

## 【表紙】

【提出書類】 有価証券報告書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 2021年10月15日

【計算期間】 第14期(自 2021年1月16日 至 2021年7月15日)

【ファンド名】 ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド(為替ヘッジあり)  
ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド(為替ヘッジなし)

【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】 代表取締役社長 有田 浩之

【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

【連絡場所】 東京都千代田区丸の内一丁目8番3号

【電話番号】 03-6703-7940

【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【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】

ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド（為替ヘッジあり）、ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド（為替ヘッジなし）は、市場動向に左右されにくい安定的な収益を追求し、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。

（「ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド（為替ヘッジあり）」、「ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド（為替ヘッジなし）」を総称して、以下「当ファンド」または「ファンド」という場合があります。また、各々を「各ファンド」、「ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド（為替ヘッジあり）」を「為替ヘッジあり」、「ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド（為替ヘッジなし）」を「為替ヘッジなし」という場合があります。）

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（絶対収益追求型）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 (絶対収益追求型)

##### <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 一般 大型株 中小型株 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 不動産投信 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	年1回 年2回 年4回 年6回 (隔月) 年12回 (毎月) 日々 その他	グローバル (日本を含む)  日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング	ファミリー ファンド  ファンド・ オブ・ ファンズ	<為替ヘッジあり> あり(フルヘッジ)  <為替ヘッジなし> なし	ブル・ベア型  条件付運用型  ロング・ショート 型 / 絶対収益追求型  その他

## &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われ従来 <sup>1</sup> 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	目論見書また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	目論見書また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 (絶対収益追求型)	目論見書また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）	目論見書また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2回	目論見書または投資信託約款において、年2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	グローバル (日本を含む)	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界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	目論見書また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)	目論見書または投資信託約款において、為替のフルヘッジまた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。
	為替ヘッジなし	目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないものをいう。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	絶対収益追求型	目論見書または投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい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、かつ親投資信託はファンド・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みます。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、「為替ヘッジあり」、「為替ヘッジなし」合わせて1,000億円です。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. 主として、世界の株式および株式関連の派生商品等に投資し、買い建て・売り建てポジションを構築することにより、世界の株式市場の動向に左右されにくい安定的な収益を追求し、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。
- b. 主として、世界の株式および株式関連の派生商品等に投資し、絶対収益の追求を目指す2つの投資信託証券（以下「投資対象ファンド」といいます。）に投資を行ないます。

絶対収益追求とは、特定の市場（当ファンドにおいては世界の株式市場を指します。）の動向に左右されにくい収益の追求を目指すことをいいます。ただし、必ず収益を得ることができるということを意味するものではありません。

「為替ヘッジなし」は、世界の株式市場の動向に左右されにくい収益の追求を目指しますが、為替相場の変動による影響を受けます。

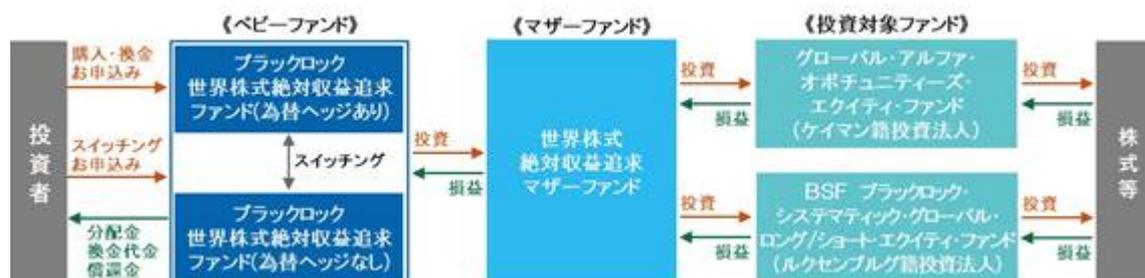
- 各投資対象ファンドにおいて買い建て・売り建てのポジションを構築するにあたっては、積極的にデリバティブ取引（先物・スワップなど）を活用します。  
買い建て額と売り建て額の合計額は、各投資対象ファンドの純資産総額を上回る金額となります。

- 各投資対象ファンドへの投資割合は、原則として均等配分（各50%程度）を基本とします。  
各投資対象ファンドへの投資割合は、原則として市況動向および各投資対象ファンドの収益性等を勘案して委託会社が決定します。

- c. ファンドは、世界株式絶対収益追求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、投資信託証券を実質的な投資対象とするファンド・オブ・ファンズです。

投資対象とする投資信託証券は、本書提出日現在、以下の通りです。

- グローバル・アルファ・オポチュニティーズ・エクイティ・ファンド・リミテッド クラスA投資証券（ケイマン籍投資法人、以下「グローバル・アルファ・オポチュニティーズ・エクイティ・ファンド」といいます。）
- ブラックロック・ストラテジック・ファンズ（BSF）ブラックロック・システムティック・グローバル・ロング/ショート・エクイティ・ファンド クラスJ投資証券（ルクセンブルグ籍投資法人、以下「BSF ブラックロック・システムティック・グローバル・ロング/ショート・エクイティ・ファンド」といいます。）



## &lt; ファンドの仕組みについて &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。

ファミリーファンド方式とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、投資者から投資された資金をまとめてベビーファンド（「為替ヘッジあり」、「為替ヘッジなし」）とし、その資金の全部または一部をマザーファンドに投資して実質的な運用を行なう仕組みです。なお、信託約款上では「マザーファンド」は「親投資信託」という表現で定義されています。

スイッチングの取扱いについては、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。

## d. 各投資対象ファンドの運用戦略は、ブラックロック独自の計量モデルを活用します。

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; 運用プロセス（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、買い建て・売り建ての最適な組み合わせのポートフォリオを構築します。

## [イメージ図]



※ 上記は、2つの投資対象ファンドに共通する運用プロセスです。  
 ※ 資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。  
 ※ 投資対象ファンドの運用プロセスは変更となる場合があります。

## e. 当ファンドは、為替ヘッジの有無により、「為替ヘッジあり」と「為替ヘッジなし」があります。「為替ヘッジあり」と「為替ヘッジなし」間で無手数料でスイッチング（乗換え）が可能です。

為替ヘッジあり	投資対象ファンドの発行通貨である米ドルに対して、原則として為替ヘッジを行ない、為替変動リスクの低減を図ります。（米ドル金利が円金利より高い場合、ヘッジ・コストがかかります。）
為替ヘッジなし	投資対象ファンドの発行通貨である米ドルに対して、原則として為替ヘッジを行いません。このため、為替変動の影響を受けます。

スイッチングの際には、換金時と同様の税金がかかります。

## f. 原則として、年2回の毎決算時（原則として1月15日および7月15日。休業日の場合は翌営業日）に収益分配方針に基づき、分配を行ないます。

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。運用状況によっては、分配を行わない場合もあります。

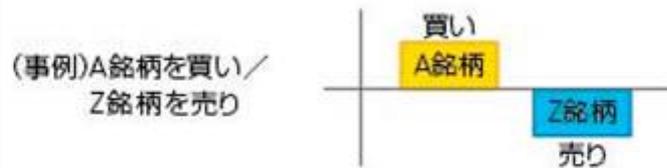
(追加的記載事項)

## 買い建て/売り建てポジションとその損益について

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]

### 買い建て/売り建ての組み合わせによる損益



	株式相場上昇時	株式相場下落時
損益がプラスになる場合	<p>A銘柄10%上昇、Z銘柄7%上昇</p> <p>A銘柄とZ銘柄の上昇率の差の3%が利益となります。 (A銘柄単体での買いでは10%の利益)</p>	<p>A銘柄3%下落、Z銘柄5%下落</p> <p>A銘柄とZ銘柄の下落率の差の2%が利益となります。 (A銘柄単体での買いでは3%の損失)</p>
損益がマイナスになる場合	<p>A銘柄7%上昇、Z銘柄10%上昇</p> <p>A銘柄とZ銘柄の上昇率の差の3%が損失となります。 (A銘柄単体での買いでは7%の利益)</p>	<p>A銘柄5%下落、Z銘柄3%下落</p> <p>A銘柄とZ銘柄の下落率の差の2%が損失となります。 (A銘柄単体での買いでは5%の損失)</p>

※イメージ図は、当運用戦略をご理解頂くことを目的に作成したものであり、ファンドの運用成果等を保証するものではありません。

※イメージ図では説明の簡略化のために、買いと売りの各投資額は同額としています。

※買いと売りの双方で損失した場合は、運用上想定される以上にファンドの運用成果に影響があり、損失が拡大する可能性があります。

## (参考)グロスポジションについて

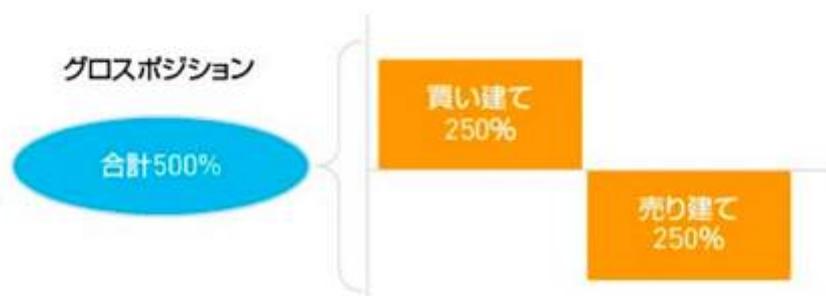
投資対象ファンドは、デリバティブ取引を活用し、買い建てと売り建てポジションを構築します。

グロスポジションとは、純資産総額に対する買い建て額と売り建て額の割合の合計をいいます。

$$\text{グロスポジション(\%)} = \frac{\text{買い建て額}}{\text{投資対象ファンドの純資産総額}} + \frac{\text{売り建て額}}{\text{投資対象ファンドの純資産総額}}$$

[イメージ図]

グロスポジション：500% の例



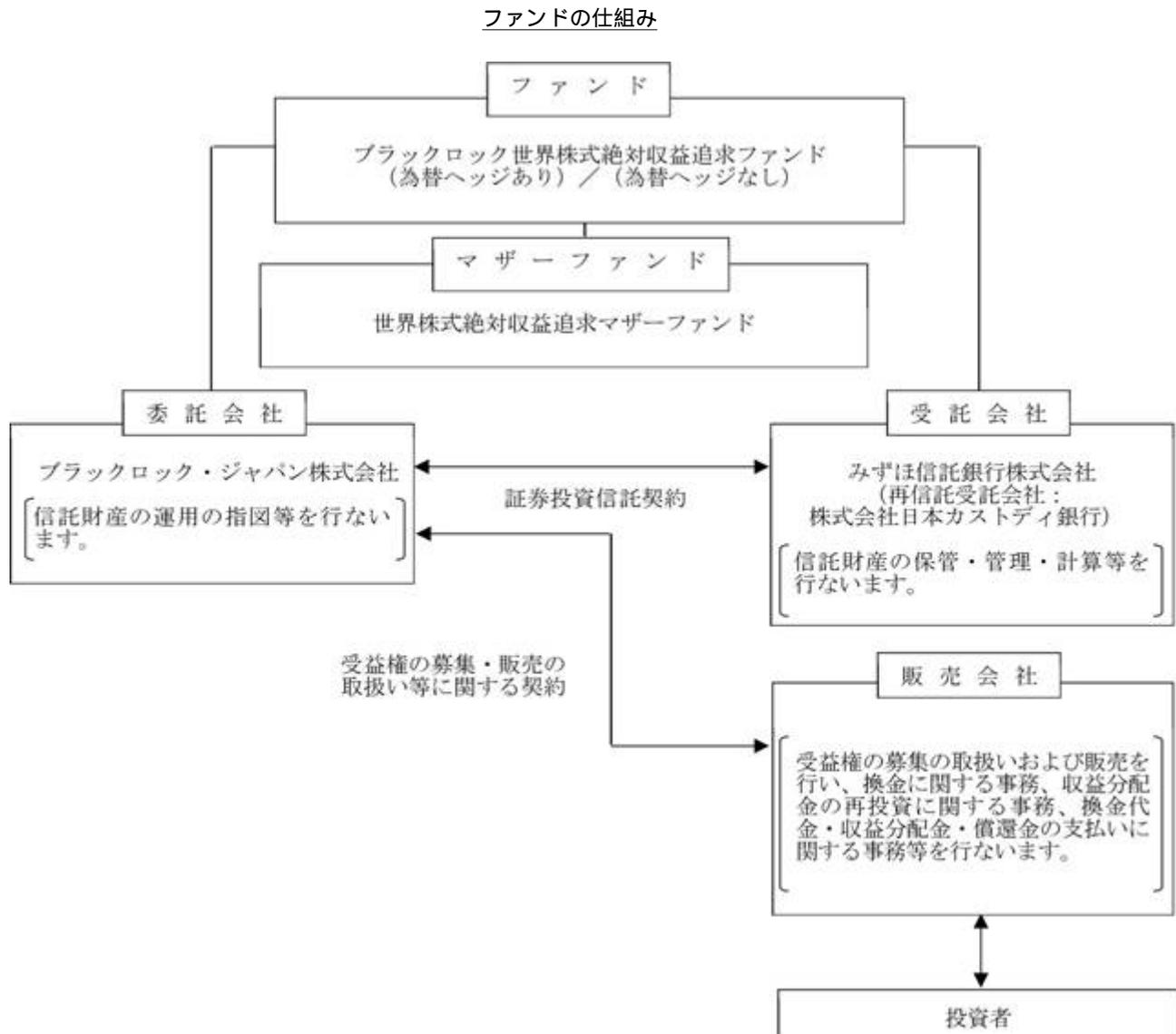
※上記のイメージ図は、投資対象ファンドにおけるグロスポジションをご理解頂くことを目的に作成したものであり、当ファンドの運用成果等を保証するものではありません。

## (2) 【ファンドの沿革】

2014年7月7日 信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

2015年4月16日 マザーファンド名称を「ブラックロック世界株式絶対収益追求マザーファンド」から「世界株式絶対収益追求マザーファンド」へ変更

## (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;

2021年7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・デザート・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】

世界株式絶対収益追求マザーファンドの受益証券への投資を通じて、主として世界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（買い建ておよび売り建て）ポジションを構築する投資信託証券に投資を行ない、市場動向に左右されにくい投資収益を追求します。マザーファンドの投資対象ファンドは、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。

マザーファンドが投資する各投資対象ファンドへの投資割合は、原則として均等配分を基本とします。基本投資割合は、資金動向、市況動向、および各投資対象ファンドの収益性・流動性等を勘案して、委託会社の判断により変更することができます。

#### （為替ヘッジあり）

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。

#### （為替ヘッジなし）

実質外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

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、自己また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また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。

## &lt;参考&gt; マザーファンドの運用の基本方針

## 世界株式絶対収益追求マザーファンド

## 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にくい安定的な収益を追求し、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行いません。

## 2. 運用方法

## (1) 投資対象

主として世界の株式および株式関連の派生商品等に投資を行ない、ロング・ショート（買建および売建）ポジションを構築する投資信託証券に投資を行いません。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。

## (2) 投資態度

主として世界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（買建および売建）ポジションを構築する投資信託証券（以下、「投資対象ファンド」といいます。）に投資を行ない、市場動向に左右されにくい投資収益を追求します。投資対象ファンドは、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。

各投資対象ファンドへの投資割合は、原則として均等配分を基本とします。基本投資割合は、資金動向、市況動向、および各投資対象ファンドの収益性・流動性等を勘案して、委託会社の判断により変更することができます。

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、原則として為替ヘッジを行いません。

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。

## (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いません。

## (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（a．およびc．に掲げるものに該当するものを除きます。以下同じ。）
- c．約束手形

## 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として世界株式絶対収益追求マザーファンドの受益証券のほか、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（以下「社振法」といいます。）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、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

当ファンドの設定、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. グローバル・アルファ・オポチュニティーズ・エクイティ・ファンド

形態	ケイマン籍（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、世界の株式および株式関連の派生商品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長期的に米国短期金利を上回るトータル・リターンを目指します。
存続期間	無期限
主な投資対象	<ul style="list-style-type: none"> <li>・世界の株式および関連するデリバティブ取引に投資します。</li> <li>・主として、先進国の企業の発行する株式および関連するデリバティブ取引への投資を行いますが、先進国以外の国の企業が発行する株式および関連するデリバティブ取引にも投資することがあります。</li> <li>・世界の株式および関連するデリバティブ取引について、買い建ておよび売り建ての両方を行いません。</li> <li>・買い建ておよび売り建てのポジションについては、主にスワップ取引を含むデリバティブ取引を活用して行いません。買い建てと売り建ての想定元本の合計（グロスポジション）は、原則として純資産総額の200%～500%の範囲内とします。</li> </ul>
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・一発行会社の発行する株式について、発行済株数の50%を越えて当該発行会社に投資しないこととします。</li> <li>・資金の借入れについては、純資産総額の10%以内とします。</li> <li>・現物株式による売り建てについては、純資産総額の範囲とします。</li> </ul>
管理報酬	年1.65%
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12月末日）に決算を行いません。
収益分配方針	分配を行いません。
申込手数料	ありません。
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&トラスト・カンパニー

## b. B S F ブラックロック・システマティック・グローバル・ロング/ショート・エクイティ・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絶対収益の追求を目指します。ファンドの純資産の少なくとも70%を先進国の株式もしくは株式関連の派生商品等へ投資を行ないます。ファンドは、先進国の株式に広く分散投資を行ない、それと同時に市場動向との相関性の低いリターンを生み出すことを目指します。
存続期間	無期限
主な投資対象	先進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	年1.50%
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)に決算を行ないます。
収益分配方針	分配を行ないます。ただし、必ず分配を行なうものではありません。
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・ファイナンシャル・マネジメント・インク
保管会社	ステート・ストリート・バンク・インターナショナル GmbH

## (3) 【運用体制】

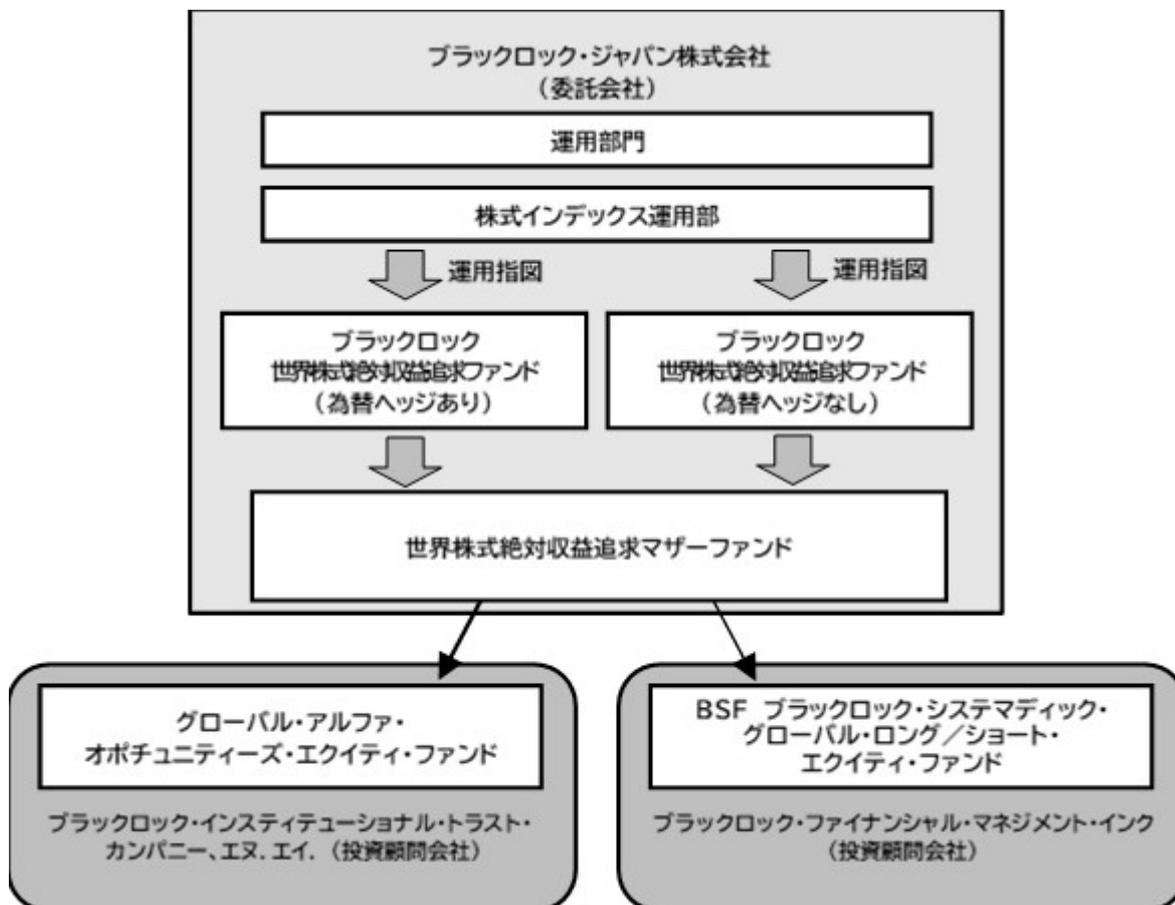
ファンドの運用・管理の各業務の役割分担を社内規程により定めております。

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ながら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9.49兆ドル<sup>\*</sup>（約1,054兆円）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。

\* 2021年6月末現在。(円換算レートは1ドル=110.99円を使用)

#### (4)【分配方針】

##### 収益分配方針

年2回の毎決算時(原則として1月15日および7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、分配を行ないます。

##### 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な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ないます。

##### 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) 一般コースの場合

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) 累積投資コースの場合

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ないます。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な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】

## 各ファンドの約款で定める投資制限

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. 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。

## 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償還金の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。

#### 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。

### 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．買い建て・売り建てポジションを構築する戦略リスク

投資対象ファンドは、計量モデルを活用し、買い建て・売り建てポジションを構築する運用戦略により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。買い建てた銘柄の価格が下落した場合、もしくは売り建て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。また買い建てと売り建ての双方で損失した場合は、運用上想定されていた以上に当ファンドの運用成果に影響があり、損失が拡大する可能性があります。

##### b．株価変動リスク

投資対象ファンドは、世界各国の株式および株式関連の派生商品に投資を行いません。世界各国の経済・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。

##### c．デリバティブ取引のリスク

投資対象ファンドは、株式関連のデリバティブ取引（先物・スワップなど）を行いません。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いません。投資対象ファンドでは、投資対象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いません。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、大きい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

「為替ヘッジあり」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高い場合、ヘッジ・コストがかかります。

「為替ヘッジなし」は、原則として投資対象ファンドの発行通貨である米ドルに対して、為替ヘッジを行いません。したがって、為替レートの変動が運用成果に影響を与えます。

#### e．カンントリー・リスク

投資対象ファンドは、エマージング（新興）市場の発行体が発行する株式にも一部投資する場合があります。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、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。

#### 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（スイッチングを含みます）。

##### b．ファンドの繰上償還

各ファンドは各ファンドの換金により受益権の口数が30億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、各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．流動性リスクに関する事項

当ファンドが保有する資産の市場環境等の状況により、保有有価証券の流動性が低下し、投資者からの換金請求に制約がかかる等のリスク（流動性リスク）があります。当ファンドにおいて流動性リスクが顕在化すると考えられる状況は以下の通りです。

- ・経済全体または個別企業の業績の影響により、株価変動が大きくなるまたは取引量が著しく少なくなる等、株式市場動向が不安定になった場合
- ・デリバティブ市場において価格変動が大きくなるまたは取引量が著しく少なくなる等、デリバティブ市場動向が不安定になった場合
- ・主要投資対象とするファンドの購入・換金に制限がかかった場合

金融商品取引所等における取引の停止時、決済機能の停止時または大口の換金請求については、換金請求に制限がかかる場合があります。

##### e．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なった場合、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、運用担当部門から独立したリスク管理担当部門においてファンドの投資リスクおよび流動性リスクの計測・分析、投資・流動性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（流動性リスクを含む）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、社内の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、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、並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。

## 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、購入受付日の翌営業日の基準価額に3.85%（税抜3.50%）を上限として、販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

詳細は販売会社にお問い合わせください。

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ています（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。

