(117,845)	Flowers Foods Inc	Bank of America Merrill Lynch	21,212
(54,054)	Flowserve Corp	Bank of America Merrill Lynch	98,919
(11,713)	Flowserve Corp	Morgan Stanley	(28,111)
14,395	Fluent Inc	Morgan Stanley	(1,871)
13,700	Fluent Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,918)
26,862	Fluent Inc	Goldman Sachs	(2,309)
15,467	Fluor Corp	Goldman Sachs	(38,671)
7,134	Fluor Corp	Morgan Stanley	2,955
(27,256)	FMC Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3,543)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(109,573)	FNB Corp/PA	Bank of America Merrill Lynch	(4,383)
4,959	Focus Financial Partners Inc 'A'	Goldman Sachs	(5,365)
2,076	Focus Financial Partners Inc 'A'	Morgan Stanley	(1,619)
6,200	Focus Financial Partners Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(6,386)
13,111	Fomento Economico Mexicano SAB de CV ADR	Morgan Stanley	(15,078)
3,326	Fomento Economico Mexicano SAB de CV ADR	Goldman Sachs	7,450
(14,180)	FONAR Corp	Bank of America Merrill Lynch	9,075
(4,312)	FONAR Corp	Goldman Sachs	2,760
(12,209)	Foot Locker Inc	Bank of America Merrill Lynch	(55,551)
(4,264)	Foot Locker Inc	Morgan Stanley	(12,749)
134,025	Ford Motor Co	Bank of America Merrill Lynch	12,062
19,762	Ford Motor Co	Goldman Sachs	1,779
(11,546)	ForeScout Technologies Inc	Goldman Sachs	(4,965)
(11,379)	ForeScout Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,893)
(5,539)	Forestar Group Inc	Morgan Stanley	(2,936)
(44,288)	FormFactor Inc	Morgan Stanley	(48,717)
(47,082)	FormFactor Inc	Bank of America Merrill Lynch	(50,849)
(3,047)	Forrester Research Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11,853)
(23,836)	Forterra Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,912)
16,819	Fortinet Inc	Bank of America Merrill Lynch	26,742
14,795	Fortinet Inc	Morgan Stanley	94,392
16,199	Fortinet Inc	Goldman Sachs	25,756
(69,330)	Fortive Corp	Goldman Sachs	96,369
23,042	Fortune Brands Home & Security Inc	Goldman Sachs	13,003
16,858	Fortune Brands Home & Security Inc	Bank of America Merrill Lynch	10,115
14,244	Fortune Brands Home & Security Inc	Morgan Stanley	4,141
1,859	Forty Seven Inc	Bank of America Merrill Lynch	9,964
2,303	Forum Energy Technologies Inc	Morgan Stanley	(921)
(6,863)	Forum Energy Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	5,353
(55,661)	Forward Air Corp	Bank of America Merrill Lynch	(153,068)
(4,067)	Forward Air Corp	Goldman Sachs	(11,888)
(21,318)	Fossil Group Inc	Morgan Stanley	5,116
(44,342)	Fossil Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(29,709)
1,122	Foundation Building Materials Inc	Bank of America Merrill Lynch	(45)
9,695	Foundation Building Materials Inc	Goldman Sachs	(388)
324,111	Four Corners Property Trust Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	374,348
32,536	Four Corners Property Trust Inc (Reit)	Goldman Sachs	37,579
106,474	Four Corners Property Trust Inc (Reit)	Morgan Stanley	66,546
30,450	Fox Factory Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	(150,119)
(559,919)	Francesca's Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	335,951
(15,646)	Frank's International NV	Goldman Sachs	8,605
(49,866)	Frank's International NV	Morgan Stanley	24,434
902	Franklin Covey Co	Bank of America Merrill Lynch	1,146
2,139	Franklin Covey Co	Morgan Stanley	2,930
(12,063)	Franklin Electric Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	12,063

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(9,736)	Franklin Electric Co Inc	Goldman Sachs	9,736
(15,100)	Franklin Financial Network Inc	Goldman Sachs	240
(25,615)	Franklin Financial Network Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,562
42,367	Franklin Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	84,734
320,676	Franklin Street Properties Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(19,241)
28,840	Franklin Street Properties Corp (Reit)	Goldman Sachs	(1,730)
7,110	Franklin Street Properties Corp (Reit)	Morgan Stanley	-
(169,312)	Fred's Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	27,090
(53,519)	Fred's Inc 'A'	Morgan Stanley	(2,141)
(8,093)	Fred's Inc 'A'	Goldman Sachs	1,295
(17,375)	Freeport-McMoRan Inc	Goldman Sachs	4,691
(53,152)	Freeport-McMoRan Inc	Morgan Stanley	(48,900)
(120,581)	FreightCar America Inc	Bank of America Merrill Lynch	108,523
(87,567)	Fresh Del Monte Produce Inc	Bank of America Merrill Lynch	(220,669)
39,787	Fresh Del Monte Produce Inc	Morgan Stanley	111,006
6,858	Freshpet Inc	Goldman Sachs	(17,762)
42,002	Front Yard Residential Corp (Reit)	Goldman Sachs	9,799
6,232	frontdoor Inc	Goldman Sachs	10,461
48,013	frontdoor Inc	Bank of America Merrill Lynch	72,980
27,623	frontdoor Inc	Morgan Stanley	18,507
(22,212)	FRP Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	7,552
515	FS Bancorp Inc	Morgan Stanley	494
14,315	FS Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	10,736
2,861	FS Bancorp Inc	Goldman Sachs	2,146
34,502	FTD Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9,661)
7,936	FTD Cos Inc	Goldman Sachs	(2,222)
(5,695)	FTI Consulting Inc	Goldman Sachs	(3,043)
3,684	FTS International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,973)
(162,298)	Fulton Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(66,542)
(12,780)	Fulton Financial Corp	Morgan Stanley	(6,134)
(50,988)	Fusion Connect Inc	Morgan Stanley	3,059
(86,691)	Fusion Connect Inc	Bank of America Merrill Lynch	41,612
18,153	FutureFuel Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,089)
9,840	FutureFuel Corp	Goldman Sachs	(590)
8,225	FutureFuel Corp	Morgan Stanley	411
1,086	G-III Apparel Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	245
(6,040)	G1 Therapeutics Inc	Goldman Sachs	9,777
(5,894)	G1 Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	12,436
(3,368)	Gafisa SA ADR	Goldman Sachs	(1,785)
(11,535)	Gafisa SA ADR	Morgan Stanley	(5,883)
(210,118)	GAIN Capital Holdings Inc	Morgan Stanley	(16,809)
(21,892)	GAIN Capital Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	11,603
(4,254)	GAMCO Investors Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(5,403)
(65,904)	GameStop Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(33,637)
(87,222)	GameStop Corp 'A'	Morgan Stanley	22,678

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(91,303)	Gaming and Leisure Properties Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(104,998)
(27,936)	Gaming and Leisure Properties Inc (Reit)	Goldman Sachs	(32,134)
(103,626)	Gap Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	(87,046)
962	Gardner Denver Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(683)
(25,021)	Gardner Denver Holdings Inc	Morgan Stanley	(27,023)
12,303	Gardner Denver Holdings Inc	Goldman Sachs	(8,735)
54,990	Garmin Ltd	Bank of America Merrill Lynch	53,890
29,960	Garrett Motion Inc	Bank of America Merrill Lynch	(43,742)
(16,442)	Gartner Inc	Bank of America Merrill Lynch	(136,962)
7,922	GasLog Ltd	Goldman Sachs	2,535
41,384	GasLog Ltd	Morgan Stanley	63,318
62,929	Gates Industrial Corp Plc	Bank of America Merrill Lynch	(45,938)
(4,670)	GATX Corp	Goldman Sachs	(8,266)
5,073	GATX Corp	Bank of America Merrill Lynch	8,979
1,621	GATX Corp	Goldman Sachs	2,869
(12,357)	GATX Corp	Bank of America Merrill Lynch	(21,872)
(48,332)	GCI Liberty Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(47,849)
(152,897)	GCP Applied Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(15,290)
23,374	Gencor Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,506)
8,388	Gencor Industries Inc	Goldman Sachs	(1,258)
10,604	Gencor Industries Inc	Morgan Stanley	(3,711)
(4,869)	Generac Holdings Inc	Goldman Sachs	(1,711)
126,123	Generac Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	15,135
(2,150)	Generac Holdings Inc	Morgan Stanley	(4,085)
8,395	General Electric Co	Bank of America Merrill Lynch	(5,835)
26,707	General Electric Co	Goldman Sachs	(18,561)
15,393	General Electric Co	Morgan Stanley	(1,462)
46,042	General Motors Co	Bank of America Merrill Lynch	77,120
(37,720)	Genesco Inc	Bank of America Merrill Lynch	55,071
(7,835)	Genesee & Wyoming Inc 'A'	Goldman Sachs	(20,449)
(74,101)	Genesee & Wyoming Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(193,404)
(31,356)	Genesee & Wyoming Inc 'A'	Morgan Stanley	(122,288)
(116,096)	Genie Energy Ltd 'B'	Bank of America Merrill Lynch	13,932
(16,163)	Genie Energy Ltd 'B'	Morgan Stanley	(970)
19,842	Genomic Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	(17,858)
23,806	Genomic Health Inc	Goldman Sachs	13,631
(62,895)	Genpact Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(55,348)
(82,525)	Gentex Corp	Bank of America Merrill Lynch	33,835
(35,724)	Gentex Corp	Morgan Stanley	357
(54,043)	Gentherm Inc	Morgan Stanley	(81,065)
(165,667)	Gentherm Inc	Bank of America Merrill Lynch	(324,707)
(868)	Genuine Parts Co	Bank of America Merrill Lynch	(1,128)
(3,315)	GEO Group Inc/The (Reit)	Goldman Sachs	(3,083)
(12,130)	GEO Group Inc/The (Reit)	Morgan Stanley	(7,157)
2,851	Geopark Ltd	Goldman Sachs	(6,358)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
8,292	Geopark Ltd	Morgan Stanley	(6,053)
3,935	Gerdau SA ADR	Goldman Sachs	(787)
504,362	Gerdau SA ADR	Morgan Stanley	(20,174)
(6,652)	German American Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,863
(223,940)	Geron Corp	Goldman Sachs	10,077
(10,039)	Geron Corp	Morgan Stanley	50
9,307	Getty Realty Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	20,475
7,913	Getty Realty Corp (Reit)	Goldman Sachs	13,925
6,797	Getty Realty Corp (Reit)	Morgan Stanley	6,797
(10,304)	Gibraltar Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,243)
53,740	Gilead Sciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	47,291
(16,816)	Glacier Bancorp Inc	Goldman Sachs	(26,906)
(30,310)	Glacier Bancorp Inc	Morgan Stanley	(30,007)
33,681	Gladstone Commercial Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(8,757)
11,836	Gladstone Commercial Corp (Reit)	Goldman Sachs	(3,077)
7,647	Gladstone Commercial Corp (Reit)	Morgan Stanley	1,071
60,088	Gladstone Land Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	23,434
20,431	Gladstone Land Corp (Reit)	Morgan Stanley	6,742
14,163	Gladstone Land Corp (Reit)	Goldman Sachs	5,524
6,500	Global Blood Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(35,750)
44,460	Global Brass & Copper Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	36,457
(496)	Global Eagle Entertainment Inc	Goldman Sachs	(35)
(203,056)	Global Eagle Entertainment Inc	Morgan Stanley	30,458
(17,279)	Global Indemnity Ltd	Morgan Stanley	(7,430)
(40,340)	Global Medical REIT Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,614)
(700)	Global Medical REIT Inc	Goldman Sachs	(28)
(12,112)	Global Payments Inc	Goldman Sachs	(24,466)
(64,355)	Global Payments Inc	Bank of America Merrill Lynch	(129,997)
(14,575)	Global Payments Inc	Morgan Stanley	(121,118)
24,534	Global Water Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,870)
7,295	Global Water Resources Inc	Goldman Sachs	(2,043)
8,624	Global Water Resources Inc	Morgan Stanley	172
29,462	Globant SA	Morgan Stanley	150,256
2,465	Globus Medical Inc 'A'	Morgan Stanley	(9,687)
39,275	Globus Medical Inc 'A'	Goldman Sachs	(131,472)
19,125	Globus Medical Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(75,735)
7,270	Glu Mobile Inc	Bank of America Merrill Lynch	(872)
7,587	Glu Mobile Inc	Goldman Sachs	(910)
4,031	GMS Inc	Goldman Sachs	1,975
1,557	GMS Inc	Morgan Stanley	1,183
38,833	GNC Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	(10,873)
24,066	GNC Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(6,738)
52,825	GoDaddy Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	64,975
(10,689)	Gol Linhas Aereas Inteligentes SA ADR	Goldman Sachs	1,283
(17,402)	Gol Linhas Aereas Inteligentes SA ADR	Morgan Stanley	9,571

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
25,518	Golar LNG Ltd	Goldman Sachs	16,076
67,293	Golar LNG Ltd	Bank of America Merrill Lynch	42,395
70,393	Golar LNG Ltd	Morgan Stanley	205,844
50,221	Gold Resource Corp	Bank of America Merrill Lynch	(10,546)
25,600	Gold Resource Corp	Goldman Sachs	(5,376)
23,155	Gold Resource Corp	Morgan Stanley	(3,473)
(24,979)	Golden Entertainment Inc	Bank of America Merrill Lynch	(58,701)
(18,014)	Golden Entertainment Inc	Goldman Sachs	(44,533)
(1,379)	Goldman Sachs Group Inc/The	Morgan Stanley	(1,241)
(11,550)	Goodyear Tire & Rubber Co/The	Bank of America Merrill Lynch	(8,547)
43,364	Goodyear Tire & Rubber Co/The	Morgan Stanley	18,213
(3,432)	Goosehead Insurance Inc 'A'	Morgan Stanley	(7,894)
20,416	Gopro Inc 'A'	Goldman Sachs	698
(29,072)	GP Strategies Corp	Goldman Sachs	24,130
(158,214)	GP Strategies Corp	Bank of America Merrill Lynch	131,318
(6,143)	Graco Inc	Goldman Sachs	(61)
(17,700)	Graco Inc	Morgan Stanley	(9,027)
45,244	Graco Inc	Bank of America Merrill Lynch	452
1,170	Graco Inc	Goldman Sachs	12
(15,858)	GrafTech International Ltd	Morgan Stanley	(13,796)
(4,196)	Graham Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,350
72	Graham Holdings Co 'B'	Morgan Stanley	248
(314)	Graham Holdings Co 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(6,346)
(13,674)	Grand Canyon Education Inc	Bank of America Merrill Lynch	13,674
(9,996)	Granite Construction Inc	Morgan Stanley	3,399
(17,030)	Granite Construction Inc	Goldman Sachs	15,402
97,269	Granite Point Mortgage Trust Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	56,416
10,025	Granite Point Mortgage Trust Inc (Reit)	Goldman Sachs	5,815
2,749	Granite Point Mortgage Trust Inc (Reit)	Morgan Stanley	797
(339,410)	Graphic Packaging Holding Co	Bank of America Merrill Lynch	(95,035)
10,819	Gray Television Inc	Morgan Stanley	2,056
1,571	Gray Television Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,257)
60,105	Gray Television Inc	Goldman Sachs	(45,081)
(394,204)	Great Lakes Dredge & Dock Corp	Bank of America Merrill Lynch	(70,957)
2,538	Great Southern Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(533)
(135,213)	Great Western Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(93,297)
34,274	Green Brick Partners Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11,996)
21,449	Green Brick Partners Inc	Goldman Sachs	(7,507)
80,259	Green Dot Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(85,075)
(119,816)	Green Plains Inc	Bank of America Merrill Lynch	176,130
(1,285)	Greenbrier Cos Inc/The	Morgan Stanley	(4,189)
(15,645)	Greenhill & Co Inc	Morgan Stanley	11,890
(51,665)	Greenhill & Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	35,649
(1,208)	Greenhill & Co Inc	Goldman Sachs	834
145,732	Greenlight Capital Re Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(9,473)



保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
52,118	GreenSky Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(24,495)
7,489	GreenSky Inc 'A'	Morgan Stanley	674
(2,971)	Greif Inc 'A'	Goldman Sachs	683
(27,991)	Greif Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	6,438
(23,007)	Greif Inc 'A'	Morgan Stanley	23,467
(6,271)	Greif Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	5,644
(2,342)	Griffin Industrial Realty Inc	Bank of America Merrill Lynch	796
(6,214)	Griffin Industrial Realty Inc	Goldman Sachs	2,113
27,052	Griffon Corp	Bank of America Merrill Lynch	26,781
(41,812)	Gritstone Oncology Inc	Morgan Stanley	(111,220)
(6,618)	Group 1 Automotive Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,169
25,826	Group 1 Automotive Inc	Morgan Stanley	(46,229)
(10,140)	Group 1 Automotive Inc	Goldman Sachs	10,897
(145,236)	Groupon Inc	Goldman Sachs	(27,595)
(45,020)	Groupon Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,554)
(260,426)	Groupon Inc	Morgan Stanley	(18,230)
5,860	GrubHub Inc	Bank of America Merrill Lynch	(72,488)
7,406	GrubHub Inc	Morgan Stanley	(4,221)
23,216	Grupo Aeroportuario del Centro Norte SAB de CV ADR	Goldman Sachs	(35,192)
34,276	Grupo Aeroportuario del Centro Norte SAB de CV ADR	Morgan Stanley	21,251
(3,909)	Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV ADR	Goldman Sachs	38,191
(22,162)	Grupo Televisa SAB ADR	Goldman Sachs	5,541
(122,625)	Grupo Televisa SAB ADR	Morgan Stanley	26,978
3,019	GSI Technology Inc	Goldman Sachs	(543)
(8,810)	GTT Communications Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,400)
195,425	GTx Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9,771)
55,165	GTx Inc	Goldman Sachs	(2,758)
32,464	GTx Inc	Morgan Stanley	(974)
(26,413)	Guaranty Bancshares Inc/TX	Bank of America Merrill Lynch	(13,894)
(4,349)	Guaranty Bancshares Inc/TX	Morgan Stanley	(609)
(26,652)	Guess? Inc	Goldman Sachs	(42,643)
(62,518)	Guess? Inc	Morgan Stanley	(136,289)
(75,271)	Guess? Inc	Bank of America Merrill Lynch	(120,434)
(2,925)	Guidewire Software Inc	Goldman Sachs	(16,974)
(1,358)	Guidewire Software Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,713)
(15,189)	Guidewire Software Inc	Morgan Stanley	(122,879)
(32,922)	Gulf Island Fabrication Inc	Goldman Sachs	(1,646)
(124,890)	Gulfport Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	79,930
(11,353)	Gulfport Energy Corp	Goldman Sachs	7,266
73,839	H&E Equipment Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(31,012)
1,046	H&E Equipment Services Inc	Morgan Stanley	533
14,863	H&E Equipment Services Inc	Goldman Sachs	(6,242)
13,326	H&R Block Inc	Goldman Sachs	(2,532)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
59,878	H&R Block Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11,377)
16,453	H&R Block Inc	Morgan Stanley	494
25,237	Hackett Group Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	(24,985)
(47,435)	Haemonetics Corp	Bank of America Merrill Lynch	25,615
7,296	Haemonetics Corp	Morgan Stanley	40,785
(5,806)	Hain Celestial Group Inc/The	Morgan Stanley	11,206
(10,958)	Hain Celestial Group Inc/The	Goldman Sachs	17,875
(154,787)	Halcon Resources Corp	Morgan Stanley	(23,218)
(126,901)	Halcon Resources Corp	Bank of America Merrill Lynch	12,690
91,792	Halliburton Co	Bank of America Merrill Lynch	(130,345)
24,223	Halliburton Co	Morgan Stanley	7,994
82,776	Halliburton Co	Goldman Sachs	(117,542)
121,040	Hallmark Financial Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	48,416
30,306	Hallmark Financial Services Inc	Morgan Stanley	7,273
(60,107)	Hamilton Beach Brands Holding Co 'A'	Bank of America Merrill Lynch	42,075
(35,737)	Hamilton Lane Inc 'A'	Morgan Stanley	(8,398)
(103,895)	Hamilton Lane Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(46,233)
(223,036)	Hancock Whitney Corp	Bank of America Merrill Lynch	(84,754)
(3,970)	Hanesbrands Inc	Morgan Stanley	(2,342)
(102,775)	Hanesbrands Inc	Goldman Sachs	(23,638)
1,610	Hanger Inc	Morgan Stanley	2,061
1,468	Hanger Inc	Goldman Sachs	1,776
(8,745)	Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital Inc (Reit)	Goldman Sachs	3,544
11,843	Hanover Insurance Group Inc/The	Goldman Sachs	32,984
38,531	Hanover Insurance Group Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	130,813
39,620	Hanover Insurance Group Inc/The	Morgan Stanley	144,760
(2,066)	HarborOne Bancorp Inc	Goldman Sachs	496
(1,106)	Harley-Davidson Inc	Goldman Sachs	(1,261)
(21,504)	Harley-Davidson Inc	Morgan Stanley	(56,556)
3,244	Harris Corp	Bank of America Merrill Lynch	(29,293)
3,364	Harris Corp	Morgan Stanley	(10,664)
(13,492)	Harsco Corp	Goldman Sachs	6,746
(18,709)	Harsco Corp	Bank of America Merrill Lynch	9,355
(6,834)	Harsco Corp	Morgan Stanley	(10,524)
117,811	Hartford Financial Services Group Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	15,315
68,479	Harvard Bioscience Inc	Bank of America Merrill Lynch	13,696
(45,966)	Hasbro Inc	Morgan Stanley	8,274
(39,509)	Hasbro Inc	Bank of America Merrill Lynch	67,560
(26,256)	Haverty Furniture Cos Inc	Goldman Sachs	20,217
(101,253)	Haverty Furniture Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	77,965
(355,268)	Hawaiian Electric Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(152,765)
(38,754)	Hawaiian Electric Industries Inc	Morgan Stanley	(24,415)
1,591	Hawkins Inc	Goldman Sachs	2,450
1,308	Hawkins Inc	Morgan Stanley	1,818
(65,154)	Haynes International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(78,185)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(8,737)	HB Fuller Co	Goldman Sachs	(8,300)
(80,967)	HB Fuller Co	Morgan Stanley	(102,828)
(2,446)	HCA Healthcare Inc	Morgan Stanley	(23,310)
(1,106)	HCA Healthcare Inc	Goldman Sachs	(7,432)
(2,392)	HCI Group Inc	Goldman Sachs	(1,100)
(1,337)	HCI Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(615)
(35,049)	HCP Inc (Reit)	Morgan Stanley	(7,010)
(29,033)	HCP Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(15,968)
21,260	HD Supply Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	21,260
(28,214)	Health Insurance Innovations Inc 'A'	Goldman Sachs	93,106
(13,793)	Health Insurance Innovations Inc 'A'	Morgan Stanley	(27,448)
(9,290)	Healthcare Realty Trust Inc (Reit)	Goldman Sachs	(20,903)
(63,825)	Healthcare Realty Trust Inc (Reit)	Morgan Stanley	(56,804)
(327,286)	Healthcare Realty Trust Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(736,394)
(29,369)	Healthcare Services Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(96,624)
(76,106)	Healthcare Services Group Inc	Morgan Stanley	(133,947)
(143,467)	Healthcare Services Group Inc	Goldman Sachs	(470,110)
105,390	Healthcare Trust of America Inc (Reit) 'A'	Bank of America Merrill Lynch	191,283
(19,737)	HealthEquity Inc	Bank of America Merrill Lynch	(75,790)
24,308	HealthStream Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,215)
(33,689)	Heartland Express Inc	Goldman Sachs	(23,919)
(107,141)	Heartland Express Inc	Bank of America Merrill Lynch	(76,070)
(55,130)	Heartland Express Inc	Morgan Stanley	(56,784)
(4,319)	Heartland Financial USA Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,166
10,939	Hecla Mining Co	Bank of America Merrill Lynch	(1,313)
17,600	Hecla Mining Co	Goldman Sachs	(544)
246,489	Hecla Mining Co	Morgan Stanley	(39,438)
34,218	HEICO Corp	Goldman Sachs	(3,244)
43,598	HEICO Corp	Morgan Stanley	90,684
4,529	HEICO Corp 'A'	Goldman Sachs	1,993
81,285	HEICO Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	35,765
1,369	HEICO Corp 'A'	Morgan Stanley	3,327
1,795	Heidrick & Struggles International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(323)
2,141	Heidrick & Struggles International Inc	Goldman Sachs	(385)
10,923	Helen of Troy Ltd	Goldman Sachs	66,112
30,418	Helen of Troy Ltd	Bank of America Merrill Lynch	216,272
10,209	Helen of Troy Ltd	Morgan Stanley	33,486
2,400	Helmerich & Payne Inc	Goldman Sachs	(1,824)
(5,957)	Helmerich & Payne Inc	Goldman Sachs	10,158
2,796	Helmerich & Payne Inc	Morgan Stanley	1,426
(5,864)	Hemisphere Media Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(293)
1,336	Hennessy Advisors Inc	Morgan Stanley	(641)
24,078	Hennessy Advisors Inc	Bank of America Merrill Lynch	(15,169)
1,400	Henry Schein Inc	Goldman Sachs	7,375
5,582	Henry Schein Inc	Morgan Stanley	32,522

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益 / (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(25,918)	Henry Schein Inc	Bank of America Merrill Lynch	(110,670)
16,479	Herbalife Nutrition Ltd	Goldman Sachs	44,658
(3,205)	Herbalife Nutrition Ltd	Morgan Stanley	(9,903)
25,066	Herc Holdings Inc	Morgan Stanley	15,541
46,210	Herc Holdings Inc	Goldman Sachs	(94,173)
63,887	Heritage Commerce Corp	Bank of America Merrill Lynch	-
232,174	Heritage Commerce Corp	Morgan Stanley	44,113
45,204	Heritage Commerce Corp	Goldman Sachs	-
10,462	Heritage Insurance Holdings	Goldman Sachs	196
(9,257)	Herman Miller Inc	Goldman Sachs	7,498
(128,882)	Herman Miller Inc	Bank of America Merrill Lynch	104,394
(11,668)	Herman Miller Inc	Morgan Stanley	(6,301)
4,465	Hersha Hospitality Trust (Reit)	Goldman Sachs	2,773
9,493	Hershey Co/The	Goldman Sachs	(1,709)
8,551	Hershey Co/The	Morgan Stanley	17,273
61,755	Hershey Co/The	Bank of America Merrill Lynch	(11,116)
(26,021)	Hertz Global Holdings Inc	Morgan Stanley	(11,189)
(11,043)	Heska Corp	Bank of America Merrill Lynch	(37,877)
(262)	Heska Corp	Goldman Sachs	(899)
(61,924)	Hess Corp	Bank of America Merrill Lynch	242,742
27,584	Hewlett Packard Enterprise Co	Goldman Sachs	(8,679)
110,268	Hewlett Packard Enterprise Co	Bank of America Merrill Lynch	(47,415)
(4,071)	Hexcel Corp	Goldman Sachs	(6,875)
2,380	HFF Inc 'A'	Morgan Stanley	5,617
5,124	HFF Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	11,068
22,560	HFF Inc 'A'	Goldman Sachs	48,730
41,013	Hibbett Sports Inc	Bank of America Merrill Lynch	(131,037)
129,790	Highwoods Properties Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(106,428)
(171,759)	Hill International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,718)
(41,500)	Hill International Inc	Morgan Stanley	(3,320)
(12,069)	Hill International Inc	Goldman Sachs	(2,192)
(2,036)	Hill-Rom Holdings Inc	Goldman Sachs	(10,231)
(1,181)	Hill-Rom Holdings Inc	Morgan Stanley	(4,712)
30,524	Hill-Rom Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	143,158
(6,304)	Hillenbrand Inc	Goldman Sachs	24,901
(29,428)	Hillenbrand Inc	Morgan Stanley	3,826
(23,889)	Hillenbrand Inc	Bank of America Merrill Lynch	94,362
(15,666)	Hilton Grand Vacations Inc	Goldman Sachs	(33,946)
(42,703)	Hilton Grand Vacations Inc	Morgan Stanley	(71,741)
(13,618)	Hilton Worldwide Holdings Inc	Goldman Sachs	(36,769)
(30,643)	Hilton Worldwide Holdings Inc	Morgan Stanley	(75,688)
8,314	HMS Holdings Corp	Goldman Sachs	(6,734)
13,146	HMS Holdings Corp	Morgan Stanley	(920)
(17,239)	HollyFrontier Corp	Goldman Sachs	32,237
(39,031)	HollyFrontier Corp	Bank of America Merrill Lynch	72,988

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(12,301)	HollyFrontier Corp	Morgan Stanley	(49,819)
10,210	Hollysys Automation Technologies Ltd	Goldman Sachs	(9,087)
6,974	Hollysys Automation Technologies Ltd	Morgan Stanley	5,091
(2,033)	Hologic Inc	Goldman Sachs	(6,363)
(38,702)	Hologic Inc	Bank of America Merrill Lynch	(125,394)
(10,403)	Home Bancorp Inc	Goldman Sachs	9,675
195,796	Home BancShares Inc/AR	Bank of America Merrill Lynch	(72,445)
112,311	Home BancShares Inc/AR	Goldman Sachs	(33,204)
(44,115)	HomeStreet Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,323)
(10,708)	Honeywell International Inc	Goldman Sachs	(16,374)
1,987	Hooker Furniture Corp	Goldman Sachs	(497)
(26,005)	Hope Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,021)
(155,024)	Horizon Global Corp	Bank of America Merrill Lynch	(41,856)
(36,780)	Horizon Global Corp	Morgan Stanley	(5,885)
(2,765)	Horizon Pharma Plc	Morgan Stanley	2,406
204,735	Hormel Foods Corp	Morgan Stanley	(47,089)
39,432	Hormel Foods Corp	Bank of America Merrill Lynch	(789)
71,142	Hormel Foods Corp	Goldman Sachs	(1,423)
44,917	Hortonworks Inc	Bank of America Merrill Lynch	21,111
10,794	Hortonworks Inc	Goldman Sachs	5,073
(4,524)	Hospitality Properties Trust (Reit)	Goldman Sachs	(271)
(32,477)	Hospitality Properties Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(1,949)
(11,857)	Hospitality Properties Trust (Reit)	Morgan Stanley	(5,691)
(61,112)	Host Hotels & Resorts Inc (Reit)	Goldman Sachs	7,092
172,215	Host Hotels & Resorts Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(10,333)
(67,606)	Host Hotels & Resorts Inc (Reit)	Morgan Stanley	(4,056)
10,679	Houghton Mifflin Harcourt Co	Goldman Sachs	4,788
(25,287)	Houlihan Lokey Inc	Morgan Stanley	(33,632)
(777,150)	Hovnanian Enterprises Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(38,858)
(17,905)	Hovnanian Enterprises Inc 'A'	Goldman Sachs	(895)
(78,029)	Howard Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	10,924
(38,478)	Howard Hughes Corp/The	Morgan Stanley	(171,227)
245,473	HP Inc	Morgan Stanley	51,549
126,712	HP Inc	Goldman Sachs	(183,732)
44,979	HP Inc	Bank of America Merrill Lynch	(65,220)
2,048	Hub Group Inc 'A'	Goldman Sachs	4,004
9,229	Hub Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(14,213)
2,384	Hub Group Inc 'A'	Morgan Stanley	1,279
21,456	Hubbell Inc	Goldman Sachs	9,226
24,455	Hubbell Inc	Bank of America Merrill Lynch	10,516
32,726	Hubbell Inc	Morgan Stanley	49,089
1,161	HubSpot Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,904
(4,095)	HubSpot Inc	Goldman Sachs	(56,842)
37,043	Hudson Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	14,076
7,503	Hudson Ltd 'A'	Goldman Sachs	2,851