当ファンドの取得申込は、2020年10月10日以降、受け付けませんこととします。

分配金の受取方法により、「一般コース」、「累積投資コース」の2つのコースがあります。「累積投資コース」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。

スイッチングにより購入する場合は、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

ファンドの実質的な信託報酬（a + b）は、信託財産の純資産総額に対して年2.2933%（税抜2.228%）程度となります。

#### a．ファンドの信託報酬

計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.7183%（税抜0.653%）の率を乗じて得た額とします。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0.0275% （税抜0.025%）	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0.6600% （税抜0.60%）	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

#### b．投資対象ファンドにかかる運用管理費用

年1.575%程度が投資対象ファンドから支払われます。

各投資対象ファンドへ均等に配分したものととして算出しています。

#### 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0.11%（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。

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。

<sup>\*</sup> 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

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ど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ついては各販売会社毎に、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%、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数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%、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)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。

少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」がご利用になれます。NISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。なお、NISAの口座では、特定口座や一般口座で生じた配当所得および譲渡所得との損益通算はできません。非課税の対象となる金額、期間等を含めて詳しくは販売会社にお問い合わせください。

## 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%、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。

外貨建資産への投資により外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

上記は2021年7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2021年7月末現在のものです。

「ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド(為替ヘッジあり)」

## (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	50,365,168	99.14
内 日本	50,365,168	99.14
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	434,469	0.86
純資産総額	50,799,637	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	世界株式絶対収益追求マ ザーファンド	日本	親投資信託 受益証券	43,117,172	1.1759	50,705,794	1.1681	50,365,168	99.14

(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	99.14

(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】

2021年7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(2015年1月15日)	957,773,597	(同左)	0.9845	(同左)
第2期(2015年7月15日)	706,420,247	716,876,433	1.0134	1.0284
第3期(2016年1月15日)	431,355,676	(同左)	0.9882	(同左)
第4期(2016年7月15日)	257,693,759	(同左)	0.9387	(同左)
第5期(2017年1月16日)	205,337,547	(同左)	0.9494	(同左)
第6期(2017年7月18日)	186,476,290	(同左)	0.9820	(同左)
第7期(2018年1月15日)	159,770,771	(同左)	0.9934	(同左)
第8期(2018年7月17日)	125,789,790	(同左)	0.9650	(同左)
第9期(2019年1月15日)	115,787,456	(同左)	0.9544	(同左)
第10期(2019年7月16日)	101,429,981	(同左)	0.9724	(同左)
第11期(2020年1月15日)	89,167,045	(同左)	0.9387	(同左)
第12期(2020年7月15日)	83,645,450	(同左)	0.9403	(同左)
第13期(2021年1月15日)	68,745,586	(同左)	0.9060	(同左)
第14期(2021年7月15日)	50,959,802	(同左)	0.9222	(同左)
2020年7月末現在	83,494,363		0.9386	
2020年8月末現在	83,874,609		0.9534	
2020年9月末現在	81,606,694		0.9276	
2020年10月末現在	79,978,093		0.9259	
2020年11月末現在	78,648,872		0.9105	
2020年12月末現在	69,596,868		0.9112	
2021年1月末現在	63,789,915		0.9129	
2021年2月末現在	64,390,983		0.9215	
2021年3月末現在	65,217,969		0.9333	
2021年4月末現在	62,853,301		0.9301	
2021年5月末現在	60,814,832		0.9345	
2021年6月末現在	59,873,853		0.9200	
2021年7月末現在	50,799,637		0.9193	

## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1期	
第2期	0.0150
第3期	
第4期	
第5期	
第6期	
第7期	
第8期	
第9期	
第10期	
第11期	
第12期	
第13期	
第14期	

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1期	1.6
第2期	4.5
第3期	2.5
第4期	5.0
第5期	1.1
第6期	3.4
第7期	1.2
第8期	2.9
第9期	1.1
第10期	1.9
第11期	3.5
第12期	0.2
第13期	3.6
第14期	1.8

(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	998,560,692	25,710,000	972,850,692
第2期	22,680,735	298,452,329	697,079,098
第3期	98,124,924	358,683,774	436,520,248
第4期	2,804,198	164,800,640	274,523,806
第5期	35,149,826	93,384,340	216,289,292
第6期	13,280,231	39,666,243	189,903,280
第7期		29,077,262	160,826,018
第8期		30,468,963	130,357,055
第9期	50,604	9,091,990	121,315,669
第10期		17,002,909	104,312,760
第11期		9,323,895	94,988,865
第12期		6,030,604	88,958,261
第13期		13,080,309	75,877,952
第14期		20,619,325	55,258,627

## 「ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド(為替ヘッジなし)」

## (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	719,531,681	100.03
内 日本	719,531,681	100.03
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	247,034	0.03
純資産総額	719,284,647	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	世界株式絶対収益追求マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	615,984,660	1.1760	724,397,968	1.1681	719,531,681	100.03

(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	100.03

(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

2021年7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(2015年1月15日)	12,135,487,725	13,301,883,530	1.0404	1.1404
第2期(2015年7月15日)	13,312,136,629	13,921,571,606	1.0922	1.1422
第3期(2016年1月15日)	9,391,426,507	9,484,247,383	1.0118	1.0218
第4期(2016年7月15日)	5,796,915,954	(同左)	0.8628	(同左)
第5期(2017年1月16日)	4,505,061,079	(同左)	0.9534	(同左)
第6期(2017年7月18日)	3,258,112,206	(同左)	0.9780	(同左)
第7期(2018年1月15日)	2,468,653,368	(同左)	0.9856	(同左)
第8期(2018年7月17日)	2,040,093,900	(同左)	0.9822	(同左)
第9期(2019年1月15日)	1,584,286,967	(同左)	0.9544	(同左)
第10期(2019年7月16日)	1,342,789,696	(同左)	0.9825	(同左)
第11期(2020年1月15日)	1,120,990,956	(同左)	0.9781	(同左)
第12期(2020年7月15日)	899,644,956	(同左)	0.9622	(同左)
第13期(2021年1月15日)	772,254,819	(同左)	0.8996	(同左)
第14期(2021年7月15日)	725,219,342	(同左)	0.9714	(同左)
2020年7月末現在	872,094,442		0.9362	
2020年8月末現在	879,231,734		0.9583	
2020年9月末現在	852,787,482		0.9367	
2020年10月末現在	827,483,845		0.9248	
2020年11月末現在	793,662,001		0.9034	
2020年12月末現在	784,307,105		0.9016	
2021年1月末現在	762,307,640		0.9122	
2021年2月末現在	757,726,047		0.9366	
2021年3月末現在	784,632,136		0.9887	
2021年4月末現在	767,654,628		0.9698	
2021年5月末現在	775,310,020		0.9824	
2021年6月末現在	765,508,345		0.9746	
2021年7月末現在	719,284,647		0.9645	

## 分配の推移

	1口当たりの分配金(円)
第1期	0.1000
第2期	0.0500
第3期	0.0100
第4期	
第5期	
第6期	
第7期	
第8期	
第9期	
第10期	
第11期	
第12期	
第13期	
第14期	

## 収益率の推移

	収益率(%)
第1期	14.0
第2期	9.8
第3期	6.4
第4期	14.7
第5期	10.5
第6期	2.6
第7期	0.8
第8期	0.3
第9期	2.8
第10期	2.9
第11期	0.4
第12期	1.6
第13期	6.5
第14期	8.0

(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	12,278,492,168	614,534,115	11,663,958,053
第2期	4,455,831,030	3,931,089,532	12,188,699,551
第3期	3,291,947,721	6,198,559,640	9,282,087,632
第4期	209,741,336	2,773,360,058	6,718,468,910
第5期	90,712,428	2,084,085,529	4,725,095,809
第6期	29,368,515	1,423,205,002	3,331,259,322
第7期	82,625,597	909,247,881	2,504,637,038
第8期	1,027,622	428,549,479	2,077,115,181
第9期	638,045	417,760,595	1,659,992,631
第10期	273,194	293,550,581	1,366,715,244
第11期	234,649	220,845,674	1,146,104,219
第12期	138,048	211,281,813	934,960,454
第13期		76,532,356	858,428,098
第14期		111,853,868	746,574,230

(参考情報)「世界株式絶対収益追求マザーファンド」

## (1) 投資状況

資産の種類	金額(円)	投資比率(%)
投資証券	763,141,667	99.13
内 ケイマン諸島	382,909,712	49.74
内 ルクセンブルグ	380,231,955	49.39
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	6,724,153	0.87
純資産総額	769,865,820	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	グローバル・アルファ・オポチュニティーズ・エクイティ・ファンド・リミテッド クラスA投資証券	ケイマン諸島	投資証券	338,647	1,133.97	384,018,397	1,130.70	382,909,712	49.74
2	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・システムティック・グローバル・ロング/ショート・エクイティ・ファンド クラスJ投資証券	ルクセンブルグ	投資証券	30,250	12,603.39	381,258,714	12,569.45	380,231,955	49.39

(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	99.13

(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。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

当ファンドの取得申込は、2020年10月10日以降、受け付けないこととします。

#### (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。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「一般コース」と分配金が税引き後無手数料で再投資される「累積投資コース」の2つの申込方法があります。

「累積投資コース」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、詳細は販売会社に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予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、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を当日のお申込みとします（スイッチングを含みます。）。ただし、受付時間は販売会社により異なることがあります。詳細は販売会社にお問い合わせください。受付時間を過ぎての購入の申込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

以下に定める日のいずれかに該当する場合には、販売会社の営業日であっても購入（スイッチングを含みます。）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。

- ・ニューヨーク市の銀行の休業日
- ・ルクセンブルグの銀行の休業日
- ・12月24日
- ・その他マザーファンドの投資対象ファンドの受付不可日

## (5) 購入単位

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「一般コース」と、分配金が税引き後、無手数料で再投資される「累積投資コース」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単位は、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。

スイッチングによる各ファンドの購入単位についても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。

## (6) 購入価額

購入受付日の翌営業日の基準価額とします。

また、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 . 購入受付日の翌営業日の基準価額に3.85%（税抜3.50%）を上限として、販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

詳細は、販売会社にお問い合わせください。

なお、購入時手数料には消費税等相当額が含まれています。

b . 「累積投資コース」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。

c . スwitchingによる購入の場合は、無手数料とします。

## (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（スイッチングを含みます。）。

## 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、委託会社に換金の申込を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。換金の申込の受付は、午後3時までとなっております（スイッチングを含みます。）。ただし、受付時間は販売会社により異なることがあります。詳細は販売会社にお問い合わせください。受付時間を過ぎての換金の申込は翌営業日の取扱いとします。

### (2) 換金単位

換金単位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。

### (3) 換金不可日

以下に定める日のいずれかに該当する場合には、販売会社の営業日であっても換金（スイッチングを含みます。）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。

- ・ニューヨーク市の銀行の休業日
- ・ルクセンブルグの銀行の休業日
- ・12月24日
- ・その他マザーファンドの投資対象ファンドの受付不可日

### (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。詳細は販売会社にお問い合わせください。

### (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8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け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け付けたものとします（スイッチングを含みます。）。

### 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「世株収益追有」、「世株収益追無」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、2014年7月7日から2024年7月8日までとします。ただし、委託会社は、信託期間満了前に信託期間の延長が投資者に有利であると認めるときは、受託会社と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

#### (4)【計算期間】

毎年1月16日から7月15日まで、および7月16日から翌年1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、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、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、各ファンドの受益権の口数が30億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、各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発送します。
- d . c . の書面決議において、投資者(委託会社およびファンド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また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、監督官庁よりファンドの償還の命令を受けたときはその命令に従い、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当ファンド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発送します。

- 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、当ファンド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また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、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合にかかる一また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株式会社日本カストディ銀行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、購入いただいた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。

<一般コース>

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。

<累積投資コース>

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営業日に、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、

##### (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8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14期計算期間(2021年1月16日から2021年7月15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「世界株式絶対収益追求マザーファンド」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】

## 【ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド(為替ヘッジあり)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第13期 (2021年1月15日現在)	第14期 (2021年7月15日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	828,660	9,261,659
親投資信託受益証券	68,695,570	50,705,794
派生商品評価勘定	7,913	-
未収入金	-	268,995
流動資産合計	69,532,143	60,236,448
資産合計	69,532,143	60,236,448
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	5,011
未払解約金	453,100	9,014,140
未払受託者報酬	12,348	9,536
未払委託者報酬	276,863	213,803
その他未払費用	44,246	34,156
流動負債合計	786,557	9,276,646
負債合計	786,557	9,276,646
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	75,877,952	55,258,627
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	7,132,366	4,298,825
(分配準備積立金)	833,882	607,275
元本等合計	68,745,586	50,959,802
純資産合計	68,745,586	50,959,802
負債純資産合計	69,532,143	60,236,448

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第13期 (自 2020年7月16日 至 2021年1月15日)	第14期 (自 2021年1月16日 至 2021年7月15日)
営業収益		
有価証券売買等損益	5,020,340	5,225,737
為替差損益	2,441,677	3,800,598
営業収益合計	2,578,663	1,425,139
営業費用		
受託者報酬	12,348	9,536
委託者報酬	276,863	213,803
その他費用	50,453	34,494
営業費用合計	339,664	257,833
営業利益又は営業損失( )	2,918,327	1,167,306
経常利益又は経常損失( )	2,918,327	1,167,306
当期純利益又は当期純損失( )	2,918,327	1,167,306
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( )	317,570	271,972
期首剰余金又は期首欠損金( )	5,312,811	7,132,366
剰余金増加額又は欠損金減少額	781,202	1,938,207
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	781,202	1,938,207
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金( )	7,132,366	4,298,825

## (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 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期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。

## 3 収益及び費用の計上基準

有価証券売買等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準

約定日基準で計上しております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが当計算期間の翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第13期 (2021年1月15日現在)	第14期 (2021年7月15日現在)
1 当該計算期間の末日における受益権総数	75,877,952口	55,258,627口
2 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 7,132,366円	元本の欠損 4,298,825円
3 1口当たり純資産額	0.9060円	0.9222円

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第13期 (自 2020年7月16日 至 2021年1月15日)	第14期 (自 2021年1月16日 至 2021年7月15日)
分配金の計算過程	<p>当計算期末における、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)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(356,347円)、分配準備積立金(833,882円)により、分配対象収益は1,190,229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。</p>	<p>当計算期末における、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)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(259,510円)、分配準備積立金(607,275円)により、分配対象収益は866,785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。</p>

## （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、「買い建て・売り建てポジションを構築する戦略リスク」、「株価変動リスク」、「デリバティブ取引のリスク」、「為替変動リスク」、「カントリー・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、親投資信託の外貨建資産の時価総額のうち当ファンドに属するとみなした額の為替変動リスクの低減を目的としており、投機を目的とした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

第13期 (2021年1月15日現在)	第14期 (2021年7月15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>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 「(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」に記載されております。 (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。</p>	<p>2 時価の算定方法 (1) 有価証券 同左  (2) デリバティブ取引 同左  (3) 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 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。</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 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>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13期 (2021年1月15日現在)	第14期 (2021年7月15日現在)
期首元本額	88,958,261円	75,877,952円
期中追加設定元本額	- 円	- 円
期中一部解約元本額	13,080,309円	20,619,325円

## 2 有価証券関係

第13期(2021年1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	4,385,416
合計	4,385,416

第14期(2021年7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	3,918,910
合計	3,918,910

## 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	第13期(2021年1月15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	67,893,113		67,885,200	7,913
合 計		67,893,113		67,885,200	7,913

区分	種類	第14期(2021年7月15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	50,989,888	-	50,994,899	5,011
合 計		50,989,888	-	50,994,899	5,011

## (注1) 時価の算定方法

## 為替予約取引

- 1 計算期間末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。

計算期間末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。

計算期間末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。

- ・ 計算期間末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。
- ・ 計算期間末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 計算期間末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、計算期間末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。

## (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	世界株式絶対収益追求マザーファンド	43,117,172	50,705,794	
親投資信託受益証券 合計		43,117,172	50,705,794	
合計		43,117,172	50,705,794	

(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

当該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。

## 【ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド(為替ヘッジなし)】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第13期 (2021年1月15日現在)	第14期 (2021年7月15日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
親投資信託受益証券	775,753,166	728,369,353
未収入金	1,305,127	5,624,821
流動資産合計	777,058,293	733,994,174
資産合計	777,058,293	733,994,174
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,305,127	5,624,821
未払受託者報酬	130,042	117,098
未払委託者報酬	2,903,761	2,614,627
その他未払費用	464,544	418,286
流動負債合計	4,803,474	8,774,832
負債合計	4,803,474	8,774,832
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	858,428,098	746,574,230
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	86,173,279	21,354,888
(分配準備積立金)	24,633,371	21,423,622
元本等合計	772,254,819	725,219,342
純資産合計	772,254,819	725,219,342
負債純資産合計	777,058,293	733,994,174

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第13期 (自 2020年7月16日 至 2021年1月15日)	第14期 (自 2021年1月16日 至 2021年7月15日)
営業収益		
有価証券売買等損益	53,070,186	62,108,954
営業収益合計	53,070,186	62,108,954
営業費用		
受託者報酬	130,042	117,098
委託者報酬	2,903,761	2,614,627
その他費用	464,544	418,286
営業費用合計	3,498,347	3,150,011
営業利益又は営業損失( )	56,568,533	58,958,943
経常利益又は経常損失( )	56,568,533	58,958,943
当期純利益又は当期純損失( )	56,568,533	58,958,943
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( )	2,819,928	5,368,994
期首剰余金又は期首欠損金( )	35,315,498	86,173,279
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,890,824	11,228,442
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,890,824	11,228,442
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金( )	86,173,279	21,354,888

## (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。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが当計算期間の翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第13期 (2021年1月15日現在)	第14期 (2021年7月15日現在)
1 当該計算期間の末日における受益権総数	858,428,098口	746,574,230口
2 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 86,173,279円	元本の欠損 21,354,888円
3 1口当たり純資産額	0.8996円	0.9714円

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第13期 (自 2020年7月16日 至 2021年1月15日)	第14期 (自 2021年1月16日 至 2021年7月15日)
分配金の計算過程	当計算期末における、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)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(16,689,501円)、分配準備積立金(24,633,371円)により、分配対象収益は41,322,872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。	当計算期末における、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)(19,781,703円)、収益調整金(その他収益調整金)(14,514,845円)、分配準備積立金(21,423,622円)により、分配対象収益は55,720,170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、「買い建て・売り建てポジションを構築する戦略リスク」、「株価変動リスク」、「デリバティブ取引のリスク」、「為替変動リスク」、「カントリー・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13期 (2021年1月15日現在)	第14期 (2021年7月15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>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 「(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>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 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>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 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>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13期 (2021年1月15日現在)	第14期 (2021年7月15日現在)
期首元本額	934,960,454円	858,428,098円
期中追加設定元本額	- 円	- 円
期中一部解約元本額	76,532,356円	111,853,868円

## 2 有価証券関係

第13期(2021年1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	50,420,055
合計	50,420,055

第14期(2021年7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	56,547,688
合計	56,547,688

## 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	世界株式絶対収益追求マザーファンド	619,361,695	728,369,353	
親投資信託受益証券 合計		619,361,695	728,369,353	
合計		619,361,695	728,369,353	

(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、「世界株式絶対収益追求マザーファンド」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2021年7月15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。

## 「世界株式絶対収益追求マザーファンド」の状況

## (1) 貸借対照表

項目	(2021年7月15日現在)
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	16,594,250
投資証券	768,352,478
流動資産合計	784,946,728
資産合計	784,946,728
負債の部	
流動負債	
未払解約金	5,893,816
流動負債合計	5,893,816
負債合計	5,893,816
純資産の部	
元本等	
元本	662,478,867
剰余金又は欠損金( )	116,574,045
元本等合計	779,052,912
純資産合計	779,052,912
負債純資産合計	784,946,728

(注) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年7月16日から翌年7月15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自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社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。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

本報告書における開示対象ファンドの当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが本報告書における開示対象ファンドの当計算期間の翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2021年7月15日現在)
1 当該計算日における受益権総数	662,478,867口
2 1口当たり純資産額	1.1760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、「買い建て・売り建てポジションを構築する戦略リスク」、「株価変動リスク」、「デリバティブ取引のリスク」、「為替変動リスク」、「カントリー・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、外貨建有価証券の売買の決済等に必要となる外貨の売買の為に、その受渡日までの数日間の為替予約を利用しております。なお、当ファンドは外貨建資産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

(2021年7月15日現在)

- |                |  |
|----------------|--|
| (2021年7月15日現在) |  |
| 1              | 貸借対照表計上額、時価及び差額<br>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<br>(1) 有価証券<br>「(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。<br>(2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>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<br>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。 |
| 4              | 金銭債権の計算日後の償還予定額<br>金銭債権は全て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

(2021年7月15日現在)	
同計算期間の期首元本額	778,509,023円
同計算期間中の追加設定元本額	276,969円
同計算期間中の一部解約元本額	116,307,125円
同計算期間末日の元本額	662,478,867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。	
ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド（為替ヘッジなし）	619,361,695円
ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド（為替ヘッジあり）	43,117,172円
合計	662,478,867円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	(2021年7月15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	5,370,157
合計	5,370,157

(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

該当事項はありません。

## (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・システムティック・グローバル・ロング/ショート・エクイティ・ファンド クラスJ投資証券	30,250.480	3,482,132.750	
		グローバル・アルファ・オポチュニティーズ・エクイティ・ファンド・リミテッド クラスA投資証券	338,647.370	3,507,337.630	
	アメリカドル	小計	368,897.850	6,989,470.380 (768,352,478)	
投資証券 合計				768,352,478 (768,352,478)	
合計				768,352,478 (768,352,478)	

(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

該当事項はありません。

## (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・グローバル・ロング/ショート・エクイティ・ファンド クラスJ投資証券」及び「グローバル・アルファ・オポチュニティーズ・エクイティ・ファンド・リミテッド クラスA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・グローバル・ロング/ショート・エクイティ・ファンド クラスJ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、2020年11月30日に終了する中間計算期間(2020年6月1日から2020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2020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)「グローバル・アルファ・オポチュニティーズ・エクイティ・ファンド・リミテッドクラスA投資証券」は、ケイマン諸島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、2020年12月31日に終了する計算期間(2020年1月1日から2020年12月31日まで)に係る財務書類であります。当該財務書類は、その原文を翻訳したものです。

なお、「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・グローバル・ロング/ショート・エクイティ・ファンド クラスJ投資証券」は、2021年3月8日付で「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・システムティック・グローバル・ロング/ショート・エクイティ・ファンド クラスJ投資証券」へ名称変更いたしました。

## グローバル・アルファ・オポチュニティーズ・エクイティ・ファンド・リミテッド

要約投資有価証券明細表 2020年12月31日

期末現在の未決済デリバティブ金融商品

差金決済契約(以下「CFD」という。)

参照事業体	取引相手	期日	正味名目価額 (米ドル)	未実現評価益 (損) (米ドル)	参照事業体の 純額 (米ドル)	未実現評価益 (損)の対純資 産比率(%)
持分証券 - 買建/売建	Merrill Lynch International	2021年1月15日	8,553	(3,390) <sup>(a)</sup>	5,780	(0.1)
	Morgan Stanley & Co. International	2021年1月22日	6,592	(11,898) <sup>(b)</sup>	(4,992)	(0.3)
			15,145	(15,288)	788	

(a) (616)米ドルの正味配当金および融資手数料を含む。

(b) (314)米ドルの正味配当金および融資手数料を含む。

期末現在、Merrill Lynch Internationalを取引相手とする2021年1月15日期日のCFD合計の基礎となる個々の買建および売建ポジションならびに関連する持分証券の価額は、下表のとおりである。

国	価額 (米ドル)	CFD価額の比率 (%)
参照事業体 - 買建 普通株式		
オーストラリア		
素材	30	0.5
通信	18,981	328.4
消費財、循環型	8,903	154.0
消費財、非循環型	9,328	161.4
エネルギー	1,641	28.4
金融	23,206	401.5
資本財	3,576	61.9
技術	1,835	31.7
	67,500	
ベルギー		
金融	1,694	29.3
資本財	2,333	40.4
	4,027	
カナダ		
素材	1,505	26.0
消費財、循環型	2,799	48.4
消費財、非循環型	2,425	42.0
エネルギー	4,760	82.4
金融	11,383	196.9
資本財	379	6.6
電気・ガス・水道	2,533	43.8
	25,784	
中国		
消費財、循環型	2,766	47.9
金融	3,031	52.4
	5,797	
デンマーク		
素材	4,022	69.6

国	価額 (米ドル)	CFD価額の比率 (%)
フィンランド		
金融	1,438	24.9
資本財	1,373	23.7
	2,811	
フランス		
通信	2,129	36.9
消費財、非循環型	6,936	120.0
資本財	26,502	458.5
	35,567	
ドイツ		
素材	865	15.0
消費財、非循環型	1,758	30.4
金融	4,313	74.6
技術	3,996	69.1
	10,932	
中国香港特別行政区		
消費財、循環型	312	5.4
多角化事業	2,773	48.0
エネルギー	395	6.8
金融	3,660	63.3
	7,140	
アイルランド		
消費財、非循環型	725	12.5
イスラエル		
エネルギー	3,694	63.9
金融	4,463	77.2
技術	1,822	31.6
	9,979	
イタリア		
金融	10,726	185.6
資本財	1,835	31.7
電気・ガス・水道	293	5.1
	12,854	
日本		
素材	16,764	290.0
通信	2,868	49.6
消費財、循環型	21,682	375.1
消費財、非循環型	7,071	122.3
エネルギー	539	9.3
金融	4,471	77.4
資本財	19,394	335.6
技術	8,167	141.3
	80,956	

国	価額 (米ドル)	CFD価額の比率 (%)
ルクセンブルグ 通信	924	16.0
中国マカオ特別行政区 消費財、循環型	4,030	69.7
マルタ 消費財、循環型	726	12.6
メキシコ 素材	1,961	33.9
オランダ 消費財、非循環型	2,792	48.3
資本財	1,394	24.1
	4,186	
ニュージーランド 金融	3,525	61.0
資本財	11,701	202.4
	15,226	
ノルウェー 通信	171	2.9
消費財、非循環型	59	1.0
エネルギー	3,570	61.8
	3,800	
シンガポール 通信	18,066	312.6
金融	4,103	71.0
	22,169	
スペイン 金融	4,488	77.7
スウェーデン 素材	10,639	184.0
消費財、循環型	92	1.6
金融	10,316	178.5
資本財	1,848	32.0
	22,895	
スイス 消費財、循環型	2,881	49.8
金融	970	16.8
資本財	2,104	36.4
	5,955	

国	価額 (米ドル)	CFD価額の比率 (%)
英国		
素材	4,495	77.8
通信	3,372	58.3
消費財、循環型	6,765	117.1
消費財、非循環型	960	16.6
エネルギー	4,600	79.6
金融	1,516	26.2
	21,708	
米国		
素材	3,748	64.8
通信	11,401	197.2
消費財、循環型	18,182	314.6
消費財、非循環型	40,362	698.3
エネルギー	3,594	62.2
金融	29,928	517.8
資本財	29,777	515.2
技術	28,838	498.9
電気・ガス・水道	11,189	193.6
	177,019	
参照事業体 - 買建合計	553,181	
参照事業体 - 売建 普通株式		
オーストラリア		
素材	(7,669)	(132.7)
消費財、循環型	(5,160)	(89.3)
エネルギー	(2,575)	(44.6)
金融	(3,346)	(57.9)
資本財	(3,875)	(67.0)
技術	(1,797)	(31.1)
電気・ガス・水道	(3,569)	(61.7)
	(27,991)	
ベルギー		
通信	(43)	(0.7)
消費財、非循環型	(2,254)	(39.0)
	(2,297)	
ブルキナファソ		
素材	(209)	(3.6)

国	価額 (米ドル)	CFD価額の比率 (%)
カナダ		
素材	(10,237)	(177.1)
通信	(566)	(9.8)
消費財、循環型	(688)	(11.9)
消費財、非循環型	(18,012)	(311.6)
エネルギー	(8,666)	(149.9)
金融	(2,941)	(50.9)
資本財	(4,409)	(76.3)
技術	(11,557)	(199.9)
電気・ガス・水道	(36,862)	(637.8)
	(93,938)	
中国		
消費財、非循環型	(3,166)	(54.8)
資本財	(2,159)	(37.3)
	(5,325)	
デンマーク		
消費財、非循環型	(4,067)	(70.4)
フランス		
通信	(1,157)	(20.0)
消費財、循環型	(2,416)	(41.8)
消費財、非循環型	(1,513)	(26.2)
金融	(4,294)	(74.3)
資本財	(1,983)	(34.3)
技術	(4,301)	(74.4)
電気・ガス・水道	(1,970)	(34.1)
	(17,634)	
ドイツ		
素材	(845)	(14.6)
通信	(3,244)	(56.1)
消費財、非循環型	(3,859)	(66.8)
金融	(639)	(11.1)
資本財	(3,491)	(60.4)
	(12,078)	
中国香港特別行政区		
消費財、循環型	(1,190)	(20.6)
金融	(23,460)	(405.9)
資本財	(2,686)	(46.4)
技術	(3,958)	(68.5)
電気・ガス・水道	(4,624)	(80.0)
	(35,918)	
アイルランド		
消費財、循環型	(18,298)	(316.6)
消費財、非循環型	(3,061)	(53.0)
金融	(4,324)	(74.8)
資本財	(11,863)	(205.2)
	(37,546)	

国	価額 (米ドル)	CFD価額の比率 (%)
イスラエル		
通信	(12,053)	(208.5)
消費財、非循環型	(2,056)	(35.6)
	(14,109)	
イタリア		
通信	(1,645)	(28.4)
金融	(565)	(9.8)
資本財	(2,029)	(35.1)
電気・ガス・水道	(220)	(3.8)
	(4,459)	
コートジボワール		
素材	(372)	(6.4)
日本		
素材	(7,235)	(125.2)
消費財、循環型	(10,509)	(181.8)
消費財、非循環型	(10,072)	(174.2)
エネルギー	(1,779)	(30.8)
金融	(18,070)	(312.6)
資本財	(7,011)	(121.3)
電気・ガス・水道	(2,785)	(48.2)
	(57,461)	
キルギスタン		
素材	(1,064)	(18.4)
ルクセンブルグ		
素材	(2,136)	(37.0)
消費財、非循環型	(1,869)	(32.3)
	(4,005)	
中国マカオ特別行政区		
消費財、循環型	(14,797)	(256.0)
オランダ		
通信	(591)	(10.2)
技術	(2,912)	(50.4)
	(3,503)	
ニュージーランド		
電気・ガス・水道	(1,576)	(27.3)
シンガポール		
資本財	(4,336)	(75.0)

国	価額 (米ドル)	CFD価額の比率 (%)
スペイン		
消費財、循環型	(540)	(9.3)
消費財、非循環型	(4,222)	(73.1)
金融	(1,610)	(27.9)
資本財	(7,949)	(137.5)
電気・ガス・水道	(4,324)	(74.8)
	(18,645)	
スウェーデン		
消費財、非循環型	(1,182)	(20.5)
金融	(3,944)	(68.2)
資本財	(1,636)	(28.3)
	(6,762)	
スイス		
通信	(1,581)	(27.4)
消費財、非循環型	(699)	(12.1)
金融	(2,458)	(42.5)
資本財	(1,748)	(30.2)
	(6,486)	
英国		
通信	(1,998)	(34.6)
消費財、循環型	(5,395)	(93.3)
消費財、非循環型	(3,249)	(56.2)
多角化事業	(10,466)	(181.1)
金融	(12,273)	(212.3)
資本財	(4,316)	(74.7)
技術	(3,606)	(62.4)
	(41,303)	
米国		
素材	(16,795)	(290.6)
通信	(10,660)	(184.4)
消費財、循環型	(9,234)	(159.8)
消費財、非循環型	(14,936)	(258.4)
エネルギー	(226)	(3.9)
金融	(19,813)	(342.8)
資本財	(20,931)	(362.1)
技術	(24,177)	(418.3)
電気・ガス・水道	(10,641)	(184.1)
	(127,413)	
ザンビア		
素材	(4,107)	(71.1)
参照事業体 - 売建合計	(547,401)	
参照事業体 - Merrill Lynch International純額	5,780	

期末現在、Morgan Stanley & Co. Internationalを取引相手とする2021年1月22日期日のCFD合計の基礎となる個々の買建および売建ポジションならびに関連する持分証券の価額は、下表のとおりである。

国	価額 (米ドル)	CFD価額の比率 (%)
参照事業体 - 買建		
普通株式		
オーストラリア		
素材	47,094	943.4
通信	8,402	168.3
消費財、循環	44,654	894.5
消費財、非循環型	78,270	1,567.9
エネルギー	5,482	109.8
金融	58,347	1,168.8
資本財	34,001	681.1
技術	10,320	206.8
	286,570	
オーストリア		
素材	5,628	112.7
金融	16,123	323.0
資本財	6,510	130.4
	28,261	
ベルギー		
素材	1,202	24.1
消費財、非循環型	1,674	33.5
金融	9,336	187.0
資本財	1,134	22.7
電気・ガス・水道	5,845	117.1
	19,191	
バミューダ		
金融	17,577	352.1
カナダ		
素材	5,974	119.7
通信	23,135	463.4
消費財、循環型	10,866	217.7
消費財、非循環型	7,898	158.2
エネルギー	29,695	594.9
金融	72,817	1,458.7
資本財	641	12.8
電気・ガス・水道	41,175	824.8
	192,201	
チリ		
素材	3,255	65.2

国	価額 (米ドル)	CFD価額の比率 (%)
中国		
通信	16,000	320.5
消費財、循環型	4,527	90.7
消費財、非循環型	1,981	39.7
金融	24,246	485.7
	46,754	
コロンビア		
通信	2,563	51.3
デンマーク		
素材	31,645	633.9
消費財、非循環型	12,814	256.7
金融	18,776	376.1
資本財	13,855	277.6
	77,090	
フィンランド		
通信	6,022	120.6
金融	27,205	545.0
資本財	3,568	71.5
	36,795	
フランス		
素材	13,469	269.8
通信	11,561	231.6
消費財、循環型	25,797	516.8
消費財、非循環型	32,970	660.4
金融	20,237	405.4
資本財	166,432	3,334.0
技術	567	11.4
	271,033	
ドイツ		
素材	30,742	615.8
通信	9,962	199.6
消費財、循環型	31,478	630.6
消費財、非循環型	16,391	328.3
エネルギー	1,220	24.4
金融	87,628	1,755.4
資本財	26,542	531.7
技術	8,262	165.5
	212,225	

国	価額 (米ドル)	CFD価額の比率 (%)
中国香港特別行政区		
消費財、循環型	6,242	125.0
消費財、非循環型	7,790	156.1
多角化事業	8,318	166.6
金融	54,297	1,087.7
資本財	9,618	192.7
	86,265	
アイルランド		
消費財、非循環型	27,983	560.6
資本財	15,241	305.3
	43,224	
イスラエル		
エネルギー	1,073	21.5
金融	36,195	725.0
技術	2,450	49.1
	39,718	
イタリア		
消費財、循環型	225	4.5
消費財、非循環型	10,200	204.3
金融	69,972	1,401.7
資本財	22,552	451.8
電気・ガス・水道	1,896	38.0
	104,845	
日本		
素材	141,301	2,830.6
通信	87,900	1,760.8
消費財、循環型	213,759	4,282.0
消費財、非循環型	278,954	5,588.0
エネルギー	21,243	425.5
金融	165,944	3,324.2
資本財	476,087	9,537.0
技術	124,128	2,486.5
電気・ガス・水道	12,537	251.2
	1,521,853	
ルクセンブルグ		
通信	12,242	245.2
中国マカオ特別行政区		
消費財、循環型	8,060	161.5

国	価額 (米ドル)	CFD価額の比率 (%)
マルタ		
消費財、循環型	2,187	43.8
メキシコ		
素材	4,941	99.0
オランダ		
消費財、非循環型	70,845	1,419.2
金融	40,653	814.3
資本財	14,745	295.4
	126,243	
ニュージーランド		
技術	2,039	40.8
ノルウェー		
通信	2,769	55.5
消費財、非循環型	7,764	155.5
エネルギー	14,084	282.1
金融	654	13.1
	25,271	
シンガポール		
通信	13,435	269.1
消費財、循環型	9,045	181.2
消費財、非循環型	1,491	29.9
金融	56,145	1,124.7
資本財	1,011	20.2
	81,127	
スペイン		
金融	25,207	504.9
資本財	4,141	83.0
	29,348	
スウェーデン		
素材	55,017	1,102.1
通信	1,948	39.0
消費財、循環型	62,581	1,253.6
消費財、非循環型	13,963	279.7
金融	46,885	939.2
資本財	30,423	609.5
技術	974	19.5
	211,791	

国	価額 (米ドル)	CFD価額の比率 (%)
<b>スイス</b>		
消費財、循環型	4,162	83.4
消費財、非循環型	40,171	804.7
金融	38,613	773.5
資本財	45,074	902.9
	128,020	
<b>英国</b>		
素材	18,318	367.0
通信	28,325	567.4
消費財、循環型	13,734	275.1
消費財、非循環型	24,976	500.3
エネルギー	12,542	251.2
金融	62,642	1,254.9
技術	10,724	214.8
電気・ガス・水道	31,498	631.0
	202,759	
<b>米国</b>		
素材	52,105	1,043.8
通信	188,090	3,767.8
消費財、循環型	250,456	5,017.2
消費財、非循環型	383,559	7,683.5
エネルギー	52,495	1,051.6
金融	396,227	7,937.2
資本財	345,049	6,912.0
技術	313,584	6,281.7
電気・ガス・水道	157,716	3,159.4
	2,139,281	
参照事業体 - 買建合計	5,962,729	
<b>参照事業体 - 売建</b>		
普通株式		
オーストラリア		
素材	(53,046)	(1,062.6)
通信	(1,449)	(29.0)
消費財、循環型	(97,176)	(1,946.6)
エネルギー	(42,099)	(843.3)
金融	(17,314)	(346.9)
資本財	(29,044)	(581.8)
技術	(5,614)	(112.5)
電気・ガス・水道	(47,847)	(958.5)
	(293,589)	

国	価額 (米ドル)	CFD価額の比率 (%)
オーストリア		
通信	(3,168)	(63.5)
エネルギー	(1,817)	(36.4)
金融	(1,069)	(21.4)
	(6,054)	
ベルギー		
通信	(2,189)	(43.9)
消費財、非循環型	(14,471)	(289.9)
金融	(15,357)	(307.6)
資本財	(1,518)	(30.4)
	(33,535)	
ブラジル		
素材	(13,430)	(269.0)
カナダ		
素材	(39,587)	(793.0)
通信	(3,831)	(76.7)
消費財、循環型	(26,335)	(527.5)
消費財、非循環型	(26,696)	(534.8)
金融	(32,494)	(650.9)
資本財	(33,369)	(668.5)
技術	(46,457)	(930.6)
電気・ガス・水道	(9,298)	(186.3)
	(218,067)	
中国		
消費財、非循環型	(21,110)	(422.9)
デンマーク		
消費財、非循環型	(30,465)	(610.3)
資本財	(4,469)	(89.5)
	(34,934)	
フィンランド		
素材	(938)	(18.8)
資本財	(12,268)	(245.8)
技術	(5,883)	(117.8)
	(19,089)	

国	価額 (米ドル)	CFD価額の比率 (%)
フランス		
素材	(7,436)	(149.0)
通信	(25,485)	(510.5)
消費財、循環型	(8,737)	(175.0)
消費財、非循環型	(15,450)	(309.5)
エネルギー	(5,984)	(119.9)
金融	(16,216)	(324.8)
資本財	(14,437)	(289.2)
技術	(27,977)	(560.4)
電気・ガス・水道	(25,269)	(506.2)
	(146,991)	
ドイツ		
素材	(58,825)	(1,178.4)
通信	(47,104)	(943.6)
消費財、循環型	(20,739)	(415.4)
消費財、非循環型	(67,511)	(1,352.4)
金融	(8,591)	(172.1)
資本財	(19,838)	(397.4)
技術	(9,728)	(194.9)
電気・ガス・水道	(7,187)	(143.9)
	(239,523)	
中国香港特別行政区		
消費財、循環型	(3,890)	(77.9)
消費財、非循環型	(5,979)	(119.8)
多角化事業	(61,600)	(1,234.0)
金融	(4,385)	(87.8)
資本財	(16,114)	(322.8)
電気・ガス・水道	(5,417)	(108.5)
	(97,385)	
インドネシア		
消費財、非循環型	(10,274)	(205.8)
イスラエル		
消費財、非循環型	(5,674)	(113.7)
エネルギー	(644)	(12.9)
資本財	(2,187)	(43.8)
技術	(1,994)	(39.9)
	(10,499)	

国	価額 (米ドル)	CFD価額の比率 (%)
イタリア		
通信	(3,369)	(67.5)
消費財、循環型	(26,081)	(522.4)
金融	(10,993)	(220.2)
資本財	(28,428)	(569.5)
電気・ガス・水道	(11,521)	(230.8)
	(80,392)	
日本		
素材	(180,572)	(3,617.2)
通信	(29,205)	(585.0)
消費財、循環型	(335,658)	(6,723.9)
消費財、非循環型	(184,946)	(3,704.9)
エネルギー	(14,132)	(283.1)
金融	(280,387)	(5,616.7)
資本財	(345,141)	(6,913.9)
技術	(114,154)	(2,286.7)
電気・ガス・水道	(98,390)	(1,971.0)
	(1,582,585)	
キルギスタン		
素材	(532)	(10.7)
ルクセンブルグ		
素材	(30,163)	(604.2)
中国マカオ特別行政区		
消費財、循環型	(2,236)	(44.8)
オランダ		
通信	(13,773)	(275.9)
消費財、循環型	(7,123)	(142.7)
消費財、非循環型	(46,303)	(927.6)
金融	(26,993)	(540.7)
技術	(29,972)	(600.4)
	(124,164)	
ニュージーランド		
電気・ガス・水道	(11,623)	(232.8)
ノルウェー		
消費財、非循環型	(17,133)	(343.2)
金融	(42,988)	(861.2)
	(60,121)	

国	価額 (米ドル)	CFD価額の比率 (%)
シンガポール		
通信	(3,667)	(73.5)
消費財、循環型	(5,092)	(102.0)
消費財、非循環型	(2,070)	(41.5)
エネルギー	(3,257)	(65.2)
金融	(42,155)	(844.5)
資本財	(16,885)	(338.2)
	(73,126)	
スペイン		
通信	(207)	(4.2)
消費財、循環型	(4,993)	(100.0)
消費財、非循環型	(22,124)	(443.2)
エネルギー	(4,793)	(96.0)
金融	(14,691)	(294.3)
資本財	(10,534)	(211.0)
電気・ガス・水道	(7,811)	(156.5)
	(65,153)	
スウェーデン		
通信	(4,910)	(98.4)
消費財、非循環型	(41,546)	(832.2)
エネルギー	(2,257)	(45.2)
金融	(44,368)	(888.8)
資本財	(32,004)	(641.1)
	(125,085)	
スイス		
通信	(9,411)	(188.5)
消費財、循環型	(2)	(0.0)
消費財、非循環型	(75,943)	(1,521.3)
金融	(64,427)	(1,290.6)
資本財	(76,551)	(1,533.5)
	(226,334)	
トルコ		
素材	(3,297)	(66.0)

国	価額 (米ドル)	CFD価額の比率 (%)
英国		
通信	(5,783)	(115.8)
消費財、循環型	(8,612)	(172.5)
消費財、非循環型	(24,909)	(499.0)
金融	(139,133)	(2,787.1)
資本財	(77,740)	(1,557.3)
技術	(9,689)	(194.1)
	<u>(265,866)</u>	
米国		
素材	(93,975)	(1,882.5)
通信	(111,613)	(2,235.8)
消費財、循環型	(183,247)	(3,670.8)
消費財、非循環型	(384,900)	(7,710.3)
エネルギー	(28,901)	(579.0)
金融	(523,584)	(10,488.5)
資本財	(392,250)	(7,857.6)
技術	(346,547)	(6,942.1)
電気・ガス・水道	(101,000)	(2,023.2)
	<u>(2,166,017)</u>	
ザンビア		
素材	(6,547)	(131.2)
参照事業体 - 売建合計	<u>(5,967,721)</u>	
参照事業体 - Morgan Stanley & Co. International純額	<u>(4,992)</u>	

## リスク・エクスポージャー別のデリバティブ金融商品

期末現在、資産負債計算書上のデリバティブ金融商品の公正価値は、下表のとおりである。

	商品契約 (米ドル)	信用契約 (米ドル)	株式契約 (米ドル)	為替契約 (米ドル)	金利契約 (米ドル)	合計 (米ドル)
負債 - デリバティブ金融商品						
差金決済契約						
差金決済契約に係る未実現評価損	-	-	15,288	-	-	15,288

2020年12月31日に終了した会計年度における損益計算書上のデリバティブ金融商品による影響は、下表のとおりである。

	商品取引 (米ドル)	信用契約 (米ドル)	株式取引 (米ドル)	為替取引 (米ドル)	金利契約 (米ドル)	合計 (米ドル)
以下に係る実現純利益(損失)						
差金決済契約	-	-	118,792	-	-	118,792
以下に係る未実現評価益(損)の純変動額						
差金決済契約	-	-	39,357	-	-	39,357

未決済デリバティブ金融商品の平均残高<sup>(a)</sup>

	(米ドル)
差金決済契約	
契約の平均名目価額 - 買建	7,504,271
契約の平均名目価額 - 売建	7,495,359

<sup>(a)</sup> 未決済の平均名目価額は、2020年12月31日に終了した会計年度における平均取引高を表す。

## 期末現在のデリバティブ金融商品 - 相殺

ファンドのデリバティブ資産および負債(種類別)は下表のとおりである。

	資産 (米ドル)	負債 (米ドル)
デリバティブ金融商品		
差金決済契約	-	15,288
資産負債計算書上のデリバティブ資産および負債の合計	-	15,288
マスター・ネットリング契約または同様の契約(以下「MNA」という。)の 対象となるデリバティブ金融商品合計	-	15,288

下表は、MNAに基づき相殺可能な金額およびファンドの関連する受取および/又は差入担保を控除後の、2020年12月31日現在のファンドのデリバティブ資産および負債を示している。

取引相手	MNAの対象となる				デリバティブ負債(純額) <sup>(b)</sup> (米ドル)
	取引相手別のデリバティブ負債 (米ドル)	相殺可能なデリバティブ (米ドル)	非現金担保 <sup>(a)</sup> (米ドル)	現金担保 <sup>(a)</sup> (米ドル)	
Merrill Lynch International	3,390	-	-	-	3,390
Morgan Stanley & Co. International	11,898	-	-	(11,898)	-
	15,288	-	-	(11,898)	3,390

<sup>(a)</sup> 財務報告の目的上、受取または差入担保の超過額は表示されていない。

<sup>(b)</sup> 債務不履行時に取引相手に支払われる純額を表す。

## 期末の公正価値ヒエラルキー

投資およびデリバティブの公正価値の算定には様々なインプットが使用される。投資およびデリバティブ金融商品の評価に関するファンドの方針の情報については財務書類に対する注記を参照のこと。

開示ヒエラルキー別のファンドの投資およびデリバティブ金融商品の要約は下表のとおりである。

	レベル1 (米ドル)	レベル2 (米ドル)	レベル3 (米ドル)	合計 (米ドル)
デリバティブ金融商品 <sup>(a)</sup>				
負債				
株式契約	-	(15,288)	-	(15,288)

(a) デリバティブ金融商品はリスク・エクスポージャー別に分類され、差金決済契約を含む。差金決済契約は、デリバティブ金融商品に係る未実現評価益（損）に表示されている。