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
17,537	Hudson Ltd 'A'	Morgan Stanley	7,190
(1,617)	Hudson Pacific Properties Inc (Reit)	Goldman Sachs	(2,095)
(51,066)	Hudson Pacific Properties Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(27,576)
(2,615)	Humana Inc	Goldman Sachs	(33,524)
8,815	Humana Inc	Bank of America Merrill Lynch	113,008
(3,203)	Humana Inc	Morgan Stanley	(79,787)
7,243	Huntington Bancshares Inc/OH	Goldman Sachs	(1,666)
2,728	Huntington Ingalls Industries Inc	Goldman Sachs	9,275
(9,313)	Huntington Ingalls Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,073)
7,702	Huntington Ingalls Industries Inc	Morgan Stanley	29,884
114,950	Huntsman Corp	Bank of America Merrill Lynch	(178,173)
8,375	Hurco Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	(16,499)
5,540	Hurco Cos Inc	Goldman Sachs	(10,914)
4,676	Hurco Cos Inc	Morgan Stanley	(140)
598	Huron Consulting Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	472
995	Huron Consulting Group Inc	Morgan Stanley	1,701
(19,653)	Huttig Building Products Inc	Goldman Sachs	2,948
(227,574)	Huttig Building Products Inc	Morgan Stanley	29,585
(5,455)	Huttig Building Products Inc	Bank of America Merrill Lynch	818
(32,171)	Hyatt Hotels Corp 'A'	Goldman Sachs	(52,384)
(51,239)	Hyatt Hotels Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(72,759)
(12,173)	Hyatt Hotels Corp 'A'	Morgan Stanley	(23,250)
(2,234)	Hyster Yale Materials	Bank of America Merrill Lynch	(2,837)
(2,624)	Hyster Yale Materials	Goldman Sachs	(2,518)
5,796	I3 Verticals Inc 'A'	Morgan Stanley	11,302
29,809	I3 Verticals Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	44,415
36,404	I3 Verticals Inc 'A'	Goldman Sachs	54,242
(5,829)	IAC/InterActiveCorp	Bank of America Merrill Lynch	37,597
(6,571)	IBERIABANK Corp	Bank of America Merrill Lynch	(7,622)
1,507	IBERIABANK Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,748
509	IBERIABANK Corp	Goldman Sachs	590
(4,236)	IBERIABANK Corp	Goldman Sachs	(3,166)
30,488	ICF International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(46,647)
7,192	ICF International Inc	Goldman Sachs	(11,004)
7,720	ICF International Inc	Morgan Stanley	11,966
(44,311)	Ichor Holdings Ltd	Morgan Stanley	(54,503)
(73,068)	Ichor Holdings Ltd	Goldman Sachs	(81,836)
(1,243)	ICU Medical Inc	Goldman Sachs	(3,941)
(286)	ICU Medical Inc	Bank of America Merrill Lynch	832
(919)	ICU Medical Inc	Morgan Stanley	(7,251)
200,103	IDACORP Inc	Bank of America Merrill Lynch	(280,144)
33,525	IDACORP Inc	Morgan Stanley	(45,929)
(901)	Idera Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	847
(15,095)	Idera Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	11,623
11,148	IDEX Corp	Bank of America Merrill Lynch	(10,925)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
366	IDEX Corp	Goldman Sachs	(359)
6,171	IDEXX Laboratories Inc	Goldman Sachs	7,161
18,179	IDEXX Laboratories Inc	Bank of America Merrill Lynch	17,452
1,045	IDEXX Laboratories Inc	Morgan Stanley	9,280
7,572	IDT Corp 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(1,590)
20,595	IDT Corp 'B'	Goldman Sachs	(9,554)
(113,536)	IES Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(18,166)
(15,550)	IHS Markit Ltd	Goldman Sachs	(10,574)
(81,042)	IHS Markit Ltd	Morgan Stanley	(245,557)
(64,641)	II-VI Inc	Bank of America Merrill Lynch	91,144
(14,828)	II-VI Inc	Morgan Stanley	(18,535)
(9,003)	Illinois Tool Works Inc	Morgan Stanley	(21,697)
42,136	Illinois Tool Works Inc	Bank of America Merrill Lynch	58,569
(4,472)	Illumina Inc	Bank of America Merrill Lynch	(60,685)
(18,935)	Immersion Corp	Morgan Stanley	947
49,564	Immune Design Corp	Goldman Sachs	3,469
29,887	Immune Design Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,092
75,057	Immune Design Corp	Morgan Stanley	6,005
(111,448)	Immunomedics Inc	Goldman Sachs	(50,152)
(7,972)	Impac Mortgage Holdings Inc	Morgan Stanley	2,790
(74,556)	Imperva Inc	Bank of America Merrill Lynch	39,515
(4,997)	Imperva Inc	Morgan Stanley	2,199
18,403	Incyte Corp	Bank of America Merrill Lynch	(17,115)
105,500	Independence Contract Drilling Inc	Bank of America Merrill Lynch	(33,760)
44,662	Independence Contract Drilling Inc	Goldman Sachs	(14,292)
64,562	Independence Contract Drilling Inc	Morgan Stanley	-
(26,667)	Independence Holding Co	Bank of America Merrill Lynch	(27,734)
(14,176)	Independence Holding Co	Morgan Stanley	(16,302)
(5,477)	Independence Realty Trust Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(712)
247,973	Independent Bank Corp/MI	Bank of America Merrill Lynch	(49,595)
24,648	Independent Bank Corp/MI	Goldman Sachs	(4,930)
22,935	Independent Bank Corp/MI	Morgan Stanley	-
(7,899)	Independent Bank Corp/Rockland MA	Morgan Stanley	(4,660)
(112,373)	Independent Bank Corp/Rockland MA	Bank of America Merrill Lynch	(44,949)
(7,632)	Independent Bank Group Inc	Goldman Sachs	3,282
(7,683)	Independent Bank Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,304
(30,045)	Independent Bank Group Inc	Morgan Stanley	(62,494)
642,983	Infinera Corp	Bank of America Merrill Lynch	(475,807)
105,153	Infinera Corp	Morgan Stanley	(23,134)
(30,176)	Information Services Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,414)
23,501	Infrastructure and Energy Alternatives Inc	Bank of America Merrill Lynch	13,396
23,744	Infrastructure and Energy Alternatives Inc	Goldman Sachs	13,534
13,337	Infrastructure and Energy Alternatives Inc	Morgan Stanley	9,069
46,431	Ingersoll-Rand Plc	Bank of America Merrill Lynch	(3,714)
22,246	Ingersoll-Rand Plc	Morgan Stanley	38,041

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(24,037)	Ingevity Corp	Morgan Stanley	(62,015)
(56,093)	Ingevity Corp	Bank of America Merrill Lynch	8,414
43,390	Ingles Markets Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(76,366)
(10,668)	Ingredion Inc	Morgan Stanley	(24,963)
(26,618)	Ingredion Inc	Goldman Sachs	(149,061)
(20,471)	Ingredion Inc	Bank of America Merrill Lynch	(114,638)
(115,480)	InnerWorkings Inc	Bank of America Merrill Lynch	57,740
12,374	Innophos Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(19,922)
2,121	Innophos Holdings Inc	Morgan Stanley	255
14,934	Innophos Holdings Inc	Goldman Sachs	(23,278)
87,622	Innospec Inc	Bank of America Merrill Lynch	(223,436)
6,882	Innospec Inc	Goldman Sachs	(17,549)
5,511	Innospec Inc	Morgan Stanley	4,409
101,669	Innoviva Inc	Bank of America Merrill Lynch	158,604
13,387	Innoviva Inc	Goldman Sachs	19,583
(5,744)	Inogen Inc	Goldman Sachs	(33,741)
(23,140)	Inovalon Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(41,652)
24,100	Inphi Corp	Bank of America Merrill Lynch	47,718
1,185	Inphi Corp	Morgan Stanley	1,706
10,556	Inphi Corp	Goldman Sachs	20,901
(2,362)	Inphi Corp	Morgan Stanley	(3,401)
(23,935)	Inseego Corp	Bank of America Merrill Lynch	(718)
(59,663)	Inseego Corp	Morgan Stanley	(14,916)
(57,983)	Insmed Inc	Bank of America Merrill Lynch	(29,571)
59,374	Insperity Inc	Bank of America Merrill Lynch	(401,368)
13,935	Insperity Inc	Morgan Stanley	46,125
28,001	Insperity Inc	Goldman Sachs	(180,785)
(5,895)	Inspire Medical Systems Inc	Morgan Stanley	(8,843)
(138,355)	Installed Building Products Inc	Bank of America Merrill Lynch	(644,734)
6,062	Insteel Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,789)
3,234	Insteel Industries Inc	Goldman Sachs	(2,555)
3,309	Insteel Industries Inc	Morgan Stanley	2,018
10,189	Insulet Corp	Goldman Sachs	25,880
7,130	Insulet Corp	Morgan Stanley	49,554
(7,268)	Insulet Corp	Bank of America Merrill Lynch	(18,461)
18,348	Integer Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	54,310
1,390	Integer Holdings Corp	Morgan Stanley	6,158
6,228	Integer Holdings Corp	Goldman Sachs	18,435
(35,582)	Integra LifeSciences Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	15,300
996	Intel Corp	Goldman Sachs	(169)
19,275	Intel Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3,277)
2,889	Intel Corp	Morgan Stanley	4,045
(36,087)	Intelsat SA	Morgan Stanley	(34,244)
(6,551)	Intelsat SA	Goldman Sachs	(2,031)
9,035	Inter Parfums Inc	Bank of America Merrill Lynch	5,963



保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(7,339)	Interactive Brokers Group Inc 'A'	Goldman Sachs	(12,623)
(34,442)	Interactive Brokers Group Inc 'A'	Morgan Stanley	(142,245)
(3,764)	Intercept Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(38,092)
4,165	Intercontinental Exchange Inc	Goldman Sachs	4,748
3,697	Intercontinental Exchange Inc	Morgan Stanley	8,910
(65,827)	InterDigital Inc	Bank of America Merrill Lynch	175,100
(10,031)	Internap Corp	Bank of America Merrill Lynch	4,614
214,563	International Bancshares Corp	Bank of America Merrill Lynch	(306,825)
3,504	International Bancshares Corp	Morgan Stanley	(175)
(9,141)	International Business Machines Corp	Goldman Sachs	(27,172)
(1,346)	International Flavors & Fragrances Inc	Goldman Sachs	(1,942)
(1,257)	International Flavors & Fragrances Inc	Morgan Stanley	(1,936)
36,696	International Game Technology Plc	Bank of America Merrill Lynch	39,632
20,580	International Game Technology Plc	Goldman Sachs	22,226
(147,613)	International Seaways Inc	Goldman Sachs	(202,230)
20,672	International Speedway Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(6,822)
10,516	International Speedway Corp 'A'	Goldman Sachs	(3,470)
16,645	Interpublic Group of Cos Inc/The	Goldman Sachs	1,332
42,234	Interpublic Group of Cos Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	3,379
24,909	Interpublic Group of Cos Inc/The	Morgan Stanley	32,133
31,741	Intersect ENT Inc	Bank of America Merrill Lynch	(22,536)
14,517	Intersect ENT Inc	Goldman Sachs	(10,307)
13,188	InterXion Holding NV	Goldman Sachs	(18,991)
7,837	InterXion Holding NV	Morgan Stanley	11,520
(783)	INTL. FCStone Inc	Goldman Sachs	5,191
(61,936)	INTL. FCStone Inc	Bank of America Merrill Lynch	410,636
284,781	Intrepid Potash Inc	Bank of America Merrill Lynch	(165,173)
49,272	Intrepid Potash Inc	Goldman Sachs	(28,578)
93,818	Intrepid Potash Inc	Morgan Stanley	(7,505)
(5,078)	Intrexon Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,844
(24,045)	Intrexon Corp	Morgan Stanley	5,771
(10,290)	IntriCon Corp	Bank of America Merrill Lynch	(6,483)
(25,510)	IntriCon Corp	Goldman Sachs	(16,071)
710	Intuitive Surgical Inc	Morgan Stanley	21,265
1,984	Intuitive Surgical Inc	Goldman Sachs	36,924
(251,361)	Invacare Corp	Bank of America Merrill Lynch	118,003
125,948	Invesco Ltd	Bank of America Merrill Lynch	17,633
161,923	Invesco Mortgage Capital Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	87,438
3,515	Invesco Mortgage Capital Inc (Reit)	Goldman Sachs	2,249
24,989	Investors Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	-
646,625	Investors Bancorp Inc	Morgan Stanley	6,466
(218,669)	Investors Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	-
124,556	Investors Bancorp Inc	Goldman Sachs	-
(745,496)	Investors Real Estate Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	96,914
(378,516)	Investors Real Estate Trust (Reit)	Goldman Sachs	49,207

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
64,863	Invitae Corp	Bank of America Merrill Lynch	61,620
38,315	Invitae Corp	Goldman Sachs	39,421
(14,182)	ION Geophysical Corp	Goldman Sachs	6,807
(12,951)	ION Geophysical Corp	Morgan Stanley	12,044
(12,257)	Iovance Biotherapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,106
(338)	IPG Photonics Corp	Goldman Sachs	31
(14,435)	IPG Photonics Corp	Bank of America Merrill Lynch	(29,592)
(11,199)	IPG Photonics Corp	Morgan Stanley	(34,269)
(1,088)	IQVIA Holdings Inc	Goldman Sachs	(4,842)
(29,949)	IQVIA Holdings Inc	Morgan Stanley	(175,202)
(12,006)	IQVIA Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(53,427)
14,338	iRadimed Corp	Bank of America Merrill Lynch	3,585
7,916	iRadimed Corp	Goldman Sachs	1,979
1,545	iRadimed Corp	Morgan Stanley	(1,700)
(1,258)	iRhythm Technologies Inc	Goldman Sachs	(8,930)
20,726	iRhythm Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	22,799
9,691	iRhythm Technologies Inc	Goldman Sachs	27,292
1,208	iRhythm Technologies Inc	Morgan Stanley	9,302
(5,821)	iRobot Corp	Morgan Stanley	(15,658)
(1,024)	iRobot Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4,731)
(42,521)	Iron Mountain Inc (Reit)	Goldman Sachs	(15,698)
5,864	Ironwood Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	3,929
84,849	Ironwood Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	173,092
(130,777)	Iteris Inc	Goldman Sachs	6,539
(205,811)	Iteris Inc	Bank of America Merrill Lynch	10,291
(81,234)	Iteris Inc	Morgan Stanley	(9,748)
36,767	ITT Inc	Bank of America Merrill Lynch	(45,223)
34,114	ITT Inc	Morgan Stanley	21,151
195,356	J Alexander 's Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(66,421)
22,474	J Alexander 's Holdings Inc	Goldman Sachs	(7,641)
8,879	J Alexander 's Holdings Inc	Morgan Stanley	4,706
506	J&J Snack Foods Corp	Goldman Sachs	(86)
1,317	J&J Snack Foods Corp	Morgan Stanley	1,712
(4,656)	J. Jill Inc	Goldman Sachs	(1,762)
9,080	j2 Global Inc	Morgan Stanley	14,437
(73,092)	j2 Global Inc	Bank of America Merrill Lynch	(35,084)
(968)	Jack Henry & Associates Inc	Goldman Sachs	261
(8,613)	Jack Henry & Associates Inc	Morgan Stanley	(22,566)
(17,835)	Jack Henry & Associates Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,815
(137,432)	Jack in the Box Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,073,344)
(8,739)	Jacobs Engineering Group Inc	Goldman Sachs	(3,491)
22,899	Jagged Peak Energy Inc	Morgan Stanley	(5,954)
186,608	Jagged Peak Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(132,492)
29,717	Jagged Peak Energy Inc	Goldman Sachs	(21,099)
65,029	James River Group Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	47,471

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
18,009	James River Group Holdings Ltd	Goldman Sachs	13,147
(174,393)	Janus Henderson Group Plc	Goldman Sachs	15,695
(15,240)	Janus Henderson Group Plc	Morgan Stanley	4,877
12,859	Jason Industries Inc	Morgan Stanley	(900)
13,812	Jazz Pharmaceuticals Plc	Bank of America Merrill Lynch	34,392
13,361	JB Hunt Transport Services Inc	Goldman Sachs	13,978
34,687	JB Hunt Transport Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	43,012
8,051	JB Hunt Transport Services Inc	Morgan Stanley	18,255
(8,358)	JBG SMITH Properties (Reit)	Goldman Sachs	3,024
(12,072)	JBG SMITH Properties (Reit)	Morgan Stanley	4,225
82,493	Jefferies Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	55,270
(218,250)	JELD-WEN Holding Inc	Bank of America Merrill Lynch	(237,893)
(158,507)	JELD-WEN Holding Inc	Morgan Stanley	(152,167)
(1,487)	Jernigan Capital Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(2,141)
(19,020)	JetBlue Airways Corp	Goldman Sachs	(24,074)
(68,044)	JetBlue Airways Corp	Bank of America Merrill Lynch	(83,694)
(7,659)	JetBlue Airways Corp	Morgan Stanley	(8,042)
22,309	JM Smucker Co/The	Bank of America Merrill Lynch	(200,112)
71,554	JMP Group LLC	Morgan Stanley	(716)
60,618	John B Sanfilippo & Son Inc	Bank of America Merrill Lynch	(115,780)
2,134	John B Sanfilippo & Son Inc	Morgan Stanley	(341)
4,469	John B Sanfilippo & Son Inc	Goldman Sachs	(8,536)
(37,702)	John Bean Technologies Corp	Bank of America Merrill Lynch	128,941
(4,113)	John Bean Technologies Corp	Goldman Sachs	14,066
19,651	John Wiley & Sons Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(3,144)
(19,985)	Johnson & Johnson	Goldman Sachs	(22,783)
13,169	Johnson & Johnson	Bank of America Merrill Lynch	15,013
(36,512)	Johnson & Johnson	Morgan Stanley	(124,506)
17,767	Johnson Controls International plc	Goldman Sachs	16,725
44,344	Johnson Controls International plc	Morgan Stanley	45,212
(102,573)	Johnson Controls International plc	Goldman Sachs	(92,316)
(3,974)	Jones Lang LaSalle Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11,843)
(704)	Jones Lang LaSalle Inc	Goldman Sachs	(4,537)
(872)	Jones Lang LaSalle Inc	Morgan Stanley	(2,171)
25,753	Jounce Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9,271)
16,135	Jounce Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(5,809)
11,227	Jounce Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(4,603)
944	Juniper Networks Inc	Goldman Sachs	113
54,231	Juniper Networks Inc	Bank of America Merrill Lynch	6,508
12,871	K12 Inc	Bank of America Merrill Lynch	15,316
1,478	K12 Inc	Goldman Sachs	1,759
(87,503)	Kadmon Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	7,875
(108,246)	Kadmon Holdings Inc	Morgan Stanley	31,391
6,024	Kaiser Aluminum Corp	Morgan Stanley	17,229
31,418	Kaiser Aluminum Corp	Bank of America Merrill Lynch	66,292

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
29,951	Kala Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11,082)
46,361	Kala Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(17,154)
23,199	Kala Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	1,392
4,450	Kalvista Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(54)
(92,641)	Kaman Corp	Bank of America Merrill Lynch	168,607
(30,473)	Kaman Corp	Morgan Stanley	28,949
(17,483)	Kaman Corp	Goldman Sachs	29,812
(5,598)	Kansas City Southern	Goldman Sachs	(12,763)
(23,711)	Kansas City Southern	Bank of America Merrill Lynch	(54,061)
(29,124)	Kansas City Southern	Morgan Stanley	(133,679)
(14,509)	KAR Auction Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	435
24,390	Karyopharm Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(35,122)
(51,372)	KB Home	Goldman Sachs	(193,672)
(113,164)	KB Home	Bank of America Merrill Lynch	(426,628)
(48,489)	KB Home	Morgan Stanley	(38,791)
(195,907)	KBR Inc	Bank of America Merrill Lynch	266,434
(13,881)	KBR Inc	Morgan Stanley	(8,467)
(34,353)	Keane Group Inc	Morgan Stanley	11,680
(78,356)	Keane Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	61,901
(5,163)	Kearny Financial Corp	Goldman Sachs	(723)
(2,590)	Kearny Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(363)
51,042	Kellogg Co	Bank of America Merrill Lynch	29,604
1,011	Kellogg Co	Morgan Stanley	1,375
(15,140)	Kelly Services Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	7,116
(11,904)	Kelly Services Inc 'A'	Goldman Sachs	5,595
(51,880)	KEMET Corp	Bank of America Merrill Lynch	(19,714)
(931)	Kemper Corp	Bank of America Merrill Lynch	(587)
(117,729)	Kennametal Inc	Bank of America Merrill Lynch	34,141
(23,043)	Kennametal Inc	Goldman Sachs	(12,970)
(335,396)	Kennedy-Wilson Holdings Inc	Goldman Sachs	(191,176)
29,523	Key Energy Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(56,389)
11,989	Key Energy Services Inc	Morgan Stanley	(6,234)
64,497	Key Tronic Corp	Bank of America Merrill Lynch	(9,030)
11,081	Key Tronic Corp	Morgan Stanley	(3,435)
60,170	KeyCorp	Goldman Sachs	(14,441)
112,306	KeyCorp	Bank of America Merrill Lynch	(26,953)
284,218	KeyCorp	Morgan Stanley	79,581
582	Keysight Technologies Inc	Goldman Sachs	1,536
11,907	Keysight Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	31,434
(261,843)	KeyW Holding Corp/The	Morgan Stanley	(295,883)
111,157	Kforce Inc	Bank of America Merrill Lynch	(36,682)
(5,045)	Kilroy Realty Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(2,018)
(19,990)	Kilroy Realty Corp (Reit)	Goldman Sachs	(25,836)
(24,850)	Kimball Electronics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11,183)
45,502	Kimball International Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(36,402)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
6,848	Kimball International Inc 'B'	Morgan Stanley	(1,644)
808	Kimball International Inc 'B'	Goldman Sachs	(646)
(15,984)	Kimberly-Clark Corp	Morgan Stanley	(34,525)
(7,424)	Kimberly-Clark Corp	Goldman Sachs	(31,016)
67,240	Kimco Realty Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	43,034
47,886	Kimco Realty Corp (Reit)	Morgan Stanley	36,393
4,019	Kinder Morgan Inc/DE	Goldman Sachs	371
30,310	Kindred Biosciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	28,188
21,352	Kindred Biosciences Inc	Goldman Sachs	19,857
9,388	Kindred Biosciences Inc	Morgan Stanley	6,665
11,435	Kinsale Capital Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	34,076
7,319	Kinsale Capital Group Inc	Morgan Stanley	17,200
10,276	Kinsale Capital Group Inc	Goldman Sachs	30,622
(15,546)	Kirby Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,710
(30,729)	Kirkland's Inc	Bank of America Merrill Lynch	(32,265)
6,201	Kite Realty Group Trust (Reit)	Goldman Sachs	3,332
2,458	Kite Realty Group Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	891
19,044	KKR Real Estate Finance Trust Inc (Reit)	Morgan Stanley	6,285
274,241	KKR Real Estate Finance Trust Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	52,106
8,349	KKR Real Estate Finance Trust Inc (Reit)	Goldman Sachs	1,586
28,734	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	Goldman Sachs	80,937
13,890	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	Morgan Stanley	29,725
11,153	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	24,202
(37,960)	Knowles Corp	Morgan Stanley	(3,037)
34,969	Kohl's Corp	Bank of America Merrill Lynch	(201,771)
34,056	Kohl's Corp	Morgan Stanley	123,283
26,413	Koninklijke Philips NV	Goldman Sachs	3,797
29,923	Koninklijke Philips NV	Morgan Stanley	2,095
4,539	Kopin Corp	Morgan Stanley	(182)
12,665	Kopin Corp	Bank of America Merrill Lynch	(760)
59,907	Kopin Corp	Goldman Sachs	(3,594)
16,909	Koppers Holdings Inc	Goldman Sachs	(47,852)
12,598	Koppers Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(35,652)
(6,080)	Korn/Ferry International	Morgan Stanley	(11,370)
2,828	Korn/Ferry International	Goldman Sachs	6,165
35,102	Korn/Ferry International	Bank of America Merrill Lynch	76,522
8,523	Kosmos Energy Ltd	Goldman Sachs	(1,243)
(158,999)	Kosmos Energy Ltd	Goldman Sachs	58,830
(55,952)	Kraft Heinz Co/The	Bank of America Merrill Lynch	58,190
(74,675)	Kraft Heinz Co/The	Morgan Stanley	6,721
(6,056)	Kraft Heinz Co/The	Goldman Sachs	6,298
(18,643)	Kraton Corp	Bank of America Merrill Lynch	8,203
(7,086)	Kraton Corp	Goldman Sachs	(1,383)
(4,495)	Kratos Defense & Security Solutions Inc	Goldman Sachs	9,889
(85,629)	Kratos Defense & Security Solutions Inc	Morgan Stanley	29,114

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(129,161)	Kratos Defense & Security Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	284,154
(3,206)	Krystal Biotech Inc	Morgan Stanley	(8,560)
(4,909)	Krystal Biotech Inc	Goldman Sachs	(9,720)
2,052	Kulicke & Soffa Industries Inc	Goldman Sachs	1,580
3,914	Kulicke & Soffa Industries Inc	Morgan Stanley	4,971
6,423	KushCo Holdings Inc	Morgan Stanley	3,083
(2,172)	L Brands Inc	Goldman Sachs	(3,451)
(24,903)	L Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	54,040
(44,958)	L Brands Inc	Morgan Stanley	(159,601)
(7,353)	L3 Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	73,751
2,963	La Jolla Pharmaceutical Co	Bank of America Merrill Lynch	(1,867)
8,095	La Jolla Pharmaceutical Co	Goldman Sachs	(5,100)
5,435	La-Z-Boy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(978)
(2,819)	La-Z-Boy Inc	Morgan Stanley	(1,099)
(2,893)	Laboratory Corp of America Holdings	Morgan Stanley	45,420
(29,708)	Laboratory Corp of America Holdings	Bank of America Merrill Lynch	543,656
315,147	Ladder Capital Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	135,513
54,875	Ladder Capital Corp (Reit)	Goldman Sachs	23,596
15,237	Ladder Capital Corp (Reit)	Morgan Stanley	2,286
29,974	Ladenburg Thalmann Financial Services Inc	Morgan Stanley	5,995
89,814	Ladenburg Thalmann Financial Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	8,981
64,380	Ladenburg Thalmann Financial Services Inc	Goldman Sachs	6,438
115,121	Lakeland Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	145,052
45,216	Lakeland Financial Corp	Goldman Sachs	56,972
20,673	Lakeland Financial Corp	Morgan Stanley	14,471
13,794	Lamar Advertising Co (Reit) 'A'	Goldman Sachs	276
15,023	Lamar Advertising Co (Reit) 'A'	Bank of America Merrill Lynch	300
3,759	Lamb Weston Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(21,614)
1,092	Lancaster Colony Corp	Morgan Stanley	(470)
4,354	Lancaster Colony Corp	Bank of America Merrill Lynch	740
32,054	Landec Corp	Bank of America Merrill Lynch	34,298
30,698	Landec Corp	Goldman Sachs	32,847
4,264	Landec Corp	Morgan Stanley	1,237
(1,504)	Lands' End Inc	Morgan Stanley	(3,444)
(6,606)	Lands' End Inc	Bank of America Merrill Lynch	(19,330)
46,719	Landstar System Inc	Bank of America Merrill Lynch	99,979
30,397	Landstar System Inc	Goldman Sachs	66,623
31,020	Landstar System Inc	Morgan Stanley	117,256
(65,338)	Lannett Co Inc	Goldman Sachs	7,841
(11,223)	Lannett Co Inc	Morgan Stanley	1,347
(68,449)	Lantheus Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(92,406)
410,517	Laredo Petroleum Inc	Bank of America Merrill Lynch	(340,729)
14,406	Laredo Petroleum Inc	Morgan Stanley	(8,355)
47,577	Las Vegas Sands Corp	Bank of America Merrill Lynch	28,070
(63,909)	Latam Airlines Group SA ADR	Morgan Stanley	(639)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(5,353)	Lattice Semiconductor Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,178
(79,460)	Laureate Education Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(37,346)
(33,918)	Laureate Education Inc 'A'	Morgan Stanley	(14,924)
(14,090)	Laureate Education Inc 'A'	Goldman Sachs	(6,396)
(771)	Lawson Products Inc/DE	Bank of America Merrill Lynch	131
(808)	Lawson Products Inc/DE	Goldman Sachs	137
(56,060)	LCI Industries	Bank of America Merrill Lynch	(77,363)
(7,104)	LCI Industries	Goldman Sachs	(16,787)
3,039	LCNB Corp	Goldman Sachs	-
28,677	LCNB Corp	Bank of America Merrill Lynch	-
16,775	LCNB Corp	Morgan Stanley	6,039
25,429	Leaf Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	509
9,669	Leaf Group Ltd	Goldman Sachs	193
2,956	Leaf Group Ltd	Morgan Stanley	266
(5,986)	Lear Corp	Goldman Sachs	(718)
(29,077)	Lear Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3,489)
(9,164)	Lear Corp	Morgan Stanley	13,105
14,397	Legg Mason Inc	Goldman Sachs	4,319
112,107	Legg Mason Inc	Bank of America Merrill Lynch	33,632
2,968	Legg Mason Inc	Morgan Stanley	979
(38,091)	Leggett & Platt Inc	Bank of America Merrill Lynch	(51,423)
(155,890)	Leggett & Platt Inc	Goldman Sachs	(153,853)
(43,105)	Leggett & Platt Inc	Morgan Stanley	(29,742)
(12,473)	Leidos Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	19,583
(11,599)	Leidos Holdings Inc	Goldman Sachs	6,658
(7,811)	Leidos Holdings Inc	Morgan Stanley	937
(10,838)	LeMaitre Vascular Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11,380)
(12,220)	LendingClub Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,322
(4,321)	LendingTree Inc	Goldman Sachs	(91,908)
(769)	LendingTree Inc	Morgan Stanley	(21,386)
(13,566)	Lennar Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(50,330)
(12,700)	Lennar Corp 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(25,908)
162	Lennox International Inc	Goldman Sachs	1,500
11,264	Lennox International Inc	Bank of America Merrill Lynch	104,305
(2,380)	Level One Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,285
(623)	Level One Bancorp Inc	Morgan Stanley	361
(1,748)	LGI Homes Inc	Goldman Sachs	(1,436)
(3,228)	LHC Group Inc	Goldman Sachs	(22,713)
(2,850)	LHC Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(25,593)
(11,382)	LHC Group Inc	Morgan Stanley	(104,373)
34,525	Libbey Inc	Bank of America Merrill Lynch	(17,263)
10,189	Libbey Inc	Goldman Sachs	(5,095)
17,564	Libbey Inc	Morgan Stanley	(12,646)
(6,836)	Liberty Broadband Corp 'A'	Goldman Sachs	(23,662)
(6,545)	Liberty Broadband Corp 'A'	Morgan Stanley	(42,346)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(55,063)	Liberty Broadband Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(173,999)
(41,687)	Liberty Broadband Corp 'C'	Bank of America Merrill Lynch	(111,304)
12,457	Liberty Expedia Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	2,242
5,713	Liberty Global Plc 'A'	Morgan Stanley	343
45,645	Liberty Global Plc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(7,760)
6,482	Liberty Latin America Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1,556
5,183	Liberty Latin America Ltd 'A'	Goldman Sachs	1,244
2,785	Liberty Latin America Ltd 'A'	Morgan Stanley	2,033
50,194	Liberty Latin America Ltd 'C'	Goldman Sachs	28,941
1,849	Liberty Latin America Ltd 'C'	Bank of America Merrill Lynch	1,035
69,294	Liberty Latin America Ltd 'C'	Morgan Stanley	67,215
10,371	Liberty Media Corp-Liberty Braves 'C'	Morgan Stanley	6,430
11,008	Liberty Media Corp-Liberty Braves 'C'	Bank of America Merrill Lynch	2,752
30,246	Liberty Media Corp-Liberty Braves 'C'	Goldman Sachs	7,562
(7,569)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'A'	Morgan Stanley	(7,342)
(2,263)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'A'	Goldman Sachs	2,987
4,875	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	Goldman Sachs	(8,921)
899	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	Bank of America Merrill Lynch	(1,645)
2,458	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'A'	Goldman Sachs	(1,721)
69,762	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(48,833)
1,971	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'A'	Morgan Stanley	3,016
71,836	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C'	Bank of America Merrill Lynch	(40,228)
65,875	Liberty Oilfield Services Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(124,504)
20,176	Liberty Oilfield Services Inc 'A'	Goldman Sachs	(38,133)
(28,855)	Liberty Property Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(41,840)
(7,969)	Liberty Tax Inc	Goldman Sachs	(18,329)
(21,019)	Liberty TripAdvisor Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(841)
(31,832)	Liberty TripAdvisor Holdings Inc 'A'	Morgan Stanley	(45,201)
(5,796)	Liberty TripAdvisor Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	(232)
14,064	Life Storage Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	17,158
7,328	Life Storage Inc (Reit)	Morgan Stanley	9,526
16,125	Life Storage Inc (Reit)	Goldman Sachs	21,077
(400)	Lifetime Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	(460)
(20,487)	Lifetime Brands Inc	Goldman Sachs	(22,056)
(56,479)	Lifevantage Corp	Morgan Stanley	(116,347)
(74,048)	Lilis Energy Inc	Morgan Stanley	6,822
(88,725)	Limelight Networks Inc	Bank of America Merrill Lynch	18,189
4,748	Limoneira Co	Morgan Stanley	(2,374)
105,568	Limoneira Co	Bank of America Merrill Lynch	(34,837)
17,305	Limoneira Co	Goldman Sachs	(5,711)
(1,018)	Lincoln Electric Holdings Inc	Morgan Stanley	(2,932)
(16,466)	Lincoln Electric Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(14,655)
4,083	Lincoln National Corp	Goldman Sachs	(4,410)