グローバル・アルファ・オポチュニティーズ・エクイティ・ファンド・リミテッド  
資産負債計算書 2020年12月31日

	米ドル
資産	
現金	2,778,403
ブローカーに対する債権	7,723
差入担保金：	
担保 - OTCデリバティブ	1,070,000
外国通貨、公正価値（取得原価311,951米ドル）	324,675
前払費用	8,229
資産合計	4,189,030
負債	
ブローカーに対する債務	1,496
未払金：	
未払投資運用報酬	11,523
未払管理事務代行報酬	23,984
未払監査報酬	47,000
その他の未払費用	77
以下に係る未実現評価損：	
差金決済契約	15,288
負債合計	99,368
純資産	4,089,662

財務書類に対する注記を参照のこと。

## グローバル・アルファ・オポチュニティーズ・エクイティ・ファンド・リミテッド

損益計算書 2020年12月31日に終了した会計年度

	米ドル
投資収益	
受取利息	16,297
投資収益合計	16,297
費用	
投資運用報酬	78,694
管理事務代行報酬	57,894
監査報酬	47,000
取締役報酬	16,000
専門家報酬	3,329
その他の費用	8,129
費用合計	211,046
投資純利益（損失）	(194,749)
実現および未実現利益（損失）	
以下に係る実現純利益（損失）：	
差金決済契約	118,792
外国通貨取引	(9,063)
実現純利益（損失）	109,729
以下に係る未実現評価益（損）の純変動額：	
差金決済契約	39,357
外貨換算	10,972
未実現評価益（損）の純変動	50,329
実現および未実現純利益（損失）	160,058
運用による純資産の純増加（減少）額	(34,691)

財務書類に対する注記を参照のこと。

グローバル・アルファ・オポチュニティーズ・エクイティ・ファンド・リミテッド  
純資産変動計算書 2020年12月31日に終了した会計年度

	米ドル
純資産の増加(減少)	
運用	
投資純利益(損失)	(194,749)
実現純利益(損失)	109,729
未実現評価益(損)の純変動	50,329
運用による純資産の純増加(減少)額	(34,691)
資本取引	
投資証券買戻し	(1,363,440)
資本取引による純資産の純増加(減少)額	(1,363,440)
純資産	
純資産の純増加(減少)額	(1,398,131)
期首純資産	5,487,793
期末純資産	4,089,662

財務書類に対する注記を参照のこと。

グローバル・アルファ・オポチュニティーズ・エクイティ・ファンド・リミテッド  
 キャッシュ・フロー計算書 2020年12月31日に終了した会計年度

	米ドル
営業活動により生じた（に使用した）キャッシュ・フロー	
運用による純資産の純増加（減少）額	(34,691)
運用による純資産の純増加（減少）額から営業活動により生じた（に使用した）現金純額への調整：	
実現純（利益）損失	(109,729)
未実現評価（益）損の純変動	(50,329)
デリバティブに関して取引相手から受領した（に支払った）純支払額	118,792
営業資産の（増加）減少：	
ブローカーに対する債権	(4,568)
前払費用	(8,229)
営業負債の増加（減少）：	
ブローカーに対する債務	(51,350)
未払金：	
未払投資運用報酬	(29,847)
未払管理事務代行報酬	4,304
その他の未払費用	(63)
営業活動により生じた（に使用した）現金純額	(165,710)
財務活動により生じた（に使用した）キャッシュ・フロー	
投資証券買戻し	(1,363,440)
財務活動により生じた（に使用した）現金純額	(1,363,440)
拘束性および非拘束性の現金および外国通貨の純増加（減少）額	(1,529,150)
現金に対する為替レートの影響額	1,909
拘束性および非拘束性の現金および外国通貨	
期首	5,700,319
期末	4,173,078

財務書類に対する注記を参照のこと。

グローバル・アルファ・オポチュニティーズ・エクイティ・ファンド・リミテッド  
キャッシュ・フロー計算書 2020年12月31日に終了した会計年度(続き)  
期末現在の拘束性および非拘束性の現金および外国通貨から資産負債計算書への調整

	米ドル
現金	2,778,403
外国通貨、公正価値	324,675
差入担保金:	
担保 - OTCデリバティブ	1,070,000
期末	4,173,078

財務書類に対する注記を参照のこと。

グローバル・アルファ・オポチュニティーズ・エクイティ・ファンド・リミテッド  
財務ハイライト 2020年12月31日に終了した会計年度

	クラス A
	米ドル
期首純資産価額	10.59
投資純利益(損失) <sup>(a)</sup>	(0.44)
実現および未実現純利益(損失)	0.32
運用による純資産の純増加(減少)額	(0.12)
期末純資産価額	10.47
トータル・リターン <sup>(b)</sup>	
トータル・リターン	(1.13) %
平均純資産に占める割合	
投資純利益(損失)	(4.09) %
営業費用	4.43 %

(a) 当期における発行済の平均投資証券口数に基づく。

(b) 該当がある場合、投資運用報酬による影響を含む。

トータル・リターンおよび割合は、各クラス投資証券を全体として捉えて計算したものである。個々の投資主のトータル・リターンおよび割合は、資本取引の時期および異なる投資運用報酬の取り決め(該当がある場合)に基づき異なる場合がある。一部の財務ハイライトデータは、四捨五入により、資本勘定に関する計算書とは異なる場合がある。

財務書類に対する注記を参照のこと。

純資産計算書 2020年11月30日現在（未監査）

	注記	ブラックロック・グローバル・ロング/ショート・エクイティ・ファンド 米ドル
資産		
投資有価証券 - 取得原価		52,416,709
投資有価証券 - 時価	2 (a)	52,416,709
銀行預金	2 (a)	3,420,220
ブローカーに対する債権	14	3,610,309
売却投資有価証券未収金	2 (a)、 2 (d)	12,507,139
販売投資証券未収金	2 (a)	62,351
以下に係る未実現純評価益：		
先物取引	2 (d)	863,444
未決済先渡為替予約	2 (d)	706,194
差金決済契約	2 (d)	2,589,069
その他の資産	2 (a)	63,185
資産合計		76,238,620
負債		
ブローカーに対する債務	14	785,273
未払利息および未払配当金	2 (a)、 2 (d)	93,662
購入投資有価証券未払金	2 (a)、 2 (d)	13,283,648
買戻し投資証券未払金	2 (a)	119,685
以下に係る未実現純評価損：		
先物取引	2 (d)	150,258
未決済先渡為替予約	2 (d)	346,028
差金決済契約	2 (d)	2,887,182
未払費用およびその他の負債	2 (a)、 4、 5、 6、 7、 8	764,951
負債合計		18,430,687
純資産合計		57,807,933

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 会計年度末における純資産価額の概要 2020年11月30日現在(未監査)

ブラックロック・グローバル・ロング/ショート・  
エクイティ・ファンド

	通貨	2020年	2020年	2019年	2018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	57,807,933	72,200,396	103,685,956	125,579,518
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	104.86	108.48	112.23	107.34
クラスAユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	91.12	94.73	100.48	98.90
クラスAスウェーデン・クロネ・ヘッジ無分配投資証券	スウェーデン・クロネ	918.16	952.17	1,008.03	990.94
クラスA Iユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	91.97	95.56	-	-
クラスC無分配投資証券	米ドル	94.77	98.53	102.95	99.45
クラスD無分配投資証券	米ドル	104.21	107.46	110.52	105.07
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	98.23	101.81	107.35	105.02
クラスD英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	英ポンド	101.21	104.55	109.26	105.65
クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	91.44	95.30	101.60	100.51
クラスIユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	92.97	96.22	-	-
クラスJ分配型投資証券	米ドル	108.99	112.41	115.62	109.94
クラスX無分配投資証券	米ドル	120.01	122.84	124.47	116.59

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 2020年11月30日に終了した会計期間（未監査）

	注記	ブラックロック・グローバル・ロング/ショート・エクイティ・ファンド 米ドル
期首純資産		72,200,396
収益		
債券利息	2 (c)	45,728
差金決済契約に係る受取配当金、源泉徴収税控除後	2 (c)、2 (d)	602,778
その他の収益		196
収益合計		648,702
費用		
銀行利息	2 (c)	42,042
差金決済契約に係る支払利息	2 (c)、2 (d)	251,117
差金決済契約に係る支払配当金、源泉徴収税控除後	2 (c)、2 (d)	800,530
管理事務代行報酬	5	93,860
預託報酬	2 (i)、6	613,725
税金	8	15,313
販売報酬	4	32,486
投資運用報酬および投資運用再委託報酬	4	502,946
払戻考慮前費用合計		2,352,019
費用の払戻し	4	570,521
払戻考慮後費用合計		1,781,498
投資純損失		(1,132,796)
以下に係る実現純利益 / (損失) :		
投資有価証券	2 (a)、2 (b)	1,315
差金決済契約	2 (d)	(1,435,047)
先物取引	2 (d)	(302,545)
外国通貨および先渡為替予約	2 (d)、2 (e)、2 (j)	5,076,564
オプション/スワップション契約	2 (d)	(239,929)
当期実現純利益		3,100,358
以下に係る未実現評価益 / (損) の純変動額 :		
差金決済契約	2 (d)	(294,223)
先物取引	2 (d)	989,600
外国通貨および先渡為替予約	2 (d)、2 (e)、2 (j)	(996,135)
オプション/スワップション契約	2 (d)	30,001
当期末実現評価益 / (損) の純変動		(270,757)
運用成績による純資産の増加		1,696,805
資本の変動		
投資証券発行による正味受取額		5,645,466
投資証券買戻しによる正味支払額		(21,734,734)
資本の変動による純資産の減少		(16,089,268)
期末純資産		57,807,933

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 2020年11月30日に終了した会計期間(未監査)

ブラックロック・グローバル・ロング/ショート・エクイティ・  
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	48,096	3,127	1,138	50,085
クラスAユーロ・ヘッジ無分配投資証券	134,935	-	87,001	47,934
クラスAスウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配 投資証券	584	342	347	579
クラスA Iユーロ・ヘッジ無分配投資証券	45	-	-	45
クラスC無分配投資証券	1,148	-	110	1,038
クラスD無分配投資証券	42,701	6,490	22,518	26,673
クラスDユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証 券	246,772	22,439	56,164	213,047
クラスD英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資 証券	4,506	280	1,492	3,294
クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券	113,255	12,811	17,258	108,808
クラスIユーロ・ヘッジ無分配投資証券	11,085	1,485	1,130	11,440
クラスJ分配型投資証券	44,414	-	6,242	38,172
クラスX無分配投資証券	10,633	2,401	940	12,094

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・グローバル・ロング/ショート・エクイティ・ファンド

投資有価証券明細表 2020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 (%)
債券			
	米国		
USD 4,650,000	United States Treasury Bill 10/12/2020 (Zero Coupon)	4,649,865	8.04
USD 1,600,000	United States Treasury Bill 17/12/2020 (Zero Coupon)	1,599,931	2.77
USD 3,750,000	United States Treasury Bill 7/1/2021 (Zero Coupon)	3,749,653	6.49
USD 4,000,000	United States Treasury Bill 14/1/2021 (Zero Coupon)	3,999,658	6.92
USD 3,000,000	United States Treasury Bill 19/1/2021 (Zero Coupon)	2,999,735	5.19
USD 3,250,000	United States Treasury Bill 21/1/2021 (Zero Coupon)	3,249,519	5.62
USD 3,500,000	United States Treasury Bill 28/1/2021 (Zero Coupon)	3,499,549	6.05
USD 6,150,000	United States Treasury Bill 11/2/2021 (Zero Coupon)	6,148,622	10.63
USD 5,000,000	United States Treasury Bill 18/2/2021 (Zero Coupon)	4,998,848	8.65
USD 5,800,000	United States Treasury Bill 25/2/2021 (Zero Coupon)	5,798,739	10.03
USD 6,000,000	United States Treasury Bill 4/3/2021 (Zero Coupon)	5,998,403	10.38
USD 4,000,000	United States Treasury Bill 11/3/2021 (Zero Coupon)	3,999,212	6.92
USD 1,725,000	United States Treasury Bill-When Issued 8/12/2020 (Zero Coupon)	1,724,975	2.98
		52,416,709	90.67
債券合計		52,416,709	90.67
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		52,416,709	90.67
投資有価証券(時価)合計		52,416,709	90.67
その他の純資産		5,391,224	9.33
純資産合計(米ドル)		57,807,933	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。

## 金融デリバティブ商品

## 差金決済契約

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益 / (損) (米ドル)
	オーストラリア		
(18,127)	Abacus Property Group (REIT)	Goldman Sachs	535
3,672	Adbri Ltd	Bank of America Merrill Lynch	192
4,889	Adbri Ltd	Morgan Stanley	(144)
(798)	Afterpay Ltd	Goldman Sachs	499
(4,099)	AGL Energy Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,440)
(4,692)	AGL Energy Ltd	Goldman Sachs	(1,419)
(997)	AGL Energy Ltd	Morgan Stanley	(81)
509	Altium Ltd	Goldman Sachs	(242)
15,395	Alumina Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,073
(550)	AMP Ltd	Bank of America Merrill Lynch	14
(13,418)	AMP Ltd	Morgan Stanley	-
(1,379)	Ampol Ltd	Goldman Sachs	(2,671)
(461)	Ampol Ltd	Morgan Stanley	(306)
(492)	ARB Corp Ltd	Goldman Sachs	138
3,319	Aristocrat Leisure Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,420)
270	Aristocrat Leisure Ltd	Goldman Sachs	(110)
2,291	Aristocrat Leisure Ltd	Morgan Stanley	(2,688)
(390)	ASX Ltd	Goldman Sachs	1,329
275	AUB Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(168)
1,133	Aurizon Holdings Ltd	Goldman Sachs	259
21,833	Aurizon Holdings Ltd	Morgan Stanley	2,900
1,455	Austral Ltd	Bank of America Merrill Lynch	129
3,964	Austral Ltd	Goldman Sachs	380
2,145	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	Goldman Sachs	2,390
1,279	Bapcor Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(244)
310	Bapcor Ltd	Goldman Sachs	(31)
952	Bapcor Ltd	Morgan Stanley	(176)
18,222	Beach Energy Ltd	Morgan Stanley	605
(1,337)	Bega Cheese Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(365)
(140)	Bega Cheese Ltd	Goldman Sachs	(38)
(297)	Bega Cheese Ltd (Rights)	Bank of America Merrill Lynch	(191)
(31)	Bega Cheese Ltd (Rights)	Goldman Sachs	(20)
739	Bendigo & Adelaide Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	703
4,579	Bendigo & Adelaide Bank Ltd	Goldman Sachs	4,156
7,078	Bendigo & Adelaide Bank Ltd	Morgan Stanley	2,089
(573)	BHP Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(833)
(2,166)	BHP Group Ltd	Goldman Sachs	(2,426)
(1,525)	BHP Group Ltd	Morgan Stanley	(1,148)
(5,288)	Bingo Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	195
(5,679)	Bingo Industries Ltd	Goldman Sachs	168
(151)	Blackmores Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(351)
(1,938)	Boral Ltd	Bank of America Merrill Lynch	357

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	オーストラリア(続き)		
(1,284)	Boral Ltd	Goldman Sachs	237
(18,139)	Bravura Solutions Ltd	Goldman Sachs	(1,119)
374	Breville Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(169)
2,135	Brickworks Ltd	Bank of America Merrill Lynch	412
890	Brickworks Ltd	Goldman Sachs	329
13,715	BWP Trust (REIT)	Goldman Sachs	405
(2,661)	Centuria Industrial (REIT)	Goldman Sachs	37
1,778	Centuria Office (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(96)
3,656	Challenger Ltd	Goldman Sachs	1,005
11,651	Challenger Ltd	Morgan Stanley	2,973
(825)	Champion Iron Ltd	Goldman Sachs	(96)
(1,661)	Charter Hall Group (REIT)	Goldman Sachs	882
6,445	Charter Hall Long Wale (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(333)
7,027	Charter Hall Long Wale (REIT)	Goldman Sachs	(363)
7,024	Charter Hall Retail (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(288)
3,012	Charter Hall Social Infrastructure (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(148)
7,881	Charter Hall Social Infrastructure (REIT)	Goldman Sachs	-
2,883	CIMIC Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4,743
3,336	CIMIC Group Ltd	Goldman Sachs	4,867
1,077	CIMIC Group Ltd	Morgan Stanley	1,422
(24,720)	Cleanaway Waste Management Ltd	Goldman Sachs	(384)
(3,007)	Cleanaway Waste Management Ltd	Morgan Stanley	(67)
40	Cochlear Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(371)
238	Cochlear Ltd	Goldman Sachs	(2,199)
73	Cochlear Ltd	Morgan Stanley	(339)
237	Coles Group Ltd	Goldman Sachs	2
2,001	Coles Group Ltd	Morgan Stanley	(133)
(2,256)	Collins Foods Ltd	Goldman Sachs	1,365
(2,086)	Commonwealth Bank of Australia	Goldman Sachs	(5,041)
(171)	Commonwealth Bank of Australia	Morgan Stanley	67
400	Corporate Travel Management Ltd	Goldman Sachs	775
154	Corporate Travel Management Ltd	Morgan Stanley	41
(304)	Credit Corp Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(150)
(227)	Credit Corp Group Ltd	Goldman Sachs	(112)
(1,425)	Crown Resorts Ltd	Goldman Sachs	(95)
(2,177)	Crown Resorts Ltd	Morgan Stanley	(369)
3,367	CSR Ltd	Morgan Stanley	75
(5,701)	Data#3 Ltd	Goldman Sachs	(1,725)
1,110	Deterra Royalties Ltd	Bank of America Merrill Lynch	270
1,175	Deterra Royalties Ltd	Goldman Sachs	286
3,891	Deterra Royalties Ltd	Morgan Stanley	689
1,258	Dicker Data Ltd	Bank of America Merrill Lynch	381
412	Dicker Data Ltd	Goldman Sachs	154
1,371	Domain Holdings Australia Ltd	Goldman Sachs	84

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	オーストラリア(続き)		
8,141	Downer EDI Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(118)
3,794	Downer EDI Ltd	Goldman Sachs	(230)
1,254	Downer EDI Ltd	Morgan Stanley	(62)
1,016	Elders Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(990)
4,173	Elders Ltd	Goldman Sachs	(4,311)
(1,128)	EML Payments Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(91)
(193)	EML Payments Ltd	Goldman Sachs	(28)
(652)	Evolution Mining Ltd	Bank of America Merrill Lynch	245
(2,622)	Evolution Mining Ltd	Goldman Sachs	1,416
(2,753)	Evolution Mining Ltd	Morgan Stanley	975
259	Flight Centre Travel Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	138
200	Flight Centre Travel Group Ltd	Goldman Sachs	152
2,042	Flight Centre Travel Group Ltd	Morgan Stanley	1,522
(7,387)	Fortescue Metals Group Ltd	Goldman Sachs	(7,599)
(1)	G8 Education Ltd	Bank of America Merrill Lynch	-
1,850	Genworth Mortgage Insurance Australia Ltd	Bank of America Merrill Lynch	560
2,186	Genworth Mortgage Insurance Australia Ltd	Goldman Sachs	694
684	Goodman Group (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	55
587	Goodman Group (REIT)	Goldman Sachs	73
1,577	GPT Group (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	81
1,151	GPT Group (REIT)	Goldman Sachs	(8)
2,031	GrainCorp Ltd 'A'	Goldman Sachs	(120)
6,390	Growthpoint Properties Australia Ltd (REIT)	Goldman Sachs	(278)
(1,016)	GUD Holdings Ltd	Goldman Sachs	772
(12,403)	GWA Group Ltd	Goldman Sachs	(275)
(3,498)	Hansen Technologies Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(103)
(15,025)	Hansen Technologies Ltd	Goldman Sachs	(443)
4,296	Harvey Norman Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	127
1,971	Harvey Norman Holdings Ltd	Morgan Stanley	29
(2,005)	Healius Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(53)
(4,348)	Healius Ltd	Goldman Sachs	(417)
317	HUB24 Ltd	Bank of America Merrill Lynch	73
(300)	IDP Education Ltd	Morgan Stanley	(46)
7,367	Iluka Resources Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,631
13,634	Iluka Resources Ltd	Goldman Sachs	2,687
39,660	Iluka Resources Ltd	Morgan Stanley	2,634
(5,429)	Ingenia Communities Group (REIT)	Goldman Sachs	80
1,293	Insurance Australia Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(148)
466	Insurance Australia Group Ltd	Goldman Sachs	(27)
(1,112)	Integrated Research Ltd	Goldman Sachs	114
(1,143)	InvoCare Ltd	Bank of America Merrill Lynch	304
11,864	I00F Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,976
4,029	I00F Holdings Ltd	Goldman Sachs	1,011

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	オーストラリア(続き)		
12,950	I00F Holdings Ltd	Morgan Stanley	1,147
(5,709)	IPH Ltd	Goldman Sachs	169
(1,224)	IRESS Ltd	Goldman Sachs	(569)
(482)	JB Hi-Fi Ltd	Bank of America Merrill Lynch	260
(95)	JB Hi-Fi Ltd	Morgan Stanley	(15)
957	Jumbo Interactive Ltd	Goldman Sachs	(21)
(1,417)	Kogan.com Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,810
(554)	Kogan.com Ltd	Goldman Sachs	1,357
(1,276)	Kogan.com Ltd	Morgan Stanley	847
7,878	Lifestyle Communities Ltd	Goldman Sachs	1,744
(4,537)	Link Administration Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	134
(1,629)	Link Administration Holdings Ltd	Goldman Sachs	48
(9,127)	Link Administration Holdings Ltd	Morgan Stanley	-
(276)	Macquarie Group Ltd	Goldman Sachs	(13,941)
189	Magellan Financial Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(252)
592	Magellan Financial Group Ltd	Morgan Stanley	(987)
(4,605)	McMillan Shakespeare Ltd	Goldman Sachs	(2,378)
13,541	Medibank Pvt Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(599)
8,856	Medibank Pvt Ltd	Goldman Sachs	(408)
7,986	Medibank Pvt Ltd	Morgan Stanley	(118)
(337)	Megaport Ltd	Bank of America Merrill Lynch	410
(542)	Megaport Ltd	Goldman Sachs	660
(2,749)	Megaport Ltd	Morgan Stanley	1,846
14,689	Metcash Ltd	Goldman Sachs	(650)
4,276	Metcash Ltd	Morgan Stanley	(347)
921	Mineral Resources Ltd	Morgan Stanley	836
(2,968)	Monadelphous Group Ltd	Goldman Sachs	(3,986)
(2,231)	National Australia Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,288)
(4,027)	National Australia Bank Ltd	Goldman Sachs	(3,863)
(439)	Netwealth Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(161)
(2,152)	Newcrest Mining Ltd	Goldman Sachs	3,746
(262)	NEXTDC Ltd	Bank of America Merrill Lynch	171
(1,372)	NEXTDC Ltd	Morgan Stanley	648
(1,883)	nib holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(597)
6,909	Nine Entertainment Co Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(612)
(11,347)	NRW Holdings Ltd	Goldman Sachs	(1,340)
1,732	Nufarm Ltd	Goldman Sachs	(175)
1,889	Nufarm Ltd	Morgan Stanley	(344)
(1,138)	Omni Bridgeway Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(395)
(1,567)	Omni Bridgeway Ltd	Goldman Sachs	(555)
244	Orica Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(82)
222	Orica Ltd	Goldman Sachs	(77)
1,058	Orica Ltd	Morgan Stanley	(242)
3,644	Origin Energy Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,227
25,079	Origin Energy Ltd	Morgan Stanley	6,022

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	オーストラリア(続き)		
(2,230)	Orocobre Ltd	Goldman Sachs	(369)
(4,290)	Orora Ltd	Bank of America Merrill Lynch	359
(13,205)	Orora Ltd	Goldman Sachs	1,072
(7,115)	Orora Ltd	Morgan Stanley	472
3,193	OZ Minerals Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3,204
1,898	OZ Minerals Ltd	Goldman Sachs	1,835
2,865	OZ Minerals Ltd	Morgan Stanley	2,262
(1,307)	Pact Group Holdings Ltd	Goldman Sachs	149
3,927	Pendal Group Ltd	Goldman Sachs	1,644
434	Perpetual Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,351
621	Perpetual Ltd	Goldman Sachs	1,934
630	Perpetual Ltd	Morgan Stanley	748
(954)	Premier Investments Ltd	Goldman Sachs	(458)
(7,942)	Ramelius Resources Ltd	Goldman Sachs	1,421
421	Ramsay Health Care Ltd	Morgan Stanley	(680)
206	REA Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	637
21	REA Group Ltd	Goldman Sachs	64
515	REA Group Ltd	Morgan Stanley	1,748
(839)	Regis Resources Ltd	Goldman Sachs	104
(3,693)	Regis Resources Ltd	Morgan Stanley	327
1,863	Reliance Worldwide Corp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(171)
895	Reliance Worldwide Corp Ltd	Goldman Sachs	(52)
2,329	Reliance Worldwide Corp Ltd	Morgan Stanley	(206)
(65)	Rio Tinto Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(98)
(372)	Rio Tinto Ltd	Goldman Sachs	(983)
(171)	Rio Tinto Ltd	Morgan Stanley	173
6,429	Rural Funds Group (REIT)	Goldman Sachs	285
1,305	Sandfire Resources Ltd	Bank of America Merrill Lynch	19
2,520	Sandfire Resources Ltd	Goldman Sachs	56
(399)	Santos Ltd	Goldman Sachs	(88)
(2,163)	Select Harvests Ltd	Bank of America Merrill Lynch	383
(2,171)	Select Harvests Ltd	Goldman Sachs	384
(4,079)	Service Stream Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(391)
(10,788)	Service Stream Ltd	Goldman Sachs	(1,035)
(88)	Seven Group Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(9)
(947)	Seven Group Holdings Ltd	Goldman Sachs	(98)
(183)	Seven Group Holdings Ltd	Morgan Stanley	111
(1,743)	SG Fleet Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(59)
(12,973)	Silver Lake Resources Ltd	Goldman Sachs	2,489
2,124	Sims Ltd	Bank of America Merrill Lynch	768
624	Sims Ltd	Goldman Sachs	203
2,089	Sims Ltd	Morgan Stanley	1,017
373	Sonic Healthcare Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(340)
415	Sonic Healthcare Ltd	Goldman Sachs	(397)
107	Sonic Healthcare Ltd	Morgan Stanley	(22)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	オーストラリア(続き)		
(8,666)	Spark Infrastructure Group (Unit)	Bank of America Merrill Lynch	182
(7,197)	Spark Infrastructure Group (Unit)	Goldman Sachs	163
(3,295)	Spark Infrastructure Group (Unit)	Morgan Stanley	49
7,961	St Barbara Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,674)
5,894	St Barbara Ltd	Goldman Sachs	(1,218)
1,706	St Barbara Ltd	Morgan Stanley	(126)
1,883	Steadfast Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(122)
4,267	Steadfast Group Ltd	Goldman Sachs	31
(7,461)	Stockland (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(165)
(3,855)	Stockland (REIT)	Goldman Sachs	(57)
(7,159)	Suncorp Group Ltd	Goldman Sachs	(2,968)
4,888	Super Retail Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(627)
3,334	Super Retail Group Ltd	Goldman Sachs	(276)
906	Super Retail Group Ltd	Morgan Stanley	(100)
(3,967)	Tabcorp Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	849
(7,092)	Tabcorp Holdings Ltd	Goldman Sachs	1,389
(12,743)	Tabcorp Holdings Ltd	Morgan Stanley	1,975
5,498	Tassal Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(203)
37,876	Tassal Group Ltd	Goldman Sachs	(1,817)
4,713	Technology One Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,220
2,408	Technology One Ltd	Goldman Sachs	462
3,709	Technology One Ltd	Morgan Stanley	437
(5,762)	Telstra Corp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	425
(6,647)	Telstra Corp Ltd	Goldman Sachs	441
(13,588)	Telstra Corp Ltd	Morgan Stanley	100
(2,264)	TPG Telecom Ltd	Bank of America Merrill Lynch	390
(4,043)	TPG Telecom Ltd	Goldman Sachs	690
(2,063)	TPG Telecom Ltd	Morgan Stanley	609
1,386	Transurban Group (Unit)	Goldman Sachs	(525)
1,575	Treasury Wine Estates Ltd	Goldman Sachs	(1,679)
(14,650)	Tuas Ltd	Bank of America Merrill Lynch	982
(4,835)	Tuas Ltd	Morgan Stanley	107
2,449	Vicinity Centres (REIT)	Goldman Sachs	(14)
12,000	Vicinity Centres (REIT)	Morgan Stanley	-
(5,184)	Village Roadshow Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,027)
(1,884)	Village Roadshow Ltd	Goldman Sachs	(737)
(3,619)	Vocus Group Ltd	Goldman Sachs	436
10,585	Waypoint REIT (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(391)
14,318	Waypoint REIT (REIT)	Goldman Sachs	(528)
(1,857)	Webjet Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(651)
(3,428)	Webjet Ltd	Goldman Sachs	(1,720)
(5,402)	Wesfarmers Ltd	Goldman Sachs	(3,640)
(1,936)	Wesfarmers Ltd	Morgan Stanley	(586)
(3,131)	Western Areas Ltd	Goldman Sachs	(174)
(14,410)	Westgold Resources Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,445

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益 / (損) (米ドル)
	オーストラリア (続き)		
(4,369)	Westgold Resources Ltd	Goldman Sachs	709
491	WiseTech Global Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(341)
658	Woodside Petroleum Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(530)
192	Worley Ltd	Bank of America Merrill Lynch	222
1,377	Worley Ltd	Goldman Sachs	1,274
2,334	Worley Ltd	Morgan Stanley	517
(3,546)	Zip Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(372)
(5,631)	Zip Co Ltd	Morgan Stanley	597
			15,781
	オーストリア		
(526)	ams AG	Morgan Stanley	71
(106)	ANDRITZ AG	Bank of America Merrill Lynch	10
(164)	AT&S Austria Technologie & Systemtechnik AG	Bank of America Merrill Lynch	(405)
(169)	AT&S Austria Technologie & Systemtechnik AG	Goldman Sachs	(418)
(111)	BAWAG Group AG	Bank of America Merrill Lynch	(144)
(29)	BAWAG Group AG	Morgan Stanley	6
731	CA Immobilien Anlagen AG	Goldman Sachs	614
(78)	DO & CO AG	Goldman Sachs	(851)
(456)	Erste Group Bank AG	Bank of America Merrill Lynch	221
(139)	FACC AG	Goldman Sachs	(205)
(391)	IMMOFINANZ AG	Goldman Sachs	(585)
(631)	Kapsch TrafficCom AG	Bank of America Merrill Lynch	76
(312)	Kapsch TrafficCom AG	Goldman Sachs	37
1,169	Oesterreichische Post AG	Goldman Sachs	2,173
(1,811)	OMV AG	Goldman Sachs	(3,302)
113	Palfinger AG	Goldman Sachs	468
(558)	Raiffeisen Bank International AG	Morgan Stanley	(295)
(292)	S IMMO AG	Bank of America Merrill Lynch	102
(994)	S&T AG	Goldman Sachs	(380)
(104)	Schoeller-Bleckmann Oilfield Equipment AG	Goldman Sachs	(143)
(6)	Semperit AG Holding	Bank of America Merrill Lynch	(16)
(160)	Semperit AG Holding	Goldman Sachs	(451)
(183)	Telekom Austria AG	Goldman Sachs	(4)
(800)	UNIQA Insurance Group AG	Bank of America Merrill Lynch	(605)
(553)	Verbund AG	Bank of America Merrill Lynch	(3,151)
(59)	Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe	Goldman Sachs	(48)
(307)	voestalpine AG	Morgan Stanley	-
(138)	Wienerberger AG	Morgan Stanley	33
(135)	Zumtobel Group AG	Goldman Sachs	(118)
			(7,310)
	バハマ		
(990)	OneSpaWorld Holdings Ltd	Goldman Sachs	(337)
			(337)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	ベルギー		
(63)	Ackermans & van Haaren NV	Bank of America Merrill Lynch	15
(20)	Ackermans & van Haaren NV	Goldman Sachs	5
(37)	Aedifica SA (REIT)	Goldman Sachs	18
(18)	Aedifica SA (REIT)	Morgan Stanley	28
384	Ageas SA	Goldman Sachs	400
1,002	AGFA-Gevaert NV	Bank of America Merrill Lynch	(2)
186	Akka Technologies	Goldman Sachs	212
924	Befimmo SA (REIT)	Goldman Sachs	222
(243)	Bekaert SA	Bank of America Merrill Lynch	(1,312)
(3)	Cie d' Entreprises CFE	Bank of America Merrill Lynch	(28)
(387)	Cie d' Entreprises CFE	Goldman Sachs	(3,621)
236	Cofinimmo SA (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(566)
133	Cofinimmo SA (Reit)	Goldman Sachs	(319)
41	D' ieteren SA	Goldman Sachs	31
177	Elia Group SA/NV	Bank of America Merrill Lynch	318
75	Elia Group SA/NV	Morgan Stanley	81
134	Etablissements Franz Colruyt NV	Bank of America Merrill Lynch	95
502	Euronav NV	Bank of America Merrill Lynch	(126)
(5,281)	Exmar NV	Goldman Sachs	(1,235)
1,212	Fagron	Bank of America Merrill Lynch	362
221	Fagron	Goldman Sachs	(8)
(51)	Gimv NV	Goldman Sachs	37
(110)	Groupe Bruxelles Lambert SA	Bank of America Merrill Lynch	(165)
(172)	Groupe Bruxelles Lambert SA	Goldman Sachs	(285)
177	Intervest Offices & Warehouses NV (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	32
114	Intervest Offices & Warehouses NV (REIT)	Goldman Sachs	20
(263)	KBC Ancora	Bank of America Merrill Lynch	(454)
260	KBC Group NV	Bank of America Merrill Lynch	727
953	KBC Group NV	Morgan Stanley	892
(109)	Kinepolis Group NV	Goldman Sachs	(314)
376	Melexis NV	Goldman Sachs	2,741
623	Ontex Group NV	Bank of America Merrill Lynch	(176)
(355)	Orange Belgium SA	Goldman Sachs	(213)
(462)	Proximus SADP	Goldman Sachs	210
1,253	Recticel SA	Bank of America Merrill Lynch	661
855	Recticel SA	Goldman Sachs	451
157	Retail Estates NV (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	320
(36)	Sioen Industries NV	Bank of America Merrill Lynch	(13)
(52)	Sofina SA	Bank of America Merrill Lynch	(811)
(319)	Solvay SA	Bank of America Merrill Lynch	(3,191)
(546)	Telenet Group Holding NV	Bank of America Merrill Lynch	(891)
(173)	Tessengerlo Group SA	Goldman Sachs	145
347	Umicore SA	Bank of America Merrill Lynch	862
766	Umicore SA	Morgan Stanley	1,829

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	ベルギー(続き)		
(28)	Van de Velde NV	Bank of America Merrill Lynch	(47)
(32)	Van de Velde NV	Goldman Sachs	(54)
529	X-Fab Silicon Foundries SE	Bank of America Merrill Lynch	135
			(2,982)
	バミューダ		
(418)	Argo Group International Holdings Ltd	Goldman Sachs	443
411	Athene Holding Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(253)
1,186	Athene Holding Ltd 'A'	Morgan Stanley	735
794	Axalta Coating Systems Ltd	Bank of America Merrill Lynch	297
1,135	Axalta Coating Systems Ltd	Goldman Sachs	410
167	Axalta Coating Systems Ltd	Morgan Stanley	30
372	Axis Capital Holdings Ltd	Morgan Stanley	(320)
381	Brookfield Renewable Partners LP	Bank of America Merrill Lynch	4,469
359	Bunge Ltd	Morgan Stanley	54
(1,989)	BW LPG Ltd	Goldman Sachs	(2,307)
(2,474)	BW Offshore Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(413)
(2,000)	Cafe de Coral Holdings Ltd	Morgan Stanley	41
1,000	CK Infrastructure Holdings Ltd	Morgan Stanley	45
(251)	Enstar Group Ltd	Goldman Sachs	1,609
77	Essent Group Ltd	Morgan Stanley	(19)
(182)	Everest Re Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	479
(15)	Everest Re Group Ltd	Goldman Sachs	(27)
(60)	Everest Re Group Ltd	Morgan Stanley	385
12,000	First Pacific Co Ltd	Goldman Sachs	(219)
4,000	First Pacific Co Ltd	Morgan Stanley	(74)
(1,092)	Frontline Ltd	Goldman Sachs	399
1,750	Golden Ocean Group Ltd	Goldman Sachs	660
(8,860)	Hafnia Ltd	Goldman Sachs	705
(8,000)	Haitong International Securities Group Ltd	Morgan Stanley	(10)
(107)	Helen of Troy Ltd	Bank of America Merrill Lynch	414
(247)	Hiscox Ltd	Morgan Stanley	78
(1,700)	Hongkong Land Holdings Ltd	Goldman Sachs	170
(1,100)	Hongkong Land Holdings Ltd	Morgan Stanley	242
177	IHS Markit Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,280
15	IHS Markit Ltd	Morgan Stanley	89
787	Invesco Ltd	Bank of America Merrill Lynch	307
1,217	Invesco Ltd	Goldman Sachs	4
(365)	James River Group Holdings Ltd	Goldman Sachs	1,420
(700)	Jardine Matheson Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	957
1,600	Jardine Strategic Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,062)
1,200	Jardine Strategic Holdings Ltd	Morgan Stanley	(1,556)
(1,000)	Johnson Electric Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	134
(1,000)	Johnson Electric Holdings Ltd	Goldman Sachs	134
2,500	Kerry Logistics Network Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(168)
1,500	Kerry Logistics Network Ltd	Goldman Sachs	(101)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	パミューダ(続き)		
13,000	Kerry Properties Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(966)
1,000	Kerry Properties Ltd	Goldman Sachs	(98)
9,500	Kerry Properties Ltd	Morgan Stanley	(1,217)
35	Lancashire Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	8
2,126	Lancashire Holdings Ltd	Goldman Sachs	512
(828)	Liberty Latin America Ltd 'C'	Goldman Sachs	170
(2,000)	Luk Fook Holdings International Ltd	Goldman Sachs	52
(12,400)	Man Wah Holdings Ltd	Goldman Sachs	1,160
(40,643)	Mandarin Oriental International Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,032)
(900)	Mandarin Oriental International Ltd	Goldman Sachs	(45)
479	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,117
1,436	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	Goldman Sachs	2,297
535	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	Morgan Stanley	1,252
11,000	NWS Holdings Ltd	Goldman Sachs	(397)
(56)	RenaissanceRe Holdings Ltd	Goldman Sachs	260
(103)	RenaissanceRe Holdings Ltd	Morgan Stanley	379
(2,000)	Shangri-La Asia Ltd	Bank of America Merrill Lynch	23
(24,000)	Shangri-La Asia Ltd	Goldman Sachs	932
(580)	Signet Jewelers Ltd	Goldman Sachs	(2,523)
(4,532)	Stolt-Nielsen Ltd	Goldman Sachs	1,390
(2,874)	Third Point Reinsurance Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(504)
1,328	Triton International Ltd	Goldman Sachs	4,807
(148,000)	United Energy Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(764)
40	White Mountains Insurance Group Ltd	Goldman Sachs	743
(5,000)	Yue Yuen Industrial Holdings Ltd	Goldman Sachs	52
			15,069
	英領バージン諸島		
(256)	Capri Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(194)
(1,232)	Nomad Foods Ltd	Goldman Sachs	(579)
			(773)
	カナダ		
920	Aecon Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	391
945	Aecon Group Inc	Goldman Sachs	402
(176)	Ag Growth International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(333)
396	Agnico Eagle Mines Ltd	Goldman Sachs	(1,956)
950	Air Canada	Goldman Sachs	3,131
143	Air Canada	Morgan Stanley	347
(1,129)	Alamos Gold Inc 'A'	Morgan Stanley	192
1,044	Alaris Equity Partners Income (Unit)	Goldman Sachs	480
604	Algonquin Power & Utilities Corp	Bank of America Merrill Lynch	(79)
1,296	Algonquin Power & Utilities Corp	Goldman Sachs	(170)
2,191	Algonquin Power & Utilities Corp	Morgan Stanley	440
(1,470)	Alimentation Couche-Tard Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	2,216
(450)	Alimentation Couche-Tard Inc 'B'	Morgan Stanley	132
1,221	Allied Properties Real Estate Investment Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	963

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	カナダ(続き)		
100	Allied Properties Real Estate Investment Trust (REIT)	Morgan Stanley	2
315	AltaGas Ltd	Bank of America Merrill Lynch	73
336	AltaGas Ltd	Goldman Sachs	192
1,093	Altius Minerals Corp	Bank of America Merrill Lynch	287
3,629	Altius Minerals Corp	Goldman Sachs	954
(208)	Altus Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	8
(132)	Altus Group Ltd	Goldman Sachs	5
(97)	Andlauer Healthcare Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	150
(110)	Andlauer Healthcare Group Inc	Goldman Sachs	170
631	ARC Resources Ltd	Bank of America Merrill Lynch	371
7,226	ARC Resources Ltd	Goldman Sachs	4,093
4,248	ARC Resources Ltd	Morgan Stanley	854
176	Aritzia Inc	Goldman Sachs	(185)
421	Artis Real Estate Investment Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	133
2,593	Artis Real Estate Investment Trust (REIT)	Goldman Sachs	822
80	Atco Ltd ' I '	Goldman Sachs	(7)
595	ATS Automation Tooling Systems Inc	Goldman Sachs	879
(2,821)	B2Gold Corp	Morgan Stanley	44
307	Badger Daylighting Ltd	Bank of America Merrill Lynch	269
278	Badger Daylighting Ltd	Goldman Sachs	233
(1,271)	Ballard Power Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,738)
1,258	Bank of Montreal	Bank of America Merrill Lynch	1,065
59	Bank of Montreal	Goldman Sachs	285
377	Bank of Montreal	Morgan Stanley	309
785	Bank of Nova Scotia	Morgan Stanley	303
312	Bausch Health Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	(205)
1,191	Bausch Health Cos Inc	Goldman Sachs	(1,124)
(859)	BCE Inc	Bank of America Merrill Lynch	(173)
(482)	BCE Inc	Goldman Sachs	(97)
(1,931)	BCE Inc	Morgan Stanley	(269)
4,328	Birchcliff Energy Ltd	Bank of America Merrill Lynch	221
5,215	Birchcliff Energy Ltd	Goldman Sachs	194
(3,760)	BlackBerry Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,762)
(3,303)	BlackBerry Ltd	Goldman Sachs	(2,426)
1,140	Boardwalk Real Estate Investment Trust (REIT)	Goldman Sachs	1,710
(629)	Boralex Inc ' A '	Bank of America Merrill Lynch	(1,346)
(177)	Boralex Inc ' A '	Goldman Sachs	(333)
(200)	Boralex Inc ' A '	Morgan Stanley	(241)
342	Brookfield Infrastructure Corp ' A '	Goldman Sachs	(107)
(381)	Brookfield Renewable Corp ' A '	Bank of America Merrill Lynch	(5,499)
397	Brookfield Renewable Corp ' A '	Morgan Stanley	481
137	CAE Inc	Goldman Sachs	119
961	Cameco Corp	Goldman Sachs	(205)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	カナダ(続き)		
(3,697)	Canaccord Genuity Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(964)
(2,532)	Canaccord Genuity Group Inc	Goldman Sachs	(1,044)
444	Canada Goose Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(247)
529	Canada Goose Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(448)
328	Canada Goose Holdings Inc	Goldman Sachs	(462)
803	Canada Goose Holdings Inc	Goldman Sachs	(594)
40	Canada Goose Holdings Inc	Morgan Stanley	(80)
(67)	Canadian Pacific Railway Ltd	Goldman Sachs	1,039
(281)	Canadian Pacific Railway Ltd	Morgan Stanley	2,103
(834)	Canadian Solar Inc	Morgan Stanley	(3,002)
(160)	Canadian Tire Corp Ltd 'A'	Morgan Stanley	(533)
547	Canadian Utilities Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	529
740	Canadian Utilities Ltd 'A'	Goldman Sachs	715
471	Canadian Utilities Ltd 'A'	Morgan Stanley	310
(5,969)	Capital Power Corp	Morgan Stanley	(4,984)
(279)	Cascades Inc	Goldman Sachs	27
(595)	Celestica Inc	Goldman Sachs	(313)
6,421	Cenovus Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,812
3,005	Cenovus Energy Inc	Morgan Stanley	-
(341)	CGI Inc	Bank of America Merrill Lynch	(928)
(220)	CGI Inc	Morgan Stanley	(488)
1,514	Chorus Aviation Inc	Bank of America Merrill Lynch	205
899	Chorus Aviation Inc	Goldman Sachs	128
(312)	CI Financial Corp	Morgan Stanley	99
654	Cineplex Inc	Bank of America Merrill Lynch	413
140	Colliers International Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	680
141	Colliers International Group Inc	Morgan Stanley	313
(4,796)	Cominar 'U' (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	-
(630)	Computer Modelling Group Ltd	Goldman Sachs	(27)
(10)	Constellation Software Inc	Bank of America Merrill Lynch	(380)
(12)	Constellation Software Inc	Goldman Sachs	(1,157)
(7)	Constellation Software Inc	Morgan Stanley	86
(14)	Corby Spirit and Wine Ltd	Bank of America Merrill Lynch	-
(62)	Corby Spirit and Wine Ltd	Goldman Sachs	2
(1,435)	Corus Entertainment Inc	Goldman Sachs	(44)
932	Crombie Real Estate Investment Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(223)
1,033	Descartes Systems Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,225
194	Descartes Systems Group Inc	Goldman Sachs	793
667	Descartes Systems Group Inc	Morgan Stanley	784
(205)	Dollarama Inc	Bank of America Merrill Lynch	(304)
(162)	Dollarama Inc	Morgan Stanley	(233)
(1,525)	Dream Industrial Real Estate Investment Trust (REIT)	Goldman Sachs	(153)
443	Dream Office Real Estate Investment Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	154

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	カナダ(続き)		
2,473	Dream Office Real Estate Investment Trust (REIT)	Goldman Sachs	860
(2,061)	ECN Capital Corp	Bank of America Merrill Lynch	(207)
(712)	Eldorado Gold Corp	Bank of America Merrill Lynch	929
(1,439)	Eldorado Gold Corp	Goldman Sachs	2,529
(2,417)	Eldorado Gold Corp	Morgan Stanley	1,476
(539)	Element Fleet Management Corp	Bank of America Merrill Lynch	(100)
(1,842)	Element Fleet Management Corp	Goldman Sachs	(342)
(160)	Element Fleet Management Corp	Morgan Stanley	(16)
1,335	Emera Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,307)
621	Emera Inc	Goldman Sachs	(346)
3,955	Emera Inc	Morgan Stanley	(2,323)
971	Enbridge Inc	Goldman Sachs	2,668
3,546	Endeavour Silver Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,124)
781	Endeavour Silver Corp	Goldman Sachs	(248)
553	Enerflex Ltd	Bank of America Merrill Lynch	586
927	Enerflex Ltd	Goldman Sachs	982
(4,993)	Enerplus Corp	Goldman Sachs	(1,988)
287	Enghouse Systems Ltd	Goldman Sachs	722
1,662	Equinox Gold Corp	Goldman Sachs	(1,234)
56	Equitable Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(70)
185	Equitable Group Inc	Goldman Sachs	(84)
1,000	ERO Copper Corp	Goldman Sachs	1,662
(126)	Evertz Technologies Ltd	Bank of America Merrill Lynch	9
132	Exchange Income Corp	Bank of America Merrill Lynch	(46)
(790)	Extendicare Inc	Bank of America Merrill Lynch	28
(8)	Fairfax Financial Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(59)
(27)	Fairfax Financial Holdings Ltd	Goldman Sachs	10
(72)	Fairfax Financial Holdings Ltd	Morgan Stanley	33
(1,385)	Fiera Capital Corp	Bank of America Merrill Lynch	(64)
(643)	Finning International Inc	Goldman Sachs	(855)
(169)	Finning International Inc	Morgan Stanley	(25)
1,972	First Majestic Silver Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,242)
540	First Majestic Silver Corp	Goldman Sachs	(438)
1,881	First Majestic Silver Corp	Morgan Stanley	829
304	First National Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	242
50	First National Financial Corp	Goldman Sachs	40
(1,370)	First Quantum Minerals Ltd	Morgan Stanley	(816)
197	FirstService Corp	Goldman Sachs	(554)
359	FirstService Corp	Morgan Stanley	355
2,572	Fortis Inc	Morgan Stanley	(1,929)
988	Fortuna Silver Mines Inc	Bank of America Merrill Lynch	(530)
1,503	Fortuna Silver Mines Inc	Goldman Sachs	(834)
82	Franco-Nevada Corp	Bank of America Merrill Lynch	46
(750)	Freehold Royalties Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(307)
(1,239)	Freehold Royalties Ltd	Goldman Sachs	9