保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
38,209	Lincoln National Corp	Bank of America Merrill Lynch	(41,266)
97,791	Lincoln National Corp	Morgan Stanley	157,444
2,369	Lindblad Expeditions Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(711)
2,192	Lindblad Expeditions Holdings Inc	Goldman Sachs	(813)
(49,779)	Lindsay Corp	Bank of America Merrill Lynch	(117,478)
12,674	Lions Gate Entertainment Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(4,436)
36,495	Lions Gate Entertainment Corp 'A'	Goldman Sachs	(12,773)
14,571	Lions Gate Entertainment Corp 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(2,040)
33,857	Lions Gate Entertainment Corp 'B'	Goldman Sachs	(4,740)
64,568	Lions Gate Entertainment Corp 'B'	Morgan Stanley	71,025
(10,328)	Liquidia Technologies Inc	Goldman Sachs	6,848
(3,398)	Liquidity Services Inc	Goldman Sachs	340
1,104	Lithia Motors Inc 'A'	Goldman Sachs	(949)
20,589	Lithia Motors Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(17,707)
1,825	Lithia Motors Inc 'A'	Morgan Stanley	566
(7,179)	Littelfuse Inc	Goldman Sachs	(24,193)
(21,569)	Littelfuse Inc	Bank of America Merrill Lynch	(72,688)
(8,628)	Littelfuse Inc	Morgan Stanley	(72,648)
(47,117)	LivaNova Plc	Goldman Sachs	996,906
(883)	LivaNova Plc	Morgan Stanley	(247)
15,901	Live Nation Entertainment Inc	Bank of America Merrill Lynch	26,873
(47,647)	Live Oak Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	31,923
(9,296)	Live Oak Bancshares Inc	Goldman Sachs	6,228
36,431	Livent Corp	Goldman Sachs	51,872
26,006	Livent Corp	Morgan Stanley	55,913
15,756	LivePerson Inc	Morgan Stanley	14,023
40,441	LivePerson Inc	Bank of America Merrill Lynch	(44,890)
24,963	LivePerson Inc	Goldman Sachs	(27,709)
8,134	Livexlive Media Inc	Goldman Sachs	2,898
(111,633)	LKQ Corp	Goldman Sachs	(16,830)
(160,892)	LKQ Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4,827)
(12,140)	LKQ Corp	Morgan Stanley	(5,949)
(2,537)	Louisiana-Pacific Corp	Goldman Sachs	(450)
(183,450)	Louisiana-Pacific Corp	Bank of America Merrill Lynch	(14,676)
(45,089)	Lowe's Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	20,290
1,577	Loxo Oncology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(17,237)
(10,198)	LPL Financial Holdings Inc	Goldman Sachs	(12,914)
(4,957)	LPL Financial Holdings Inc	Morgan Stanley	(16,804)
(23,712)	LPL Financial Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(36,991)
(40,204)	LSB Industries Inc	Morgan Stanley	(6,835)
(6,207)	LSB Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,110)
(15,653)	LSB Industries Inc	Goldman Sachs	(5,322)
111,044	LSI Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,773)
91,421	LSI Industries Inc	Goldman Sachs	(6,399)
19,374	LSI Industries Inc	Morgan Stanley	6,587

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
6,740	Lululemon Athletica Inc	Goldman Sachs	2,220
10,935	Lululemon Athletica Inc	Bank of America Merrill Lynch	(85,621)
6,970	Lululemon Athletica Inc	Morgan Stanley	77,646
(53,942)	Lumber Liquidators Holdings Inc	Morgan Stanley	14,564
(9,631)	Lumentum Holdings Inc	Goldman Sachs	(30,269)
(4,915)	Lumentum Holdings Inc	Morgan Stanley	(19,365)
(11,518)	Luminex Corp	Morgan Stanley	(24,649)
(24,503)	Luminex Corp	Goldman Sachs	(64,732)
36,692	Luther Burbank Corp	Bank of America Merrill Lynch	22,749
27,564	Luther Burbank Corp	Goldman Sachs	17,090
8,886	Luther Burbank Corp	Morgan Stanley	6,665
(40,441)	Lydall Inc	Bank of America Merrill Lynch	61,875
(44,081)	LyondellBasell Industries NV 'A'	Goldman Sachs	13,169
(26,536)	LyondellBasell Industries NV 'A'	Morgan Stanley	(35,824)
(53,679)	M&T Bank Corp	Bank of America Merrill Lynch	(13,420)
260,545	M/I Homes Inc	Bank of America Merrill Lynch	442,927
32,182	M/I Homes Inc	Goldman Sachs	54,709
66,942	Macatawa Bank Corp	Bank of America Merrill Lynch	(18,744)
32,528	Macatawa Bank Corp	Goldman Sachs	(9,108)
46,302	Macatawa Bank Corp	Morgan Stanley	4,167
34,781	Macerich Co/The (Reit)	Morgan Stanley	51,476
(71,178)	Macerich Co/The (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(108,902)
(3,409)	Mack-Cali Realty Corp (Reit)	Goldman Sachs	(2,625)
(11,690)	Mack-Cali Realty Corp (Reit)	Morgan Stanley	(5,611)
(85,155)	Mack-Cali Realty Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(65,569)
4,794	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	Goldman Sachs	(1,246)
(45,768)	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	11,900
(39,451)	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	Goldman Sachs	10,257
(3,892)	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	Morgan Stanley	(1,284)
22,105	Macquarie Infrastructure Corp	Goldman Sachs	69,208
14,099	Macquarie Infrastructure Corp	Morgan Stanley	26,083
(12,862)	Macquarie Infrastructure Corp	Bank of America Merrill Lynch	(42,830)
1,548	MacroGenics Inc	Morgan Stanley	(62)
2,794	MacroGenics Inc	Goldman Sachs	(866)
630	Madison Square Garden Co/The 'A'	Goldman Sachs	7,493
(363)	Madrigal Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	7,314
(4,471)	Madrigal Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	90,091
(1,836)	Madrigal Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	1,506
46,926	Magnolia Oil & Gas Corp	Morgan Stanley	(10,324)
(962)	Majesco	Bank of America Merrill Lynch	366
14,613	MakeMyTrip Ltd	Goldman Sachs	25,326
10,800	MakeMyTrip Ltd	Morgan Stanley	22,171
8,858	Malibu Boats Inc 'A'	Goldman Sachs	(3,524)
23,638	Malibu Boats Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(21,747)
3,687	Malibu Boats Inc 'A'	Morgan Stanley	5,162

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
1,833	Mallinckrodt Plc	Goldman Sachs	(1,536)
22,351	Mallinckrodt Plc	Bank of America Merrill Lynch	(177,690)
28,718	Mallinckrodt Plc	Morgan Stanley	(81,392)
(28,969)	Mammoth Energy Services Inc	Morgan Stanley	(1,738)
(3,074)	Manitex International Inc	Goldman Sachs	(2,029)
(3,360)	ManpowerGroup Inc	Goldman Sachs	(2,789)
19,195	ManpowerGroup Inc	Bank of America Merrill Lynch	43,381
777	ManTech International Corp/VA 'A'	Goldman Sachs	1,146
17,155	ManTech International Corp/VA 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(8,921)
17,993	Marathon Oil Corp	Goldman Sachs	(17,093)
77,351	Marathon Oil Corp	Bank of America Merrill Lynch	(73,483)
55,275	Marathon Oil Corp	Morgan Stanley	30,401
(8,886)	Marathon Petroleum Corp	Bank of America Merrill Lynch	5,865
(30,528)	Marathon Petroleum Corp	Goldman Sachs	11,407
89,121	Marcus & Millichap Inc	Bank of America Merrill Lynch	(54,364)
43,572	Marcus & Millichap Inc	Goldman Sachs	(15,456)
2,336	Marcus & Millichap Inc	Morgan Stanley	(187)
91,251	Marcus Corp/The	Bank of America Merrill Lynch	10,038
3,192	Marin Software Inc	Bank of America Merrill Lynch	319
4,734	Marin Software Inc	Goldman Sachs	473
2,918	Marin Software Inc	Morgan Stanley	788
8,557	Marine Products Corp	Morgan Stanley	4,621
29,354	MarineMax Inc	Goldman Sachs	(89,530)
77,475	MarineMax Inc	Bank of America Merrill Lynch	(236,299)
(12,707)	Marinus Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(254)
(587)	Markel Corp	Goldman Sachs	(17,223)
(4,575)	Markel Corp	Morgan Stanley	(190,640)
2,429	MarketAxess Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	19,602
(22,663)	Marlin Business Services Corp	Morgan Stanley	27,649
(18,694)	Marlin Business Services Corp	Bank of America Merrill Lynch	19,442
(6,682)	Marriott International Inc/MD 'A'	Goldman Sachs	12,001
13,373	Marriott Vacations Worldwide Corp	Goldman Sachs	65,341
9,395	Marriott Vacations Worldwide Corp	Bank of America Merrill Lynch	47,163
20,235	Marriott Vacations Worldwide Corp	Morgan Stanley	91,058
(38,716)	Marsh & McLennan Cos Inc	Goldman Sachs	(12,389)
(64,623)	Marsh & McLennan Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	(20,679)
(49,600)	Marsh & McLennan Cos Inc	Morgan Stanley	(137,888)
134,949	Marten Transport Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(66,125)
4,982	Marten Transport Ltd	Goldman Sachs	(2,441)
2,729	Marten Transport Ltd	Morgan Stanley	846
3,484	Martin Marietta Materials Inc	Bank of America Merrill Lynch	22,820
(177,806)	Marvell Technology Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	394,729
59,630	Masimo Corp	Bank of America Merrill Lynch	129,993
(6,428)	Masonite International Corp	Morgan Stanley	(2,635)
(2,509)	Masonite International Corp	Goldman Sachs	(1,745)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
15,731	MasTec Inc	Bank of America Merrill Lynch	(20,293)
42,440	MasTec Inc	Goldman Sachs	24,400
23,517	Mastercard Inc 'A'	Goldman Sachs	(15,800)
34,967	Mastercard Inc 'A'	Morgan Stanley	455,476
36,393	MasterCraft Boat Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(62,596)
26,742	Matador Resources Co	Bank of America Merrill Lynch	(54,821)
2,181	Matador Resources Co	Morgan Stanley	720
8,545	Matador Resources Co	Goldman Sachs	(17,517)
1,447	Match Group Inc	Goldman Sachs	(241)
(11,298)	Match Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,373
1,324	Materion Corp	Bank of America Merrill Lynch	(5,349)
(4,197)	Matson Inc	Goldman Sachs	3,085
(1,788)	Matson Inc	Morgan Stanley	54
(51,358)	Mattel Inc	Goldman Sachs	-
(4,826)	Maui Land & Pineapple Co Inc	Goldman Sachs	(483)
(64,753)	Maui Land & Pineapple Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,475)
15,466	Maxar Technologies Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(35,881)
41,135	Maxim Integrated Products Inc	Bank of America Merrill Lynch	85,149
(69,830)	Maximus Inc	Bank of America Merrill Lynch	(261,863)
13,333	MaxLinear Inc	Goldman Sachs	6,495
(16,187)	MaxLinear Inc	Morgan Stanley	(20,557)
(35,778)	MBIA Inc	Bank of America Merrill Lynch	(13,059)
(60,983)	MBIA Inc	Morgan Stanley	(5,184)
(73,878)	MBIA Inc	Goldman Sachs	(26,965)
1,804	MBT Financial Corp	Morgan Stanley	415
69,608	MBT Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	11,833
9,754	McCormick & Co Inc/MD	Goldman Sachs	29,385
27,386	McCormick & Co Inc/MD	Bank of America Merrill Lynch	23,552
18,576	McCormick & Co Inc/MD	Morgan Stanley	80,167
(90,540)	McDermott International Inc	Goldman Sachs	3,999
(15,673)	McDermott International Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,135
(29,637)	McDermott International Inc	Morgan Stanley	(18,375)
(24,254)	McDonald's Corp	Goldman Sachs	(114,236)
4,161	McDonald's Corp	Bank of America Merrill Lynch	19,598
134,126	McGrath RentCorp	Bank of America Merrill Lynch	76,452
4,200	McKesson Corp	Goldman Sachs	(5,544)
29,677	McKesson Corp	Bank of America Merrill Lynch	(39,174)
9,826	McKesson Corp	Morgan Stanley	49,032
114,174	MDC Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	202,088
23,713	MDC Holdings Inc	Goldman Sachs	41,972
16,499	MDC Partners Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1,788
19,342	MDC Partners Inc 'A'	Morgan Stanley	3,868
2,297	MDU Resources Group Inc	Goldman Sachs	1,280
(21,166)	MDU Resources Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	847
1,323	MDU Resources Group Inc	Morgan Stanley	529

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
1,432	MedCath Corp*,**	Morgan Stanley	-
1,716	Media General Inc*	Bank of America Merrill Lynch	(283)
1,127	Media General Inc*	Morgan Stanley	152
(184,703)	Medical Properties Trust Inc (Reit)	Morgan Stanley	(138,527)
(860)	Medidata Solutions Inc	Goldman Sachs	(5,581)
52,788	Medidata Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	342,594
(2,789)	Medidata Solutions Inc	Morgan Stanley	(13,025)
(3,695)	Medifast Inc	Morgan Stanley	(3,030)
(12,465)	Medifast Inc	Bank of America Merrill Lynch	146,090
4,563	Medley Management Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,916)
6,005	MEDNAX Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,042
3,450	MEDNAX Inc	Morgan Stanley	2,553
(3,642)	Medpace Holdings Inc	Goldman Sachs	(23,918)
29,658	Medpace Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	169,940
(1,969)	Medpace Holdings Inc	Morgan Stanley	(12,641)
3,747	Medpace Holdings Inc	Goldman Sachs	28,712
117,557	Meet Group Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	15,282
38,010	Meet Group Inc/The	Goldman Sachs	4,941
28,103	Meet Group Inc/The	Morgan Stanley	1,405
(14,034)	MEI Pharma Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,666
19,372	Mellanox Technologies Ltd	Morgan Stanley	51,336
33,244	Menlo Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(27,260)
27,931	Menlo Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(22,903)
(1,798)	MercadoLibre Inc	Goldman Sachs	(43,414)
(2,068)	MercadoLibre Inc	Bank of America Merrill Lynch	(34,825)
(388)	MercadoLibre Inc	Morgan Stanley	(18,543)
155,188	Mercantile Bank Corp	Bank of America Merrill Lynch	(114,839)
24,739	Mercantile Bank Corp	Goldman Sachs	(18,307)
24,288	Mercantile Bank Corp	Morgan Stanley	2,429
(21,617)	Merchants Bancorp/IN	Bank of America Merrill Lynch	25,940
(5,021)	Merchants Bancorp/IN	Goldman Sachs	6,025
54,312	Merck & Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	198,673
(4,824)	Mercury General Corp	Goldman Sachs	14,424
(6,462)	Mercury General Corp	Morgan Stanley	1,616
3,723	Mercury General Corp	Goldman Sachs	(4,783)
(2,913)	Mercury Systems Inc	Goldman Sachs	(7,806)
(24,211)	Mercury Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(13,558)
(20,412)	Mercury Systems Inc	Morgan Stanley	(60,215)
(61,122)	Meredith Corp	Goldman Sachs	(26,975)
(10,108)	Meredith Corp	Morgan Stanley	(34,974)
37,650	Meridian Bancorp Inc	Morgan Stanley	6,401
226,892	Meridian Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	63,530
105,324	Meridian Bancorp Inc	Goldman Sachs	29,491
(141,516)	Meridian Bioscience Inc	Bank of America Merrill Lynch	63,682
2,386	Merit Medical Systems Inc	Morgan Stanley	10,069

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
164	Merit Medical Systems Inc	Goldman Sachs	630
43,459	Merit Medical Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	166,883
6,632	Meritage Homes Corp	Goldman Sachs	13,994
84,087	Meritage Homes Corp	Bank of America Merrill Lynch	177,424
25,196	Meritor Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,275
18,636	Meritor Inc	Morgan Stanley	8,386
7,843	Mersana Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(314)
18,400	Mersana Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(22,264)
13,039	Mersana Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(15,777)
(1,413)	Mesa Laboratories Inc	Morgan Stanley	(27,144)
(2,235)	Mesa Laboratories Inc	Goldman Sachs	(52,724)
(5,439)	Mesa Laboratories Inc	Bank of America Merrill Lynch	(128,306)
(117,177)	Meta Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	228,495
(85,285)	Methode Electronics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,676)
(116,212)	MetLife Inc	Bank of America Merrill Lynch	40,674
23,016	MetLife Inc	Morgan Stanley	37,976
(510)	Mettler-Toledo International Inc	Goldman Sachs	(20,951)
(381)	Mettler-Toledo International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(15,651)
(2,015)	Mettler-Toledo International Inc	Morgan Stanley	(74,757)
114,405	MFA Financial Inc (Reit)	Goldman Sachs	17,694
195,914	MFA Financial Inc (Reit)	Morgan Stanley	32,326
(9,211)	MFA Financial Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(1,428)
(58,493)	MGE Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(107,042)
(27,257)	MGIC Investment Corp	Bank of America Merrill Lynch	10,903
(42,446)	MGIC Investment Corp	Morgan Stanley	(10,612)
105,986	MGIC Investment Corp	Bank of America Merrill Lynch	(42,394)
1,961	MGM Growth Properties LLC 'A' (Reit)	Goldman Sachs	924
78,887	MGM Growth Properties LLC 'A' (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	97,820
13,786	MGM Growth Properties LLC 'A' (Reit)	Morgan Stanley	6,513
(63,016)	MGM Resorts International	Bank of America Merrill Lynch	(40,330)
(94,218)	MGM Resorts International	Morgan Stanley	(115,888)
(2,568)	MGP Ingredients Inc	Morgan Stanley	(103)
964	MGP Ingredients Inc	Morgan Stanley	39
26,559	Michael Kors Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(75,162)
(61,978)	Michaels Cos Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	27,270
(50,963)	Microchip Technology Inc	Goldman Sachs	59,117
(6,609)	Micron Technology Inc	Goldman Sachs	(3,597)
(24,370)	Micron Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	66,774
(64,415)	Microsoft Corp	Goldman Sachs	(199,474)
1,275	Microsoft Corp	Bank of America Merrill Lynch	3,379
(6,138)	Microsoft Corp	Morgan Stanley	(42,107)
65,721	MicroStrategy Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	86,095
12,286	Mid-America Apartment Communities Inc (Reit)	Goldman Sachs	49,758
(4,167)	Mid-America Apartment Communities Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(16,876)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
35,417	Mid-America Apartment Communities Inc (Reit)	Morgan Stanley	78,015
160	Mid-America Apartment Communities Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	409
(14,201)	Middleby Corp/The	Bank of America Merrill Lynch	(18,603)
(134,870)	Middlesex Water Co	Bank of America Merrill Lynch	(205,002)
(49,466)	Midland States Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	35,121
(22,682)	MidSouth Bancorp Inc	Morgan Stanley	(10,207)
(32,219)	MidSouth Bancorp Inc	Goldman Sachs	(6,766)
(245,274)	MidSouth Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(51,508)
11,003	Midstates Petroleum Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,081)
7,196	Midstates Petroleum Co Inc	Goldman Sachs	(2,015)
11,363	Midstates Petroleum Co Inc	Morgan Stanley	(2,727)
59,486	Miller Industries Inc/TN	Bank of America Merrill Lynch	74,358
6,186	Miller Industries Inc/TN	Goldman Sachs	7,733
24,865	Miller Industries Inc/TN	Morgan Stanley	4,724
(4,257)	Mimecast Ltd	Goldman Sachs	(6,919)
(16,438)	MINDBODY Inc 'A'	Morgan Stanley	(38,958)
(43,543)	MINDBODY Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(74,023)
(18,703)	Minerals Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	35,349
(139,775)	Minerva Neurosciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	71,285
(12,193)	Minerva Neurosciences Inc	Goldman Sachs	6,218
52,854	Miragen Therapeutics Inc	Goldman Sachs	4,396
12,920	Miragen Therapeutics Inc	Morgan Stanley	1,163
16,950	Miragen Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,695
(10,471)	Mirati Therapeutics Inc	Morgan Stanley	32,565
(1,730)	Misonix Inc	Goldman Sachs	(1,124)
(18,386)	Misonix Inc	Morgan Stanley	3,493
119,134	Mistras Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,148)
8,560	Mistras Group Inc	Goldman Sachs	(514)
6,258	Mistras Group Inc	Morgan Stanley	501
(6,075)	Mitek Systems Inc	Goldman Sachs	911
(1,177)	MKS Instruments Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,849)
51,970	Mobile Mini Inc	Bank of America Merrill Lynch	(22,867)
43,437	MobileIron Inc	Morgan Stanley	13,900
55,864	MobileIron Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,235)
55,468	MobileIron Inc	Goldman Sachs	(2,219)
167,834	Model N Inc	Bank of America Merrill Lynch	(15,105)
21,246	Model N Inc	Goldman Sachs	(1,912)
10,702	Modine Manufacturing Co	Goldman Sachs	(8,776)
128,617	Modine Manufacturing Co	Bank of America Merrill Lynch	(105,466)
20,446	Moelis & Co 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(30,056)
50,755	Moelis & Co 'A'	Goldman Sachs	(74,610)
2,132	Moelis & Co 'A'	Morgan Stanley	362
(28,882)	Mohawk Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(94,444)
24,555	Molecular Templates Inc	Goldman Sachs	407

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(640)	Molina Healthcare Inc	Goldman Sachs	(9,504)
(8,722)	Molina Healthcare Inc	Bank of America Merrill Lynch	(129,522)
(3,738)	Molina Healthcare Inc	Morgan Stanley	(45,678)
40,135	Molson Coors Brewing Co 'B'	Bank of America Merrill Lynch	20,870
(125,291)	Mondelez International Inc 'A'	Goldman Sachs	(63,285)
(155,912)	Mondelez International Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(81,074)
(97,056)	Mondelez International Inc 'A'	Morgan Stanley	(65,028)
(19,579)	MoneyGram International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(979)
(6,378)	MoneyGram International Inc	Morgan Stanley	(765)
(2,069)	MongoDB Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10,883)
(3,120)	MongoDB Inc	Morgan Stanley	(26,146)
(16,715)	Monolithic Power Systems Inc	Morgan Stanley	(72,627)
(30,643)	Monolithic Power Systems Inc	Goldman Sachs	(49,174)
(19,842)	Monotype Imaging Holdings Inc	Goldman Sachs	12,226
(16,781)	Monotype Imaging Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	13,425
(5,702)	Monro Inc	Morgan Stanley	(8,667)
(35,391)	Monro Inc	Goldman Sachs	(102,988)
53,639	Monster Beverage Corp	Morgan Stanley	109,424
23,401	Monster Beverage Corp	Bank of America Merrill Lynch	95,008
1,085	Monster Beverage Corp	Goldman Sachs	4,405
(1,883)	Moody's Corp	Bank of America Merrill Lynch	(19,583)
(31,488)	Moog Inc 'A'	Morgan Stanley	(116,820)
4,029	Moog Inc 'A'	Goldman Sachs	564
43,106	Morgan Stanley	Goldman Sachs	(8,502)
193,947	Morgan Stanley	Bank of America Merrill Lynch	(34,910)
8,437	Morningstar Inc	Bank of America Merrill Lynch	(24,299)
2,569	Morningstar Inc	Morgan Stanley	6,449
5,733	Morningstar Inc	Goldman Sachs	(6,768)
4,996	Motorola Solutions Inc	Goldman Sachs	9,392
43,800	Motorola Solutions Inc	Morgan Stanley	303,096
22,671	Motorola Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	42,621
(6,632)	Mr Cooper Group Inc	Goldman Sachs	531
(2,807)	Mr Cooper Group Inc	Morgan Stanley	(1,825)
58,544	MRC Global Inc	Morgan Stanley	45,079
(3,219)	MSA Safety Inc	Goldman Sachs	6,728
(5,260)	MSA Safety Inc	Bank of America Merrill Lynch	10,993
(25,541)	MSA Safety Inc	Morgan Stanley	(33,459)
(39,547)	MSC Industrial Direct Co Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	107,568
(1,129)	MSCI Inc	Goldman Sachs	(6,458)
(21,335)	MSCI Inc	Bank of America Merrill Lynch	(122,036)
(1,465)	MSCI Inc	Morgan Stanley	(11,061)
91,684	MSG Networks Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	172,366
62,071	MSG Networks Inc 'A'	Goldman Sachs	116,693
20,542	MSG Networks Inc 'A'	Morgan Stanley	25,267
(54,093)	MTS Systems Corp	Bank of America Merrill Lynch	6,491



保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(67,953)	Mueller Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	108,045
(64,371)	Multi-Color Corp	Bank of America Merrill Lynch	52,141
514	Murphy Oil Corp	Morgan Stanley	740
3,091	Murphy Oil Corp	Goldman Sachs	(1,391)
(7,063)	Murphy USA Inc	Bank of America Merrill Lynch	(13,349)
2,484	Murphy USA Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,695
(1,485)	Murphy USA Inc	Goldman Sachs	(2,807)
(119,525)	Myers Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9,562)
(57,764)	Mylan NV	Goldman Sachs	67,991
(1,000)	MyoKardia Inc	Goldman Sachs	(5,230)
(7,264)	MyoKardia Inc	Bank of America Merrill Lynch	(37,991)
(10,129)	MyoKardia Inc	Morgan Stanley	(48,720)
14,723	MYR Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	5,153
5,275	MYR Group Inc	Goldman Sachs	1,846
9,023	MYR Group Inc	Morgan Stanley	6,406
(12,168)	Myriad Genetics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(31,393)
(7,179)	Myriad Genetics Inc	Goldman Sachs	(17,568)
380,299	Nabors Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(501,995)
(2,358)	NACCO Industries Inc 'A'	Goldman Sachs	(2,995)
(6,113)	NACCO Industries Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(7,764)
82,558	Nanometrics Inc	Bank of America Merrill Lynch	16,512
2,520	Nanometrics Inc	Goldman Sachs	504
2,605	Nanometrics Inc	Morgan Stanley	2,657
20,222	NanoString Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	15,975
35,477	NanoString Technologies Inc	Goldman Sachs	28,027
(7,713)	Napco Security Technologies Inc	Goldman Sachs	5,476
(56,419)	Napco Security Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	40,057
(50,675)	Nasdaq Inc	Bank of America Merrill Lynch	(110,978)
27,263	Natera Inc	Bank of America Merrill Lynch	27,536
(45,544)	National Bankshares Inc	Morgan Stanley	61,940
3,323	National Beverage Corp	Goldman Sachs	(9,200)
6,964	National Beverage Corp	Morgan Stanley	(30,041)
1,199	National Beverage Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,782)
(8,324)	National Fuel Gas Co	Goldman Sachs	(10,155)
(64,273)	National Fuel Gas Co	Bank of America Merrill Lynch	(78,413)
(18,546)	National Fuel Gas Co	Morgan Stanley	8,902
3,870	National General Holdings Corp	Goldman Sachs	3,403
(191,037)	National Health Investors Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(511,979)
10,729	National HealthCare Corp	Bank of America Merrill Lynch	46,564
5,459	National HealthCare Corp	Goldman Sachs	23,692
1,537	National HealthCare Corp	Morgan Stanley	4,058
3,451	National Instruments Corp	Goldman Sachs	6,213
90,594	National Instruments Corp	Bank of America Merrill Lynch	(60,698)
(51,516)	National Oilwell Varco Inc	Bank of America Merrill Lynch	60,274
(2,209)	National Presto Industries Inc	Goldman Sachs	685

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
9,676	National Research Corp	Goldman Sachs	3,774
17,852	National Research Corp	Morgan Stanley	3,035
6,933	National Research Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,704
12,811	National Retail Properties Inc (Reit)	Goldman Sachs	21,266
100,803	National Retail Properties Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	167,333
19,452	National Storage Affiliates Trust (Reit)	Morgan Stanley	10,699
159,533	National Storage Affiliates Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	36,693
21,965	National Storage Affiliates Trust (Reit)	Goldman Sachs	4,841
(18,778)	National Vision Holdings Inc	Goldman Sachs	53,893
(26,044)	National Vision Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	74,746
(35,045)	National Vision Holdings Inc	Morgan Stanley	(12,266)
(7,171)	Natural Gas Services Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	8,677
30,991	Natural Grocers by Vitamin Cottage Inc	Bank of America Merrill Lynch	121,175
19,357	Natural Grocers by Vitamin Cottage Inc	Goldman Sachs	75,686
11,560	Natural Health Trends Corp	Goldman Sachs	(6,127)
2,829	Natural Health Trends Corp	Morgan Stanley	(396)
6,581	Natural Health Trends Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3,488)
(75,480)	Nature 's Sunshine Products Inc	Bank of America Merrill Lynch	755
(9,741)	Nature 's Sunshine Products Inc	Morgan Stanley	(1,266)
(86,856)	Natus Medical Inc	Bank of America Merrill Lynch	(320,499)
(16,453)	Natus Medical Inc	Morgan Stanley	(29,615)
(189,390)	Navient Corp	Bank of America Merrill Lynch	234,844
(222,087)	Navigant Consulting Inc	Bank of America Merrill Lynch	(366,444)
(18,960)	Navistar International Corp	Bank of America Merrill Lynch	(7,774)
35,687	NCI Building Systems Inc	Goldman Sachs	(38,899)
68,446	NCI Building Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(74,606)
20,383	NCI Building Systems Inc	Morgan Stanley	2,038
(90,259)	NCR Corp	Bank of America Merrill Lynch	(94,772)
(6,058)	NCR Corp	Morgan Stanley	(11,026)
(19,611)	Neenah Inc	Bank of America Merrill Lynch	103,938
(11,641)	Neenah Inc	Morgan Stanley	(11,990)
(21,130)	Neenah Inc	Goldman Sachs	107,461
(56,050)	Nelnet Inc ' A '	Bank of America Merrill Lynch	(41,477)
(2,602)	Neogen Corp	Goldman Sachs	(5,022)
(29,890)	Neogen Corp	Bank of America Merrill Lynch	(57,688)
(8,262)	Neogen Corp	Morgan Stanley	(30,817)
43,156	NeoGenomics Inc	Bank of America Merrill Lynch	38,840
10,233	Neon Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(1,170)
(2,348)	NETGEAR Inc	Goldman Sachs	(2,010)
(107,537)	NetScout Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10,754)
(4,278)	NetScout Systems Inc	Morgan Stanley	(4,535)
(4,493)	Nevro Corp	Morgan Stanley	(369)
37,215	Nevro Corp	Bank of America Merrill Lynch	58,800
(8,566)	New Home Co Inc/The	Goldman Sachs	167
(6,877)	New Home Co Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	(413)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(577)	New Jersey Resources Corp	Goldman Sachs	589
(19,258)	New Jersey Resources Corp	Morgan Stanley	7,318
12,980	New Jersey Resources Corp	Goldman Sachs	(21,820)
2,503	New Jersey Resources Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,553)
46,789	New Relic Inc	Bank of America Merrill Lynch	73,459
9,318	New Relic Inc	Goldman Sachs	14,629
27,078	New Residential Investment Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(1,625)
15,259	New Residential Investment Corp (Reit)	Goldman Sachs	(916)
7,355	New Senior Investment Group Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	221
(279,595)	New York Community Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(345,964)
(392,642)	New York Mortgage Trust Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(58,896)
(76,367)	New York Mortgage Trust Inc (Reit)	Morgan Stanley	(11,455)
706	New York Times Co/The 'A'	Goldman Sachs	438
(192,036)	New York Times Co/The 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(119,062)
4,715	New York Times Co/The 'A'	Morgan Stanley	5,988
(35,420)	Newell Brands Inc	Goldman Sachs	(68,176)
(44,131)	Newell Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	(116,065)
73,488	NewLink Genetics Corp	Bank of America Merrill Lynch	(8,084)
528	NewMarket Corp	Bank of America Merrill Lynch	3,675
(10,898)	NewMarket Corp	Morgan Stanley	(86,857)
150,028	Newmont Mining Corp	Bank of America Merrill Lynch	(145,527)
(43,915)	News Corp 'A'	Goldman Sachs	20,201
(7,145)	News Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	3,287
(31,100)	News Corp 'B'	Bank of America Merrill Lynch	10,885
58,902	Nexa Resources SA	Morgan Stanley	(589)
104,245	Nexa Resources SA	Goldman Sachs	(5,212)
9,611	Nexstar Media Group Inc 'A'	Goldman Sachs	2,499
960	Nexstar Media Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	250
(20,709)	Nexstar Media Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(5,384)
(10,588)	NextEra Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,341
(3,491)	NextEra Energy Inc	Goldman Sachs	1,431
136,286	NIC Inc	Goldman Sachs	(56,708)
52,797	NIC Inc	Bank of America Merrill Lynch	(23,231)
6,049	NIC Inc	Morgan Stanley	665
30,087	Nicholas Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(32,193)
(55,603)	Nielsen Holdings Plc	Goldman Sachs	(81,180)
(104,104)	NII Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	7,808
42,726	Nike Inc 'B'	Goldman Sachs	62,737
27,883	Nike Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	12,547
34,434	Nike Inc 'B'	Morgan Stanley	113,288
3,890	Nine Energy Service Inc	Goldman Sachs	(8,364)
9,324	Nine Energy Service Inc	Bank of America Merrill Lynch	(20,047)
(200,291)	NiSource Inc	Bank of America Merrill Lynch	(136,198)
(101,934)	NiSource Inc	Morgan Stanley	(32,619)
(165,813)	NiSource Inc	Goldman Sachs	(112,753)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(25,535)	NL Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	13,534
(8,386)	NL Industries Inc	Goldman Sachs	4,445
(8,687)	nLight Inc	Bank of America Merrill Lynch	17,548
(1,667)	nLight Inc	Goldman Sachs	3,367
(43,369)	NMI Holdings Inc 'A'	Morgan Stanley	(27,322)
(111,428)	NN Inc	Bank of America Merrill Lynch	31,200
(50,503)	NN Inc	Goldman Sachs	(401)
9,797	Noble Corp plc	Bank of America Merrill Lynch	(1,568)
5,405	Noble Corp plc	Morgan Stanley	432
13,981	Noble Corp plc	Goldman Sachs	(2,237)
9,879	Noble Energy Inc	Goldman Sachs	(17,585)
5,133	Noble Energy Inc	Morgan Stanley	(103)
9,937	Noble Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(17,688)
29,371	Nomad Foods Ltd	Morgan Stanley	(4,699)
(21,715)	Noodles & Co	Morgan Stanley	21,064
199,617	Nordic American Tankers Ltd	Bank of America Merrill Lynch	19,962
91,285	Nordic American Tankers Ltd	Goldman Sachs	9,129
(24,825)	Nordson Corp	Bank of America Merrill Lynch	235,093
(17,513)	Nordson Corp	Morgan Stanley	95,621
15,564	Nordstrom Inc	Goldman Sachs	(91,672)
11,489	Nordstrom Inc	Morgan Stanley	17,923
24,722	Nordstrom Inc	Bank of America Merrill Lynch	(145,613)
3,832	Norfolk Southern Corp	Goldman Sachs	(4,162)
25,399	Norfolk Southern Corp	Bank of America Merrill Lynch	(59,688)
16,813	Norfolk Southern Corp	Morgan Stanley	111,470
(76,101)	Northeast Bancorp	Goldman Sachs	23,591
(98,746)	Northeast Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	30,611
(31,537)	Northern Oil and Gas Inc	Goldman Sachs	1,820
(24,281)	Northern Oil and Gas Inc	Bank of America Merrill Lynch	6,799
(281)	Northern Technologies International Corp	Morgan Stanley	(643)
7,588	Northern Trust Corp	Goldman Sachs	8,765
(48,479)	Northern Trust Corp	Bank of America Merrill Lynch	(11,393)
3,218	Northern Trust Corp	Morgan Stanley	4,521
(234,544)	Northfield Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(14,073)
(25,717)	Northrim BanCorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	14,916
(267,687)	NorthStar Realty Europe Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	32,122
(910,269)	Northwest Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	(227,567)
(3,461)	Northwest Natural Holding Co	Goldman Sachs	7,599
(89,151)	Northwest Natural Holding Co	Bank of America Merrill Lynch	241,599
(41,392)	Northwest Natural Holding Co	Morgan Stanley	52,154
(24,172)	Northwest Pipe Co	Bank of America Merrill Lynch	16,195
(5,441)	NorthWestern Corp	Morgan Stanley	(1,850)
(6,764)	NorthWestern Corp	Goldman Sachs	621
14,008	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	Goldman Sachs	11,487
43,803	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	35,918

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
29,727	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	Morgan Stanley	15,458
(356)	Norwood Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	516
(315)	Norwood Financial Corp	Morgan Stanley	(16)
(408)	Novocure Ltd	Goldman Sachs	(1,212)
(5,249)	Novocure Ltd	Morgan Stanley	(24,145)
(33,421)	NOW Inc	Bank of America Merrill Lynch	26,737
(10,502)	NRG Energy Inc	Goldman Sachs	3,151
(19,206)	NRG Energy Inc	Morgan Stanley	(8,835)
(74,823)	Nuance Communications Inc	Bank of America Merrill Lynch	49,383
2,986	Nuance Communications Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,725)
3,900	Nuance Communications Inc	Morgan Stanley	(507)
(5,658)	Nucor Corp	Bank of America Merrill Lynch	15,786
(5,056)	Nucor Corp	Goldman Sachs	14,106
6,993	Nutanix Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	19,580
1,869	NuVasive Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,803
1,071	NuVasive Inc	Morgan Stanley	(311)
(6,250)	NuVasive Inc	Bank of America Merrill Lynch	(16,063)
(2,544)	NuVasive Inc	Morgan Stanley	738
(14,591)	Nuvectra Corp	Bank of America Merrill Lynch	(17,217)
(24,419)	NVE Corp	Bank of America Merrill Lynch	(283,260)
(17,193)	nVent Electric Plc	Goldman Sachs	(1,633)
3,842	NVIDIA Corp	Goldman Sachs	37,182
3,962	NVIDIA Corp	Bank of America Merrill Lynch	(173,773)
4,855	NVIDIA Corp	Morgan Stanley	65,688
(137)	NVR Inc	Bank of America Merrill Lynch	(15,756)
(173)	NVR Inc	Goldman Sachs	(19,897)
56,350	Nymox Pharmaceutical Corp	Morgan Stanley	2,254
133,116	Nymox Pharmaceutical Corp	Bank of America Merrill Lynch	(10,649)
37,662	Nymox Pharmaceutical Corp	Goldman Sachs	(3,013)
705	Oak Valley Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	1,551
3,770	Oak Valley Bancorp	Goldman Sachs	8,294
400	Oak Valley Bancorp	Morgan Stanley	480
42,368	Oasis Midstream Partners LP	Bank of America Merrill Lynch	(16,947)
38,661	Oasis Midstream Partners LP	Goldman Sachs	(15,464)
42,210	Oasis Petroleum Inc	Bank of America Merrill Lynch	(59,516)
(33,726)	Oasis Petroleum Inc	Goldman Sachs	9,932
2,439	Occidental Petroleum Corp	Bank of America Merrill Lynch	(7,341)
(640,603)	OceanFirst Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(140,933)
(12,578)	Ocular Therapeutix Inc	Goldman Sachs	(15,848)
(50,599)	Ocular Therapeutix Inc	Morgan Stanley	(46,551)
(223,712)	Ocwen Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	110,737
(207,278)	Ocwen Financial Corp	Morgan Stanley	34,201
1,711	Odonate Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(342)
1,948	Odonate Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(390)
(18,879)	Office Depot Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,304)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(155,676)	Office Depot Inc	Morgan Stanley	(31,914)
(32,365)	Office Depot Inc	Goldman Sachs	(5,664)
7,136	OFG Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	(6,422)
15,345	OFG Bancorp	Morgan Stanley	(2,455)
3,819	OGE Energy Corp	Goldman Sachs	(955)
1,136	OGE Energy Corp	Morgan Stanley	136
64,680	OGE Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	(16,170)
(6,765)	Ohio Valley Banc Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,435)
(2,605)	Ohio Valley Banc Corp	Goldman Sachs	(938)
(25,367)	Ohio Valley Banc Corp	Morgan Stanley	(12,937)
(38,731)	Oil States International Inc	Bank of America Merrill Lynch	18,978
(11,136)	Oil States International Inc	Goldman Sachs	2,507
1,044	Oil-Dri Corp of America	Bank of America Merrill Lynch	(1,409)
2,486	Oil-Dri Corp of America	Goldman Sachs	(3,356)
(6,291)	Okta Inc	Bank of America Merrill Lynch	(35,670)
(16,713)	Okta Inc	Morgan Stanley	(194,539)
(5,145)	Old Dominion Freight Line Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,505)
(1,458)	Old Dominion Freight Line Inc	Morgan Stanley	(11,810)
(15,995)	Old National Bancorp/IN	Goldman Sachs	(6,078)
(19,488)	Old National Bancorp/IN	Bank of America Merrill Lynch	(7,405)
(27,438)	Old National Bancorp/IN	Morgan Stanley	(10,152)
(150,920)	Old Republic International Corp	Bank of America Merrill Lynch	(18,110)
79,527	Olin Corp	Bank of America Merrill Lynch	22,268
(63,939)	Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,755)
(9,008)	Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc	Morgan Stanley	(48,733)
(437)	Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc	Goldman Sachs	(39)
5,425	Olympic Steel Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,689)
7,664	Olympic Steel Inc	Goldman Sachs	(5,212)
1,047	Olympic Steel Inc	Morgan Stanley	953
1,040	Omega Flex Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,314)
1,417	Omega Flex Inc	Goldman Sachs	(7,241)
2,564	Omega Flex Inc	Morgan Stanley	(3,026)
(2,047)	Omega Healthcare Investors Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(6,714)
(76,299)	Omega Healthcare Investors Inc (Reit)	Goldman Sachs	(250,261)
(1)	Omeros Corp	Morgan Stanley	1
30,498	Omniceil Inc	Bank of America Merrill Lynch	172,314
12,395	Omniceil Inc	Goldman Sachs	70,032
(3,174)	Omnicom Group Inc	Goldman Sachs	(864)
(28,065)	Omnicom Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(15,716)
5,743	OMNOVA Solutions Inc	Goldman Sachs	(65)
9,071	ON Semiconductor Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,993
2,904	ON Semiconductor Corp	Goldman Sachs	958
(16,948)	ONE Gas Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,390)
(5,523)	ONE Gas Inc	Goldman Sachs	840
19,431	One Liberty Properties Inc (Reit)	Morgan Stanley	11,076

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
79,346	One Liberty Properties Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	4,761
22,035	One Liberty Properties Inc (Reit)	Goldman Sachs	1,322
35,941	OneMain Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(25,878)
(175,558)	OneSpan Inc	Bank of America Merrill Lynch	70,223
(1,495)	OneSpan Inc	Goldman Sachs	143
95,335	Ooma Inc	Bank of America Merrill Lynch	111,542
54,716	Ooma Inc	Goldman Sachs	64,018
19,393	Ooma Inc	Morgan Stanley	28,120
(40,562)	OPKO Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,056)
17,135	OPKO Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,714
22,507	OPKO Health Inc	Goldman Sachs	2,251
9,213	OPKO Health Inc	Morgan Stanley	1,750
(843)	Oppenheimer Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	1,256
(3,495)	OptimizeRx Corp	Morgan Stanley	(5,942)
(37,532)	Opus Bank	Bank of America Merrill Lynch	(52,920)
(261,135)	ORBCOMM Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,917)
21,325	Orbotech Ltd	Goldman Sachs	83,168
11,294	Orbotech Ltd	Morgan Stanley	30,720
(4,563)	Orchid Island Capital Inc (Reit)	Morgan Stanley	(205)
(13,473)	Orchid Island Capital Inc (Reit)	Goldman Sachs	(1,684)
(959)	Origin Bancorp Inc	Goldman Sachs	336
(12,364)	Orion Group Holdings Inc	Goldman Sachs	252
(349,774)	Oritani Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(87,444)
(26,172)	Oritani Financial Corp	Goldman Sachs	(6,506)
(175,572)	Ormat Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(693,509)
(42,697)	Ormat Technologies Inc	Morgan Stanley	(125,529)
1,536	Orrstown Financial Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,567)
3,934	Orrstown Financial Services Inc	Goldman Sachs	(4,013)
1,052	Orrstown Financial Services Inc	Morgan Stanley	368
(75,852)	Orthofix Medical Inc	Bank of America Merrill Lynch	(75,852)
2,066	Oshkosh Corp	Goldman Sachs	4,442
95,394	Oshkosh Corp	Morgan Stanley	214,637
29,199	Oshkosh Corp	Bank of America Merrill Lynch	62,778
6,945	OSI Systems Inc	Goldman Sachs	(18,335)
101,599	OSI Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(268,221)
65,643	Otonomy Inc	Goldman Sachs	(1,969)
52,323	Otonomy Inc	Morgan Stanley	(6,279)
87,702	Otonomy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,631)
54,090	Outfront Media Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	1,623
(50,228)	Overseas Shipholding Group 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,292)
8,116	Overstock.com Inc	Goldman Sachs	7,251
16,131	Ovid therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,388)
6,788	Ovid therapeutics Inc	Goldman Sachs	(3,530)
9,914	Ovid therapeutics Inc	Morgan Stanley	(2,379)
11,906	Owens & Minor Inc	Morgan Stanley	(10,239)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(53,268)	Owens Realty Mortgage Inc (Reit)	Morgan Stanley	(9,588)
(20,003)	Owens Realty Mortgage Inc (Reit)	Goldman Sachs	(7,801)
(59,057)	Owens Realty Mortgage Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(23,032)
(65,732)	Owens-Illinois Inc	Bank of America Merrill Lynch	(21,692)
28,785	Oxford Immunotec Global Plc	Bank of America Merrill Lynch	2,015
3,367	Oxford Immunotec Global Plc	Goldman Sachs	236
(9,282)	Oxford Industries Inc	Goldman Sachs	70,450
(27,323)	Oxford Industries Inc	Morgan Stanley	(34,427)
80,550	PACCAR Inc	Bank of America Merrill Lynch	73,301
7,052	PACCAR Inc	Goldman Sachs	6,417
217,425	Pacific Ethanol Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,697)
82,793	Pacific Ethanol Inc	Goldman Sachs	(3,312)
24,171	Pacific Ethanol Inc	Morgan Stanley	2,175
25,178	Pacific Mercantile Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	(5,036)
19,184	Pacific Mercantile Bancorp	Goldman Sachs	(3,837)
10,076	Pacific Mercantile Bancorp	Morgan Stanley	(2,116)
(21,574)	Pacific Premier Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11,650)
42,224	Packaging Corp of America	Bank of America Merrill Lynch	39,268
4,775	PacWest Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	(3,438)
27,835	PacWest Bancorp	Goldman Sachs	(19,730)
35,338	PacWest Bancorp	Morgan Stanley	27,564
(48,434)	Pageseguro Digital Ltd 'A'	Morgan Stanley	(26,154)
8,965	Palo Alto Networks Inc	Bank of America Merrill Lynch	72,617
4,350	Palo Alto Networks Inc	Morgan Stanley	61,205
(420)	PAM Transportation Services Inc	Goldman Sachs	2,919
(5,006)	PAM Transportation Services Inc	Morgan Stanley	5,156
(31,171)	Panhandle Oil and Gas Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	12,157
(7,986)	Panhandle Oil and Gas Inc 'A'	Goldman Sachs	1,141
(50,216)	Papa John's International Inc	Bank of America Merrill Lynch	538,818
(17,876)	Papa John's International Inc	Goldman Sachs	191,809
(11,954)	Papa John's International Inc	Morgan Stanley	107,347
335,977	Par Pacific Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	110,872
(63,506)	PAR Technology Corp	Bank of America Merrill Lynch	(200,044)
(1,039)	PAR Technology Corp	Goldman Sachs	(3,273)
30,945	Paramount Group Inc (Reit)	Goldman Sachs	-
92,878	Paramount Group Inc (Reit)	Morgan Stanley	13,932
581,122	Paramount Group Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	-
(171,311)	Paratek Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(6,852)
(36,434)	Paratek Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,457)
(32,470)	Paratek Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(5,520)
(8)	Pareteum Corp	Morgan Stanley	1
(165,523)	Park Electrochemical Corp	Bank of America Merrill Lynch	41,381
41,801	Park Hotels & Resorts Inc (Reit)	Goldman Sachs	(5,283)
120,809	Park Hotels & Resorts Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(54,364)
14,542	Park-Ohio Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(28,939)



保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
15,219	Park-Ohio Holdings Corp	Goldman Sachs	(30,286)
3,839	Park-Ohio Holdings Corp	Morgan Stanley	(3,685)
(18,718)	Parke Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	14,039
17,311	Parker-Hannifin Corp	Bank of America Merrill Lynch	(20,427)
6,846	Parker-Hannifin Corp	Goldman Sachs	(8,078)
53,072	Parsley Energy Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(90,222)
(131,709)	Party City Holdco Inc	Morgan Stanley	(90,879)
(55,390)	Party City Holdco Inc	Bank of America Merrill Lynch	(16,806)
(23,635)	Party City Holdco Inc	Goldman Sachs	(709)
(3,462)	Patrick Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	7,132
(4,242)	Patrick Industries Inc	Goldman Sachs	3,721
(17,347)	Pattern Energy Group Inc 'A'	Goldman Sachs	(15,094)
(50,344)	Pattern Energy Group Inc 'A'	Morgan Stanley	(36,248)
1,134	Patterson Cos Inc	Goldman Sachs	(578)
(64)	Patterson Cos Inc	Morgan Stanley	(1)
(36,000)	Patterson Cos Inc	Goldman Sachs	18,360
11,664	Patterson Cos Inc	Morgan Stanley	233
(45,375)	Patterson Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	23,141
(15,926)	Patterson-UTI Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	20,385
(11,361)	Paychex Inc	Bank of America Merrill Lynch	(22,495)
(16,534)	Paychex Inc	Morgan Stanley	(43,980)
(527)	Paycom Software Inc	Goldman Sachs	(3,763)
(4,493)	Paycom Software Inc	Morgan Stanley	(57,016)
22,204	Paylocity Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	59,285
6,210	Paylocity Holding Corp	Morgan Stanley	37,695
8,297	Paylocity Holding Corp	Goldman Sachs	22,153
(8,057)	PayPal Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	22,560
(1,263)	PBF Energy Inc 'A'	Goldman Sachs	402
71,097	PC Connection Inc	Bank of America Merrill Lynch	21,329
20,254	PC Connection Inc	Goldman Sachs	6,076
7,588	PC Connection Inc	Morgan Stanley	3,794
91,810	PC-Tel Inc	Morgan Stanley	(918)
10,282	PCM Inc	Goldman Sachs	(1,234)
16,529	PCM Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,983)
(3,401)	PCSB Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(952)
(1,450)	PDC Energy Inc	Goldman Sachs	7,033
(34,821)	PDC Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	168,882
9,732	PDC Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(47,200)
(18,824)	PDC Energy Inc	Morgan Stanley	24,848
115,824	PDF Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	(13,899)
30,878	PDF Solutions Inc	Goldman Sachs	(3,705)
6,289	PDF Solutions Inc	Morgan Stanley	1,698
(517,927)	PDL BioPharma Inc	Bank of America Merrill Lynch	(31,076)
(53,910)	pdvWireless Inc	Bank of America Merrill Lynch	(269,011)
(1,004)	pdvWireless Inc	Morgan Stanley	(5,010)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(115,346)	Peabody Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	495,988
(98,832)	Peabody Energy Corp	Morgan Stanley	24,708
(18,033)	Peabody Energy Corp	Goldman Sachs	(12,097)
(10,238)	Peapack Gladstone Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,969)
(7,479)	Peapack Gladstone Financial Corp	Goldman Sachs	(3,960)
(36,208)	Pebblebrook Hotel Trust (Reit)	Morgan Stanley	22,811
(25,276)	Pebblebrook Hotel Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	17,944
(4,724)	Pegasystems Inc	Morgan Stanley	(12,708)
(9,615)	Penns Woods Bancorp Inc	Morgan Stanley	(5,000)
11,331	Pennsylvania Real Estate Investment Trust (Reit)	Goldman Sachs	1,813
5,809	Penske Automotive Group Inc	Goldman Sachs	(1,222)
71,870	Penske Automotive Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,577)
4,003	Penske Automotive Group Inc	Morgan Stanley	(2,593)
(1,193)	Penumbra Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,867)
(6,219)	Penumbra Inc	Goldman Sachs	(25,374)
(20,263)	People's United Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9,929)
9,803	People's Utah Bancorp	Goldman Sachs	(6,470)
10,477	People's Utah Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	(6,915)
2,965	People's Utah Bancorp	Morgan Stanley	(1,660)
7,509	Peoples Bancorp Inc/OH	Bank of America Merrill Lynch	3,079
761	Peoples Bancorp Inc/OH	Goldman Sachs	312
5,121	Peoples Bancorp Inc/OH	Morgan Stanley	2,202
(55,324)	PepsiCo Inc	Morgan Stanley	(188,655)
(18,119)	Performance Food Group Co	Goldman Sachs	(26,827)
(16,009)	Performance Food Group Co	Morgan Stanley	(13,448)
(1,320)	PerkinElmer Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,128)
(1,579)	PerkinElmer Inc	Goldman Sachs	(2,618)
(7,876)	Perrigo Co Plc	Goldman Sachs	(2,875)
92,154	Perspecta Inc	Bank of America Merrill Lynch	(137,770)
13,049	Perspecta Inc	Morgan Stanley	(4,371)
26,365	Perspecta Inc	Goldman Sachs	(39,416)
17,952	PetIQ Inc	Bank of America Merrill Lynch	40,392
8,822	PetIQ Inc	Goldman Sachs	21,340
18,671	PetMed Express Inc	Bank of America Merrill Lynch	(64,415)
6,194	PetMed Express Inc	Goldman Sachs	(21,369)
2,500	PetMed Express Inc	Morgan Stanley	(2,475)
(25,422)	Petroleo Brasileiro SA ADR	Goldman Sachs	16,016
(92,044)	Petroleo Brasileiro SA ADR	Morgan Stanley	(12,886)
(241,197)	Pfizer Inc	Bank of America Merrill Lynch	(640,378)
(57,734)	PG&E Corp	Bank of America Merrill Lynch	(527,111)
126,297	PGT Innovations Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,578)
(21,108)	Philip Morris International Inc	Goldman Sachs	(25,330)
(29,487)	Philip Morris International Inc	Morgan Stanley	(87,871)
25,753	Phillips 66	Bank of America Merrill Lynch	(105,845)
56,646	Physicians Realty Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	58,345

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
38,658	Physicians Realty Trust (Reit)	Goldman Sachs	39,818
(16,580)	PICO Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,648)
(23,046)	Piedmont Office Realty Trust Inc 'A' (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	3,226
(582,111)	Pier 1 Imports Inc	Bank of America Merrill Lynch	58,211
(10,041)	Pieris Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,004)
55,585	Pilgrim's Pride Corp	Bank of America Merrill Lynch	40,577
40,843	Pinnacle Financial Partners Inc	Morgan Stanley	94,756
26,613	Pinnacle Financial Partners Inc	Goldman Sachs	87,291
39,658	Pinnacle Financial Partners Inc	Bank of America Merrill Lynch	130,078
99,417	Pinnacle West Capital Corp	Bank of America Merrill Lynch	(19,883)
42,971	Pinnacle West Capital Corp	Morgan Stanley	9,883
83,267	Pioneer Energy Services Corp	Bank of America Merrill Lynch	(24,147)
(15,696)	Piper Jaffray Cos	Morgan Stanley	(2,982)
(374)	Piper Jaffray Cos	Goldman Sachs	15
(319,604)	Pitney Bowes Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,392)
26,050	Pivotal Software Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(3,387)
(5,011)	PJT Partners Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(5,211)
114,365	Plains GP Holdings LP 'A'	Bank of America Merrill Lynch	48,033
53,021	Planet Fitness Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	95,438
(8,205)	Platform Specialty Products Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3,774)
25,567	Playa Hotels & Resorts NV	Bank of America Merrill Lynch	(12,784)
5,557	Playa Hotels & Resorts NV	Goldman Sachs	(2,779)
(2,089)	PlayAGS Inc	Bank of America Merrill Lynch	(439)
(2,508)	Plexus Corp	Goldman Sachs	(5,342)
(34,902)	Plexus Corp	Bank of America Merrill Lynch	(74,341)
(46,574)	Plexus Corp	Morgan Stanley	(102,463)
(1,881)	Pluralsight Inc 'A'	Goldman Sachs	(4,816)
30,958	PNM Resources Inc	Goldman Sachs	11,145
71,796	PNM Resources Inc	Morgan Stanley	16,513
81,453	PNM Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	29,323
(1,215)	Polaris Industries Inc	Goldman Sachs	(207)
(19,459)	Polaris Industries Inc	Morgan Stanley	(18,681)
(1,556)	PolyOne Corp	Morgan Stanley	(78)
(4,542)	Ponce de Leon Federal Bank	Morgan Stanley	318
(1,237)	Pool Corp	Goldman Sachs	(11,727)
(6,067)	Pool Corp	Morgan Stanley	(45,563)
(10,162)	Pool Corp	Bank of America Merrill Lynch	(96,336)
(19,791)	Popular Inc	Bank of America Merrill Lynch	30,874
(30,103)	Popular Inc	Morgan Stanley	(33,414)
70,631	Portland General Electric Co	Goldman Sachs	219
69,326	Portland General Electric Co	Morgan Stanley	14,866
179,063	Portland General Electric Co	Bank of America Merrill Lynch	(5,372)
(4,151)	Portland General Electric Co	Goldman Sachs	1,045
(4,864)	Portola Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,402)
25,504	Portola Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	23,081

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
15,708	Post Holdings Inc	Morgan Stanley	61,732
(162,112)	Potbelly Corp	Bank of America Merrill Lynch	69,708
(835)	PotlatchDeltic Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(134)
(2,926)	PotlatchDeltic Corp (Reit)	Goldman Sachs	(1,360)
85,666	PotlatchDeltic Corp (Reit)	Morgan Stanley	113,079
65,390	PotlatchDeltic Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	10,462
17,141	PotlatchDeltic Corp (Reit)	Goldman Sachs	2,743
(49,153)	Powell Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	92,899
(4,168)	Power Integrations Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,961)
(20,497)	Power Integrations Inc	Morgan Stanley	(40,379)
(28,488)	Power Integrations Inc	Goldman Sachs	(53,053)
(33,348)	PPG Industries Inc	Morgan Stanley	(60,026)
(42,910)	PPG Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(86,249)
16,235	PPL Corp	Bank of America Merrill Lynch	-
(16,023)	PRA Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,929)
(95,459)	PRA Group Inc	Goldman Sachs	(60,911)
(71,646)	PRA Group Inc	Morgan Stanley	(42,988)
(557)	PRA Health Sciences Inc	Goldman Sachs	(12,116)
(2,155)	PRA Health Sciences Inc	Morgan Stanley	(36,807)
(66,309)	Precision Drilling Corp	Goldman Sachs	17,968
(86,471)	Precision Drilling Corp	Morgan Stanley	31,662
(2,769)	Premier Inc 'A'	Goldman Sachs	803
(126,509)	Presidio Inc	Bank of America Merrill Lynch	(92,352)
(51,834)	Presidio Inc	Morgan Stanley	(39,394)
10,337	Prestige Consumer Healthcare Inc	Goldman Sachs	13,335
20,886	Prestige Consumer Healthcare Inc	Morgan Stanley	23,810
21,808	Prestige Consumer Healthcare Inc	Bank of America Merrill Lynch	28,132
(17,176)	PriceSmart Inc	Goldman Sachs	(8,416)
(43,259)	PriceSmart Inc	Bank of America Merrill Lynch	(21,197)
(14,041)	PriceSmart Inc	Morgan Stanley	(9,969)
(24,873)	Primerica Inc	Bank of America Merrill Lynch	(68,152)
(30,428)	Primo Water Corp	Bank of America Merrill Lynch	(13,388)
(72,189)	Primo Water Corp	Goldman Sachs	(29,528)
23,917	Principal Financial Group Inc	Morgan Stanley	20,569
6,848	Principia Biopharma Inc	Goldman Sachs	9,245
(138,718)	ProAssurance Corp	Bank of America Merrill Lynch	62,423
(96,194)	Procter & Gamble Co/The	Goldman Sachs	78,879
(78,242)	Procter & Gamble Co/The	Bank of America Merrill Lynch	64,158
(9,718)	Procter & Gamble Co/The	Morgan Stanley	(14,285)
2,017	Progress Software Corp	Goldman Sachs	4,115
38,057	Progressive Corp/The	Goldman Sachs	(17,136)
63,637	Progressive Corp/The	Morgan Stanley	154,002
37,531	Prologis Inc (Reit)	Goldman Sachs	21,924
138,782	Prologis Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	123,516
28,734	Prologis Inc (Reit)	Morgan Stanley	12,357