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	カナダ(続き)		
(438)	Genworth MI Canada Inc	Goldman Sachs	50
(497)	George Weston Ltd	Morgan Stanley	(8)
(302)	goeasy Ltd	Bank of America Merrill Lynch	176
(848)	Gran Colombia Gold Corp	Bank of America Merrill Lynch	229
1,642	Great-West Lifeco Inc	Morgan Stanley	76
(84)	H&R Real Estate Investment Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(57)
(1,529)	H&R Real Estate Investment Trust (REIT)	Goldman Sachs	(1,040)
(334)	H&R Real Estate Investment Trust (REIT)	Morgan Stanley	3
189	HLS Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(88)
285	Home Capital Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	271
1,243	Hudbay Minerals Inc	Goldman Sachs	827
782	Husky Energy Inc	Goldman Sachs	496
(854)	iA Financial Corp Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,109
(1,191)	iA Financial Corp Inc	Morgan Stanley	764
(3,636)	IAMGOLD Corp	Bank of America Merrill Lynch	815
(700)	IAMGOLD Corp	Morgan Stanley	(5)
(182)	IGM Financial Inc	Morgan Stanley	(56)
300	IMAX Corp	Goldman Sachs	(188)
577	Imperial Oil Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(522)
1,288	Imperial Oil Ltd	Goldman Sachs	(176)
2,019	Imperial Oil Ltd	Morgan Stanley	(250)
972	Innergex Renewable Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,003
1,422	Innergex Renewable Energy Inc	Goldman Sachs	3,079
1,812	Innergex Renewable Energy Inc	Morgan Stanley	2,410
180	Intact Financial Corp	Morgan Stanley	(561)
2,508	Inter Pipeline Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,974
2,568	Inter Pipeline Ltd	Goldman Sachs	2,413
3,123	Inter Pipeline Ltd	Morgan Stanley	1,497
(434)	Interfor Corp	Bank of America Merrill Lynch	(356)
(814)	Interfor Corp	Goldman Sachs	(633)
2,610	InterRent Real Estate Investment Trust (REIT)	Goldman Sachs	464
(224)	Intertape Polymer Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(177)
(740)	Intertape Polymer Group Inc	Goldman Sachs	(419)
458	Jamieson Wellness Inc	Goldman Sachs	49
61	Keyera Corp	Bank of America Merrill Lynch	95
3,048	Keyera Corp	Goldman Sachs	5,282
276	Keyera Corp	Morgan Stanley	205
338	Killam Apartment Real Estate Investment Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(84)
3,393	Killam Apartment Real Estate Investment Trust (REIT)	Goldman Sachs	(840)
(34)	Kinaxis Inc	Bank of America Merrill Lynch	(631)
(85)	Kinaxis Inc	Morgan Stanley	(689)
(861)	Kinross Gold Corp	Goldman Sachs	443

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	カナダ(続き)		
(1,721)	Knight Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(173)
(4,507)	Knight Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(453)
(607)	Labrador Iron Ore Royalty Corp	Goldman Sachs	(684)
(150)	Lassonde Industries Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	345
1,251	Laurentian Bank of Canada	Goldman Sachs	3,376
(108)	Lightspeed POS Inc	Bank of America Merrill Lynch	(951)
(69)	Lightspeed POS Inc	Goldman Sachs	(603)
(195)	Lightspeed POS Inc	Morgan Stanley	(646)
(137)	Linamar Corp	Bank of America Merrill Lynch	199
(360)	Linamar Corp	Goldman Sachs	435
479	Lions Gate Entertainment Corp 'B'	Bank of America Merrill Lynch	51
230	Loblaw Cos Ltd	Goldman Sachs	(49)
(467)	Lundin Gold Inc	Bank of America Merrill Lynch	206
336	Lundin Mining Corp	Bank of America Merrill Lynch	329
(330)	MAG Silver Corp	Goldman Sachs	707
(54)	Magna International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(22)
(1,563)	Magna International Inc	Morgan Stanley	(326)
(1,432)	Manulife Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(310)
(5,585)	Manulife Financial Corp	Goldman Sachs	(1,209)
(2,208)	Manulife Financial Corp	Morgan Stanley	(717)
444	Maple Leaf Foods Inc	Goldman Sachs	229
565	Martinrea International Inc	Bank of America Merrill Lynch	402
(167)	Masonite International Corp	Goldman Sachs	(729)
(4,322)	MEG Energy Corp	Goldman Sachs	(2,406)
(317)	Methanex Corp	Goldman Sachs	(1,699)
2,007	Metro Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,372)
242	Metro Inc	Goldman Sachs	(269)
2,523	Metro Inc	Morgan Stanley	(1,327)
116	Morguard North American Residential Real Estate Investment Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	45
3,187	Morguard North American Residential Real Estate Investment Trust (REIT)	Goldman Sachs	1,232
1,859	Morguard Real Estate Investment Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	1,768
3,925	Morguard Real Estate Investment Trust (REIT)	Goldman Sachs	3,733
250	Morneau Shepell Inc	Bank of America Merrill Lynch	197
185	MTY Food Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	371
(3,110)	Mullen Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(625)
(605)	National Bank of Canada	Goldman Sachs	(1,134)
(372)	National Bank of Canada	Morgan Stanley	(144)
760	NFI Group Inc	Goldman Sachs	958
(659)	North West Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(428)
(1,177)	North West Co Inc	Goldman Sachs	(478)
(57)	Northland Power Inc	Bank of America Merrill Lynch	(220)
(251)	Northland Power Inc	Goldman Sachs	(968)
(528)	Northland Power Inc	Morgan Stanley	(1,694)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	カナダ(続き)		
775	NorthWest Healthcare Properties Real Estate Investment Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	42
4,457	NorthWest Healthcare Properties Real Estate Investment Trust (REIT)	Goldman Sachs	241
(292)	Novagold Resources Inc	Goldman Sachs	343
542	Novanta Inc	Goldman Sachs	1,447
(1,734)	Nutrien Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4,829)
(87)	Nutrien Ltd	Goldman Sachs	(459)
(231)	Nutrien Ltd	Morgan Stanley	(482)
(976)	Open Text Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,786)
(157)	Open Text Corp	Goldman Sachs	(186)
(180)	Open Text Corp	Morgan Stanley	(107)
147	Osisko Gold Royalties Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(84)
380	Osisko Gold Royalties Ltd	Goldman Sachs	(217)
409	Osisko Gold Royalties Ltd	Morgan Stanley	22
1,042	Osisko Mining Inc	Bank of America Merrill Lynch	(242)
5,121	Osisko Mining Inc	Goldman Sachs	(1,188)
(2,462)	Park Lawn Corp	Goldman Sachs	2,456
1,189	Parkland Corp	Goldman Sachs	(421)
(1,452)	Pason Systems Inc	Goldman Sachs	(1,594)
789	Pembina Pipeline Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,539
733	Pembina Pipeline Corp	Goldman Sachs	1,476
2,697	Pembina Pipeline Corp	Morgan Stanley	1,001
1,200	Peyto Exploration & Development Corp	Bank of America Merrill Lynch	180
(1,293)	Power Corp of Canada	Bank of America Merrill Lynch	(870)
(1,125)	Power Corp of Canada	Morgan Stanley	244
2,554	PrairieSky Royalty Ltd	Goldman Sachs	2,172
(4,122)	Premier Gold Mines Ltd	Bank of America Merrill Lynch	-
(81)	Premium Brands Holdings Corp	Goldman Sachs	34
(542)	Pretium Resources Inc	Goldman Sachs	620
(899)	Pretium Resources Inc	Morgan Stanley	222
(505)	Quebecor Inc ' B '	Bank of America Merrill Lynch	168
(1,660)	Quebecor Inc ' B '	Goldman Sachs	552
(499)	Quebecor Inc ' B '	Morgan Stanley	(66)
(146)	Real Matters Inc	Bank of America Merrill Lynch	566
(755)	Real Matters Inc	Goldman Sachs	3,560
(1,724)	Real Matters Inc	Morgan Stanley	1,080
(552)	Recipe Unlimited Corp	Bank of America Merrill Lynch	(531)
137	Restaurant Brands International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(443)
748	Restaurant Brands International Inc	Goldman Sachs	(2,417)
121	Restaurant Brands International Inc	Morgan Stanley	(295)
118	Richelieu Hardware Ltd	Bank of America Merrill Lynch	47
(356)	RioCan Real Estate Investment Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(237)
(667)	RioCan Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	(108)
(1,623)	Rogers Sugar Inc	Bank of America Merrill Lynch	(321)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	カナダ(続き)		
(92)	Royal Bank of Canada	Goldman Sachs	39
(3,501)	Sabina Gold & Silver Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,029
(6,476)	Sabina Gold & Silver Corp	Goldman Sachs	1,903
11,519	Sandstorm Gold Ltd	Goldman Sachs	(5,700)
(177)	Saputo Inc	Bank of America Merrill Lynch	(186)
(138)	Saputo Inc	Goldman Sachs	(130)
(395)	Saputo Inc	Morgan Stanley	(373)
1,801	Savaria Corp	Goldman Sachs	627
1,014	Seabridge Gold Inc	Bank of America Merrill Lynch	(240)
1,895	Seabridge Gold Inc	Goldman Sachs	(1,296)
1,463	Seven Generations Energy Ltd 'A'	Goldman Sachs	554
(487)	Shaw Communications Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	207
(271)	Shaw Communications Inc 'B'	Goldman Sachs	115
(373)	Shaw Communications Inc 'B'	Morgan Stanley	46
(2,362)	Sienna Senior Living Inc	Bank of America Merrill Lynch	(310)
(1,458)	Silvercorp Metals Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,875
213	Sleep Country Canada Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(122)
812	Sleep Country Canada Holdings Inc	Goldman Sachs	(465)
851	SmartCentres Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	(228)
527	SNC-Lavalin Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	959
494	SNC-Lavalin Group Inc	Goldman Sachs	920
236	SNC-Lavalin Group Inc	Morgan Stanley	245
1,110	Spin Master Corp	Bank of America Merrill Lynch	(446)
763	Spin Master Corp	Goldman Sachs	(307)
511	SSR Mining Inc	Bank of America Merrill Lynch	(645)
611	SSR Mining Inc	Goldman Sachs	(906)
1,583	SSR Mining Inc	Morgan Stanley	(734)
(957)	Stantec Inc	Bank of America Merrill Lynch	(422)
(767)	Stantec Inc	Goldman Sachs	(338)
(948)	Stella-Jones Inc	Goldman Sachs	(768)
549	Summit Industrial Income REIT (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(2)
(4,311)	Sun Life Financial Inc	Morgan Stanley	3,882
1,110	Suncor Energy Inc	Goldman Sachs	1,712
103	Suncor Energy Inc	Morgan Stanley	10
(2,508)	Superior Plus Corp	Goldman Sachs	(1,125)
733	TC Energy Corp	Morgan Stanley	850
1,962	Teck Resources Ltd 'B'	Bank of America Merrill Lynch	1,915
360	Teck Resources Ltd 'B'	Goldman Sachs	323
711	Teck Resources Ltd 'B'	Morgan Stanley	583
2,312	TELUS Corp	Bank of America Merrill Lynch	178
1,606	TELUS Corp	Goldman Sachs	99
8,134	TELUS Corp	Morgan Stanley	2,767
(350)	Teranga Gold Corp	Goldman Sachs	208
(3,619)	Teranga Gold Corp	Morgan Stanley	-
(1,406)	TFI International Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,381

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	カナダ(続き)		
(889)	TFI International Inc	Morgan Stanley	69
(1,202)	Thomson Reuters Corp	Bank of America Merrill Lynch	3,968
(6)	Thomson Reuters Corp	Goldman Sachs	20
2,145	Timbercreek Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	265
425	Timbercreek Financial Corp	Goldman Sachs	53
45	TMX Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(15)
93	TMX Group Ltd	Goldman Sachs	(30)
37	TMX Group Ltd	Morgan Stanley	35
(265)	Torex Gold Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	324
(509)	Torex Gold Resources Inc	Goldman Sachs	622
(1,567)	Toronto-Dominion Bank	Morgan Stanley	(715)
1,484	Tourmaline Oil Corp	Bank of America Merrill Lynch	746
(3,584)	TransAlta Corp	Goldman Sachs	(1,127)
160	TransAlta Renewables Inc	Bank of America Merrill Lynch	115
306	TransAlta Renewables Inc	Goldman Sachs	220
(1,217)	Transat AT Inc	Bank of America Merrill Lynch	(536)
(2,008)	Transcontinental Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(3,059)
(234)	Transcontinental Inc 'A'	Goldman Sachs	(356)
341	Tricon Residential Inc	Goldman Sachs	(100)
256	Turquoise Hill Resources Ltd	Goldman Sachs	(12)
(1,437)	Uranium Participation Corp	Bank of America Merrill Lynch	22
(363)	Victoria Gold Corp	Bank of America Merrill Lynch	17
15	Viemed Healthcare Inc	Bank of America Merrill Lynch	11
1,161	Viemed Healthcare Inc	Goldman Sachs	862
(366)	Wesdome Gold Mines Ltd	Goldman Sachs	(167)
(390)	West Fraser Timber Co Ltd	Goldman Sachs	283
(467)	Westshore Terminals Investment Corp	Bank of America Merrill Lynch	(13)
573	Wheaton Precious Metals Corp	Morgan Stanley	(678)
(6,539)	Whitecap Resources Inc	Goldman Sachs	(3,473)
83	Winpak Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(25)
304	Winpak Ltd	Goldman Sachs	(90)
546	WPT Industrial Real Estate Investment Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	197
290	WPT Industrial Real Estate Investment Trust (Reit)	Goldman Sachs	67
323	Xenon Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	264
304	Zymeworks Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,656
89	Zymeworks Inc	Goldman Sachs	925
			25,456
	ケイマン諸島		
190	Ambarella Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,244
41,000	Ausnutria Dairy Corp Ltd	Goldman Sachs	(3,385)
500	Budweiser Brewing Co APAC Ltd	Bank of America Merrill Lynch	35
8,900	Budweiser Brewing Co APAC Ltd	Morgan Stanley	(2,813)
(3,500)	CK Asset Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(361)
(9,500)	CK Asset Holdings Ltd	Goldman Sachs	77

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	ケイマン諸島(続き)		
(9,000)	CK Hutchison Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,277)
(2,500)	CK Hutchison Holdings Ltd	Goldman Sachs	(22)
(325)	Endeavour Mining Corp	Goldman Sachs	392
(90)	Endeavour Mining Corp	Morgan Stanley	15
4,800	ESR Cayman Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,084)
800	ESR Cayman Ltd	Morgan Stanley	(181)
(89)	Fabrinet	Goldman Sachs	152
46,000	FIH Mobile Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(349)
(342)	Fresh Del Monte Produce Inc	Goldman Sachs	(133)
11	Global Indemnity Ltd	Goldman Sachs	72
1,556	Greenlight Capital Re Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(59)
1,263	Greenlight Capital Re Ltd 'A'	Goldman Sachs	(13)
6,000	Health & Happiness H&H International Holdings Ltd	Goldman Sachs	116
(252)	Herbalife Nutrition Ltd	Goldman Sachs	34
(176)	Herbalife Nutrition Ltd	Morgan Stanley	-
152	Ichor Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	254
154	Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR	Bank of America Merrill Lynch	(88)
870	Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR	Goldman Sachs	(60)
2,051	Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR	Morgan Stanley	(123)
(8,000)	MGM China Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(83)
(13,600)	MGM China Holdings Ltd	Goldman Sachs	(140)
(8,000)	Minth Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	516
1,751	Sapiens International Corp NV	Goldman Sachs	79
(11,000)	SITC International Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	2,206
112	SMART Global Holdings Inc	Goldman Sachs	49
574	Theravance Biopharma Inc	Goldman Sachs	(510)
(26,000)	WH Group Ltd	Goldman Sachs	1,275
1,000	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	Goldman Sachs	(109)
16,400	Wynn Macau Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,058)
(6,200)	XD Inc	Goldman Sachs	(3,011)
			(6,343)
	キュラソー島		
216	Schlumberger NV	Bank of America Merrill Lynch	345
			345
	デンマーク		
(188)	Ambu A/S 'B'	Goldman Sachs	(303)
(613)	Ambu A/S 'B'	Morgan Stanley	(1,215)
3	AP Moller - Maersk A/S 'A'	Bank of America Merrill Lynch	687
7	AP Moller - Maersk A/S 'A'	Morgan Stanley	937
14	AP Moller - Maersk A/S 'B'	Goldman Sachs	2,934
(52)	Carlsberg A/S 'B'	Goldman Sachs	239
(85)	Carlsberg A/S 'B'	Morgan Stanley	36
96	Chr Hansen Holding A/S	Bank of America Merrill Lynch	(386)
408	Chr Hansen Holding A/S	Goldman Sachs	(171)
224	Chr Hansen Holding A/S	Morgan Stanley	(650)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	デンマーク(続き)		
28	Coloplast A/S 'B'	Bank of America Merrill Lynch	113
188	Coloplast A/S 'B'	Goldman Sachs	(95)
46	Coloplast A/S 'B'	Morgan Stanley	74
(236)	D/S Norden A/S	Bank of America Merrill Lynch	(198)
375	Demant A/S	Bank of America Merrill Lynch	1,243
192	Demant A/S	Goldman Sachs	572
145	Drilling Co of 1972 A/S	Goldman Sachs	(155)
32	DSV PANALPINA A/S	Bank of America Merrill Lynch	(25)
719	DSV PANALPINA A/S	Morgan Stanley	(3,709)
534	FLSmidth & Co A/S	Bank of America Merrill Lynch	1,101
473	FLSmidth & Co A/S	Goldman Sachs	1,059
103	FLSmidth & Co A/S	Morgan Stanley	83
(288)	H Lundbeck A/S	Bank of America Merrill Lynch	90
991	ISS A/S	Goldman Sachs	402
825	ISS A/S	Morgan Stanley	485
773	Jyske Bank A/S RegS	Bank of America Merrill Lynch	972
134	Jyske Bank A/S RegS	Goldman Sachs	83
276	Jyske Bank A/S RegS	Morgan Stanley	71
(34)	Netcompany Group A/S	Goldman Sachs	(282)
(354)	Netcompany Group A/S	Morgan Stanley	(2,654)
(1,920)	Nilfisk Holding A/S	Bank of America Merrill Lynch	(7,260)
343	NKT A/S	Goldman Sachs	(553)
559	NKT A/S	Goldman Sachs	3,091
(144)	NNIT A/S	Bank of America Merrill Lynch	19
929	Novozymes A/S 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(2,306)
558	Novozymes A/S 'B'	Goldman Sachs	(1,190)
273	Novozymes A/S 'B'	Morgan Stanley	(260)
105	Orsted A/S	Bank of America Merrill Lynch	47
(1,396)	Pandora A/S	Morgan Stanley	(5,761)
(108)	Per Aarsleff Holding A/S	Bank of America Merrill Lynch	(165)
118	Ringkjoebing Landbobank A/S	Bank of America Merrill Lynch	99
66	Ringkjoebing Landbobank A/S	Goldman Sachs	64
30	ROCKWOOL International A/S 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(1,480)
51	ROCKWOOL International A/S 'B'	Morgan Stanley	(1,694)
(3,672)	Scandinavian Tobacco Group A/S	Bank of America Merrill Lynch	(566)
(111)	Schow & Co A/S	Bank of America Merrill Lynch	71
83	SimCorp A/S	Bank of America Merrill Lynch	385
328	SimCorp A/S	Goldman Sachs	1,916
147	SimCorp A/S	Morgan Stanley	995
358	Spar Nord Bank A/S	Bank of America Merrill Lynch	(109)
2,783	Spar Nord Bank A/S	Goldman Sachs	(277)
177	Sydbank AS	Bank of America Merrill Lynch	(63)
606	Sydbank AS	Goldman Sachs	(185)
(132)	Topdanmark AS	Bank of America Merrill Lynch	77
(43)	Topdanmark AS	Morgan Stanley	49

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	デンマーク(続き)		
97	Zealand Pharma A/S	Bank of America Merrill Lynch	181
188	Zealand Pharma A/S	Goldman Sachs	368
			(13,169)
	フェロー諸島		
34	Bakkafrost P/F	Bank of America Merrill Lynch	(180)
501	Bakkafrost P/F	Goldman Sachs	(2,568)
67	Bakkafrost P/F	Morgan Stanley	(8)
			(2,756)
	フィンランド		
(667)	Adapteo Oyj	Bank of America Merrill Lynch	(118)
(2,165)	Adapteo Oyj	Goldman Sachs	(383)
2,061	Aktia Bank Oyj	Bank of America Merrill Lynch	346
5,001	Aktia Bank Oyj	Goldman Sachs	840
(352)	BasWare Oyj	Bank of America Merrill Lynch	(45)
(258)	BasWare Oyj	Goldman Sachs	(47)
(212)	Cargotec Oyj	Bank of America Merrill Lynch	23
(177)	Cargotec Oyj	Morgan Stanley	(416)
(63)	Caverion Oyj	Bank of America Merrill Lynch	(11)
(10,872)	Caverion Oyj	Goldman Sachs	(1,956)
(6,613)	Citycon Oyj	Bank of America Merrill Lynch	1,810
623	Elisa Oyj	Morgan Stanley	(284)
(964)	Fortum Oyj	Bank of America Merrill Lynch	(1,374)
(847)	Fortum Oyj	Goldman Sachs	(1,406)
(4,631)	Fortum Oyj	Morgan Stanley	(7,972)
(3,490)	F-Secure Oyj	Goldman Sachs	(230)
(353)	Huhtamaki Oyj	Morgan Stanley	745
(105)	Kesko Oyj ' B '	Bank of America Merrill Lynch	(115)
(2,381)	Kesko Oyj ' B '	Morgan Stanley	(1,115)
115	Kojamo Oyj	Goldman Sachs	(31)
730	Kojamo Oyj	Morgan Stanley	(193)
83	Kone Oyj ' B '	Morgan Stanley	74
(1,832)	Metsa Board Oyj	Goldman Sachs	(82)
(242)	Metso Outotec Oyj	Goldman Sachs	(18)
190	Musti Group Oyj	Goldman Sachs	205
8,674	Nordea Bank Abp	Bank of America Merrill Lynch	(610)
2,520	Nordea Bank Abp	Morgan Stanley	(68)
(340)	Orion Oyj ' B '	Bank of America Merrill Lynch	(298)
(4,140)	Outokumpu Oyj	Bank of America Merrill Lynch	(79)
474	Rovio Entertainment Oyj	Bank of America Merrill Lynch	6
284	Sampo Oyj ' A '	Morgan Stanley	361
(257)	Sanoma Oyj	Bank of America Merrill Lynch	(43)
(1,129)	Sanoma Oyj	Goldman Sachs	31
(82)	Stora Enso Oyj ' R '	Goldman Sachs	(74)
(3,274)	Stora Enso Oyj ' R '	Morgan Stanley	(2,219)
(1,163)	TietoEVRY Oyj	Morgan Stanley	(1,837)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	フィンランド(続き)		
288	Tokmanni Group Corp	Bank of America Merrill Lynch	146
1,036	Tokmanni Group Corp	Goldman Sachs	413
(389)	UPM-Kymmene Oyj	Bank of America Merrill Lynch	(915)
(130)	UPM-Kymmene Oyj	Goldman Sachs	(250)
(1,078)	UPM-Kymmene Oyj	Morgan Stanley	(1,849)
(190)	Uponor Oyj	Bank of America Merrill Lynch	(171)
112	Valmet Oyj	Goldman Sachs	(16)
1,467	Wartsila Oyj Abp	Morgan Stanley	(271)
1,459	YIT Oyj	Bank of America Merrill Lynch	(149)
6,480	YIT Oyj	Goldman Sachs	(691)
			(20,336)
	フランス		
(655)	ABC arbitrage	Goldman Sachs	(14)
(1,377)	Accor SA	Morgan Stanley	1,520
218	Aeroports de Paris	Goldman Sachs	(418)
592	Air France-KLM	Bank of America Merrill Lynch	643
3,579	Air France-KLM	Morgan Stanley	2,949
147	Air Liquide SA	Goldman Sachs	493
370	Air Liquide SA	Morgan Stanley	352
(114)	Albioma SA	Goldman Sachs	(236)
1,674	ALD SA	Bank of America Merrill Lynch	(608)
295	ALD SA	Goldman Sachs	(170)
844	ALD SA	Morgan Stanley	(243)
1,793	Alstom SA	Morgan Stanley	7,678
(43)	Alten SA	Goldman Sachs	141
464	Amundi SA	Bank of America Merrill Lynch	(306)
352	Amundi SA	Goldman Sachs	(232)
428	Amundi SA	Morgan Stanley	(411)
(7)	Atos SE	Bank of America Merrill Lynch	(66)
(2,696)	AXA SA	Morgan Stanley	(2,852)
(1,211)	Beneteau SA	Goldman Sachs	(247)
(17,452)	Bollere SA	Morgan Stanley	2,722
(173)	Bonduelle SCA	Goldman Sachs	(66)
(829)	Bouygues SA	Morgan Stanley	(229)
411	Carrefour SA	Bank of America Merrill Lynch	55
1,656	Carrefour SA	Goldman Sachs	(51)
582	Carrefour SA	Morgan Stanley	279
136	Chargeurs SA	Bank of America Merrill Lynch	108
226	Cie des Alpes	Bank of America Merrill Lynch	22
(114)	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	Bank of America Merrill Lynch	(62)
(69)	Cie Plastic Omnium SA	Goldman Sachs	-
(63)	Covivio (Reit)	Morgan Stanley	261
97	Credit Agricole SA	Goldman Sachs	118
2,464	Credit Agricole SA	Morgan Stanley	1,460
238	Danone SA	Bank of America Merrill Lynch	619