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
2,003	Proofpoint Inc	Morgan Stanley	13,747
(15,560)	Proofpoint Inc	Bank of America Merrill Lynch	(87,136)
97,351	ProPetro Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	(134,344)
(60,559)	ProPetro Holding Corp	Morgan Stanley	55,109
2,055	PROS Holdings Inc	Goldman Sachs	4,172
17,952	Prosperity Bancshares Inc	Goldman Sachs	12,746
14,476	Prosperity Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	10,278
31,791	Prosperity Bancshares Inc	Morgan Stanley	-
26,264	Protagonist Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(50,952)
26,117	Protagonist Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(50,667)
23,466	Protagonist Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(18,069)
94,615	Protective Insurance Corp ' B '	Bank of America Merrill Lynch	(107,861)
19,807	Protective Insurance Corp ' B '	Goldman Sachs	(22,580)
9,336	Protective Insurance Corp ' B '	Morgan Stanley	(9,243)
(78,282)	Proteostasis Therapeutics Inc	Morgan Stanley	34,444
5,838	Prothena Corp Plc	Goldman Sachs	1,172
(2,232)	Proto Labs Inc	Morgan Stanley	(13,392)
21,257	Proto Labs Inc	Bank of America Merrill Lynch	20,832
2,399	Proto Labs Inc	Goldman Sachs	2,351
(5,669)	Proto Labs Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,556)
(6,698)	Providence Service Corp/The	Goldman Sachs	(19,893)
(64,597)	Providence Service Corp/The	Bank of America Merrill Lynch	(191,853)
(400)	Provident Bancorp Inc	Goldman Sachs	(620)
(48,883)	Provident Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(75,769)
(42,733)	Provident Financial Services Inc	Goldman Sachs	(6,450)
(23,999)	Provident Financial Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,640)
8,453	Prudential Financial Inc	Goldman Sachs	15,745
31,836	Prudential Financial Inc	Morgan Stanley	100,602
(4,589)	PS Business Parks Inc (Reit)	Morgan Stanley	(14,685)
1,560	PTC Inc	Goldman Sachs	5,169
(15,509)	PTC Inc	Bank of America Merrill Lynch	23,264
(27,524)	PTC Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(58,076)
(44,880)	Public Service Enterprise Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(12,118)
(34,640)	Public Storage (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(179,089)
(4,366)	Public Storage (Reit)	Goldman Sachs	(22,572)
(17,125)	PulteGroup Inc	Goldman Sachs	(38,528)
(96,156)	PulteGroup Inc	Bank of America Merrill Lynch	(267,314)
(11,315)	PulteGroup Inc	Morgan Stanley	(10,976)
14,408	Puma Biotechnology Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,755
14,061	Puma Biotechnology Inc	Goldman Sachs	4,640
4,229	Pure Storage Inc ' A '	Goldman Sachs	(3,256)
156,065	Pure Storage Inc ' A '	Bank of America Merrill Lynch	(120,170)
40,710	Pure Storage Inc ' A '	Morgan Stanley	55,773
(17,308)	Pyxus International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10,039)
(8,968)	Pyxus International Inc	Goldman Sachs	(5,201)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(4,377)	Pyxus International Inc	Morgan Stanley	(1,226)
21,485	QCR Holdings Inc	Goldman Sachs	(9,668)
6,520	QCR Holdings Inc	Morgan Stanley	326
80,449	QCR Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(36,202)
(1,594)	QIAGEN NV	Goldman Sachs	(845)
(28,128)	Qorvo Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11,111)
105,805	QTS Realty Trust Inc 'A' (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	212,668
18,208	QTS Realty Trust Inc 'A' (Reit)	Goldman Sachs	36,598
(8,325)	Quaker Chemical Corp	Morgan Stanley	(9,241)
(15,744)	Qualys Inc	Bank of America Merrill Lynch	(61,244)
(65,470)	Quanex Building Products Corp	Bank of America Merrill Lynch	17,022
28,695	Quanta Services Inc	Goldman Sachs	4,591
3,580	Quanta Services Inc	Morgan Stanley	2,649
29,341	Quanta Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,695
(16,712)	Quantenna Communications Inc	Bank of America Merrill Lynch	20,890
18,005	Quest Diagnostics Inc	Morgan Stanley	(28,815)
8,158	Quest Diagnostics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(75,869)
23,251	QuinStreet Inc	Bank of America Merrill Lynch	8,835
25,250	QuinStreet Inc	Goldman Sachs	30,621
61,182	QuinStreet Inc	Morgan Stanley	70,359
(32,740)	Quorum Health Corp	Goldman Sachs	8,840
(25,083)	Quorum Health Corp	Morgan Stanley	(7,274)
(9,928)	Quorum Health Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,681
107,984	Quotient Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(56,152)
8,953	Quotient Technology Inc	Morgan Stanley	5,282
36,278	Quotient Technology Inc	Goldman Sachs	(3,206)
(88,277)	Qurate Retail Inc	Bank of America Merrill Lynch	95,339
(51,291)	R1 RCM Inc	Goldman Sachs	(36,417)
(178,838)	R1 RCM Inc	Bank of America Merrill Lynch	(126,975)
(34,735)	R1 RCM Inc	Morgan Stanley	(22,925)
33,748	Ra Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	6,075
17,650	Ra Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,177
71,544	Radian Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(70,113)
25,693	Radian Group Inc	Goldman Sachs	(25,179)
293,076	Radiant Logistics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(211,015)
7,977	Radiant Logistics Inc	Morgan Stanley	(2,313)
(9,180)	Ralph Lauren Corp	Morgan Stanley	24,602
(4,530)	Rambus Inc	Goldman Sachs	498
(55,300)	Rambus Inc	Morgan Stanley	(14,931)
(526,542)	Rambus Inc	Bank of America Merrill Lynch	57,920
47,754	Range Resources Corp	Bank of America Merrill Lynch	(116,520)
18,124	Range Resources Corp	Goldman Sachs	(44,223)
18,525	Ranger Energy Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(14,820)
9,630	Ranger Energy Services Inc	Goldman Sachs	(7,704)
11,885	Ranger Energy Services Inc	Morgan Stanley	(2,734)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(14,169)	Rapid7 Inc	Morgan Stanley	(49,592)
12,771	Raven Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(50,701)
2,925	Raven Industries Inc	Goldman Sachs	(11,612)
3,444	Raven Industries Inc	Morgan Stanley	723
23,566	Raymond James Financial Inc	Goldman Sachs	(27,802)
26,817	Raymond James Financial Inc	Morgan Stanley	23,599
340	Raymond James Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(401)
(30,858)	Raymond James Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	36,412
(54,239)	Rayonier Advanced Materials Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9,221)
(76,783)	Rayonier Advanced Materials Inc	Goldman Sachs	(15,558)
14,922	Raytheon Co	Morgan Stanley	(8,953)
49,282	Raytheon Co	Bank of America Merrill Lynch	(503,662)
(10,193)	RBC Bearings Inc	Morgan Stanley	(45,053)
999	RBC Bearings Inc	Goldman Sachs	(2,198)
38,612	RE/MAX Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	121,628
10,230	RE/MAX Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	32,225
4,550	RE/MAX Holdings Inc 'A'	Morgan Stanley	9,464
(300,154)	Reading International Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(27,014)
(7,400)	Reading International Inc 'A'	Goldman Sachs	(666)
36,894	RealNetworks Inc	Bank of America Merrill Lynch	10,330
12,370	RealNetworks Inc	Goldman Sachs	3,464
11,175	RealNetworks Inc	Morgan Stanley	2,570
(32,355)	Realogy Holdings Corp	Goldman Sachs	(13,034)
158,393	Realty Income Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	231,254
(3,772)	Reata Pharmaceuticals Inc 'A'	Morgan Stanley	(10,750)
(8,043)	Reata Pharmaceuticals Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(17,212)
32,882	Recro Pharma Inc	Goldman Sachs	1,571
(146,607)	Red Lion Hotels Corp	Bank of America Merrill Lynch	(10,262)
(2,560)	Red Rock Resorts Inc 'A'	Morgan Stanley	(6,630)
(1,451)	Red Rock Resorts Inc 'A'	Goldman Sachs	(5,178)
(17,138)	Redfin Corp	Goldman Sachs	(32,219)
(24,060)	Redfin Corp	Bank of America Merrill Lynch	(45,233)
(1,332)	Redfin Corp	Morgan Stanley	(2,930)
222,975	Redwood Trust Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	20,068
25,715	Redwood Trust Inc (Reit)	Goldman Sachs	2,314
4,313	Redwood Trust Inc (Reit)	Morgan Stanley	86
12,325	Regal Beloit Corp	Goldman Sachs	559
1,288	Regal Beloit Corp	Bank of America Merrill Lynch	(193)
6,937	Regal Beloit Corp	Morgan Stanley	9,989
10,265	Regency Centers Corp (Reit)	Morgan Stanley	6,878
7,225	Regency Centers Corp (Reit)	Goldman Sachs	4,543
2,463	Regency Centers Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	2,241
105	Regeneron Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,017
162	Regeneron Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	3,112
1,225	REGENXBIO Inc	Goldman Sachs	(1,323)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
45,985	Regional Management Corp	Goldman Sachs	(54,441)
29,448	Regional Management Corp	Bank of America Merrill Lynch	(35,043)
14,756	Regional Management Corp	Morgan Stanley	(4,279)
22,288	Regions Financial Corp	Goldman Sachs	1,004
15,717	Regions Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,886)
25,031	Regions Financial Corp	Morgan Stanley	2,085
(123,459)	Regis Corp	Bank of America Merrill Lynch	17,284
(7,358)	Reinsurance Group of America Inc	Goldman Sachs	(1,252)
(6,228)	Reinsurance Group of America Inc	Morgan Stanley	(14,511)
53,446	Reliance Steel & Aluminum Co	Bank of America Merrill Lynch	(70,549)
23,594	Reliance Steel & Aluminum Co	Goldman Sachs	(31,144)
13,226	Reliance Steel & Aluminum Co	Morgan Stanley	7,936
(68,468)	Reliant Bancorp Inc	Goldman Sachs	(188,509)
(1,735)	Reliant Bancorp Inc	Morgan Stanley	1,024
(40,360)	Reliant Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(111,394)
(19,507)	RenaissanceRe Holdings Ltd	Goldman Sachs	(193,705)
(17,486)	RenaissanceRe Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(173,636)
(14,100)	RenaissanceRe Holdings Ltd	Morgan Stanley	(10,716)
8,815	Renasant Corp	Bank of America Merrill Lynch	353
14,481	Renasant Corp	Morgan Stanley	2,027
(10,641)	Renewable Energy Group Inc	Goldman Sachs	(6,069)
(18,799)	Rentech Inc*	Morgan Stanley	-
(29,941)	Repligen Corp	Bank of America Merrill Lynch	(61,080)
91,775	Republic Bancorp Inc/KY 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(101,870)
9,191	Republic Bancorp Inc/KY 'A'	Goldman Sachs	(10,202)
13,010	Republic Bancorp Inc/KY 'A'	Morgan Stanley	(7,546)
85,656	Republic First Bancorp Inc	Goldman Sachs	54,820
363,793	Republic First Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	232,828
85,636	Republic First Bancorp Inc	Morgan Stanley	62,514
7,563	Republic Services Inc	Goldman Sachs	6,667
79,709	Republic Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	133,911
12,662	Republic Services Inc	Morgan Stanley	17,919
(30,022)	Research Frontiers Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,406)
(129,742)	Research Frontiers Inc	Morgan Stanley	(23,354)
86,471	Resideo Technologies Inc	Morgan Stanley	146,136
52,336	Resideo Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(48,672)
77,370	Resideo Technologies Inc	Goldman Sachs	(19,271)
(994)	ResMed Inc	Goldman Sachs	(8,810)
13,195	ResMed Inc	Bank of America Merrill Lynch	83,788
4,184	ResMed Inc	Goldman Sachs	26,568
(624)	ResMed Inc	Morgan Stanley	(4,299)
(3,637)	Resolute Energy Corp	Goldman Sachs	(3,031)
(73,975)	Retail Opportunity Investments Corp (Reit)	Goldman Sachs	(29,960)
(107,289)	Retail Opportunity Investments Corp (Reit)	Morgan Stanley	(47,744)
(20,997)	Retail Properties of America Inc 'A' (Reit)	Goldman Sachs	(12,598)



保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(521,976)	Retail Properties of America Inc 'A' (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(313,186)
(307,243)	Retail Properties of America Inc 'A' (Reit)	Morgan Stanley	(193,563)
(17,957)	REV Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10,774)
(178,772)	REV Group Inc	Goldman Sachs	(107,263)
76,612	Revance Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(55,161)
20,501	Revance Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(14,761)
24,337	Revance Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(19,713)
17,573	REX American Resources Corp	Bank of America Merrill Lynch	(100,869)
6,721	REX American Resources Corp	Goldman Sachs	(38,579)
4,699	REX American Resources Corp	Morgan Stanley	(9,774)
118,222	Rexford Industrial Realty Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	22,462
(10,054)	Rexnord Corp	Goldman Sachs	10,557
284,524	Rexnord Corp	Bank of America Merrill Lynch	(298,750)
4,538	Rexnord Corp	Goldman Sachs	(4,765)
4,109	Rexnord Corp	Morgan Stanley	2,260
(16,094)	Rexnord Corp	Morgan Stanley	(8,852)
(6,136)	RH	Bank of America Merrill Lynch	29,514
(13,052)	RH	Morgan Stanley	(58,734)
17,508	Rhythm Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	27,137
1,038	Rhythm Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	1,609
3,668	Rhythm Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	1,834
76,380	Ribbon Communications Inc	Bank of America Merrill Lynch	(32,080)
87,426	Ribbon Communications Inc	Goldman Sachs	(32,054)
24,397	Ribbon Communications Inc	Morgan Stanley	(5,611)
30,294	Rigel Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(362)
1,883	RigNet Inc	Morgan Stanley	2,222
24,815	RingCentral Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	114,893
25	RingCentral Inc 'A'	Morgan Stanley	250
6,906	RingCentral Inc 'A'	Goldman Sachs	32,825
102,143	Riverview Bancorp Inc	Morgan Stanley	(15,321)
240,141	Riverview Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(67,239)
65,279	Riverview Bancorp Inc	Goldman Sachs	(17,926)
(18,664)	RLI Corp	Morgan Stanley	(20,717)
13,041	RLJ Lodging Trust (Reit)	Goldman Sachs	4,695
(9,732)	RLJ Lodging Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(3,504)
(62,599)	RMR Group Inc/The 'A'	Bank of America Merrill Lynch	261,038
1,858	Robert Half International Inc	Goldman Sachs	4,027
38,758	Robert Half International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(39,921)
(19,188)	Rocket Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(20,531)
25,796	Rockwell Automation Inc	Goldman Sachs	(27,344)
25,769	Rockwell Automation Inc	Bank of America Merrill Lynch	(27,315)
27,219	Rockwell Automation Inc	Morgan Stanley	117,858
4,364	Rocky Brands Inc	Goldman Sachs	(218)
10,829	Rocky Brands Inc	Morgan Stanley	108

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
23,097	Rocky Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,155)
(38,312)	Rogers Corp	Bank of America Merrill Lynch	(229,489)
(19,806)	Rogers Corp	Morgan Stanley	(130,720)
963	Roku Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,399)
2,822	Roku Inc	Goldman Sachs	(5,286)
32,570	Rollins Inc	Bank of America Merrill Lynch	102,921
8,420	Rollins Inc	Goldman Sachs	26,607
1,438	Rollins Inc	Morgan Stanley	5,824
2,892	Roper Technologies Inc	Morgan Stanley	26,914
4,898	Roper Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,939
2,858	Roper Technologies Inc	Goldman Sachs	7,093
(39,021)	Rosetta Stone Inc	Bank of America Merrill Lynch	37,850
(9,249)	Ross Stores Inc	Bank of America Merrill Lynch	96,745
(99,082)	Rowan Cos Plc 'A'	Goldman Sachs	150,605
(7,091)	Royal Caribbean Cruises Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(15,600)
(158,839)	RPC Inc	Goldman Sachs	12,707
(4,611)	RPC Inc	Morgan Stanley	1,568
(1,996)	RPM International Inc	Goldman Sachs	(3,593)
(10,415)	RPM International Inc	Morgan Stanley	(29,162)
(566,516)	RPT Realty (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(509,864)
21,877	RR Donnelley & Sons Co	Goldman Sachs	1,923
27,749	RTI Surgical Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,382)
47,801	RTI Surgical Inc	Morgan Stanley	(8,604)
39,630	RTI Surgical Inc	Goldman Sachs	(6,345)
(231,358)	RTW RetailWinds Inc	Bank of America Merrill Lynch	115,679
72,640	Rubicon Project Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	(9,443)
37,405	Rubicon Project Inc/The	Goldman Sachs	(4,071)
18,873	Rubicon Project Inc/The	Morgan Stanley	755
(15,293)	Rubicon Technology Inc	Morgan Stanley	(9,940)
104,433	Rush Enterprises Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(84,591)
7,365	Rush Enterprises Inc 'A'	Morgan Stanley	(4,861)
117,951	Ruth's Hospitality Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(247,697)
21,660	Ruth's Hospitality Group Inc	Goldman Sachs	(45,486)
16,436	Ruth's Hospitality Group Inc	Morgan Stanley	(8,547)
50,640	Ryder System Inc	Bank of America Merrill Lynch	29,371
3,713	Ryerson Holding Corp	Morgan Stanley	(1,225)
39,692	Ryerson Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	(41,677)
14,020	Ryerson Holding Corp	Goldman Sachs	(14,721)
138,288	Ryman Hospitality Properties Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(376,143)
9,265	Ryman Hospitality Properties Inc (Reit)	Goldman Sachs	(25,201)
12,787	Ryman Hospitality Properties Inc (Reit)	Morgan Stanley	(25,318)
7,872	S&P Global Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,802
(144,293)	S&T Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(129,864)
(7,792)	Sabra Health Care REIT Inc (Reit)	Goldman Sachs	(1,013)
(371,924)	Sabra Health Care REIT Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(48,350)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(40,482)	Sabre Corp	Goldman Sachs	(47,364)
(41,157)	Sabre Corp	Bank of America Merrill Lynch	(48,154)
(42,807)	Sabre Corp	Morgan Stanley	(53,081)
(406,532)	Safeguard Scientifics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(158,547)
(27,799)	Saga Communications Inc 'A'	Morgan Stanley	(51,706)
(6,279)	Sage Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(32,525)
(8,281)	SailPoint Technologies Holding Inc	Goldman Sachs	2,108
(2,834)	SailPoint Technologies Holding Inc	Morgan Stanley	(2,409)
(5,621)	SailPoint Technologies Holding Inc	Bank of America Merrill Lynch	8,881
11,363	salesforce.com Inc	Bank of America Merrill Lynch	88,404
13,205	salesforce.com Inc	Morgan Stanley	240,859
56,373	salesforce.com Inc	Goldman Sachs	439,024
2,613	Sally Beauty Holdings Inc	Morgan Stanley	5,174
(98,734)	Sally Beauty Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(21,721)
(7,685)	Sanderson Farms Inc	Goldman Sachs	(66,969)
(679)	Sanderson Farms Inc	Morgan Stanley	(4,020)
(138,221)	SandRidge Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	128,546
63,200	Sandy Spring Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(12,008)
30,099	Sandy Spring Bancorp Inc	Goldman Sachs	(5,013)
11,852	Sandy Spring Bancorp Inc	Morgan Stanley	2,252
33,559	Sangamo Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	52,688
36,635	Sangamo Therapeutics Inc	Goldman Sachs	57,517
(2,784)	Sarepta Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(25,418)
(2,463)	Sarepta Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(22,487)
(83,198)	Saul Centers Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(832)
(2,921)	SBA Communications Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	1,285
29,874	ScanSource Inc	Goldman Sachs	(53,773)
21,844	ScanSource Inc	Morgan Stanley	17,257
115,261	ScanSource Inc	Bank of America Merrill Lynch	(207,470)
(89,613)	Schlumberger Ltd	Bank of America Merrill Lynch	296,619
7,901	Schneider National Inc 'B'	Goldman Sachs	(1,819)
186,296	Schneider National Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(42,848)
20,356	Schneider National Inc 'B'	Morgan Stanley	6,717
32,089	Schnitzer Steel Industries Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(17,970)
(1,701)	Scholastic Corp	Bank of America Merrill Lynch	757
(3,669)	Scholastic Corp	Goldman Sachs	1,633
(10,075)	Science Applications International Corp	Bank of America Merrill Lynch	3,728
(42,661)	Scientific Games Corp/DE 'A'	Bank of America Merrill Lynch	45,647
(34,900)	Scientific Games Corp/DE 'A'	Goldman Sachs	(7,200)
(23,255)	Scotts Miracle-Gro Co/The	Bank of America Merrill Lynch	72,556
9,611	Scotts Miracle-Gro Co/The	Morgan Stanley	3,460
(1,218)	Seaboard Corp	Bank of America Merrill Lynch	(267,607)
(38,503)	Seacoast Banking Corp of Florida	Morgan Stanley	(84,322)
35,072	Seadrill Ltd	Goldman Sachs	(82,419)
3,102	Seadrill Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(7,290)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
26,863	Seadrill Ltd	Morgan Stanley	(1,612)
(15,091)	Seagate Technology Plc	Goldman Sachs	29,578
(47,487)	Sealed Air Corp	Bank of America Merrill Lynch	(6,648)
(23,473)	Sealed Air Corp	Morgan Stanley	18,778
(39,590)	Sealed Air Corp	Goldman Sachs	(5,543)
17,432	Sears Hometown and Outlet Stores Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,358)
33,246	Sears Hometown and Outlet Stores Inc	Morgan Stanley	(6,649)
984	SeaSpine Holdings Corp	Morgan Stanley	964
35,891	SeaSpine Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	76,807
(5,890)	Seattle Genetics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(43,292)
38,325	SeaWorld Entertainment Inc	Bank of America Merrill Lynch	124,556
53,341	SeaWorld Entertainment Inc	Morgan Stanley	93,880
(17,692)	SecureWorks Corp 'A'	Morgan Stanley	(43,522)
(1,692)	SecureWorks Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(3,875)
61,582	SEI Investments Co	Bank of America Merrill Lynch	(54,795)
11,564	SEI Investments Co	Goldman Sachs	(6,545)
3,550	SEI Investments Co	Morgan Stanley	3,869
26,979	Select Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	14,838
10,423	Select Bancorp Inc	Goldman Sachs	5,733
10,020	Select Bancorp Inc	Morgan Stanley	7,515
4,899	Select Energy Services Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(2,205)
12,541	Select Energy Services Inc 'A'	Goldman Sachs	(5,643)
6,857	Select Energy Services Inc 'A'	Morgan Stanley	(2,126)
10,340	Select Interior Concepts Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	4,653
404	Select Interior Concepts Inc 'A'	Goldman Sachs	182
111,180	Select Medical Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(32,242)
7,322	Select Medical Holdings Corp	Morgan Stanley	2,929
10,113	Select Medical Holdings Corp	Goldman Sachs	(2,933)
12,472	Selecta Biosciences Inc	Goldman Sachs	3,563
16,503	Selective Insurance Group Inc	Goldman Sachs	23,434
16,643	Selective Insurance Group Inc	Morgan Stanley	33,952
1,845	SemGroup Corp 'A'	Morgan Stanley	(148)
1,210	SemGroup Corp 'A'	Goldman Sachs	(1,258)
(3,974)	Sempre Energy	Goldman Sachs	247
(42,124)	Sempre Energy	Bank of America Merrill Lynch	(79,614)
(21,470)	Sempre Energy	Morgan Stanley	(16,317)
(8,721)	Semtech Corp	Bank of America Merrill Lynch	(25,640)
1,121	Semtech Corp	Morgan Stanley	6,822
(4,184)	SendGrid Inc	Goldman Sachs	(14,739)
(835)	SendGrid Inc	Morgan Stanley	(5,377)
(106,165)	Senior Housing Properties Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	150,754
(20,548)	Sensata Technologies Holding Plc	Goldman Sachs	42,534
(22,755)	Sensata Technologies Holding Plc	Morgan Stanley	28,444
(8,629)	Senseonics Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,538)
(53,814)	Sensient Technologies Corp	Bank of America Merrill Lynch	91,484

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(1,216)	Sensient Technologies Corp	Morgan Stanley	(401)
35,936	Seres Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	16,531
40,099	Seres Therapeutics Inc	Goldman Sachs	18,446
16,612	Seres Therapeutics Inc	Morgan Stanley	10,798
(167,303)	Seritage Growth Properties 'A' (Reit)	Goldman Sachs	(234,000)
(36,213)	Service Corp International/US	Goldman Sachs	(72,064)
(46,528)	Service Corp International/US	Bank of America Merrill Lynch	(92,591)
(41,415)	Service Corp International/US	Morgan Stanley	(98,154)
(27,753)	ServiceMaster Global Holdings Inc	Goldman Sachs	(31,203)
8,337	ServiceMaster Global Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	14,048
(3,507)	ServiceMaster Global Holdings Inc	Morgan Stanley	(6,996)
6,335	ServiceNow Inc	Morgan Stanley	138,737
62,393	ServiceSource International Inc	Morgan Stanley	624
143,449	ServiceSource International Inc	Bank of America Merrill Lynch	-
80,728	ServiceSource International Inc	Goldman Sachs	-
2,008	ServisFirst Bancshares Inc	Goldman Sachs	2,942
29,668	ServisFirst Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	43,464
(11,907)	Shake Shack Inc 'A'	Goldman Sachs	(45,604)
(5,865)	Shake Shack Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(16,701)
(30,192)	Shenandoah Telecommunications Co	Bank of America Merrill Lynch	(97,973)
(6,938)	Sherwin-Williams Co/The	Bank of America Merrill Lynch	1,110
(1,533)	Sherwin-Williams Co/The	Morgan Stanley	(8,784)
(5,726)	Shiloh Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(802)
(27,878)	Ship Finance International Ltd	Morgan Stanley	(14,497)
(3,239)	Ship Finance International Ltd	Goldman Sachs	(2,947)
27,332	Shoe Carnival Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,007
11,745	Shoe Carnival Inc	Goldman Sachs	1,292
1,119	Shoe Carnival Inc	Morgan Stanley	2,148
(2,087)	Shopify Inc 'A'	Goldman Sachs	(17,360)
(283)	Shopify Inc 'A'	Morgan Stanley	(4,378)
5,260	Shore Bancshares Inc	Goldman Sachs	(1,736)
3,393	Shore Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,120)
(9,857)	ShotSpotter Inc	Morgan Stanley	(49,384)
(5,375)	Shutterfly Inc	Goldman Sachs	8,080
(30,446)	Shutterfly Inc	Bank of America Merrill Lynch	57,238
(1,758)	Shutterfly Inc	Morgan Stanley	(756)
111,800	Sierra Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	71,552
24,434	Sierra Bancorp	Goldman Sachs	15,638
88,667	Sierra Bancorp	Morgan Stanley	114,380
(27,668)	SIGA Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(15,494)
7,410	Signature Bank/New York NY	Bank of America Merrill Lynch	60,540
(65,450)	Signet Jewelers Ltd	Bank of America Merrill Lynch	293,871
(31,938)	Silgan Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,026)
48,660	Silicon Laboratories Inc	Bank of America Merrill Lynch	74,936
3,532	Silvercrest Asset Management Group Inc 'A'	Goldman Sachs	(1,307)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
11,405	Silvercrest Asset Management Group Inc 'A'	Morgan Stanley	(1,140)
10,062	Silvercrest Asset Management Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(3,723)
(25,973)	Simmons First National Corp 'A'	Goldman Sachs	(42,855)
(38,202)	Simmons First National Corp 'A'	Morgan Stanley	(48,899)
(117,613)	Simmons First National Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(194,061)
24,000	Simon Property Group Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	88,560
18,887	Simply Good Foods Co/The	Morgan Stanley	5,666
90,095	Simply Good Foods Co/The	Bank of America Merrill Lynch	34,236
38,737	Simply Good Foods Co/The	Goldman Sachs	14,720
(2,782)	Simpson Manufacturing Co Inc	Goldman Sachs	(2,779)
(3,787)	Simpson Manufacturing Co Inc	Morgan Stanley	(6,286)
6,047	Simpson Manufacturing Co Inc	Goldman Sachs	(3,447)
64,951	Simpson Manufacturing Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(37,022)
(33,542)	Simulations Plus Inc	Bank of America Merrill Lynch	16,436
(15,695)	SINA Corp/China	Goldman Sachs	28,722
(12,409)	SINA Corp/China	Morgan Stanley	(29,533)
45,474	Sinclair Broadcast Group Inc 'A'	Goldman Sachs	21,152
48,501	Sinclair Broadcast Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	21,379
25,632	Sinclair Broadcast Group Inc 'A'	Morgan Stanley	13,585
147,147	Sirius XM Holdings Inc	Morgan Stanley	37,522
37,163	SITE Centers Corp (Reit)	Goldman Sachs	46,850
39,343	SITE Centers Corp (Reit)	Morgan Stanley	48,392
(24,841)	SiteOne Landscape Supply Inc	Bank of America Merrill Lynch	85,950
(66,470)	SITO Mobile Ltd	Goldman Sachs	8,641
(14,402)	SITO Mobile Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,872
6,952	Six Flags Entertainment Corp	Goldman Sachs	14,708
3,066	Six Flags Entertainment Corp	Morgan Stanley	2,759
(8,739)	Six Flags Entertainment Corp	Goldman Sachs	(21,411)
(6,555)	Six Flags Entertainment Corp	Bank of America Merrill Lynch	(16,060)
13,921	SJW Group	Bank of America Merrill Lynch	(147,423)
(53,567)	Skechers U.S.A. Inc 'A'	Morgan Stanley	(42,854)
(39,478)	Skyline Champion Corp	Bank of America Merrill Lynch	34,346
(25,834)	Skyline Champion Corp	Goldman Sachs	22,476
(13,011)	Skyline Champion Corp	Morgan Stanley	13,271
12,323	Skyworks Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	(19,594)
24,694	SL Green Realty Corp (Reit)	Morgan Stanley	56,024
(7,916)	Sleep Number Corp	Bank of America Merrill Lynch	(6,649)
(422,543)	SLM Corp	Bank of America Merrill Lynch	157,054
(64,321)	SLM Corp	Morgan Stanley	(14,794)
20,205	SM Energy Co	Bank of America Merrill Lynch	(29,297)
34,766	SM Energy Co	Goldman Sachs	(50,411)
216,453	Smart & Final Stores Inc	Bank of America Merrill Lynch	(54,113)
(26,281)	SMART Global Holdings Inc	Goldman Sachs	(87,910)
(7,587)	SMART Global Holdings Inc	Morgan Stanley	(12,025)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
36,186	SmartFinancial Inc	Bank of America Merrill Lynch	-
28,719	SmartFinancial Inc	Goldman Sachs	-
20,536	SmartFinancial Inc	Morgan Stanley	(12,322)
(1,000)	Smartsheet Inc 'A'	Goldman Sachs	(1,618)
(2,261)	Smartsheet Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1,831
155,645	Snap Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(70,040)
41,687	Snap-on Inc	Morgan Stanley	113,389
10,263	Snap-on Inc	Bank of America Merrill Lynch	6,774
6,982	Snap-on Inc	Goldman Sachs	4,608
(16,349)	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA ADR	Goldman Sachs	15,859
(33,508)	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA ADR	Morgan Stanley	(39,539)
4,964	Sohu.com Ltd ADR	Goldman Sachs	1,787
11,420	Sohu.com Ltd ADR	Morgan Stanley	1,599
(970)	SolarEdge Technologies Inc	Goldman Sachs	(1,765)
(2,181)	SolarEdge Technologies Inc	Morgan Stanley	(829)
98,142	Sonic Automotive Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(166,841)
70,379	Sonic Automotive Inc 'A'	Goldman Sachs	(119,644)
13,954	Sonic Automotive Inc 'A'	Morgan Stanley	(14,512)
(718)	Sonoco Products Co	Goldman Sachs	(136)
(1,039)	Sonoco Products Co	Bank of America Merrill Lynch	(197)
(10,550)	Sonoco Products Co	Morgan Stanley	(4,220)
157,779	Sonos Inc	Morgan Stanley	-
11,912	Sonos Inc	Goldman Sachs	6,351
4,368	Sotheby's	Goldman Sachs	218
(70,201)	Sotheby's	Bank of America Merrill Lynch	(3,510)
25,048	Sotheby's	Morgan Stanley	34,065
(58,382)	South Jersey Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	20,434
(77,154)	South Jersey Industries Inc	Morgan Stanley	59,409
(45,399)	South Jersey Industries Inc	Goldman Sachs	15,890
(3,495)	South State Corp	Goldman Sachs	(10,800)
12,905	South State Corp	Bank of America Merrill Lynch	39,876
(21,338)	South State Corp	Morgan Stanley	(73,616)
(23,301)	Southern Co/The	Goldman Sachs	11,417
(101,324)	Southern Co/The	Morgan Stanley	(98,284)
(138,801)	Southern Co/The	Bank of America Merrill Lynch	68,012
13,933	Southern Copper Corp	Goldman Sachs	(65,624)
73,181	Southern Copper Corp	Morgan Stanley	66,595
(25,513)	Southern Copper Corp	Bank of America Merrill Lynch	120,166
(37,018)	Southern Copper Corp	Goldman Sachs	174,355
(38,857)	Southern Copper Corp	Morgan Stanley	(35,360)
9,051	Southern First Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	8,960
1,342	Southern First Bancshares Inc	Morgan Stanley	470
6,846	Southern First Bancshares Inc	Goldman Sachs	6,778
(1,290)	Southern Missouri Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,000)
(746)	Southern Missouri Bancorp Inc	Goldman Sachs	(1,156)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(6,415)	Southern National Bancorp of Virginia Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,283)
(2,675)	Southern National Bancorp of Virginia Inc	Goldman Sachs	(535)
(107,809)	Southside Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	(51,748)
(1,813)	Southside Bancshares Inc	Goldman Sachs	(870)
12,290	Southwest Airlines Co	Goldman Sachs	9,218
50,682	Southwest Airlines Co	Bank of America Merrill Lynch	38,012
20,555	Southwest Airlines Co	Morgan Stanley	26,722
2,706	Southwest Gas Holdings Inc	Morgan Stanley	(15,884)
15,067	Southwest Gas Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(111,345)
1,190	Southwest Gas Holdings Inc	Goldman Sachs	(8,794)
11,869	Southwestern Energy Co	Goldman Sachs	(6,884)
22,575	Southwestern Energy Co	Bank of America Merrill Lynch	(13,094)
(34,835)	Southwestern Energy Co	Morgan Stanley	9,057
44,035	Spark Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	156,765
(1,613)	Spark Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(2,468)
(150,841)	Spartan Motors Inc	Bank of America Merrill Lynch	72,404
(50,798)	Spartan Motors Inc	Goldman Sachs	24,383
7,549	Spectrum Brands Holdings Inc	Goldman Sachs	(67,790)
13,623	Spectrum Brands Holdings Inc	Morgan Stanley	(24,930)
39,480	Spectrum Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	52,903
16,664	Spectrum Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	22,330
11,116	Spectrum Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	10,671
15,311	Speedway Motorsports Inc	Bank of America Merrill Lynch	9,033
24,877	Speedway Motorsports Inc	Goldman Sachs	14,134
7,092	Speedway Motorsports Inc	Morgan Stanley	355
1,643	Spero Therapeutics Inc	Goldman Sachs	702
(6,925)	Spire Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,125)
(15,890)	Spire Inc	Goldman Sachs	20,004
(1,705)	Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	4,808
(23,937)	Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	67,502
5,125	Spirit Airlines Inc	Goldman Sachs	50,123
10,997	Spirit Airlines Inc	Morgan Stanley	124,886
7,880	Spirit MTA REIT (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(5,201)
32,434	Spirit Realty Capital Inc (Reit)	Goldman Sachs	1,781
6,760	Spirit Realty Capital Inc (Reit)	Morgan Stanley	(456)
(272,175)	Spirit Realty Capital Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	112,953
9,204	Splunk Inc	Bank of America Merrill Lynch	59,458
10,924	Splunk Inc	Morgan Stanley	169,650
32,219	Spok Holdings Inc	Goldman Sachs	20,620
47,399	Spok Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	30,335
94,292	Sportsman's Warehouse Holdings Inc	Goldman Sachs	(12,861)
1,000	Spring Bank Pharmaceuticals	Goldman Sachs	192
305,772	Sprint Corp	Bank of America Merrill Lynch	67,270
341,118	Sprint Corp	Morgan Stanley	75,046
17,869	Sprint Corp	Goldman Sachs	3,931



保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
3,396	Sprouts Farmers Market Inc	Morgan Stanley	(12,078)
10,614	SPS Commerce Inc	Goldman Sachs	(80,030)
37,785	SPS Commerce Inc	Bank of America Merrill Lynch	(284,899)
6,112	SPS Commerce Inc	Morgan Stanley	7,029
(114,236)	SPX Corp	Bank of America Merrill Lynch	53,691
(23,808)	SPX Corp	Goldman Sachs	11,190
2,061	SPX Flow Inc	Goldman Sachs	(82)
313	SPX FLOW Inc	Bank of America Merrill Lynch	139
1,035	SPX Flow Inc	Morgan Stanley	1,480
(8,471)	Square Inc 'A'	Goldman Sachs	(5,607)
1,210	Square Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(4,901)
(37,567)	SRC Energy Inc	Goldman Sachs	37,943
(101,469)	SRC Energy Inc	Morgan Stanley	17,250
2,337	SS&C Technologies Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,290
(5,006)	STAAR Surgical Co	Bank of America Merrill Lynch	19,949
(3,628)	STAAR Surgical Co	Goldman Sachs	14,458
(2,642)	STAAR Surgical Co	Morgan Stanley	(2,444)
349,663	STAG Industrial Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	223,784
(3,533)	Stamps.com Inc	Bank of America Merrill Lynch	(38,863)
7,928	Standex International Corp	Bank of America Merrill Lynch	(13,319)
(1,851)	Stanley Black & Decker Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,518
(23,354)	Stanley Black & Decker Inc	Goldman Sachs	7,419
(12,838)	Stanley Black & Decker Inc	Morgan Stanley	(26,703)
(13,151)	Starbucks Corp	Goldman Sachs	60
(61,453)	Starbucks Corp	Bank of America Merrill Lynch	38,101
(40,044)	Starbucks Corp	Morgan Stanley	(52,057)
(11,882)	StarTek Inc	Goldman Sachs	(1,545)
(181,638)	StarTek Inc	Bank of America Merrill Lynch	(23,613)
(438,970)	Starwood Property Trust Inc (Reit)	Morgan Stanley	(223,875)
(355,939)	Starwood Property Trust Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(177,970)
(290,872)	State Auto Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(244,332)
(74,676)	State Bank Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	76,916
(920)	State Bank Financial Corp	Morgan Stanley	(83)
(2,479)	State Bank Financial Corp	Goldman Sachs	2,553
12,037	State Street Corp	Morgan Stanley	12,518
(40,531)	State Street Corp	Bank of America Merrill Lynch	(43,368)
35,421	Steel Dynamics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(176,397)
13,305	Steel Dynamics Inc	Goldman Sachs	(18,182)
2,270	Steel Dynamics Inc	Morgan Stanley	(5,493)
236,074	Steelcase Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(118,037)
(73,416)	Stericycle Inc	Bank of America Merrill Lynch	(186,477)
2,021	Steris Plc	Bank of America Merrill Lynch	2,243
31,647	Steris Plc	Goldman Sachs	35,674
(9,469)	Sterling Bancorp/DE	Goldman Sachs	(6,250)
(241,574)	Sterling Bancorp/DE	Bank of America Merrill Lynch	(159,439)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(462,296)	Sterling Bancorp/DE	Morgan Stanley	(480,788)
(292)	Stitch Fix Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(67)
(27,889)	Stitch Fix Inc 'A'	Morgan Stanley	(49,642)
12,625	Stitch Fix Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	2,904
(1,034)	Stock Yards Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	713
11,439	StoneCo Ltd 'A'	Goldman Sachs	(12,026)
16,436	StoneCo Ltd 'A'	Morgan Stanley	9,942
(15,040)	Stoneridge Inc	Bank of America Merrill Lynch	11,731
(4,727)	Stoneridge Inc	Goldman Sachs	3,787
55,233	STORE Capital Corp (Reit)	Goldman Sachs	54,681
219,189	STORE Capital Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	216,997
257,556	STORE Capital Corp (Reit)	Morgan Stanley	164,836
(19,720)	Stratasys Ltd	Goldman Sachs	9,466
(1,550)	Stratasys Ltd	Bank of America Merrill Lynch	744
(74,577)	Stratasys Ltd	Morgan Stanley	(14,170)
9,754	Strategic Education Inc	Bank of America Merrill Lynch	(35,992)
7,372	Strategic Education Inc	Goldman Sachs	(27,203)
(16,161)	Strattec Security Corp	Goldman Sachs	38,463
(31,130)	Stratus Properties Inc	Bank of America Merrill Lynch	13,075
(18,543)	Stratus Properties Inc	Goldman Sachs	7,788
(13,400)	Stratus Properties Inc	Morgan Stanley	12,328
32,291	Stryker Corp	Bank of America Merrill Lynch	94,613
21,654	Stryker Corp	Morgan Stanley	148,330
20,526	Stryker Corp	Goldman Sachs	63,220
(600)	Summit Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	240
191,299	Summit Hotel Properties Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	7,652
15,886	Summit Hotel Properties Inc (Reit)	Morgan Stanley	3,654
73,205	Summit Materials Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	19,765
3,690	Summit Materials Inc 'A'	Morgan Stanley	1,328
26,387	Summit Materials Inc 'A'	Goldman Sachs	(798)
(26,146)	Sun Communities Inc (Reit)	Goldman Sachs	(77,392)
(158,443)	Sun Hydraulics Corp	Bank of America Merrill Lynch	112,495
(38,148)	Sun Hydraulics Corp	Morgan Stanley	(78,203)
14,979	SunCoke Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(13,631)
3,071	SunCoke Energy Inc	Goldman Sachs	(2,795)
3,212	SunPower Corp	Goldman Sachs	(1,104)
(4,287)	Sunrun Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,444)
(131,759)	Sunrun Inc	Morgan Stanley	(259,565)
268,545	Sunstone Hotel Investors Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	85,847
5,856	Sunstone Hotel Investors Inc (Reit)	Goldman Sachs	1,874
129,437	Sunstone Hotel Investors Inc (Reit)	Morgan Stanley	12,844
13,686	SunTrust Banks Inc	Goldman Sachs	(8,348)
1,393	Superior Group of Cos Inc	Goldman Sachs	(293)
(46,344)	Superior Industries International Inc	Bank of America Merrill Lynch	46,807
(58,267)	Superior Industries International Inc	Goldman Sachs	42,184

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(2,726)	Supernus Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(6,824)
79,731	Surface Oncology Inc	Bank of America Merrill Lynch	11,162
25,837	Surface Oncology Inc	Goldman Sachs	3,617
41,376	Surgery Partners Inc	Bank of America Merrill Lynch	7,861
(49,647)	Surmodics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(66,527)
(9,524)	SVB Financial Group	Bank of America Merrill Lynch	(44,191)
(177,887)	Sykes Enterprises Inc	Bank of America Merrill Lynch	247,263
2,683	Synaptics Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,200
11,656	Synaptics Inc	Goldman Sachs	14,733
6,825	Synaptics Inc	Morgan Stanley	11,330
(27,847)	Synchronoss Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,063)
54,143	Syndax Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	7,580
39,877	Syndax Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	5,499
9,200	Syndax Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	1,472
(48,560)	Syneos Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	(100,519)
776	Syneos Health Inc	Morgan Stanley	2,390
(3,744)	Syneos Health Inc	Goldman Sachs	(7,750)
69,025	Synnex Corp	Bank of America Merrill Lynch	(7,593)
1,240	Synnex Corp	Morgan Stanley	3,170
642	Synnex Corp	Goldman Sachs	(71)
3,921	Synovus Financial Corp	Goldman Sachs	274
133,648	Synovus Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	9,355
5,607	Synovus Financial Corp	Morgan Stanley	9,476
(23,634)	Sysco Corp	Bank of America Merrill Lynch	(26,234)
(1,301)	Sysco Corp	Goldman Sachs	(1,444)
(29,715)	T-Mobile US Inc	Goldman Sachs	(24,018)
(83,320)	T2 Biosystems Inc	Morgan Stanley	(833)
(2,625)	T2 Biosystems Inc	Bank of America Merrill Lynch	683
(601)	Tableau Software Inc 'A'	Goldman Sachs	(11,432)
2,945	Tableau Software Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	17,965
(7,630)	Tableau Software Inc 'A'	Morgan Stanley	(116,358)
(666)	Tabula Rasa HealthCare Inc	Goldman Sachs	(5,974)
(8,363)	Tabula Rasa HealthCare Inc	Bank of America Merrill Lynch	(75,016)
(11,804)	Tabula Rasa HealthCare Inc	Morgan Stanley	(123,824)
(26,316)	Tactile Systems Technology Inc	Morgan Stanley	(35,263)
(20,089)	Tactile Systems Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	51,428
10,265	Tahoe Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	513
33,547	Tahoe Resources Inc	Morgan Stanley	2,348
46,959	Tahoe Resources Inc	Goldman Sachs	2,348
2,306	Tailored Brands Inc	Goldman Sachs	(2,122)
(61,703)	Tailored Brands Inc	Goldman Sachs	24,681
2,502	Tailored Brands Inc	Morgan Stanley	(535)
(6,395)	Take-Two Interactive Software Inc	Bank of America Merrill Lynch	12,662
13,358	Talend SA ADR	Goldman Sachs	(48,490)
9,413	Talend SA ADR	Morgan Stanley	11,766

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(12,920)	Tallgrass Energy LP	Bank of America Merrill Lynch	7,235
(1,687)	Tallgrass Energy LP	Morgan Stanley	(1,552)
604	Talos Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,619)
22,848	Talos Energy Inc	Morgan Stanley	(3,199)
15,206	Talos Energy Inc	Goldman Sachs	(39,220)
(1,951)	Tandem Diabetes Care Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,653)
17,338	Tanger Factory Outlet Centers Inc (Reit)	Morgan Stanley	9,883
(8,206)	Tanger Factory Outlet Centers Inc (Reit)	Goldman Sachs	(3,118)
(16,118)	Tapestry Inc	Bank of America Merrill Lynch	45,614
(35,358)	Targa Resources Corp	Bank of America Merrill Lynch	84,152
747	Target Corp	Goldman Sachs	299
73,442	Target Corp	Bank of America Merrill Lynch	(689,620)
49,558	Target Corp	Morgan Stanley	195,694
242	Taro Pharmaceutical Industries Ltd	Goldman Sachs	1,147
6,361	Taro Pharmaceutical Industries Ltd	Morgan Stanley	11,768
(6,661)	Taubman Centers Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(2,997)
161,871	Taylor Morrison Home Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	288,130
(65,874)	Taylor Morrison Home Corp 'A'	Morgan Stanley	(23,056)
18,262	Taylor Morrison Home Corp 'A'	Goldman Sachs	32,506
89,389	TCF Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	22,347
62,095	TCF Financial Corp	Goldman Sachs	15,524
17,697	TCF Financial Corp	Morgan Stanley	6,548
85,952	TD Ameritrade Holding Corp	Goldman Sachs	62,745
8,795	TD Ameritrade Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	6,420
68,315	TD Ameritrade Holding Corp	Morgan Stanley	111,353
48,803	TE Connectivity Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(43,923)
(8,700)	Team Inc	Bank of America Merrill Lynch	6,612
(88,858)	Team Inc	Goldman Sachs	60,090
10,336	Tech Data Corp	Bank of America Merrill Lynch	143,257
826	Tech Data Corp	Goldman Sachs	11,448
57,333	TechnipFMC Plc	Bank of America Merrill Lynch	(53,893)
4,717	TechnipFMC Plc	Goldman Sachs	(4,434)
5,813	TechnipFMC Plc	Morgan Stanley	3,197
29,309	Teekay Corp	Bank of America Merrill Lynch	(38,981)
24,027	Teekay Corp	Goldman Sachs	(31,956)
7,955	Teekay Corp	Morgan Stanley	1,830
42,624	TEGNA Inc	Bank of America Merrill Lynch	25,574
90,595	TEGNA Inc	Morgan Stanley	60,699
34,581	TEGNA Inc	Goldman Sachs	20,749
(7,045)	Teladoc Health Inc	Goldman Sachs	(42,562)
(2,098)	Teladoc Health Inc	Morgan Stanley	(18,945)
14,557	Telaria Inc	Goldman Sachs	134
(5,400)	Teledyne Technologies Inc	Goldman Sachs	24,732
(6,233)	Teledyne Technologies Inc	Morgan Stanley	(39,143)
5,019	Teledyne Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(22,987)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
305	Teledyne Technologies Inc	Goldman Sachs	(1,397)
152	Teledyne Technologies Inc	Morgan Stanley	955
(1,729)	Teleflex Inc	Goldman Sachs	(17,075)
(8,153)	Teleflex Inc	Bank of America Merrill Lynch	(96,124)
(422)	Teleflex Inc	Morgan Stanley	(8,351)
51,959	Telefonica Brasil SA ADR	Morgan Stanley	7,274
13,035	Telefonica Brasil SA ADR	Goldman Sachs	521
41,665	Telephone & Data Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	50,415
19,674	Telephone & Data Systems Inc	Morgan Stanley	29,314
(416,708)	Teligent Inc/NJ	Morgan Stanley	70,840
(32,016)	Teligent Inc/NJ	Bank of America Merrill Lynch	13,127
(41,022)	Tellurian Inc	Goldman Sachs	37,740
(122,765)	Tellurian Inc	Bank of America Merrill Lynch	112,944
(65,780)	Tellurian Inc	Morgan Stanley	10,525
(20,088)	Tempur Sealy International Inc	Goldman Sachs	(56,648)
106,604	Tenable Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	29,849
21,797	Tenable Holdings Inc	Goldman Sachs	6,103
9,442	Tenable Holdings Inc	Morgan Stanley	19,545
6,197	Tenet Healthcare Corp	Goldman Sachs	15,941
6,092	Tenet Healthcare Corp	Morgan Stanley	19,251
(15,599)	Tennant Co	Bank of America Merrill Lynch	3,432
836	Tenneco Inc 'A'	Morgan Stanley	443
57,585	Tenneco Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(12,093)
18,783	Tenneco Inc 'A'	Goldman Sachs	3,735
(5,630)	Teradyne Inc	Goldman Sachs	877
(82,784)	Terex Corp	Bank of America Merrill Lynch	(142,388)
(10,140)	Terex Corp	Goldman Sachs	(17,441)
142,776	TerraForm Power Inc 'A'	Morgan Stanley	22,844
8,091	Terreno Realty Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	3,236
898	TESARO Inc	Goldman Sachs	(554)
(7,431)	Tesla Inc	Goldman Sachs	56,441
9,571	Tetra Tech Inc	Goldman Sachs	(47,376)
61,158	Tetra Tech Inc	Bank of America Merrill Lynch	(302,732)
6,751	Tetra Tech Inc	Morgan Stanley	(3,038)
(36,139)	TETRA Technologies Inc	Goldman Sachs	9,787
(34,752)	TETRA Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	11,121
127,094	Tetraphase Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(19,064)
120,560	Tetraphase Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(18,084)
71,332	Tetraphase Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(3,567)
7,820	Texas Capital Bancshares Inc	Goldman Sachs	4,747
5,311	Texas Capital Bancshares Inc	Morgan Stanley	6,479
1,094	Texas Capital Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,022)
997	Texas Instruments Inc	Morgan Stanley	2,881
34,052	Texas Instruments Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,022
8,071	Texas Roadhouse Inc	Goldman Sachs	14,564

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
1,343	Texas Roadhouse Inc	Morgan Stanley	2,525
131,954	Texas Roadhouse Inc	Bank of America Merrill Lynch	205,848
(3,541)	Textainer Group Holdings Ltd	Goldman Sachs	(1,469)
19,075	TG Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(7,249)
3,654	TG Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(110)
11,520	TherapeuticsMD Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,613)
2,212	Theravance Biopharma Inc	Morgan Stanley	1,548
10,019	Theravance Biopharma Inc	Goldman Sachs	15,391
1,214	Thermo Fisher Scientific Inc	Bank of America Merrill Lynch	15,284
(85,287)	Third Point Reinsurance Ltd	Morgan Stanley	(20,469)
502	Thor Industries Inc	Goldman Sachs	(196)
3,865	Thor Industries Inc	Morgan Stanley	2,937
14,901	Thor Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,811)
(83,950)	Tier REIT Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(86,469)
(1,520)	Tiffany & Co	Goldman Sachs	22,297
128,196	Tile Shop Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,974)
19,163	Tilly's Inc 'A'	Goldman Sachs	(80,224)
31,339	TIM Participacoes SA ADR	Morgan Stanley	22,564
104,583	TIM Participacoes SA ADR	Goldman Sachs	(40,787)
4,857	Timberland Bancorp Inc/WA	Bank of America Merrill Lynch	(1,263)
6,222	Timberland Bancorp Inc/WA	Goldman Sachs	(1,227)
1,716	Timberland Bancorp Inc/WA	Morgan Stanley	309
37,540	Timken Co/The	Morgan Stanley	9,010
35,430	Timken Co/The	Goldman Sachs	(66,608)
24,699	Timken Co/The	Bank of America Merrill Lynch	(46,434)
75,027	TimkenSteel Corp	Bank of America Merrill Lynch	(34,512)
19,823	Titan Machinery Inc	Bank of America Merrill Lynch	73,147
19,813	Titan Machinery Inc	Goldman Sachs	73,110
13,644	Titan Machinery Inc	Morgan Stanley	62,626
(3,248)	Tivity Health Inc	Goldman Sachs	(10,783)
(7,737)	Tivity Health Inc	Morgan Stanley	(21,199)
(37,478)	TiVo Corp	Bank of America Merrill Lynch	12,743
(2,694)	TiVo Corp	Goldman Sachs	916
52,700	TJX Cos Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	(239,785)
30,005	TJX Cos Inc/The	Morgan Stanley	61,810
20,757	Tocagen Inc	Goldman Sachs	7,436
1,873	Toll Brothers Inc	Morgan Stanley	1,442
3,087	TopBuild Corp	Morgan Stanley	3,581
(88,196)	Torchmark Corp	Morgan Stanley	(128,766)
38,989	Toro Co/The	Goldman Sachs	35,630
25,461	Toro Co/The	Morgan Stanley	40,483
47,398	Total System Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(84,368)
2,651	Total System Services Inc	Goldman Sachs	(4,719)
17,375	Total System Services Inc	Morgan Stanley	80,885
143,200	Tower International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(335,088)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
11,470	Tower Semiconductor Ltd	Goldman Sachs	6,882
59,559	Tower Semiconductor Ltd	Morgan Stanley	57,772
(2,985)	Town Sports International Holdings Inc	Goldman Sachs	1,075
(46,373)	Town Sports International Holdings Inc	Morgan Stanley	1,391
11,210	Towne Bank/Portsmouth VA	Bank of America Merrill Lynch	3,027
34,668	Townsquare Media Inc 'A'	Goldman Sachs	11,440
48,543	Townsquare Media Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	16,019
5,910	Townsquare Media Inc 'A'	Morgan Stanley	2,187
22,086	TPG RE Finance Trust Inc (Reit)	Goldman Sachs	(221)
16,280	TPG RE Finance Trust Inc (Reit)	Morgan Stanley	1,954
328,402	TPG RE Finance Trust Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(3,284)
(148,730)	TPI Composites Inc	Bank of America Merrill Lynch	(374,800)
(11,453)	TPI Composites Inc	Goldman Sachs	(28,862)
6,656	Tractor Supply Co	Bank of America Merrill Lynch	13,179
3,905	Tractor Supply Co	Goldman Sachs	7,735
(7,087)	Trade Desk Inc/The 'A'	Goldman Sachs	(172,012)
(480)	Trade Desk Inc/The 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(8,983)
(9,849)	Trade Desk Inc/The 'A'	Morgan Stanley	(219,042)
(7,667)	TransDigm Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(162,464)
72,888	Transocean Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(21,138)
28,469	TransUnion	Bank of America Merrill Lynch	56,084
2,750	TransUnion	Goldman Sachs	5,383
(10,397)	TravelCenters of America LLC	Bank of America Merrill Lynch	(2,911)
(79,899)	TravelCenters of America LLC	Goldman Sachs	(22,372)
(193,091)	Travelport Worldwide Ltd	Goldman Sachs	505
3,253	Travelzoo	Bank of America Merrill Lynch	33
7,517	Travelzoo	Goldman Sachs	530
(133,701)	Trecora Resources	Bank of America Merrill Lynch	(105,624)
(3,656)	Trecora Resources	Morgan Stanley	(3,619)
(28,517)	Tredegar Corp	Bank of America Merrill Lynch	15,970
(15,161)	TreeHouse Foods Inc	Bank of America Merrill Lynch	(21,074)
(641)	Trex Co Inc	Goldman Sachs	(2,132)
(161,324)	TRI Pointe Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(183,103)
(125,217)	TRI Pointe Group Inc	Morgan Stanley	(51,965)
(251,873)	TRI Pointe Group Inc	Goldman Sachs	(257,802)
61,302	Tribune Media Co 'A'	Bank of America Merrill Lynch	90,114
15,609	Tribune Media Co 'A'	Goldman Sachs	22,945
(99,647)	Tribune Publishing Co	Bank of America Merrill Lynch	22,919
(1,729)	Tribune Publishing Co	Goldman Sachs	398
(3,476)	Tricida Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,989
(3,495)	TriCo Bancshares	Goldman Sachs	(5,156)
39,886	TriMas Corp	Bank of America Merrill Lynch	(59,430)
41,526	TriMas Corp	Goldman Sachs	(58,067)
16,724	TriMas Corp	Morgan Stanley	1,672
(28,973)	Trimble Inc	Goldman Sachs	(56,497)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(128,303)	Trimble Inc	Bank of America Merrill Lynch	(250,191)
(63,446)	Trimble Inc	Morgan Stanley	(82,480)
796	TriNet Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	119
1,543	TriNet Group Inc	Morgan Stanley	2,608
3,429	TriNet Group Inc	Goldman Sachs	514
(32,708)	Trinity Industries Inc	Goldman Sachs	(56,912)
(110,676)	Trinity Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(192,576)
(62,977)	Trinity Industries Inc	Morgan Stanley	(76,832)
(19,342)	Trinity Place Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,868)
(1,221)	Trinity Place Holdings Inc	Goldman Sachs	(244)
5,511	Trinseo SA	Bank of America Merrill Lynch	3,031
(23,648)	Trinseo SA	Goldman Sachs	(13,006)
(25,181)	Trinseo SA	Morgan Stanley	(89,141)
3,536	TripAdvisor Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,839)
2,947	TripAdvisor Inc	Goldman Sachs	(1,532)
1,501	TripAdvisor Inc	Morgan Stanley	(1,202)
(8,075)	Triple-S Management Corp 'B'	Goldman Sachs	(2,616)
78,357	TriState Capital Holdings Inc	Goldman Sachs	(11,754)
20,595	TriState Capital Holdings Inc	Morgan Stanley	4,325
313,597	TriState Capital Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(47,040)
(27,963)	Triton International Ltd/Bermuda	Goldman Sachs	31,319
(39,025)	Triton International Ltd/Bermuda	Morgan Stanley	(3,512)
(183,106)	Triumph Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(142,823)
(49,353)	Triumph Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	96,732
(176,372)	Tronox Ltd 'A'	Goldman Sachs	188,718
108,474	TrueCar Inc	Bank of America Merrill Lynch	(13,017)
36,812	TrueCar Inc	Morgan Stanley	10,675
63,265	TrueCar Inc	Goldman Sachs	(7,592)
(11,677)	Trupanion Inc	Goldman Sachs	(55,232)
(4,776)	Trupanion Inc	Morgan Stanley	(11,224)
15,693	TTM Technologies Inc	Goldman Sachs	(5,336)
3,876	TTM Technologies Inc	Morgan Stanley	(1,202)
(67,807)	TTM Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	23,054
(25,986)	Tucows Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(67,564)
(49,776)	Tupperware Brands Corp	Bank of America Merrill Lynch	(57,740)
(865)	Tupperware Brands Corp	Goldman Sachs	(1,003)
2,455	Turning Point Brands Inc	Morgan Stanley	(6,236)
11,088	Turning Point Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	(62,758)
3,355	Turning Point Brands Inc	Goldman Sachs	(18,989)
(46,139)	Tutor Perini Corp	Goldman Sachs	(17,135)
(3,891)	Twenty-First Century Fox Inc 'A'	Goldman Sachs	(560)
7,621	Twilio Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	32,770
7,558	Twin Disc Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,988)
17,707	Twitter Inc	Bank of America Merrill Lynch	(41,346)
(120,444)	Two Harbors Investment Corp (Reit)	Goldman Sachs	(7,227)



保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
47,188	Two Harbors Investment Corp (Reit)	Goldman Sachs	2,831
(11,374)	Two Harbors Investment Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(682)
48,303	Two Harbors Investment Corp (Reit)	Morgan Stanley	12,076
(5,461)	Tyler Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(14,581)
1,283	Tyler Technologies Inc	Morgan Stanley	8,558
34,210	Tyson Foods Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(13,342)
(983)	Ubiquiti Networks Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,101
25,857	UBS Group AG	Morgan Stanley	399
55,586	UBS Group AG	Goldman Sachs	(11,243)
(116,434)	UDR Inc (Reit)	Goldman Sachs	(220,594)
(23,618)	UDR Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(47,236)
(31,616)	UDR Inc (Reit)	Morgan Stanley	(39,836)
(22,328)	UFP Technologies Inc	Goldman Sachs	7,592
(2,253)	UFP Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	766
(16,458)	UGI Corp	Goldman Sachs	(1,533)
40,640	UGI Corp	Bank of America Merrill Lynch	-
4,470	UGI Corp	Goldman Sachs	-
5,403	UGI Corp	Morgan Stanley	2,918
7,290	Ultimate Software Group Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	81,648
446	Ultimate Software Group Inc/The	Goldman Sachs	4,995
(80,872)	Ultra Clean Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(25,879)
2,054	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	Goldman Sachs	5,279
(8,361)	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	Bank of America Merrill Lynch	(21,488)
(186,376)	Ultrapar Participacoes SA ADR	Morgan Stanley	(80,142)
(120,093)	UMB Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(136,906)
50,112	Umpqua Holdings Corp	Goldman Sachs	(14,532)
(22,452)	Umpqua Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	6,511
(21,003)	Under Armour Inc 'A'	Morgan Stanley	(52,718)
(55,949)	Under Armour Inc 'A'	Goldman Sachs	(91,884)
(48,529)	Unifi Inc	Bank of America Merrill Lynch	(35,426)
2,251	UniFirst Corp/MA	Bank of America Merrill Lynch	5,200
2,786	UniFirst Corp/MA	Goldman Sachs	6,436
1,103	UniFirst Corp/MA	Morgan Stanley	5,989
(465,202)	Union Bankshares Corp	Bank of America Merrill Lynch	(265,165)
4,752	Union Pacific Corp	Morgan Stanley	45,429
(62,080)	Union Pacific Corp	Bank of America Merrill Lynch	(103,674)
13,219	Unit Corp	Goldman Sachs	(20,357)
(127,103)	United Bankshares Inc/WV	Bank of America Merrill Lynch	(90,243)
(127,432)	United Bankshares Inc/WV	Goldman Sachs	(117,376)
42,575	United Community Banks Inc/GA	Goldman Sachs	(7,664)
217,506	United Community Banks Inc/GA	Bank of America Merrill Lynch	(39,151)
6,154	United Community Banks Inc/GA	Morgan Stanley	2,708
465,901	United Community Financial Corp/OH	Bank of America Merrill Lynch	23,295
41,867	United Community Financial Corp/OH	Goldman Sachs	2,093
69,321	United Community Financial Corp/OH	Morgan Stanley	14,557

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(42,794)	United Fire Group Inc	Goldman Sachs	(111,520)
(29,768)	United Insurance Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(5,358)
(11,378)	United Insurance Holdings Corp	Goldman Sachs	(2,048)
17,135	United Natural Foods Inc	Bank of America Merrill Lynch	(27,073)
43,780	United Natural Foods Inc	Morgan Stanley	(13,572)
(11,628)	United Parcel Service Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(41,163)
(12,806)	United Parcel Service Inc 'B'	Morgan Stanley	(67,872)
(6,072)	United Rentals Inc	Bank of America Merrill Lynch	14,148
2,743	United States Cellular Corp	Bank of America Merrill Lynch	7,077
(2,364)	United States Lime & Minerals Inc	Goldman Sachs	2,979
(2,615)	United States Lime & Minerals Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,295
(22,935)	United States Steel Corp	Goldman Sachs	39,223
(8,032)	United States Steel Corp	Morgan Stanley	18,956
(10,625)	United States Steel Corp	Bank of America Merrill Lynch	44,519
(28,269)	United Technologies Corp	Bank of America Merrill Lynch	269,121
10,300	United Therapeutics Corp	Bank of America Merrill Lynch	23,896
932	UnitedHealth Group Inc	Goldman Sachs	1,358
842	UnitedHealth Group Inc	Morgan Stanley	(1,040)
(116,173)	Uniti Group Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(144,055)
(188,090)	Uniti Group Inc (Reit)	Morgan Stanley	(212,542)
(45,891)	Unitil Corp	Bank of America Merrill Lynch	(108,303)
861	Unity Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,231)
1,207	Unity Bancorp Inc	Morgan Stanley	109
9,066	Unity Biotechnology Inc	Goldman Sachs	1,479
(3,855)	Univar Inc	Morgan Stanley	2,043
(26,746)	Univar Inc	Goldman Sachs	44,131
1,411	Universal Corp/VA	Bank of America Merrill Lynch	(5,418)
8,412	Universal Corp/VA	Goldman Sachs	(32,085)
2,577	Universal Corp/VA	Morgan Stanley	(5,051)
(22,334)	Universal Display Corp	Goldman Sachs	(11,167)
(42,102)	Universal Electronics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,841)
(32,715)	Universal Forest Products Inc	Goldman Sachs	22,573
75,066	Universal Forest Products Inc	Bank of America Merrill Lynch	(51,796)
(37,163)	Universal Forest Products Inc	Morgan Stanley	(4,831)
(56,097)	Universal Health Realty Income Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(95,365)
(12,330)	Universal Health Services Inc 'B'	Goldman Sachs	(118,615)
(10,043)	Universal Health Services Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(96,614)
(27,573)	Universal Health Services Inc 'B'	Morgan Stanley	(159,648)
(18,340)	Universal Insurance Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,017)
49,114	Universal Logistics Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(98,228)
38,939	Universal Stainless & Alloy Products Inc	Bank of America Merrill Lynch	(54,125)
4,314	Universal Stainless & Alloy Products Inc	Morgan Stanley	(1,596)
7,547	Universal Stainless & Alloy Products Inc	Goldman Sachs	(10,490)
3,899	Univest Corp of Pennsylvania	Morgan Stanley	2,417
94,543	Univest Corp of Pennsylvania	Bank of America Merrill Lynch	20,799

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
51,213	Univest Corp of Pennsylvania	Goldman Sachs	12,923
26,285	Unum Group	Goldman Sachs	(20,502)
92,746	Unum Group	Bank of America Merrill Lynch	(72,342)
31,430	Unum Group	Morgan Stanley	24,830
88,012	Unum Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(127,617)
1,520	Upland Software Inc	Morgan Stanley	2,538
5,793	Upland Software Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,909)
4,314	Upland Software Inc	Goldman Sachs	(4,400)
52,158	Urban One Inc	Morgan Stanley	1,565
9,869	Urban One Inc	Goldman Sachs	1,678
13,142	Urban Outfitters Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,885)
42,301	US Auto Parts Network Inc	Morgan Stanley	3,384
11,340	US Auto Parts Network Inc	Bank of America Merrill Lynch	567
20,358	US Auto Parts Network Inc	Goldman Sachs	1,018
(130,730)	US Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	61,443
1,782	US Concrete Inc	Goldman Sachs	351
(7,392)	US Ecology Inc	Bank of America Merrill Lynch	17,741
(7,434)	US Foods Holding Corp	Goldman Sachs	(4,557)
(84,121)	US Foods Holding Corp	Morgan Stanley	(8,412)
(55,790)	US Foods Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	(24,548)
17,591	US Physical Therapy Inc	Bank of America Merrill Lynch	46,264
8,972	US Physical Therapy Inc	Goldman Sachs	24,783
3,886	US Physical Therapy Inc	Morgan Stanley	19,041
(38,429)	US Silica Holdings Inc	Morgan Stanley	28,053
(20,261)	US Silica Holdings Inc	Goldman Sachs	24,313
6,486	US Xpress Enterprises Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,232)
10,534	US Xpress Enterprises Inc 'A'	Goldman Sachs	(2,001)
10,223	US Xpress Enterprises Inc 'A'	Morgan Stanley	1,738
(31,027)	USA Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,482
(38,467)	USA Technologies Inc	Morgan Stanley	5,001
(5,716)	USA Truck Inc	Bank of America Merrill Lynch	10,632
(9,295)	USA Truck Inc	Goldman Sachs	17,289
(1,255)	USANA Health Sciences Inc	Goldman Sachs	(2,070)
(2,047)	USANA Health Sciences Inc	Morgan Stanley	(4,872)
(612)	USANA Health Sciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	(704)
(586)	Vail Resorts Inc	Goldman Sachs	(8,667)
(6,724)	Vail Resorts Inc	Morgan Stanley	(97,162)
1,598	Vail Resorts Inc	Bank of America Merrill Lynch	23,634
599	Vail Resorts Inc	Goldman Sachs	8,859
3,077	Vale SA ADR	Morgan Stanley	431
38,593	Vale SA ADR	Goldman Sachs	(59,047)
(7,616)	Valero Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	33,663
(3,868)	Valhi Inc	Bank of America Merrill Lynch	39
(147,325)	Valley National Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	(89,868)
1,000	Valley National Bancorp	Morgan Stanley	660