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	フランス(続き)		
413	Danone SA	Goldman Sachs	(288)
(23)	Dassault Aviation SA	Bank of America Merrill Lynch	1,117
370	Dassault Systemes SE	Bank of America Merrill Lynch	953
165	Dassault Systemes SE	Morgan Stanley	287
(5,257)	Derichebourg SA	Bank of America Merrill Lynch	(88)
(3,675)	Derichebourg SA	Goldman Sachs	(62)
(262)	Edenred	Bank of America Merrill Lynch	(776)
(160)	Eiffage SA	Bank of America Merrill Lynch	8
815	Elior Group SA	Goldman Sachs	(182)
181	Elis SA	Morgan Stanley	(24)
(67)	Eramet SA	Goldman Sachs	(160)
(372)	Etablissements Maurel et Prom SA	Bank of America Merrill Lynch	(13)
(830)	Etablissements Maurel et Prom SA	Goldman Sachs	(30)
3,448	Eutelsat Communications SA	Bank of America Merrill Lynch	(3,440)
119	Faurecia SE	Bank of America Merrill Lynch	464
1,032	Faurecia SE	Goldman Sachs	4,023
417	Faurecia SE	Morgan Stanley	1,366
(41)	FFP	Bank of America Merrill Lynch	40
(148)	Fnac Darty SA	Bank of America Merrill Lynch	(465)
(14)	Gaztransport Et Technigaz SA	Morgan Stanley	7
(370)	GL Events	Goldman Sachs	186
(36)	Groupe Guillin	Bank of America Merrill Lynch	3
(43)	Groupe Guillin	Goldman Sachs	4
(5)	ID Logistics Group	Bank of America Merrill Lynch	2
(3)	ID Logistics Group	Goldman Sachs	3
(81)	Iliad SA	Goldman Sachs	24
(118)	Imerys SA	Morgan Stanley	(173)
(29)	Interparfums SA	Bank of America Merrill Lynch	2
(117)	Ipsen SA	Morgan Stanley	161
(675)	IPSOS	Goldman Sachs	184
(313)	Jacquet Metal Service SA	Bank of America Merrill Lynch	150
(212)	Jacquet Metals SA	Goldman Sachs	102
1,366	JCDecaux SA	Morgan Stanley	677
(142)	Kaufman & Broad SA	Bank of America Merrill Lynch	77
19	Kering SA	Goldman Sachs	(130)
31	Kering SA	Morgan Stanley	23
193	Klepierre SA (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(61)
667	Klepierre SA (REIT)	Goldman Sachs	(1,280)
580	Klepierre SA (REIT)	Morgan Stanley	703
(168)	La Francaise des Jeux SAEM	Goldman Sachs	107
(208)	Lagardere SCA	Bank of America Merrill Lynch	4
2,452	Legrand SA	Morgan Stanley	941
(239)	LISI	Bank of America Merrill Lynch	(29)
(178)	LISI	Goldman Sachs	(21)
94	L'Oreal SA	Bank of America Merrill Lynch	(926)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	フランス(続き)		
14	L'Oreal SA	Goldman Sachs	(151)
175	L'Oreal SA	Morgan Stanley	300
103	Maisons du Monde SA	Bank of America Merrill Lynch	37
515	Maisons du Monde SA	Goldman Sachs	618
477	Mersen SA	Bank of America Merrill Lynch	(86)
283	Mersen SA	Goldman Sachs	(51)
1,188	Metropole Television SA	Bank of America Merrill Lynch	1,539
824	Metropole Television SA	Goldman Sachs	1,068
1,522	Natixis SA	Bank of America Merrill Lynch	152
3,218	Natixis SA	Goldman Sachs	263
3,239	Natixis SA	Morgan Stanley	163
(85)	Nexity SA	Goldman Sachs	(339)
(99)	Orpea SA	Morgan Stanley	(47)
(257)	Publicis Groupe SA	Morgan Stanley	203
4	Quadiant SA	Bank of America Merrill Lynch	12
688	Quadiant SA	Goldman Sachs	2,071
(234)	Rallye SA	Bank of America Merrill Lynch	6
(1,765)	Rallye SA	Goldman Sachs	42
50	Remy Cointreau SA	Bank of America Merrill Lynch	(372)
114	Remy Cointreau SA	Goldman Sachs	(867)
345	Remy Cointreau SA	Morgan Stanley	(828)
369	Renault SA	Bank of America Merrill Lynch	1,850
56	Renault SA	Morgan Stanley	(37)
210	Rexel SA	Goldman Sachs	92
2,512	Rexel SA	Morgan Stanley	1,431
(206)	Rubis SCA	Goldman Sachs	340
15	Safran SA	Morgan Stanley	8
24	Sartorius Stedim Biotech	Bank of America Merrill Lynch	216
110	Sartorius Stedim Biotech	Goldman Sachs	1,663
377	SCOR SE	Goldman Sachs	93
905	SCOR SE	Morgan Stanley	217
(28)	SEB SA	Morgan Stanley	(144)
722	SMCP SA	Goldman Sachs	753
107	Societe BIC SA	Goldman Sachs	(73)
583	Societe Generale SA	Bank of America Merrill Lynch	570
1,898	Societe Generale SA	Goldman Sachs	1,713
2,044	Societe Generale SA	Morgan Stanley	1,255
378	Sodexo SA	Bank of America Merrill Lynch	(200)
(234)	SOITEC	Goldman Sachs	(4,042)
(17)	Sopra Steria Group	Bank of America Merrill Lynch	(103)
(1,557)	SPIE SA	Morgan Stanley	(1,475)
(197)	Tarkett SA	Goldman Sachs	(364)
882	Television Francaise 1	Bank of America Merrill Lynch	232
4,338	Television Francaise 1	Goldman Sachs	557
(69)	Thales SA	Goldman Sachs	89

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	フランス(続き)		
(1,660)	TOTAL SE	Morgan Stanley	(2,180)
(37)	Trigano SA	Goldman Sachs	(852)
(365)	Ubisoft Entertainment SA	Morgan Stanley	(1,182)
694	Valeo SA	Bank of America Merrill Lynch	1,903
128	Valeo SA	Goldman Sachs	304
48	Valeo SA	Morgan Stanley	97
(1,426)	Veolia Environnement SA	Goldman Sachs	(787)
(311)	Verallia SA	Goldman Sachs	(504)
(207)	Vicat SA	Bank of America Merrill Lynch	55
(99)	Vicat SA	Goldman Sachs	14
(121)	Vilmorin & Cie SA	Bank of America Merrill Lynch	(327)
(19)	Vilmorin & Cie SA	Goldman Sachs	(51)
(530)	Vivendi SA	Morgan Stanley	(32)
(14)	Wendel SE	Bank of America Merrill Lynch	(16)
(22)	Wendel SE	Goldman Sachs	(25)
(74)	Wendel SE	Morgan Stanley	(53)
(276)	Worldline SA	Goldman Sachs	(1,636)
			19,781
	ドイツ		
516	1&1 Drillisch AG	Bank of America Merrill Lynch	332
435	1&1 Drillisch AG	Goldman Sachs	240
212	1&1 Drillisch AG	Morgan Stanley	212
553	Aareal Bank AG	Bank of America Merrill Lynch	1,075
91	adidas AG	Bank of America Merrill Lynch	(317)
154	adidas AG	Goldman Sachs	(735)
54	adidas AG	Morgan Stanley	(376)
870	ADVA Optical Networking SE	Bank of America Merrill Lynch	31
2,156	ADVA Optical Networking SE	Goldman Sachs	78
(221)	AIXTRON SE	Bank of America Merrill Lynch	(464)
(946)	AIXTRON SE	Goldman Sachs	(1,082)
40	Allianz SE RegS	Bank of America Merrill Lynch	233
987	Allianz SE RegS	Morgan Stanley	4,085
70	Amadeus Fire AG	Bank of America Merrill Lynch	940
58	Amadeus Fire AG	Goldman Sachs	779
(3,211)	AURELIUS Equity Opportunities SE & Co KGaA	Bank of America Merrill Lynch	(12,210)
(191)	Aurubis AG	Bank of America Merrill Lynch	1
(229)	Aurubis AG	Goldman Sachs	(60)
(411)	Aurubis AG	Morgan Stanley	(69)
71	Basler AG	Goldman Sachs	204
(557)	Bayer AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	(1,480)
(550)	Bayer AG RegS	Morgan Stanley	(1,029)
(85)	Bayerische Motoren Werke AG (Pref)	Bank of America Merrill Lynch	(63)
(36)	Bayerische Motoren Werke AG (Pref)	Goldman Sachs	(22)
(219)	Bayerische Motoren Werke AG (Pref)	Morgan Stanley	(171)
53	BayWa AG	Bank of America Merrill Lynch	40

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	ドイツ(続き)		
98	BayWa AG	Goldman Sachs	131
(220)	Bechtle AG	Bank of America Merrill Lynch	(3,143)
(224)	Bechtle AG	Goldman Sachs	(503)
(17)	Bechtle AG	Morgan Stanley	(173)
784	Beiersdorf AG	Morgan Stanley	(1,166)
(79)	bet-at-home.com AG	Goldman Sachs	(152)
(1,353)	Bilfinger SE	Goldman Sachs	(2,077)
1,313	Borussia Dortmund GmbH & Co KGaA	Bank of America Merrill Lynch	725
3,203	Borussia Dortmund GmbH & Co KGaA	Goldman Sachs	1,498
(207)	Brenntag AG	Goldman Sachs	(330)
(886)	Brenntag AG	Morgan Stanley	(1,488)
5,291	CECONOMY AG	Bank of America Merrill Lynch	329
3,401	CECONOMY AG	Goldman Sachs	(496)
76	Cewe Stiftung & Co KGAA	Bank of America Merrill Lynch	438
545	Cewe Stiftung & Co KGAA	Goldman Sachs	3,138
109	CompuGroup Medical SE & Co KgaA	Bank of America Merrill Lynch	1,229
97	CompuGroup Medical SE & Co KgaA	Morgan Stanley	855
(153)	Continental AG	Bank of America Merrill Lynch	51
(226)	Continental AG	Morgan Stanley	(1,179)
116	Covestro AG	Goldman Sachs	184
352	Covestro AG	Morgan Stanley	587
264	CropEnergies AG	Bank of America Merrill Lynch	259
440	Daimler AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	1,879
3,431	Daimler AG RegS	Morgan Stanley	5,515
(93)	Dermapharm Holding SE	Goldman Sachs	(897)
(2,389)	Deutsche Bank AG RegS	Goldman Sachs	(719)
894	Deutsche Beteiligungs AG	Bank of America Merrill Lynch	643
167	Deutsche Beteiligungs AG	Goldman Sachs	120
(77)	Deutsche Boerse AG	Bank of America Merrill Lynch	(418)
(17)	Deutsche Boerse AG	Goldman Sachs	(45)
(126)	Deutsche Boerse AG	Morgan Stanley	(967)
(733)	Deutsche EuroShop AG	Goldman Sachs	(378)
2,334	Deutsche Lufthansa AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	(302)
2,301	Deutsche Pfandbriefbank AG	Goldman Sachs	1,452
177	Deutsche Post AG RegS	Goldman Sachs	176
1,878	Deutsche Post AG RegS	Morgan Stanley	3,852
(940)	Deutsche Telekom AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	(590)
(7,889)	Deutsche Telekom AG RegS	Morgan Stanley	(5,394)
698	Deutsche Wohnen SE	Bank of America Merrill Lynch	758
160	Deutsche Wohnen SE	Goldman Sachs	223
177	Deutsche Wohnen SE	Morgan Stanley	163
2,595	Deutz AG	Bank of America Merrill Lynch	(1,712)
1,158	DIC Asset AG	Goldman Sachs	1,334
51	Draegerwerk AG & Co KGaA (Pref)	Bank of America Merrill Lynch	(135)
165	Draegerwerk AG & Co KGaA (Pref)	Goldman Sachs	(435)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	ドイツ(続き)		
33	Duerr AG	Bank of America Merrill Lynch	137
120	Duerr AG	Goldman Sachs	493
79	Duerr AG	Morgan Stanley	231
360	DWS Group GmbH & Co KGaA	Bank of America Merrill Lynch	(568)
394	DWS Group GmbH & Co KGaA	Goldman Sachs	(621)
447	DWS Group GmbH & Co KGaA	Morgan Stanley	(59)
4,540	E.ON SE	Bank of America Merrill Lynch	(294)
162	E.ON SE	Goldman Sachs	14
14,294	E.ON SE	Morgan Stanley	1,612
480	Elmos Semiconductor SE	Bank of America Merrill Lynch	1,785
137	Elmos Semiconductor SE	Goldman Sachs	509
(284)	ElringKlinger AG	Bank of America Merrill Lynch	(559)
(232)	Encavis AG	Goldman Sachs	(504)
(182)	Evonik Industries AG	Bank of America Merrill Lynch	(87)
(445)	Evonik Industries AG	Morgan Stanley	(550)
1,327	Fielmann AG	Morgan Stanley	(557)
(397)	flatexDEGIRO AG	Goldman Sachs	(2,110)
425	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	Bank of America Merrill Lynch	(20)
635	Freenet AG	Morgan Stanley	240
(1,278)	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	Bank of America Merrill Lynch	2,238
(962)	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	Morgan Stanley	(115)
(27)	Fresenius SE & Co KGaA	Bank of America Merrill Lynch	(6)
(536)	Fresenius SE & Co KGaA	Goldman Sachs	(295)
(1,426)	Fresenius SE & Co KGaA	Morgan Stanley	(736)
(130)	FUCHS PETROLUB SE (Pref)	Morgan Stanley	(109)
(391)	GEA Group AG	Morgan Stanley	(80)
292	Hamborner AG (Reit)	Goldman Sachs	30
178	Hamburger Hafen und Logistik AG	Bank of America Merrill Lynch	171
175	Hamburger Hafen und Logistik AG	Goldman Sachs	149
(81)	Hannover Rueck SE	Bank of America Merrill Lynch	544
(358)	Hannover Rueck SE	Morgan Stanley	1,031
(349)	HeidelbergCement AG	Bank of America Merrill Lynch	(234)
(152)	HeidelbergCement AG	Goldman Sachs	(149)
(44)	HeidelbergCement AG	Morgan Stanley	(71)
310	Hella GmbH & Co KGaA	Bank of America Merrill Lynch	461
1,319	Hella GmbH & Co KGaA	Goldman Sachs	1,962
264	Hella GmbH & Co KGaA	Morgan Stanley	469
(136)	HelloFresh SE	Bank of America Merrill Lynch	(1,030)
(919)	HelloFresh SE	Morgan Stanley	(2,601)
(415)	Henkel AG & Co KGaA	Morgan Stanley	(1,543)
(844)	Henkel AG & Co KGaA (Pref)	Bank of America Merrill Lynch	(1,581)
(1,107)	Henkel AG & Co KGaA (Pref)	Morgan Stanley	(5,258)
(415)	HOCHTIEF AG	Morgan Stanley	(1,145)
(99)	Hornbach Baumarkt AG	Goldman Sachs	(116)
7	Hypoport SE	Bank of America Merrill Lynch	33

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	ドイツ(続き)		
27	Hypoport SE	Goldman Sachs	243
249	Indus Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	568
244	Indus Holding AG	Goldman Sachs	556
1,350	Infineon Technologies AG	Morgan Stanley	3,684
(820)	Jenoptik AG	Goldman Sachs	251
55	JOST Werke AG	Bank of America Merrill Lynch	53
192	JOST Werke AG	Goldman Sachs	475
(238)	Jungheinrich AG (Pref)	Bank of America Merrill Lynch	(216)
(112)	Jungheinrich AG (Pref)	Goldman Sachs	22
(1,112)	Jungheinrich AG (Pref)	Morgan Stanley	(347)
(240)	K+S AG RegS	Goldman Sachs	24
21	KION Group AG	Bank of America Merrill Lynch	(179)
21	KION Group AG	Bank of America Merrill Lynch	11
99	KION Group AG	Goldman Sachs	(255)
(535)	Kloeckner & Co SE	Goldman Sachs	(143)
561	Knorr-Bremse AG	Morgan Stanley	(350)
112	Krones AG	Bank of America Merrill Lynch	317
230	Krones AG	Goldman Sachs	827
(38)	KWS Saat SE & Co KGaA	Bank of America Merrill Lynch	(77)
(27)	KWS Saat SE & Co KGaA	Goldman Sachs	(7)
(38)	LANXESS AG	Bank of America Merrill Lynch	(8)
(1,942)	LANXESS AG	Morgan Stanley	(10,436)
28	LEG Immobilien AG	Bank of America Merrill Lynch	42
71	LEG Immobilien AG	Goldman Sachs	101
(4,132)	Leoni AG	Goldman Sachs	1,388
(624)	LPKF Laser & Electronics AG	Bank of America Merrill Lynch	(1,783)
(143)	LPKF Laser & Electronics AG	Goldman Sachs	(403)
(10)	MBB SE	Goldman Sachs	(57)
2,844	MLP SE	Bank of America Merrill Lynch	1,109
7,438	MLP SE	Goldman Sachs	2,900
(77)	MTU Aero Engines AG	Bank of America Merrill Lynch	333
(139)	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen Reg	Morgan Stanley	(434)
117	Nemetschek SE	Bank of America Merrill Lynch	465
705	Nemetschek SE	Goldman Sachs	2,628
607	Nemetschek SE	Morgan Stanley	2,767
20	New Work SE	Goldman Sachs	347
(185)	Norma Group SE	Bank of America Merrill Lynch	(732)
(63)	Norma Group SE	Goldman Sachs	(250)
(103)	OHB SE	Bank of America Merrill Lynch	(19)
(160)	OHB SE	Goldman Sachs	(29)
(405)	PATRIZIA AG	Goldman Sachs	(10)
(854)	PNE AG	Goldman Sachs	(180)
(147)	Porsche Automobil Holding SE (Pref)	Bank of America Merrill Lynch	419
(1,842)	Porsche Automobil Holding SE (Pref)	Morgan Stanley	4,905
(1,249)	ProSiebenSat.1 Media SE	Goldman Sachs	936

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	ドイツ(続き)		
1,616	Puma SE	Morgan Stanley	(2,210)
(11)	Rational AG	Goldman Sachs	170
(42)	Rheinmetall AG	Bank of America Merrill Lynch	71
(40)	Rheinmetall AG	Goldman Sachs	105
(57)	Rheinmetall AG	Morgan Stanley	255
535	Salzgitter AG	Bank of America Merrill Lynch	1,461
251	Salzgitter AG	Goldman Sachs	716
(739)	SAP SE	Morgan Stanley	(2,500)
(135)	Sartorius AG (Pref)	Bank of America Merrill Lynch	(3,759)
269	Scout24 AG	Bank of America Merrill Lynch	97
176	Scout24 AG	Goldman Sachs	(4)
1,387	Scout24 AG	Morgan Stanley	2,019
478	Siemens AG RegS	Morgan Stanley	642
(2,004)	Siemens Energy AG	Bank of America Merrill Lynch	(4,615)
(2,245)	Siemens Energy AG	Goldman Sachs	(2,086)
(2,203)	Siemens Energy AG	Morgan Stanley	(132)
180	Siemens Healthineers AG	Bank of America Merrill Lynch	298
596	Siemens Healthineers AG	Morgan Stanley	754
(285)	Siltronic AG	Goldman Sachs	(10,180)
(883)	Siltronic AG	Morgan Stanley	(27,022)
170	Sixt SE	Goldman Sachs	1,060
(40)	Sixt SE (Pref)	Bank of America Merrill Lynch	(245)
(85)	Sixt SE (Pref)	Goldman Sachs	(452)
(311)	SMA Solar Technology AG	Goldman Sachs	(851)
(109)	Stroeer SE & Co KGaA	Bank of America Merrill Lynch	(77)
(114)	Suedzucker AG	Goldman Sachs	(54)
(33)	Symrise AG	Morgan Stanley	(95)
(394)	Takkt AG	Bank of America Merrill Lynch	34
(1,010)	Takkt AG	Goldman Sachs	(853)
81	Talanx AG	Bank of America Merrill Lynch	28
399	Talanx AG	Goldman Sachs	(89)
174	Talanx AG	Morgan Stanley	71
(132)	TeamViewer AG	Bank of America Merrill Lynch	(295)
(701)	TeamViewer AG	Goldman Sachs	(244)
(306)	TeamViewer AG	Morgan Stanley	(132)
(5,206)	Telefonica Deutschland Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	210
(1,683)	Telefonica Deutschland Holding AG	Goldman Sachs	19
(10,124)	Telefonica Deutschland Holding AG	Morgan Stanley	(729)
600	thyssenkrupp AG	Goldman Sachs	501
4,025	thyssenkrupp AG	Morgan Stanley	1,159
108	Traton SE	Bank of America Merrill Lynch	218
540	Traton SE	Goldman Sachs	1,088
364	Traton SE	Morgan Stanley	190
1,570	TUI AG	Goldman Sachs	(209)
(620)	Uniper SE	Bank of America Merrill Lynch	(138)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	ドイツ(続き)		
(312)	Uniper SE	Goldman Sachs	(179)
(1,355)	Uniper SE	Morgan Stanley	(328)
(245)	United Internet AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	(168)
(372)	United Internet AG RegS	Goldman Sachs	(254)
(1,239)	United Internet AG RegS	Morgan Stanley	(262)
189	Varta AG	Bank of America Merrill Lynch	759
18	Varta AG	Morgan Stanley	(9)
717	VERBIO Vereinigte BioEnergie AG	Goldman Sachs	4,033
(159)	Volkswagen AG	Bank of America Merrill Lynch	894
(87)	Volkswagen AG	Goldman Sachs	449
(121)	Volkswagen AG	Morgan Stanley	523
245	Vonovia SE	Bank of America Merrill Lynch	766
(224)	Vossloh AG	Goldman Sachs	(321)
(226)	Wacker Neuson SE	Bank of America Merrill Lynch	222
(164)	Wacker Neuson SE	Goldman Sachs	161
(31)	Washtec AG	Bank of America Merrill Lynch	128
(384)	Washtec AG	Goldman Sachs	1,589
330	Wuestenrot & Wuerttembergische AG	Bank of America Merrill Lynch	348
679	Wuestenrot & Wuerttembergische AG	Goldman Sachs	670
(288)	Zalando SE	Goldman Sachs	(1,451)
(66)	zooplus AG	Bank of America Merrill Lynch	371
(20)	zooplus AG	Goldman Sachs	(104)
			<u>(44,389)</u>
	ジブラルタル		
10,471	888 Holdings Plc	Goldman Sachs	2,240
			<u>2,240</u>
	ガーンジー		
580	Amdocs Ltd	Morgan Stanley	661
(221)	Burford Capital Ltd	Goldman Sachs	64
			<u>725</u>
	香港		
(5,600)	AIA Group Ltd	Goldman Sachs	1,806
(1,400)	Bank of East Asia Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(201)
75,000	BOC Hong Kong Holdings Ltd	Morgan Stanley	5,805
23,000	Cathay Pacific Airways Ltd	Morgan Stanley	1,276
3,000	Champion REIT (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	124
(4,000)	CLP Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	568
(2,000)	CLP Holdings Ltd	Goldman Sachs	284
400	Dah Sing Financial Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	93
2,000	Dah Sing Financial Holdings Ltd	Goldman Sachs	464
(3,000)	Galaxy Entertainment Group Ltd	Goldman Sachs	1,291
20,000	Guotai Junan International Holdings Ltd	Goldman Sachs	129
23,000	Guotai Junan International Holdings Ltd	Morgan Stanley	148
(1,000)	Hang Lung Group Ltd	Goldman Sachs	2