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(691)	Valmont Industries Inc	Goldman Sachs	1,271
(52,532)	Valmont Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	96,659
(38,711)	Valmont Industries Inc	Morgan Stanley	(106,455)
7,261	Valvoline Inc	Goldman Sachs	3,122
71,673	Valvoline Inc	Morgan Stanley	21,502
(29,244)	Valvoline Inc	Bank of America Merrill Lynch	(12,575)
(2,289)	Varex Imaging Corp	Goldman Sachs	(3,250)
(77,223)	Varex Imaging Corp	Bank of America Merrill Lynch	(109,657)
(33,748)	Varex Imaging Corp	Morgan Stanley	(63,446)
13,606	Varian Medical Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	58,098
5,956	Varonis Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,752)
3,329	Varonis Systems Inc	Goldman Sachs	(2,097)
5,245	Varonis Systems Inc	Morgan Stanley	22,816
85,913	Vector Group Ltd	Goldman Sachs	(140,607)
(120,107)	Vector Group Ltd	Morgan Stanley	112,901
547,290	Vector Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(903,029)
29,127	Vectren Corp	Goldman Sachs	5,243
95,137	Vectren Corp	Morgan Stanley	4,757
(674)	Vectren Corp	Bank of America Merrill Lynch	(121)
(28,005)	Vectren Corp	Goldman Sachs	(5,041)
3,886	Vectrus Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,565)
3,783	Vectrus Inc	Goldman Sachs	(2,497)
2,971	Vectrus Inc	Morgan Stanley	(713)
(40,901)	Veeco Instruments Inc	Bank of America Merrill Lynch	(12,679)
17,120	Veeva Systems Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	111,280
52,346	Venator Materials Plc	Morgan Stanley	(20,938)
(7,959)	Ventas Inc (Reit)	Morgan Stanley	(9,073)
(16,939)	Veoneer Inc	Goldman Sachs	9,994
(3,982)	Veoneer Inc	Morgan Stanley	(2,787)
(93,920)	Vera Bradley Inc	Bank of America Merrill Lynch	124,914
(2,658)	Vera Bradley Inc	Goldman Sachs	3,535
123,186	Veracyte Inc	Bank of America Merrill Lynch	(186,011)
23,043	Veracyte Inc	Goldman Sachs	(29,603)
(41,642)	VEREIT Inc (Reit)	Goldman Sachs	(1,249)
(1,307,270)	VEREIT Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(39,218)
(723,341)	VEREIT Inc (Reit)	Morgan Stanley	(115,735)
(7,815)	Vericel Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,266)
(56,161)	Verint Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,739)
(9,330)	Verint Systems Inc	Morgan Stanley	(17,914)
25,431	VeriSign Inc	Bank of America Merrill Lynch	27,974
(9,905)	Verisk Analytics Inc	Goldman Sachs	(196)
(81,043)	Verisk Analytics Inc	Bank of America Merrill Lynch	20,261
(19,134)	Verisk Analytics Inc	Morgan Stanley	(68,308)
(3,635)	Veritiv Corp	Bank of America Merrill Lynch	(5,852)
(48,559)	Verizon Communications Inc	Bank of America Merrill Lynch	(36,905)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
10,359	Versum Materials Inc	Goldman Sachs	5,283
8,372	Versum Materials Inc	Morgan Stanley	11,470
7,950	Vertex Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	105,894
28,960	VF Corp	Bank of America Merrill Lynch	(107,152)
7,731	VF Corp	Morgan Stanley	10,823
28,257	Viacom Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(33,626)
6,169	Viacom Inc 'A'	Goldman Sachs	(7,341)
43,188	Viacom Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(29,368)
48,956	Viacom Inc 'B'	Morgan Stanley	5,385
(30,225)	Viad Corp	Bank of America Merrill Lynch	26,598
2,062	ViaSat Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,041)
(52,896)	ViaSat Inc	Goldman Sachs	52,367
(8,150)	ViaSat Inc	Morgan Stanley	(6,846)
(66,798)	Viavi Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,008)
(6,429)	Vicor Corp	Goldman Sachs	5,079
(9,421)	Vicor Corp	Morgan Stanley	(10,646)
(15,177)	Vicor Corp	Bank of America Merrill Lynch	11,990
(31,261)	ViewRay Inc	Morgan Stanley	(8,128)
(9,260)	ViewRay Inc	Goldman Sachs	(3,837)
(33,105)	Viking Therapeutics Inc	Goldman Sachs	16,884
(23,482)	Village Super Market Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(41,798)
(29,321)	Village Super Market Inc 'A'	Goldman Sachs	(52,000)
(14,891)	Vince Holding Corp	Morgan Stanley	(6,105)
(7,282)	Virtu Financial Inc 'A'	Goldman Sachs	4,966
(32,391)	Virtu Financial Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	14,576
(1,891)	Virtu Financial Inc 'A'	Morgan Stanley	567
406	Virtus Investment Partners Inc	Goldman Sachs	(398)
87,573	Vishay Intertechnology Inc	Goldman Sachs	101,585
84,893	Vishay Intertechnology Inc	Bank of America Merrill Lynch	98,476
117,740	Vishay Intertechnology Inc	Morgan Stanley	124,804
(4,595)	Visteon Corp	Goldman Sachs	24,675
(11,742)	Visteon Corp	Morgan Stanley	64,698
(23,464)	Visteon Corp	Bank of America Merrill Lynch	126,002
(18,953)	Vistra Energy Corp	Goldman Sachs	(1,327)
(2,737)	Vivint Solar Inc	Morgan Stanley	(109)
(22,377)	Vivint Solar Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,357)
1,821	VMware Inc 'A'	Morgan Stanley	23,400
11,712	VMware Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	94,984
11,635	Vocera Communications Inc	Bank of America Merrill Lynch	32,694
14,202	Vocera Communications Inc	Goldman Sachs	40,255
1,372	Vocera Communications Inc	Morgan Stanley	4,089
(21,712)	Vonage Holdings Corp	Goldman Sachs	(1,737)
(7,913)	Vonage Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(633)
(39,455)	Vornado Realty Trust (Reit)	Goldman Sachs	(22,451)
(69,582)	Vornado Realty Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(48,707)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(11,465)	Vornado Realty Trust (Reit)	Morgan Stanley	(19,605)
(43,044)	VOXX International Corp	Goldman Sachs	(430)
(7,886)	VOXX International Corp	Bank of America Merrill Lynch	(79)
66,678	Voya Financial Inc	Morgan Stanley	85,348
3,599	Voyager Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(936)
(2,290)	VSE Corp	Goldman Sachs	2,611
(49,594)	VSE Corp	Bank of America Merrill Lynch	56,537
25,891	Vulcan Materials Co	Bank of America Merrill Lynch	(20,972)
33,266	W&T Offshore Inc	Bank of America Merrill Lynch	(20,958)
28,202	W&T Offshore Inc	Goldman Sachs	(17,767)
(66,295)	W&T Offshore Inc	Morgan Stanley	(3,978)
34,970	Wabash National Corp	Goldman Sachs	564
58,989	Wabash National Corp	Morgan Stanley	17,697
43,145	Wabash National Corp	Bank of America Merrill Lynch	431
(46,616)	WABCO Holdings Inc	Morgan Stanley	(94,630)
(12,654)	WABCO Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(58,841)
(7,446)	WABCO Holdings Inc	Goldman Sachs	(34,624)
(5,845)	Wabtec Corp	Morgan Stanley	(39,512)
(18,714)	Wabtec Corp	Goldman Sachs	(120,144)
(5,835)	Wabtec Corp	Bank of America Merrill Lynch	(37,461)
(263,042)	Waddell & Reed Financial Inc 'A'	Goldman Sachs	(189,390)
(50,061)	Waddell & Reed Financial Inc 'A'	Morgan Stanley	(13,516)
40,408	WageWorks Inc	Bank of America Merrill Lynch	(130,922)
904	WageWorks Inc	Morgan Stanley	(796)
(1,902)	Walgreens Boots Alliance Inc	Goldman Sachs	(3,293)
(44,216)	Walgreens Boots Alliance Inc	Bank of America Merrill Lynch	(114,077)
(8,886)	Walgreens Boots Alliance Inc	Morgan Stanley	(36,077)
29,848	Walker & Dunlop Inc	Bank of America Merrill Lynch	17,312
2,526	Walmart Inc	Goldman Sachs	7,740
5,452	Walt Disney Co/The	Goldman Sachs	(1,418)
29,171	Walt Disney Co/The	Morgan Stanley	139,146
(56,832)	Walt Disney Co/The	Bank of America Merrill Lynch	14,776
(100,276)	Warrior Met Coal Inc	Goldman Sachs	219,604
(38,445)	Warrior Met Coal Inc	Morgan Stanley	(48,825)
397,876	Washington Federal Inc	Bank of America Merrill Lynch	306,365
38,408	Washington Federal Inc	Goldman Sachs	30,497
39,601	Washington Federal Inc	Morgan Stanley	46,333
(259,506)	Washington Real Estate Investment Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	293,242
(75,022)	Washington Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	73,522
(25,894)	Washington Real Estate Investment Trust (Reit)	Goldman Sachs	29,327
(2,088)	Waste Connections Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,278)
9,230	Waste Management Inc	Bank of America Merrill Lynch	16,060
(3,432)	Waters Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,167

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(52,301)	Waterstone Financial Inc	Goldman Sachs	7,322
17,121	Watsco Inc	Bank of America Merrill Lynch	108,376
86,103	Watts Water Technologies Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(151,541)
(4,470)	WaVe Life Sciences Ltd	Morgan Stanley	(20,070)
(8,123)	Wayfair Inc 'A'	Morgan Stanley	(139,309)
(717)	WD-40 Co	Bank of America Merrill Lynch	(5,091)
12,018	Webster Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(15,984)
39,701	WEC Energy Group Inc	Goldman Sachs	25,471
22,186	WEC Energy Group Inc	Morgan Stanley	22,630
(23,845)	Weight Watchers International Inc	Morgan Stanley	(78,689)
3,425	Weight Watchers International Inc	Bank of America Merrill Lynch	925
(33,599)	Weight Watchers International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9,072)
54,443	Weingarten Realty Investors (Reit)	Morgan Stanley	42,466
3,764	Weingarten Realty Investors (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	3,576
(78,153)	Weis Markets Inc	Bank of America Merrill Lynch	33,606
(94,006)	Welbilt Inc	Bank of America Merrill Lynch	(47,943)
1,602	WellCare Health Plans Inc	Goldman Sachs	5,030
6,706	WellCare Health Plans Inc	Bank of America Merrill Lynch	21,057
6,192	WellCare Health Plans Inc	Morgan Stanley	58,948
(29,934)	Wells Fargo & Co	Bank of America Merrill Lynch	(40,411)
(15,221)	Welltower Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(29,529)
(13,507)	Welltower Inc (Reit)	Morgan Stanley	(22,151)
74,348	Wendy's Co/The	Goldman Sachs	46,839
43,959	Wendy's Co/The	Morgan Stanley	16,265
149,870	Wendy's Co/The	Bank of America Merrill Lynch	94,418
115,707	Werner Enterprises Inc	Bank of America Merrill Lynch	11,571
11,245	Werner Enterprises Inc	Goldman Sachs	1,125
8,456	Wesco Aircraft Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(16,574)
77,506	WESCO International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(19,377)
5,784	WESCO International Inc	Goldman Sachs	(1,446)
56,135	WESCO International Inc	Morgan Stanley	84,764
101,487	West Bancorporation Inc	Bank of America Merrill Lynch	(61,907)
52,469	West Bancorporation Inc	Goldman Sachs	(32,006)
35,669	West Bancorporation Inc	Morgan Stanley	(713)
(15,091)	West Pharmaceutical Services Inc	Goldman Sachs	(4,376)
(25,278)	West Pharmaceutical Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,331)
(8,054)	West Pharmaceutical Services Inc	Morgan Stanley	(25,612)
(39,437)	Westamerica Bancorporation	Goldman Sachs	(31,568)
(24,014)	Westamerica Bancorporation	Morgan Stanley	(15,369)
79,605	Western Alliance Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	(10,349)
24,652	Western Alliance Bancorp	Goldman Sachs	(3,205)
19,827	Western Alliance Bancorp	Morgan Stanley	16,258
(7,580)	Western Digital Corp	Morgan Stanley	23,119
(16,022)	Western New England Bancorp Inc	Goldman Sachs	(4,486)
(104,851)	Western New England Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(29,358)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
197,615	Western Union Co/The	Bank of America Merrill Lynch	(17,785)
3,077	Westrock Co	Goldman Sachs	3,600
109,559	Westrock Co	Bank of America Merrill Lynch	128,184
194,442	Westrock Co	Morgan Stanley	248,886
12,587	Westwood Holdings Group Inc	Goldman Sachs	(9,275)
1,553	Westwood Holdings Group Inc	Morgan Stanley	(1,444)
24,246	Westwood Holdings Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(27,883)
230	WEX Inc	Bank of America Merrill Lynch	(444)
8,282	WEX Inc	Morgan Stanley	24,161
7,301	WEX Inc	Goldman Sachs	(42,520)
20,786	Weyerhaeuser Co (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(2,079)
21,545	Whirlpool Corp	Bank of America Merrill Lynch	279,654
751	White Mountains Insurance Group Ltd	Goldman Sachs	14,577
43	White Mountains Insurance Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	159
2,585	White Mountains Insurance Group Ltd	Morgan Stanley	43,893
(783)	White Mountains Insurance Group Ltd	Goldman Sachs	(15,198)
(4,984)	White Mountains Insurance Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(96,739)
7,120	Whiting Petroleum Corp	Goldman Sachs	(29,690)
25,202	Whiting Petroleum Corp	Bank of America Merrill Lynch	(105,092)
8,276	WideOpenWest Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,855)
18,032	WideOpenWest Inc	Goldman Sachs	(19,294)
8,270	WideOpenWest Inc	Morgan Stanley	(5,045)
(18,950)	Willdan Group Inc	Morgan Stanley	(29,562)
(8,071)	Willdan Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,618)
140,556	William Lyon Homes 'A'	Bank of America Merrill Lynch	153,206
15,419	William Lyon Homes 'A'	Morgan Stanley	4,472
42,636	William Lyon Homes 'A'	Goldman Sachs	46,473
18,752	Williams Cos Inc/The	Goldman Sachs	8,438
92,525	Williams Cos Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	41,636
40,953	Williams Cos Inc/The	Morgan Stanley	37,267
(860)	Williams-Sonoma Inc	Goldman Sachs	(3,528)
300	Williams-Sonoma Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,512)
(804)	Williams-Sonoma Inc	Morgan Stanley	(1,640)
(9,882)	Willis Towers Watson Plc	Goldman Sachs	7,906
29,120	Willscot Corp	Bank of America Merrill Lynch	(50,086)
29,747	Willscot Corp	Goldman Sachs	(51,165)
13,964	Willscot Corp	Morgan Stanley	6,005
16,097	Windstream Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11,107)
24,647	Windstream Holdings Inc	Goldman Sachs	(17,006)
7,004	Windstream Holdings Inc	Morgan Stanley	280
31,246	Wingstop Inc	Bank of America Merrill Lynch	(51,243)
8,717	Wingstop Inc	Goldman Sachs	(14,296)
12,794	Wingstop Inc	Morgan Stanley	20,087
(4,767)	Winmark Corp	Bank of America Merrill Lynch	9,296
(1,649)	Winmark Corp	Goldman Sachs	2,227



保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
1,361	Winnebago Industries Inc	Goldman Sachs	1,068
10,347	Winthrop Realty Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(89,502)
6,561	Wintrust Financial Corp	Goldman Sachs	(6,430)
89,752	Wintrust Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(87,957)
8,314	Wintrust Financial Corp	Morgan Stanley	11,058
(4,665)	WisdomTree Investments Inc	Goldman Sachs	1,073
(367,991)	WisdomTree Investments Inc	Bank of America Merrill Lynch	84,638
(139,570)	WisdomTree Investments Inc	Morgan Stanley	29,310
(1,705)	Wix.com Ltd	Goldman Sachs	(1,040)
1,512	Wix.com Ltd	Bank of America Merrill Lynch	922
(1,058)	Wix.com Ltd	Morgan Stanley	(7,618)
49,635	Wolverine World Wide Inc	Bank of America Merrill Lynch	86,365
9,710	Wolverine World Wide Inc	Morgan Stanley	9,613
38,795	Wolverine World Wide Inc	Goldman Sachs	67,503
(8,902)	Woodward Inc	Goldman Sachs	(18,655)
(22,758)	Woodward Inc	Bank of America Merrill Lynch	(30,041)
(7,864)	Woodward Inc	Morgan Stanley	(15,492)
52,357	Workhorse Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,492)
8,904	Workhorse Group Inc	Goldman Sachs	(1,104)
21,706	Workhorse Group Inc	Morgan Stanley	(2,366)
101,245	Workiva Inc	Bank of America Merrill Lynch	(18,224)
21,054	World Fuel Services Corp	Morgan Stanley	13,896
91,050	World Fuel Services Corp	Bank of America Merrill Lynch	(184,832)
17,411	World Fuel Services Corp	Goldman Sachs	(35,344)
23,673	World Wrestling Entertainment Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	149,613
(27,066)	Worldpay Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(75,243)
(71,395)	Worldpay Inc 'A'	Morgan Stanley	(432,654)
6,614	Worthington Industries Inc	Goldman Sachs	11,367
(19,586)	WP Carey Inc (Reit)	Goldman Sachs	(12,559)
(126,074)	WP Carey Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(144,985)
(125,660)	WP Carey Inc (Reit)	Morgan Stanley	79,166
(9,941)	WPX Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	5,368
(61,196)	WR Berkley Corp	Bank of America Merrill Lynch	(93,630)
(125,959)	WR Berkley Corp	Morgan Stanley	(134,776)
37,808	WR Grace & Co	Bank of America Merrill Lynch	(58,602)
22,581	WR Grace & Co	Morgan Stanley	11,065
(30,425)	WSFS Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	304
501	WW Grainger Inc	Goldman Sachs	4,025
2,131	WW Grainger Inc	Bank of America Merrill Lynch	12,850
4,270	WW Grainger Inc	Morgan Stanley	60,591
(3,244)	Wyndham Destinations Inc	Bank of America Merrill Lynch	843
(15,239)	Wyndham Destinations Inc	Goldman Sachs	3,965
11,452	Wyndham Hotels & Resorts Inc	Bank of America Merrill Lynch	36,475
7,784	Wyndham Hotels & Resorts Inc	Goldman Sachs	24,792
2,230	Wyndham Hotels & Resorts Inc	Morgan Stanley	5,675

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(4,697)	Wynn Resorts Ltd	Goldman Sachs	(20,340)
(3,867)	Wynn Resorts Ltd	Morgan Stanley	(9,668)
57,457	Xcel Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	28,729
14,468	Xencor Inc	Bank of America Merrill Lynch	38,919
12,669	Xencor Inc	Goldman Sachs	34,080
694	Xencor Inc	Morgan Stanley	3,088
12,984	Xenia Hotels & Resorts Inc (Reit)	Goldman Sachs	2,207
25,754	Xenia Hotels & Resorts Inc (Reit)	Morgan Stanley	12,362
(69,226)	Xerox Corp	Bank of America Merrill Lynch	16,614
(13,005)	Xerox Corp	Morgan Stanley	(19,898)
1,013	Xilinx Inc	Goldman Sachs	2,563
14,359	Xilinx Inc	Bank of America Merrill Lynch	36,328
15,410	Xilinx Inc	Morgan Stanley	58,250
2,470	XO Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	469
(3,715)	XOMA Corp	Morgan Stanley	5,312
(20,299)	XOMA Corp	Bank of America Merrill Lynch	(29,231)
(925)	XOMA Corp	Goldman Sachs	(1,332)
(2,330)	XOMA Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4,590)
(106)	XOMA Corp	Goldman Sachs	(209)
(426)	XOMA Corp	Morgan Stanley	(839)
13,979	Xperi Corp	Morgan Stanley	(979)
(10,945)	XPO Logistics Inc	Bank of America Merrill Lynch	34,707
21,990	Xylem Inc/NY	Bank of America Merrill Lynch	30,126
(5,999)	Xylem Inc/NY	Morgan Stanley	(22,796)
4,819	Yandex NV 'A'	Goldman Sachs	(459)
6,263	Yandex NV 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,816)
665	Yandex NV 'A'	Morgan Stanley	539
127,760	Yelp Inc	Bank of America Merrill Lynch	62,602
12,942	Yelp Inc	Goldman Sachs	11,227
62,360	Yext Inc	Bank of America Merrill Lynch	(127,214)
30,633	Yext Inc	Goldman Sachs	(62,491)
14,200	York Water Co/The	Bank of America Merrill Lynch	11,218
8,014	York Water Co/The	Goldman Sachs	6,331
6,382	York Water Co/The	Morgan Stanley	1,085
(93,462)	YRC Worldwide Inc	Bank of America Merrill Lynch	26,169
(102,314)	YRC Worldwide Inc	Goldman Sachs	31,366
(15,369)	Yum China Holdings Inc	Morgan Stanley	(9,529)
(7,490)	Zafgen Inc	Bank of America Merrill Lynch	34,080
47,866	ZAGG Inc	Bank of America Merrill Lynch	(46,909)
60,321	ZAGG Inc	Goldman Sachs	(59,115)
48,893	Zayo Group Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	188,238
2,517	Zebra Technologies Corp 'A'	Goldman Sachs	35,650
6,883	Zebra Technologies Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(6,057)
893	Zebra Technologies Corp 'A'	Morgan Stanley	11,636
(1,376)	Zendesk Inc	Goldman Sachs	(14,644)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
71,945	Zendesk Inc	Bank of America Merrill Lynch	266,916
(1,782)	Zendesk Inc	Morgan Stanley	(11,726)
(35,531)	Zimmer Biomet Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(27,004)
(94,739)	ZIOPHARM Oncology Inc	Morgan Stanley	4,737
(8,284)	ZIOPHARM Oncology Inc	Goldman Sachs	(2,402)
15,348	Zoetis Inc	Goldman Sachs	32,805
34,000	Zoetis Inc	Bank of America Merrill Lynch	63,240
45,169	Zoetis Inc	Morgan Stanley	191,517
(2,561)	Zogenix Inc	Goldman Sachs	3
(1,198)	Zogenix Inc	Morgan Stanley	1,438
31,338	Zogenix Inc	Bank of America Merrill Lynch	45,753
(524)	Zscaler Inc	Morgan Stanley	(2,059)
(16,157)	Zscaler Inc	Goldman Sachs	51,864
73,834	Zumiez Inc	Bank of America Merrill Lynch	(105,583)
11,046	Zumiez Inc	Morgan Stanley	5,192
89,527	Zynga Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	8,057
			<u>(30,945,709)</u>
合計			<u>(35,355,579)</u>

\* 当該有価証券には市場流動性がない。

\*\* 0.5米ドル未満の投資は端数切捨てにより0と表示されている。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

## スワップ 2018年11月30日現在

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益 (米ドル)	時価 (米ドル)
TRS	USD 10,320,049	ファンドは3ヶ月LIBORを受け取り、MSCI Daily TR Net Emerging Markets Chile USD Indexを支払う	Morgan Stanley	15/12/2018	509,337	509,337
TRS	USD 3,678,563	ファンドは3ヶ月LIBORを受け取り、MSCI Daily TR Net Emerging Markets Chile USD Indexを支払う	Morgan Stanley	13/3/2019	75,410	75,410
合計					584,747	584,747

TRS：トータル・リターン・スワップ

## 未決済先渡為替予約 2018年11月30日現在

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
ヘッジを使用したスイス・フラン建投資証券クラス						
CHF	4,624,353	USD	4,608,753	State Street Bank & Trust Company	14/12/2018	23,150
USD	321,815	CHF	321,195	State Street Bank & Trust Company	14/12/2018	96
						23,246
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	558,775,391	USD	635,848,252	State Street Bank & Trust Company	14/12/2018	(1,791,875)
USD	78,257,647	EUR	68,715,347	State Street Bank & Trust Company	14/12/2018	284,627
						(1,507,248)
ヘッジを使用した英ポンド建投資証券クラス						
GBP	192,305	USD	250,790	State Street Bank & Trust Company	14/12/2018	(5,621)
USD	23,636	GBP	18,406	State Street Bank & Trust Company	14/12/2018	170
						(5,451)
ヘッジを使用した日本円建投資証券クラス						
JPY	14,138,838,496	USD	124,457,504	State Street Bank & Trust Company	14/12/2018	130,356
USD	6,088,597	JPY	687,883,795	State Street Bank & Trust Company	14/12/2018	27,139
						157,495
ヘッジを使用したスウェーデン・クローネ建投資証券クラス						
SEK	1,502,218,331	USD	166,219,961	State Street Bank & Trust Company	14/12/2018	(1,115,328)
USD	9,017,733	SEK	81,470,600	State Street Bank & Trust Company	14/12/2018	63,527
						(1,051,801)
合計						(2,383,759)

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

業種別内訳 2018年11月30日現在

	純資産比率 (%)
金融	74.15
政府	16.96
資産担保証券	5.17
消費財、循環型	3.21
消費財、非循環型	2.20
エネルギー	1.36
技術	0.01
投資有価証券 - 時価	103.06
その他の純負債	(3.06)
	100.00

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

インスティテューショナル・U Sトレジャリー・ファンド  
損益計算書

	注記	2018年9月30日に 終了した会計年度	2017年9月30日に 終了した会計年度
		千米ドル	千米ドル
営業収益	5	156,737	39,613
損益を通じて公正価値で測定する金融資産に係る純利益	6	121	13,444
投資収益合計		156,858	53,057
営業費用	8	(13,973)	(13,022)
当期純営業利益		142,885	40,035
財務費用：			
償還可能参加型投資証券保有者への分配金	9	(140,739)	(40,445)
財務費用合計		(140,739)	(40,445)
当期純利益 / (損失)		2,146	(410)
英文目論見書に記載されている評価方法に合わせるための調整	13	-	937
運用による償還可能参加型投資証券保有者に帰属する純資産の増加		2,146	527

本損益計算書に計上された損益以外で当会計年度に認識された損益はない。  
添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

インスティテューショナル・U Sトレジャリー・ファンド  
償還可能参加型投資証券保有者に帰属する純資産変動計算書

	2018年9月30日に 終了した会計年度	2017年9月30日に 終了した会計年度
	千米ドル	千米ドル
償還可能参加型投資証券保有者に帰属する期首純資産合計	8,000,953	7,669,294
運用による償還可能参加型投資証券保有者に帰属する純資産の増加	2,146	527
投資証券取引：		
償還可能参加型投資証券の発行による収入	53,241,104	34,031,228
償還可能参加型投資証券の買戻しによる支払	(49,970,976)	(33,711,534)
分配金再投資額	35,622	11,438
投資証券取引による純資産の増加	3,305,750	331,132
償還可能参加型投資証券保有者に帰属する期末純資産合計	11,308,849	8,000,953

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

インスティテューショナル・U Sトレジャリー・ファンド  
貸借対照表

	注記	2018年9月30日現在	2017年9月30日現在
		千米ドル	千米ドル
<b>流動資産</b>			
現金		496,966	399,707
現金同等物		-	-
未収金	11	334,767	3,978
損益を通じて公正価値で測定する金融資産	4(d)	10,495,544	7,604,478
<b>流動資産合計</b>		<b>11,327,277</b>	<b>8,008,163</b>
<b>流動負債</b>			
未払金	12	18,428	7,210
損益を通じて公正価値で測定する金融負債	4(d)	-	-
<b>流動負債合計</b>		<b>18,428</b>	<b>7,210</b>
<b>償還可能参加型投資証券保有者に帰属する期末純資産価額</b>		<b>11,308,849</b>	<b>8,000,953</b>

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

## インスティテューショナル・U Sトレジャリー・ファンド

投資有価証券明細表 2018年9月30日現在

保有高	通貨	銘柄	公正価値 (千米ドル)	純資産比率 (%)
債券				
国債(2017年9月30日:44.11%)				
米国(2017年9月30日:44.11%)				
175,000,000	USD	US Treasury, 0.88%, 15/10/2018	174,949	1.55
67,900,000	USD	US Treasury, 0.75%, 31/10/2018	67,822	0.60
31,235,000	USD	US Treasury, 1.25%, 31/10/2018	31,215	0.28
125,000,000	USD	US Treasury, 1.75%, 31/10/2018	124,972	1.10
3,375,000	USD	US Treasury, 1.38%, 31/12/2018	3,371	0.03
100,000,000	USD	US Treasury, 1.50%, 31/12/2018	99,923	0.88
31,570,000	USD	US Treasury, 1.13%, 15/01/2019	31,498	0.28
28,880,000	USD	US Treasury, 1.13%, 31/01/2019	28,801	0.25
84,305,000	USD	US Treasury, 1.25%, 31/01/2019	84,055	0.74
354,590,000	USD	US Treasury, 1.50%, 31/01/2019	353,760	3.13
130,360,000	USD	US Treasury, 0.75%, 15/02/2019	129,647	1.15
51,675,000	USD	US Treasury, 1.13%, 28/02/2019	51,438	0.45
44,960,000	USD	US Treasury, 1.38%, 28/02/2019	44,799	0.40
161,985,000	USD	US Treasury, 1.50%, 28/02/2019	161,482	1.43
67,000,000	USD	US Treasury, 1.25%, 31/03/2019	66,660	0.59
540,000,000	USD	US Treasury, FRN, 2.33%, 31/01/2019	540,367	4.78
847,690,000	USD	US Treasury, FRN, 2.26%, 30/04/2019	848,308	7.50
475,000,000	USD	US Treasury, FRN, 2.25%, 31/07/2019	475,402	4.20
82,100,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 04/10/2018	82,087	0.72
20,510,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 11/10/2018	20,499	0.18
121,500,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 08/11/2018	121,242	1.07
90,375,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 23/11/2018	90,104	0.80
157,500,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 29/11/2018	156,963	1.39
331,450,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 27/12/2018	329,734	2.91
175,000,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 10/01/2019	173,969	1.54
66,275,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 17/01/2019	65,850	0.58
311,625,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 24/01/2019	309,467	2.74
100,000,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 21/02/2019	99,132	0.88
50,980,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 28/02/2019	50,511	0.45
14,320,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 20/06/2019	14,083	0.12
58,825,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 12/09/2019	57,434	0.51
米国合計			4,889,544	43.23
国債に対する投資合計			4,889,544	43.23
債券に対する投資合計			4,889,544	43.23



保有高	通貨	取引相手	金利	期日	公正価値 (千米ドル)	純資産比率 (%)
リバースレポ取引 <sup>1</sup> (2017年9月30日:50.93%)						
フランス(2017年9月30日:1.37%)						
110,000,000	USD	Natixis	2.23%	31/12/2018	110,000	0.97
フランス合計					110,000	0.97
米国(2017年9月30日:49.56%)						
621,000,000	USD	Bank of Nova Scotia	2.23%	01/10/2018	621,000	5.49
1,040,000,000	USD	BNP Paribas	2.24%	01/10/2018	1,040,000	9.20
50,000,000	USD	Citigroup	2.24%	01/10/2018	50,000	0.44
275,000,000	USD	Credit Agricole	2.24%	01/10/2018	275,000	2.43
600,000,000	USD	Credit Suisse	2.22%	01/10/2018	600,000	5.31
10,000,000	USD	HSBC	2.24%	01/10/2018	10,000	0.09
400,000,000	USD	Merrill Lynch	2.25%	01/10/2018	400,000	3.54
150,000,000	USD	Merrill Lynch	2.25%	01/10/2018	150,000	1.33
1,100,000,000	USD	Societe Generale	2.22%	01/10/2018	1,100,000	9.73
1,250,000,000	USD	TD Securities (USA)	2.25%	01/10/2018	1,250,000	11.05
米国合計					5,496,000	48.61
リバースレポ取引に対する投資合計					5,606,000	49.58
損益を通じて公正価値で測定する金融資産合計					10,495,544	92.81
現金					496,966	4.39
その他の資産および負債					316,339	2.80
償還可能参加型投資証券保有者に帰属する純資産					11,308,849	100.00
資産合計額の内訳						資産合計に 対する割合 (%)
公認の証券取引所に上場されている譲渡可能な有価証券合計						43.17
その他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券						49.49
その他の資産						7.34
資産合計						100.00

<sup>1</sup> 担保として保有する有価証券は5,689,765,000米ドルであった。

## 2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】(2019年6月末現在)

「ブラックロック・アメリカ大陸ロング・ショート・ファンド(ダイワ投資一任専用)」

資産総額	628,687,665円
負債総額	368,739円
純資産総額( - )	628,318,926円
発行済数量	601,128,571口
1単位当たり純資産額( / )	1.0452円

(参考情報)

「アメリカズ・ロングショート・マザーファンド」

資産総額	1,313,733,766円
負債総額	0円
純資産総額( - )	1,313,733,766円
発行済数量	1,019,557,607口
1単位当たり純資産額( / )	1.2885円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### 1 受益証券の名義書換え等

該当事項はありません。

### 2 受益者名簿の閉鎖の時期

受益者名簿は作成していません。

### 3 投資者に対する特典

該当事項はありません。

### 4 内国投資信託受益証券の譲渡制限の内容

ファンド受益証券の譲渡制限は設けておりません。

### 5 受益証券の再発行

投資者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。

### 6 受益権の譲渡

投資者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該投資者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

の申請のある場合には、の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

の振替について、委託会社は、当該投資者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

### 7 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

### 8 受益権の再分割

委託会社は、受益権の再分割を行いません。ただし、受託会社と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

### 9 償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている投資者（償還日以前において換金が行なわれた受益権に係る投資者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で購入代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として投資者とします。）に支払います。なお、当該投資者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託会社がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。また、受益証券を保有している投資者に対しては、償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日から受益証券と引き換えに当該投資者に支払います。

### 10 質権口記載または記録の受益権の取り扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、換金の申込の受付け、換金代金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等に当たって取り扱われます。

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額等

資本金 3,120百万円

発行する株式の総数 36,000株

発行済株式の総数 15,000株

直近5カ年における主な資本金の額の増減

2017年12月7日付で、資本金を2,435百万円から3,120百万円に増額しました。

##### (2) 委託会社の機構

経営の意思決定機構

###### <株主総会>

株主により構成される会社における最高の意思決定機関として、取締役の選任、利益処分承認、定款の変更等、会社法および定款の定めにしたがって重要事項の決定を行いません。

###### <取締役会>

取締役により構成され、当社の業務執行を決定し、その執行について監督します。

###### <エグゼクティブ委員会他各委員会>

当社における適切な経営戦略の構築、業務執行体制の構築および業務運営の推進を目的として、エグゼクティブ委員会を設置します。また、その他各種委員会を設置し、業務の能率的運営および責任体制の確立を図っています。

運用の意思決定機構

###### 投資委員会

・投資委員会にて運用にかかる投資方針、パフォーマンスおよびリスク管理に関する重要事項を審議します。

###### 運用担当部署

・各運用担当部署では、投資委員会の決定にしたがい、ファンドの個別の運用計画を策定し、各部署の投資プロセスを通して運用を行いません。

###### ポートフォリオ・マネジャー

・ポートフォリオ・マネジャーは、策定された運用計画に基づき、個別銘柄を選択し売買に関する指図を行いません。

###### リスク管理

・委託会社ではリスク管理を重視しており、独自開発のシステムを用いてリスク管理を行っております。具体的には、運用担当部門とは異なる部門においてファンドの投資リスクの計測・分析、投資制限のモニタリングなどを行なうことにより、ファンドの投資リスクが運用方針に合致していることを確認し、その結果を運用担当部門にフィードバックするほか、社内関係者で共有しております。また、委託会社の業務に関するリスクについて社内規程を定めて管理を行っております。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

投信法に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また、金融商品取引法に定める投資助言業務、第一種金融商品取引業務および第二種金融商品取引業務等を行なっています。

委託会社の運用する証券投資信託は2019年6月末現在、以下の通りです(親投資信託を除きます。 )。

種類		本数	純資産総額
公募投資信託	追加型株式投資信託	81本	1,538,584百万円
	単位型株式投資信託	0本	0百万円
私募投資信託		79本	6,420,264百万円
合計		160本	7,958,847百万円

### 3【委託会社等の経理状況】

#### 1．財務諸表の作成方法について

委託会社であるブラックロック・ジャパン株式会社(以下「当社」という。)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(1963年大蔵省令第59号。)第2条及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」(2007年8月6日内閣府令第52号。)に基づいて作成しております。

#### 2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第32期事業年度(自2018年1月1日 至2018年12月31日)の財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### 3．財務諸表に記載している金額については、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。

## (1)【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第31期 (2017年12月31日現在)	第32期 (2018年12月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	19,097	23,891
立替金	11	2
前払費用	171	151
未収入金	3	11
未収委託者報酬	1,585	1,588
未収運用受託報酬	2,642	2,291
未収収益	2 1,384	1,402
為替予約	0	-
その他流動資産	33	18
流動資産計	24,928	29,359
固定資産		
有形固定資産		
建物附属設備	1 946	1,484
器具備品	1 411	380
有形固定資産計	1,358	1,864
無形固定資産		
ソフトウェア	4	8
のれん	42	-
無形固定資産計	47	8
投資その他の資産		
投資有価証券	3	11
長期差入保証金	1,124	1,119
前払年金費用	588	696
長期前払費用	25	27
繰延税金資産	786	848
投資その他の資産計	2,528	2,702
固定資産計	3,934	4,575
資産合計	28,863	33,935



	第31期 (2017年12月31日現在)	第32期 (2018年12月31日現在)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	119	97
未払金	2	
未払収益分配金	4	4
未払償還金	74	74
未払手数料	593	515
その他未払金	1,737	1,184
未払費用	2	
未払消費税等	150	97
未払法人税等	438	440
為替予約	-	3
前受金	79	78
前受収益	15	-
賞与引当金	1,886	1,939
役員賞与引当金	144	142
早期退職慰労引当金	9	42
流動負債計	6,500	5,661
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	55	60
資産除去債務	262	781
固定負債計	318	842
負債合計	6,818	6,503
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	3,120	3,120
資本剰余金		
資本準備金	3,001	3,001
その他資本剰余金	3,846	3,846
資本剰余金合計	6,847	6,847
利益剰余金		
利益準備金	336	336
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	11,739	17,127
利益剰余金合計	12,076	17,464
株主資本合計	22,044	27,432
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	0	0
評価・換算差額等合計	0	0
純資産合計	22,044	27,431
負債・純資産合計	28,863	33,935

## (2)【損益計算書】

(単位：百万円)

		第31期 (自 2017年1月1日 至 2017年12月31日)	第32期 (自 2018年1月1日 至 2018年12月31日)
営業収益			
委託者報酬		5,202	5,639
運用受託報酬	1	8,890	8,523
その他営業収益	1	12,257	13,511
営業収益計		26,350	27,674
営業費用			
支払手数料		1,830	1,856
広告宣伝費		208	191
調査費			
調査費		380	363
委託調査費	1	4,313	4,164
調査費計		4,693	4,528
委託計算費		86	84
営業雑経費			
通信費		50	59
印刷費		62	11
諸会費		32	34
営業雑経費計		145	106
営業費用計		6,964	6,767
一般管理費			
給料			
役員報酬		353	406
給料・手当		3,960	4,213
賞与		2,232	2,359
給料計		6,546	6,979
退職給付費用		287	275
福利厚生費		892	940
事務委託費	1	2,433	2,568
交際費		69	66
寄付金		2	3
旅費交通費		243	238
租税公課		231	245
不動産賃借料		735	804
水道光熱費		65	72
固定資産減価償却費		262	315
のれん償却額		56	42
資産除去債務利息費用		3	3
諸経費		363	424
一般管理費計		12,194	12,980
営業利益		7,191	7,926

	第31期 (自 2017年1月1日 至 2017年12月31日)	第32期 (自 2018年1月1日 至 2018年12月31日)
営業外収益		
受取利息	0	0
有価証券売却益	0	0
雑益	0	0
営業外収益計	1	1
営業外費用		
為替差損	34	26
営業外費用計	34	26
経常利益	7,158	7,901
特別利益		
特別利益計	-	-
特別損失		
特別退職金	119	84
特別損失計	119	84
税引前当期純利益	7,039	7,817
法人税、住民税及び事業税	2,223	2,491
法人税等調整額	29	61
当期純利益	4,786	5,387

## (3)【株主資本等変動計算書】

第31期 (自 2017年1月1日 至 2017年12月31日)

(単位: 百万円)

	株主資本							評価・換算差額等		純資産 合計	
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金		評価・換算 差額等合計
		資本 準備金	その他資本 剰余金	資本 剰余金 合計	利益 準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計				
2017年1月1日残高	2,435	2,316	3,846	6,162	336	6,953	7,290	15,887	0	0	15,887
事業年度中の変動額											
新株の発行	685	685		685				1,370			1,370
当期純利益						4,786	4,786	4,786			4,786
株主資本以外の項目 の事業年度中の変動 額(純額)									0	0	0
事業年度中の変動額 合計	685	685	-	685	-	4,786	4,786	6,156	0	0	6,156
2017年12月31日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	11,739	12,076	22,044	0	0	22,044

第32期 (自 2018年1月1日 至 2018年12月31日)

(単位: 百万円)

	株主資本							評価・換算差額等		純資産 合計	
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金		評価・換算 差額等合計
		資本 準備金	その他資本 剰余金	資本 剰余金 合計	利益 準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計				
2018年1月1日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	11,739	12,076	22,044	0	0	22,044
事業年度中の変動額											
当期純利益						5,387	5,387	5,387			5,387
株主資本以外の項目 の事業年度中の変動 額(純額)									0	0	0
事業年度中の変動額 合計	-	-	-	-	-	5,387	5,387	5,387	0	0	5,387
2018年12月31日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	17,127	17,464	27,432	0	0	27,431

## 注 記 事 項

## 【重要な会計方針】

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## 有価証券

## その他有価証券

## 時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定）を採用しております。

## 2. デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

## 3. 固定資産の減価償却方法

## (1) 有形固定資産

定額法により償却しております。なお、主な耐用年数は建物附属設備6～18年、器具備品2～15年であります。

## (2) 無形固定資産

自社利用のソフトウェアの減価償却方法については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。

のれんの償却方法については、その効果の及ぶ期間（5～9年）に基づく定額法によっております。

## 4. 引当金の計上基準

## (1) 貸倒引当金の計上方法

債権の貸倒損失に備えるため、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

## (2) 退職給付引当金の計上方法

## 旧退職金制度

適格退職年金制度移行日現在在籍していた従業員については、旧退職金制度に基づく給付額を保証しているため、期末現在の当該給付額と年金制度に基づく給付額との差額を引当て計上しております。

## 確定拠出年金制度

確定拠出年金制度（DC）による退職年金制度を有しております。

## 確定給付年金制度

キャッシュ・バランス型の年金制度（CB）の退職年金制度を有しております。CBには、一定の利回り保証を付しており、これの将来の支払に備えるため、確定給付型の会計基準に準じた会計処理方法により引当金を計上しております。

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当期までの期間に帰属させる方法については、ポイント基準によっております。

過去勤務債務は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（9年）による定額法により費用処理しております。

数理計算上の差異は各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（9年）による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理または費用から控除することとしております。

- (3) 賞与引当金の計上方法  
従業員の賞与の支払に備えて、賞与支給見込額の当事業年度負担額を計上しております。
  - (4) 役員賞与引当金の計上方法  
役員の賞与の支払に備えて、賞与支給見込額の当事業年度負担額を計上しております。
  - (5) 早期退職慰労引当金の計上方法  
早期退職慰労の支払に備えて、早期退職慰労支給見込額の当事業年度負担額を計上しております。
5. 外貨建の資産又は負債の本邦通貨への換算基準  
外貨建金銭債権債務は、期末の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
6. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項
- (1) 消費税等の処理方法  
消費税等の会計処理は、税抜方式によっております。
  - (2) 連結納税制度の適用  
親会社であるブラックロック・ジャパン・ホールディングス合同会社を連結納税親会社として、連結納税制度を適用しております。

#### （未適用の会計基準等）

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2018年3月30日）

「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 2018年3月30日）

##### (1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し認識されます。

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足したときに又は充足するにつれて収益を認識する。

##### (2) 適用予定日

2022年12月期の期首より適用予定であります。

##### (3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

#### （表示方法の変更）

（「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の早期適用に伴う変更）

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 2018年2月16日。以下「税効果会計基準一部改正」という。）が当事業年度の期末から適用できるようになったことに伴い、当事業年度から税効果会計基準一部改正を適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更するとともに、税効果会計関係注記を変更しました。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」860百万円及び「固定負債」の「繰延税金負債」74百万円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」786百万円に含めて表示しております。

**(貸借対照表関係)**

## 1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2017年12月31日)	当事業年度 (2018年12月31日)
建物附属設備	1,346 百万円	1,525 百万円
器具備品	821 百万円	950 百万円

## 2 関係会社に対する資産及び負債

各科目に含まれているものは次のとおりであります。

	前事業年度 (2017年12月31日)	当事業年度 (2018年12月31日)
未収収益	508 百万円	554 百万円
未払金	1,713 百万円	1,168 百万円
未払費用	356 百万円	385 百万円

3 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行2行と当座貸越契約を締結しております。これら契約に基づく事業年度末の借入未実行残高は次のとおりであります。

	前事業年度 (2017年12月31日)	当事業年度 (2018年12月31日)
当座貸越極度額	1,000 百万円	1,000 百万円
借入実行残高	-	-
差引額	1,000 百万円	1,000 百万円

**(損益計算書関係)**

## 1 関係会社に対する営業収益及び営業費用

各科目に含まれているものは次のとおりであります。

	前事業年度 (自 2017年 1月 1日 至 2017年12月31日)	当事業年度 (自 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)
その他営業収益	4,670 百万円	5,680 百万円
委託調査費	438 百万円	704 百万円
事務委託費	824 百万円	864 百万円
運用受託報酬	48 百万円	149 百万円

**(株主資本等変動計算書関係)**

前事業年度(自 2017年1月1日 至 2017年12月31日)

## 1. 発行済株式に関する事項

	前事業年度期首	増加	減少	前事業年度末
普通株式(株)	10,158	4,842	-	15,000

## 2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

## 3. 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

該当事項はありません。

## 4. 配当に関する事項

該当事項はありません。

当事業年度(自 2018年1月1日 至 2018年12月31日)

## 1. 発行済株式に関する事項

	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式(株)	15,000	-	-	15,000

## 2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

## 3. 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

該当事項はありません。

## 4. 配当に関する事項

該当事項はありません。



**（金融商品関係）**

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金等に限定し、また、資金調達については関連当事者からの長期借入に限定しています。

投資有価証券は、当社設定の投資信託であり、通常の営業過程において保有しております。

デリバティブについては、外貨建て営業債権及び債務の為替変動リスクを回避するために利用し、投機的な取引は行っておりません。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

営業債権である未収委託者報酬及び未収運用受託報酬は、顧客の信用リスクに晒されています。当該リスクに関しては、当社の経理規程に従い、取引先ごとの期日管理及び残高管理を行い、個別に未収債権の回収可能性を管理する体制をしいております。

営業債務である未払手数料はその全てが1年以内の支払期日となっております。

営業債務は流動性リスクに晒されていますが、当社では資金繰計画を作成するなどの方法により管理しております。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、金額的重要性が低いものについては含めておりません。

前事業年度（2017年12月31日）

	貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
(1) 現金・預金	19,097	19,097	-
(2) 未収委託者報酬	1,585	1,585	-
(3) 未収運用受託報酬	2,642	2,642	-
(4) 未収収益	1,384	1,384	-
(5) 長期差入保証金	1,124	1,109	14
資産計	25,834	25,819	14
(1) 未払手数料	593	593	-
(2) 未払費用	1,245	1,245	-
負債計	1,838	1,838	-

当事業年度（2018年12月31日）

	貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
(1) 現金・預金	23,891	23,891	-
(2) 未収委託者報酬	1,588	1,588	-
(3) 未収運用受託報酬	2,291	2,291	-
(4) 未収収益	1,402	1,402	-
(5) 長期差入保証金	1,119	1,112	6
資産計	30,293	30,287	6
(1) 未払手数料	515	515	-
(2) 未払費用	1,039	1,039	-
負債計	1,554	1,554	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法に関する事項

資 産

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収運用受託報酬及び(4) 未収収益

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっています。

(5) 長期差入保証金

事務所敷金の時価については、事務所の敷金を当該賃貸借契約期間を基にしたインターバンク市場で取引されている円金利スワップレートで割り引いて算定する方法によっています。また従業員社宅敷金の時価については、平均残存勤務期間を基にしたインターバンク市場で取引されている円金利スワップレートで割り引いて算定する方法によっています。

負 債

(1) 未払手数料、(2) 未払費用

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっています。

(注2) 金銭債権の決算日後の償還予定額

前事業年度（2017年12月31日）

	1年以内 (百万円)	1年超 5年以内 (百万円)	5年超 10年以内 (百万円)	10年超 (百万円)
(1) 現金・預金	19,097	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	1,585	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	2,642	-	-	-
(4) 未収収益	1,384	-	-	-
(5) 長期差入保証金	-	1,051	61	11
合計	24,709	1,051	61	11

当事業年度（2018年12月31日）

	1年以内 (百万円)	1年超 5年以内 (百万円)	5年超 10年以内 (百万円)	10年超 (百万円)
(1) 現金・預金	23,891	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	1,588	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	2,291	-	-	-
(4) 未収収益	1,402	-	-	-
(5) 長期差入保証金	-	1,051	56	11
合計	29,174	1,051	56	11

**（有価証券関係）**

前事業年度（2017年12月31日）

その他有価証券

	種類	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	その他 投資信託	3	3	0
合計		3	3	0

当事業年度（2018年12月31日）

その他有価証券

	種類	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	その他 投資信託	11	12	0
合計		11	12	0

**（退職給付関係）**

前事業年度（自 2017年1月1日 至 2017年12月31日）

## 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、旧パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社で設けられていた、旧退職金制度を引き続き有しています。当社は、平成21年12月2日に旧ブラックロック・ジャパン株式会社との合併に伴い、旧ブラックロック・ジャパン株式会社における退職年金制度（確定拠出年金制度及び確定給付年金制度）を承継しました。また、平成23年1月1日付で旧パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社から引き継いだ適格退職年金制度はキャッシュ・バランス型の確定給付年金制度に移行しました。従って、平成23年1月1日以降、からの三つの制度を有しています。

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2017年 1月 1日 至 2017年12月31日)
退職給付債務の期首残高	1,745
勤務費用	268
利息費用	8
数理計算上の差異の発生額	20
退職給付の支払額	170
退職給付債務の期末残高	1,832

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2017年 1月 1日 至 2017年12月31日)
年金資産の期首残高	2,381
期待運用収益	19
数理計算上の差異の発生額	83
事業主からの拠出額	290
退職給付の支払額	153
年金資産の期末残高	2,621

## (3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

(単位：百万円)

	前事業年度 (2017年12月31日)
積立型制度の退職給付債務	1,776
年金資産	2,621
	845
非積立型制度の退職給付債務	55
未積立退職給付債務	789
未認識数理計算上の差異	242
未認識過去勤務費用	13
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	532
退職給付引当金	55
前払年金費用	588
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	532

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2017年 1月 1日 至 2017年12月31日)
勤務費用	268
利息費用	8
期待運用収益	19
数理計算上の差異の費用処理額	35
過去勤務費用の処理額	6
確定給付制度に係る退職給付費用合計	216
特別退職金	119
合計	335

## (5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	前事業年度 (2017年12月31日)
合同運用	100%
合計	100%

合同運用による年金資産の主な商品分類ごとの比率は、債券73%、株式22%及びその他3%となっております。

長期期待運用収益率の算定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

## (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (自 2017年 1月 1日 至 2017年12月31日)
割引率	0.4%
長期期待運用収益率	0.9%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、71百万円でありました。

当事業年度（自 2018年1月1日 至 2018年12月31日）

## 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、旧パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社で設けられていた、旧退職金制度を引き続き有しています。当社は、平成21年12月2日に旧ブラックロック・ジャパン株式会社との合併に伴い、旧ブラックロック・ジャパン株式会社における退職年金制度（確定拠出年金制度及び確定給付年金制度）を承継しました。また、平成23年1月1日付で旧パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社から引き継いだ適格退職年金制度はキャッシュ・バランス型の確定給付年金制度に移行しました。従って、平成23年1月1日以降、からの三つの制度を有しています。

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：百万円)

	当事業年度 (自 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)
退職給付債務の期首残高	1,832
勤務費用	269
利息費用	7
数理計算上の差異の発生額	11
退職給付の支払額	138
過去勤務費用の発生額	47
退職給付債務の期末残高	1,934

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位：百万円)

	当事業年度 (自 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)
年金資産の期首残高	2,621
期待運用収益	23
数理計算上の差異の発生額	113
事業主からの拠出額	303
退職給付の支払額	138
年金資産の期末残高	2,696

## (3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

(単位：百万円)

	当事業年度 (2018年12月31日)
積立型制度の退職給付債務	1,874
年金資産	2,696
	821
非積立型制度の退職給付債務	60
未積立退職給付債務	761
未認識数理計算上の差異	73
未認識過去勤務費用	52
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	635
退職給付引当金	60
前払年金費用	696
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	635

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：百万円)

	当事業年度 (自 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)
勤務費用	269
利息費用	7
期待運用収益	23
数理計算上の差異の費用処理額	44
過去勤務費用の処理額	8
確定給付制度に係る退職給付費用合計	200
特別退職金	84
合計	285

## (5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	当事業年度 (2018年12月31日)
合同運用	100%
合計	100%

合同運用による年金資産の主な商品分類ごとの比率は、債券77%、株式20%及びその他3%となっております。

長期期待運用収益率の算定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

## (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	当事業年度 (自 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)
割引率	0.6%
長期期待運用収益率	1.0%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、75百万円でありました。

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	(単位:百万円)	
	前事業年度 (2017年12月31日)	当事業年度 (2018年12月31日)
繰延税金資産		
未払費用	206	167
賞与引当金	537	591
資産除去債務	80	239
資産調整勘定	4	-
未払事業税	74	83
早期退職慰労引当金	2	13
退職給付引当金	17	18
有形固定資産	4	3
その他	44	96
繰延税金資産合計	973	1,213
繰延税金負債		
退職給付引当金	180	213
資産除去債務に対応する除去費用	6	152
繰延税金負債合計	186	365
繰延税金資産の純額	786	848

(注) 前事業年度及び当事業年度における繰延税金資産の純額は、貸借対照表の以下の項目に含まれております。

	(単位:百万円)	
	前事業年度 (2017年12月31日)	当事業年度 (2018年12月31日)
固定資産 - 繰延税金資産	786	848

## 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

	前事業年度 (2017年12月31日)		当事業年度 (2018年12月31日)	
法定実効税率	30.9	%	30.9	%
(調整)				
交際費等永久に損金に算入されない項目	2.1		1.0	
損金不算入ののれん償却額	0.2		0.2	
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	0.2		0.1	
所得拡大促進税制による税額控除	1.8		1.9	
その他	0.4		0.8	
税効果会計適用後の法人税等の負担率	32.0	%	31.1	%



**(資産除去債務関係)**

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

## 1. 当該資産除去債務の概要

当社事業所の定期建物賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

## 2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を当該定期建物賃貸借契約上の賃貸借期間約5年と見積り、割引率は0.16%~0.18%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。当事業年度において、資産の除去時点において必要とされる除去費用の見積額が、固定資産の取得時における見積額を大幅に超過することが明らかになったことから、見積もりの変更による増加額を0.16%で割り引き、資産除去債務残高が440百万円増加しております。

## 3. 当該資産除去債務の総額の増減

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2017年 1月 1日 至 2017年12月31日)	当事業年度 (自 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)
期首残高	258	262
有形固定資産の取得に伴う増加額	-	75
見積りの変更による増加額	-	440
時の経過による調整額	3	3
資産除去債務の履行による減少額	-	-
期末残高	262	781

**(デリバティブ取引関係)**

前事業年度 (2017年12月31日)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

(単位:百万円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建 米ドル	69	-	0	0
合計		69	-	0	0

(注) 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

当事業年度 (2018年12月31日)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

(単位:百万円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建 米ドル	164	-	3	3
合計		164	-	3	3

(注) 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

**(セグメント情報等)**

前事業年度(自 2017年1月1日 至 2017年12月31日)

## 1. セグメント情報

当社は主として投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2. 関連情報

## (1) 製品及びサービスごとの情報

(単位:百万円)

	委託者報酬	運用受託報酬	その他	合計
外部顧客営業収益	5,202	8,890	12,257	26,350

## (2) 地域ごとの情報

## 売上高

(単位:百万円)

日本	北米	その他	合計
13,186	10,831	2,332	26,350

(注) 売上高は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

## 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

## (3) 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める主要な顧客は以下のとおりです。

(単位:百万円)

相手先	営業収益	関連するセグメント名
ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク	4,719	投資運用業
ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	3,512	投資運用業

## 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

## 4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

当社は主として投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自 2018年1月1日 至 2018年12月31日)

1. セグメント情報

当社は主として投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位:百万円)

	委託者報酬	運用受託報酬	その他	合計
外部顧客営業収益	5,639	8,523	13,511	27,674

(2) 地域ごとの情報

売上高

(単位:百万円)

日本	北米	その他	合計
13,237	11,293	3,143	27,674

(注) 売上高は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める主要な顧客は以下のとおりです。

(単位:百万円)

相手先	営業収益	関連するセグメント名
ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク	5,830	投資運用業
ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	3,458	投資運用業

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

当社は主として投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

## ( 関連当事者情報 )

## 1. 関連当事者との取引

## 財務諸表提出会社と関連当事者との取引

## (1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主(会社等に限る。)等

前事業年度(自 2017年1月1日 至 2017年12月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社	ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク	米国 ニューヨーク州	14,286 百万 米ドル	投資 顧問業	(被所有) 間接 100	投資顧問 契約の 再委任等	運用受託報酬	48	未収収益	508
							受入手数料	4,670		
							委託調査費	438	未払費用	356
							事務委託費	824	その他未払金	67
親会社	ブラックロック・ジャパン・ホールディングス合同会社	日本 東京都	1万円	持株会社	(被所有) 直接 100	株式の 保有等	営業外収益	0	その他未払金	1,645

当事業年度(自 2018年1月1日 至 2018年12月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社	ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク	米国 ニューヨーク州	73 百万 米ドル	投資 顧問業	(被所有) 間接 100	投資顧問 契約の 再委任等	運用受託報酬	149	未収収益	554
							受入手数料	5,680		
							委託調査費	704	未払費用	385
							事務委託費	864	その他未払金	165
親会社	ブラックロック・ジャパン・ホールディングス合同会社	日本 東京都	1万円	持株会社	(被所有) 直接 100	株式の 保有等	営業外収益	-	その他未払金	1,002

## (2) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

前事業年度(自 2017年1月1日 至 2017年12月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2018年1月1日 至 2018年12月31日)

該当事項はありません。

## (3) 財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度 (自 2017年1月1日 至 2017年12月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社を持つ会社	ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	米国カリフォルニア州	1,000米ドル	投資顧問業	なし	投資顧問契約の再委任等	受入手数料	3,512	未収収益	296
							委託調査費	77	未払費用	17
							事務委託費	10		
同一の親会社を持つ会社	ブラックロック・インベストメント・マネジメント・エルエルシー	米国デラウェア州	314百万米ドル	投資顧問業	なし	投資顧問契約の再委任等	受入手数料	363	未収収益	28
							委託調査費	1,427	未払費用	129
							事務委託費	119	その他未払金	1

当事業年度 (自 2018年1月1日 至 2018年12月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社を持つ会社	ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	米国カリフォルニア州	1,000米ドル	投資顧問業	なし	投資顧問契約の再委任等	受入手数料	3,458	未収収益	330
							委託調査費	37	未払費用	4
							事務委託費	8		

## (注) 1. 取引条件及び取引条件の決定方針等

- (1) 運用受託報酬については、一般取引条件と同様に決定しております。
- (2) 受入手数料については、一般取引条件と同様に決定しております。
- (3) 委託調査費については、一般取引条件と同様に決定しております。
- (4) 事務委託費については、一般取引条件と同様に決定しております。

## 2. 親会社に関する注記

## (1) 親会社情報

ブラックロック・インク(ニューヨーク証券取引所に上場)  
 ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク(非上場)  
 ブラックロック・ジャパン・ホールディングス合同会社(非上場)

## (1株当たり情報)

項目	前事業年度 (自 2017年 1月 1日 至 2017年12月31日)	当事業年度 (自 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)
1株当たり純資産額	1,469,634 円 10 銭	1,828,761 円 92 銭
1株当たり当期純利益金額	456,306 円 62 銭	359,180 円 40 銭

- (注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。  
 2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	前事業年度 (自 2017年 1月 1日 至 2017年12月31日)	当事業年度 (自 2018年 1月 1日 至 2018年12月31日)
当期純利益 (百万円)	4,786	5,387
普通株主に帰属しない金額 (百万円)	-	-
普通株式に係る当期純利益 (百万円)	4,786	5,387
普通株式の期中平均株式数 (株)	10,490	15,000

独立監査人の監査報告書は、当事業年度(自 2018年1月1日 至2018年12月31日)を対象としております。

#### 4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、金融商品取引法の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- (1) 自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (2) 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして金融商品取引業等に関する内閣府令で定めるものを除きます。)
- (3) 通常の実行の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の委託会社と密接な関係を有する法人その他の団体として金融商品取引法施行令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。 )又は子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の委託会社と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。 )と有価証券の売買その他の取引又は金融デリバティブ取引を行なうこと。
- (4) 委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。
- (5) 上記に掲げるもののほか、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして金融商品取引業等に関する内閣府令で定める行為。

## 5【その他】

定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

変更年月日	変更事項
2007年9月18日	証券業登録に伴う商号変更（「パークレイズ・グローバル・インベスターズ証券投信投資顧問株式会社」に変更）のため、定款変更を行ないました。
2007年9月30日	商号変更（「パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社」に変更）のため、定款変更を行ないました。
2007年9月30日	公告の方法を変更するため、定款変更を行ないました。
2007年12月27日	事業を営むことの内容を変更するため、定款変更を行ないました。
2008年7月1日	グループ会社の1つであるパークレイズ・グローバル・インベスターズ・サービス株式会社を吸収合併し、それに伴い資本金の額を変更いたしました。
2008年7月1日	株式取扱規則に関する記述を追加するため、定款変更を行ないました。
2009年6月22日	本店所在地変更のため、定款変更を行ないました。
2009年12月2日	ブラックロック・ジャパン株式会社と合併 商号変更（「ブラックロック・ジャパン株式会社」に変更）および定款変更を行ないました。
2011年4月1日	グループ会社であるブラックロック証券株式会社を吸収合併し、それに先立ち定款変更および資本金の額の変更を行ないました。
2013年10月5日	MGPA Japan LLCより不動産投資関連の事業を譲受し、それに先立ち定款変更を行ないました。
2014年12月1日	決算期を3月31日から12月31日に変更するため、定款変更を行ないました。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

- ・名称 みずほ信託銀行株式会社
- ・資本金の額 247,369百万円（2019年3月末現在）
- ・事業の内容 銀行法に基づき、銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

#### <再信託受託会社の概要>

- ・名称 資産管理サービス信託銀行株式会社
- ・資本金 50,000百万円（2019年3月末現在）
- ・事業の内容 銀行法に基づき、銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。
- ・再信託の目的 原信託契約にかかる信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（資産管理サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

#### (2) 販売会社

名称	資本金の額(百万円) (2019年3月末現在)	事業の内容
大和証券株式会社	100,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

### 2【関係業務の概要】

#### (1) 受託会社

受託会社（受託者）として、ファンドの信託財産の保管・管理・計算、外国証券を保管・管理する外国の保管銀行への指図・連絡等を行いません。

#### (2) 販売会社

ファンドの取扱販売会社として、募集の取扱いおよび販売を行ない、換金に関する事務、収益分配金の再投資に関する事務、換金代金・収益分配金・償還金の支払いに関する事務等を行いません。

### 3【資本関係】

#### (1) 受託会社

該当事項はありません。

#### (2) 販売会社

該当事項はありません。



### 第3【その他】

1 交付目論見書の表紙等に、以下の事項を記載します。

(1) 委託会社等の情報

委託会社名

金融商品取引業者登録番号

設立年月日

資本金

当該委託会社が運用する投資信託財産の合計純資産総額

「ファンドの運用の指図を行なう者である。」旨

(2) 受託会社に関する情報

受託会社名および「ファンドの財産の保管および管理を行なう者である。」旨

(3) 詳細情報の入手方法

詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載します。

委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間等

請求目論見書の入手方法および投資信託約款が請求目論見書に添付されている旨

(4) 交付目論見書の使用開始日

(5) 届出の効力に関する事項

金商法第4条第1項又は第2項の規定による届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載します。

届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法

届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日

(6) その他の記載事項

商品内容に関して重大な変更を行なう場合には、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号、以下「投信法」という。）に基づき事前に受益者の意向を確認する旨

投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨

請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行なった場合にはその旨の記録をしておくべきである旨

「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載

2 交付目論見書の「投資リスク」記載箇所に金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用がない旨を記載します。

3 目論見書は別称として、「投資信託説明書」と称して使用する場合があります。

4 目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。

## 独立監査人の監査報告書

2019年2月28日

ブラックロック・ジャパン株式会社  
取締役会 御中

### 有限責任監査法人トーマツ

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 田 中 素 子

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 中 島 紀 子

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているブラックロック・ジャパン株式会社の2018年1月1日から2018年12月31日までの第32期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

#### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ブラックロック・ジャパン株式会社の2018年12月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

- (注) 1. 上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2019年7月31日

ブラックロック・ジャパン株式会社  
取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 辻村 和之

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているブラックロック・アメリカ大陸ロング・ショート・ファンド（ダイワ投資一任専用）の2018年6月16日から2019年6月17日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ブラックロック・アメリカ大陸ロング・ショート・ファンド（ダイワ投資一任専用）の2019年6月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

ブラックロック・ジャパン株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。