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	香港(続き)		
(8,000)	Hang Lung Properties Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,218
3,400	Hang Seng Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,579
3,700	Hang Seng Bank Ltd	Goldman Sachs	2,167
5,400	Hang Seng Bank Ltd	Morgan Stanley	2,508
(1,000)	Henderson Land Development Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(194)
(700)	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,029)
(500)	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	Morgan Stanley	(555)
(4,000)	Hong Kong Television Network Ltd	Goldman Sachs	311
(1,000)	Hysan Development Co Ltd	Morgan Stanley	(329)
(5,900)	Link (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	926
(300)	Link (REIT)	Morgan Stanley	(52)
(37,000)	Melco International Development Ltd	Morgan Stanley	1,909
10,000	MTR Corp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	129
5,000	MTR Corp Ltd	Goldman Sachs	65
2,000	New World Development Co Ltd	Goldman Sachs	(90)
25,000	PCCW Ltd	Goldman Sachs	(91)
(1,000)	Power Assets Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	65
(2,000)	Power Assets Holdings Ltd	Goldman Sachs	37
(5,500)	Power Assets Holdings Ltd	Morgan Stanley	(71)
(226,000)	Shun Tak Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,915
(2,000)	Shun Tak Holdings Ltd	Morgan Stanley	10
8,000	Sino Land Co Ltd	Goldman Sachs	877
(6,000)	SJM Holdings Ltd	Goldman Sachs	25
(1,500)	Sun Hung Kai Properties Ltd	Bank of America Merrill Lynch	116
(2,000)	Sun Hung Kai Properties Ltd	Morgan Stanley	103
500	Swire Pacific Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	126
5,000	Swire Pacific Ltd 'A'	Morgan Stanley	(835)
1,000	Swire Properties Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(13)
9,200	Swire Properties Ltd	Goldman Sachs	(119)
4,200	Swire Properties Ltd	Morgan Stanley	(54)
8,000	Vitasoy International Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	108
8,000	Vitasoy International Holdings Ltd	Goldman Sachs	495
18,000	Vitasoy International Holdings Ltd	Morgan Stanley	348
			24,394
	アイルランド		
(107)	Adient Plc	Goldman Sachs	(88)
2,816	AIB Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	714
5,534	AIB Group Plc	Goldman Sachs	1,222
8,157	AIB Group Plc	Morgan Stanley	802
70	Allegion Plc	Bank of America Merrill Lynch	(7)
51	Allegion Plc	Goldman Sachs	36
639	Allegion Plc	Morgan Stanley	(281)
(31)	Cimpress Plc	Bank of America Merrill Lynch	2
4,142	Dalata Hotel Group Plc	Goldman Sachs	(50)
479	Eaton Corp Plc	Bank of America Merrill Lynch	1,595

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	アイルランド(続き)		
54	Eaton Corp Plc	Goldman Sachs	115
362	Eaton Corp Plc	Morgan Stanley	(704)
(3,234)	Endo International Plc	Goldman Sachs	(825)
41	Flutter Entertainment Plc	Morgan Stanley	471
182	Grafton Group Plc (Unit)	Goldman Sachs	12
(3,066)	Greencore Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	414
(700)	Horizon Therapeutics Plc	Morgan Stanley	(1,176)
(3,594)	Irish Residential Properties REIT Plc	Bank of America Merrill Lynch	629
(5,218)	Irish Residential Properties REIT Plc	Goldman Sachs	914
(939)	James Hardie Industries Plc - CDI	Bank of America Merrill Lynch	(140)
(1,420)	James Hardie Industries Plc - CDI	Goldman Sachs	338
1,076	Johnson Controls International Plc	Morgan Stanley	624
181	Kerry Group Plc 'A'	Morgan Stanley	(130)
440	Kingspan Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1,425)
318	Kingspan Group Plc	Goldman Sachs	(1,278)
649	Kingspan Group Plc	Morgan Stanley	389
194	Linde Plc	Morgan Stanley	649
(272)	Medtronic Plc	Goldman Sachs	59
(666)	nVent Electric Plc	Bank of America Merrill Lynch	(7)
(233)	nVent Electric Plc	Goldman Sachs	(352)
(2,093)	Origin Enterprises Plc	Bank of America Merrill Lynch	(213)
(4,578)	Origin Enterprises Plc	Goldman Sachs	(467)
(479)	Pentair Plc	Morgan Stanley	618
(972)	Seagate Technology Plc	Goldman Sachs	(2,683)
(306)	Seagate Technology Plc	Morgan Stanley	(545)
(463)	Smurfit Kappa Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	356
(86)	STERIS Plc	Bank of America Merrill Lynch	(59)
(70)	STERIS Plc	Goldman Sachs	289
(130)	STERIS Plc	Morgan Stanley	(302)
40	Trane Technologies Plc	Bank of America Merrill Lynch	(172)
295	Trane Technologies Plc	Goldman Sachs	(884)
(1,412)	UDG Healthcare Plc	Goldman Sachs	(548)
			<u>(2,088)</u>
	マン島		
1,329	GVC Holdings Plc	Goldman Sachs	1,170
708	GVC Holdings Plc	Morgan Stanley	613
528	Playtech Plc	Bank of America Merrill Lynch	115
522	Playtech Plc	Goldman Sachs	154
34	Strix Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	1
2,128	Strix Group Plc	Goldman Sachs	93
			<u>2,146</u>
	イスラエル		
(285)	AFI Properties Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,367)
360	Alony Hetz Properties & Investments Ltd	Goldman Sachs	(48)
445	Amot Investments Ltd	Goldman Sachs	(43)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	イスラエル(続き)		
339	Ashtrom Group Ltd	Goldman Sachs	233
60	Azrieli Group Ltd	Morgan Stanley	73
1,270	Bank Hapoalim BM	Goldman Sachs	(380)
4,342	Bank Leumi Le-Israel BM	Bank of America Merrill Lynch	1,484
3,641	Bank Leumi Le-Israel BM	Morgan Stanley	231
(1,769)	Bayside Land Corp	Bank of America Merrill Lynch	(164)
(2,497)	Bayside Land Corp	Goldman Sachs	(664)
(19,658)	Bezeq The Israeli Telecommunication Corp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	612
(154)	Big Shopping Centers Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(801)
2,253	Caesarstone Ltd	Goldman Sachs	(22)
(3,011)	Cellcom Israel Ltd	Goldman Sachs	(1,156)
17	Check Point Software Technologies Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(18)
285	Compugen Ltd	Goldman Sachs	(148)
(170)	CyberArk Software Ltd	Goldman Sachs	(396)
(30)	CyberArk Software Ltd	Morgan Stanley	(90)
(407)	Delek Automotive Systems Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(338)
(3,537)	Delek Automotive Systems Ltd	Goldman Sachs	(2,941)
(1,021)	Delta Galil Industries Ltd	Goldman Sachs	(769)
359	Elco Ltd	Bank of America Merrill Lynch	152
480	Elco Ltd	Goldman Sachs	402
3	Electra Ltd/Israel	Goldman Sachs	28
515	Energix-Renewable Energies Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(193)
2,697	Energix-Renewable Energies Ltd	Morgan Stanley	(575)
7,096	Enlight Renewable Energy Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(901)
7,263	Enlight Renewable Energy Ltd	Goldman Sachs	(922)
70	Fattal Holdings 1998 Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(324)
1,909	FIBI Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,482
198	FIBI Holdings Ltd	Goldman Sachs	(44)
(433)	First International Bank Of Israel Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(26)
(129)	Fiverr International Ltd	Goldman Sachs	(2,305)
(43)	Formula Systems 1985 Ltd	Bank of America Merrill Lynch	13
382	Harel Insurance Investments & Financial Services Ltd	Morgan Stanley	136
194	IDI Insurance Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	395
490	IDI Insurance Co Ltd	Goldman Sachs	999
(1,338)	Isracard Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(251)
(136)	Israel Corp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,779)
(9,014)	Israel Discount Bank Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,281)
(35)	Kornit Digital Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(215)
(153)	Kornit Digital Ltd	Morgan Stanley	(184)
(165)	Matrix IT Ltd	Bank of America Merrill Lynch	98
221	Maytronics Ltd	Goldman Sachs	76
(460)	Melison Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,711)
(397)	Menora Mivtachim Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(916)
(680)	Menora Mivtachim Holdings Ltd	Goldman Sachs	(1,569)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	イスラエル(続き)		
(2,060)	Naphtha Israel Petroleum Corp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(171)
(2,221)	Naphtha Israel Petroleum Corp Ltd	Goldman Sachs	(257)
(41)	Nova Measuring Instruments Ltd	Goldman Sachs	(112)
335	OPC Energy Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(57)
(1,398)	Plus500 Ltd	Goldman Sachs	(722)
(2,170)	Plus500 Ltd	Morgan Stanley	972
(307)	Property & Building Corp Ltd	Goldman Sachs	(1,699)
1,655	Radware Ltd	Goldman Sachs	17
112	Rami Levy Chain Stores Hashikma Marketing 2006 Ltd	Bank of America Merrill Lynch	133
1,002	Shapir Engineering and Industry Ltd	Bank of America Merrill Lynch	564
441	Teva Pharmaceutical Industries Ltd	Goldman Sachs	(84)
1,217	Teva Pharmaceutical Industries Ltd	Morgan Stanley	335
(1,827)	Tower Semiconductor Ltd	Goldman Sachs	(1,630)
(339)	YH Dimri Construction & Development Ltd	Goldman Sachs	(1,630)
			(21,468)
	イタリア		
(13,926)	A2A SpA	Bank of America Merrill Lynch	(961)
(304)	ACEA SpA	Bank of America Merrill Lynch	62
(3,849)	Anima Holding SpA	Goldman Sachs	(385)
(1,720)	Arnoldo Mondadori Editore SpA	Goldman Sachs	(376)
(1,937)	Assicurazioni Generali SpA	Bank of America Merrill Lynch	(1,266)
487	ASTM SpA	Goldman Sachs	840
(610)	Autogrill SpA	Goldman Sachs	(15)
(617)	Azimut Holding SpA	Goldman Sachs	(244)
(1,017)	Azimut Holding SpA	Morgan Stanley	(268)
(688)	Banca Farmafactoring SpA	Goldman Sachs	95
267	Banca Generali SpA	Goldman Sachs	(160)
371	Banca IFIS SpA	Bank of America Merrill Lynch	227
439	Banca IFIS SpA	Goldman Sachs	269
(997)	Banca Mediolanum SpA	Morgan Stanley	(120)
(6,072)	Banco BPM SpA	Morgan Stanley	(11)
(146)	Biesse SpA	Goldman Sachs	82
(167)	Brunello Cucinelli SpA	Bank of America Merrill Lynch	(601)
288	Buzzi Unicem SpA	Goldman Sachs	(90)
2,674	Buzzi Unicem SpA	Morgan Stanley	257
324	Buzzi Unicem SpA - RSP	Bank of America Merrill Lynch	(14)
564	Carel Industries SpA	Bank of America Merrill Lynch	54
348	Carel Industries SpA	Goldman Sachs	33
461	Cerved Group SpA	Goldman Sachs	(4)
3,879	Credito Emiliano SpA	Goldman Sachs	1,117
(2,812)	Danieli & C Officine Meccaniche SpA	Bank of America Merrill Lynch	(405)
(1,069)	Danieli & C Officine Meccaniche SpA	Goldman Sachs	(154)
614	De' Longhi SpA	Goldman Sachs	932
(307)	doValue SpA	Bank of America Merrill Lynch	118

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	イタリア(続き)		
(585)	doValue SpA	Goldman Sachs	225
3,436	Enel SpA	Morgan Stanley	1,574
(11,700)	Eni SpA	Goldman Sachs	(8,098)
(143)	ERG SpA	Goldman Sachs	106
(889)	Falck Renewables SpA	Goldman Sachs	(270)
(5,907)	Fila SpA	Goldman Sachs	1,134
(829)	FinecoBank Banca Fineco SpA	Bank of America Merrill Lynch	(99)
(325)	Freni Brembo SpA	Bank of America Merrill Lynch	91
(123)	Gruppo MutuiOnline SpA	Goldman Sachs	(218)
270	Illimity Bank SpA	Goldman Sachs	(159)
1,225	Immobiliare Grande Distribuzione SIIQ SpA (Reit)	Goldman Sachs	(110)
219	Interpump Group SpA	Bank of America Merrill Lynch	(32)
273	Interpump Group SpA	Morgan Stanley	(72)
(26,252)	Intesa Sanpaolo SpA	Morgan Stanley	(2,469)
3,189	Iren SpA	Bank of America Merrill Lynch	771
2,741	Iren SpA	Goldman Sachs	37
494	Italgas SpA	Bank of America Merrill Lynch	(1)
115	Italmobiliare SpA	Goldman Sachs	98
(228)	La Doria SpA	Bank of America Merrill Lynch	77
2,292	Maire Tecnimont SpA	Bank of America Merrill Lynch	432
(161)	MARR SpA	Bank of America Merrill Lynch	(62)
157	Moncler SpA	Bank of America Merrill Lynch	90
2,331	Piaggio & C SpA	Bank of America Merrill Lynch	(56)
1,194	Piaggio & C SpA	Goldman Sachs	20
5,485	Pirelli & C SpA	Bank of America Merrill Lynch	1,402
2,092	Pirelli & C SpA	Goldman Sachs	701
3,130	Pirelli & C SpA	Morgan Stanley	1,299
(14,700)	PRADA SpA	Morgan Stanley	(10,335)
695	Prysmian SpA	Bank of America Merrill Lynch	1,134
103	Prysmian SpA	Goldman Sachs	168
(544)	RAI Way SpA	Bank of America Merrill Lynch	85
(23)	Reply SpA	Bank of America Merrill Lynch	24
165	SAES Getters SpA	Bank of America Merrill Lynch	218
(210)	Salvatore Ferragamo SpA	Bank of America Merrill Lynch	(141)
(1,543)	Salvatore Ferragamo SpA	Morgan Stanley	(389)
(46)	Sesa SpA	Goldman Sachs	(5)
(1,944)	Snam SpA	Goldman Sachs	(371)
514	Societa Cattolica di Assicurazioni SC	Goldman Sachs	38
898	Tamburi Investment Partners SpA	Bank of America Merrill Lynch	136
2,748	Tamburi Investment Partners SpA	Goldman Sachs	446
7,753	Telecom Italia SpA - RSP	Bank of America Merrill Lynch	454
3,711	Telecom Italia SpA - RSP	Goldman Sachs	294
41,887	Telecom Italia SpA - RSP	Morgan Stanley	1,970
(2,075)	Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	Bank of America Merrill Lynch	(20)
(1,822)	Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	Morgan Stanley	(96)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
イタリア(続き)			
(251)	Tinexta Spa	Goldman Sachs	168
(509)	Tod's SpA	Bank of America Merrill Lynch	(1,514)
(540)	Tod's SpA	Goldman Sachs	(1,606)
1,373	Unipol Gruppo SpA	Bank of America Merrill Lynch	646
3,278	Unipol Gruppo SpA	Goldman Sachs	1,541
10,524	Unipol Gruppo SpA	Morgan Stanley	858
769	UnipolSai Assicurazioni SpA	Bank of America Merrill Lynch	46
1,246	UnipolSai Assicurazioni SpA	Goldman Sachs	75
576	UnipolSai Assicurazioni SpA	Morgan Stanley	(33)
(3,706)	Webuild SpA	Goldman Sachs	(258)
			(11,044)
日本			
(1,100)	77 Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,467
(500)	77 Bank Ltd	Morgan Stanley	388
500	ABC-Mart Inc	Goldman Sachs	(3,213)
500	ABC-Mart Inc	Morgan Stanley	(2,638)
200	Achilles Corp	Bank of America Merrill Lynch	(108)
(3,800)	Acom Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(437)
(900)	Adastria Co Ltd	Goldman Sachs	958
2,900	ADEKA Corp	Goldman Sachs	1,669
(300)	Advan Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	400
(900)	Advan Co Ltd	Goldman Sachs	1,200
(2)	Advance Residence Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	48
100	Advantest Corp	Bank of America Merrill Lynch	104
300	Aeon Delight Co Ltd	Goldman Sachs	(153)
100	Aeon Fantasy Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(18)
1,800	AEON Financial Service Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(450)
2,200	AEON Financial Service Co Ltd	Goldman Sachs	(760)
2,700	AEON Financial Service Co Ltd	Morgan Stanley	(1,347)
300	Aeon Mall Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(46)
100	Aeon Mall Co Ltd	Goldman Sachs	(45)
400	AGC Inc	Goldman Sachs	(288)
200	AGC Inc	Morgan Stanley	(182)
(6,000)	Ai Holdings Corp	Goldman Sachs	3,568
(100)	AI inside Inc	Morgan Stanley	1,918
100	Aica Kogyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(110)
100	Aica Kogyo Co Ltd	Goldman Sachs	(110)
100	Aica Kogyo Co Ltd	Morgan Stanley	(273)
(700)	Aichi Corp	Goldman Sachs	(101)
1,400	Aichi Steel Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,122)
1,400	Aichi Steel Corp	Goldman Sachs	(2,122)
(400)	Aida Engineering Ltd	Bank of America Merrill Lynch	50
(800)	Ain Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	6,292
(300)	Ain Holdings Inc	Morgan Stanley	460
(1,800)	Air Water Inc	Bank of America Merrill Lynch	711

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(500)	Air Water Inc	Goldman Sachs	(13)
(800)	Air Water Inc	Morgan Stanley	560
2,900	Aisan Industry Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,196)
4,400	Aisan Industry Co Ltd	Goldman Sachs	(1,815)
400	Aisin Seiki Co Ltd	Morgan Stanley	(307)
(100)	Ajinomoto Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	115
400	Akatsuki Inc	Goldman Sachs	(625)
200	Akita Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(209)
300	Akita Bank Ltd	Goldman Sachs	(314)
1,000	Alfresa Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	106
(300)	Alpen Co Ltd	Goldman Sachs	927
(400)	Alpha Systems Inc	Goldman Sachs	(460)
(200)	Altech Corp	Bank of America Merrill Lynch	(241)
100	Amada Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(16)
2,000	Amada Co Ltd	Goldman Sachs	(326)
300	Amada Co Ltd	Morgan Stanley	(118)
(300)	Amano Corp	Bank of America Merrill Lynch	512
(100)	Amano Corp	Goldman Sachs	171
(700)	Amano Corp	Morgan Stanley	557
(400)	Amuse Inc	Goldman Sachs	(146)
700	ANA Holdings Inc	Goldman Sachs	(188)
700	Anicom Holdings Inc	Goldman Sachs	141
200	Anritsu Corp	Bank of America Merrill Lynch	(16)
2,200	Anritsu Corp	Morgan Stanley	(443)
1,600	AOKI Holdings Inc	Goldman Sachs	(859)
2,100	Aoyama Trading Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,410)
1,800	Aozora Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	777
1,000	Aozora Bank Ltd	Goldman Sachs	432
3,400	Aozora Bank Ltd	Morgan Stanley	326
(500)	Arata Corp	Goldman Sachs	(312)
400	Arcland Sakamoto Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(173)
(500)	Arcland Service Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(257)
(2,100)	Arcs Co Ltd	Goldman Sachs	1,148
100	Ariake Japan Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(547)
100	Ariake Japan Co Ltd	Goldman Sachs	(547)
400	Aruhi Corp	Bank of America Merrill Lynch	(879)
1,200	Aruhi Corp	Goldman Sachs	(2,636)
100	As One Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,199
800	Asahi Diamond Industrial Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(223)
5,800	Asahi Diamond Industrial Co Ltd	Goldman Sachs	(1,480)
1,000	Asahi Group Holdings Ltd	Goldman Sachs	(739)
200	Asahi Holdings Inc	Goldman Sachs	(758)
800	Asahi Intecc Co Ltd	Morgan Stanley	3,184
600	Asahi Kasei Corp	Bank of America Merrill Lynch	(115)
400	Asahi Kasei Corp	Goldman Sachs	(76)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
400	Asahi Kasei Corp	Morgan Stanley	(255)
(1,300)	ASKA Pharmaceutical Co Ltd	Goldman Sachs	(1,147)
(300)	ASKUL Corp	Bank of America Merrill Lynch	(504)
(400)	ASKUL Corp	Morgan Stanley	(767)
(1,800)	Astellas Pharma Inc	Morgan Stanley	2,529
(1,400)	Atom Corp	Bank of America Merrill Lynch	585
300	Autobacs Seven Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(103)
600	Avex Inc	Goldman Sachs	(451)
(200)	Awa Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	340
(800)	Awa Bank Ltd	Goldman Sachs	1,358
(700)	Axial Retailing Inc	Goldman Sachs	67
(1,200)	Azbil Corp	Morgan Stanley	(58)
(1,100)	Bandai Namco Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,061)
(1,100)	Bandai Namco Holdings Inc	Morgan Stanley	(1,593)
5,300	Bando Chemical Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(102)
11,500	Bando Chemical Industries Ltd	Goldman Sachs	(221)
(200)	Bank of Iwate Ltd	Goldman Sachs	393
(1,800)	Bank of Kyoto Ltd	Morgan Stanley	1,554
(100)	Bank of Nagoya Ltd	Goldman Sachs	191
(400)	Bank of Okinawa Ltd	Bank of America Merrill Lynch	928
(3,700)	Bank of Okinawa Ltd	Goldman Sachs	8,589
(400)	BASE Inc	Morgan Stanley	(38)
(100)	BayCurrent Consulting Inc	Bank of America Merrill Lynch	(451)
(300)	BayCurrent Consulting Inc	Morgan Stanley	(4,000)
200	Belc Co Ltd	Goldman Sachs	(422)
3,700	Belluna Co Ltd	Goldman Sachs	2,200
(600)	Benefit One Inc	Bank of America Merrill Lynch	(787)
(200)	Benefit One Inc	Morgan Stanley	(260)
900	Benesse Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,612)
1,500	Benesse Holdings Inc	Goldman Sachs	(2,479)
2,500	Benesse Holdings Inc	Morgan Stanley	(3,182)
(500)	BeNEXT Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	88
(1,100)	BeNEXT Group Inc	Goldman Sachs	(169)
100	Bengo4.com Inc	Goldman Sachs	(959)
(3,100)	Bic Camera Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,487
(200)	Bic Camera Inc	Goldman Sachs	96
(300)	Bic Camera Inc	Morgan Stanley	129
(500)	BML Inc	Bank of America Merrill Lynch	96
(200)	BML Inc	Goldman Sachs	38
1,300	Bridgestone Corp	Bank of America Merrill Lynch	586
300	Bridgestone Corp	Goldman Sachs	135
4,200	Bridgestone Corp	Morgan Stanley	(8,339)
100	Brother Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	188
600	Brother Industries Ltd	Goldman Sachs	1,128
1,000	Brother Industries Ltd	Morgan Stanley	153

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(400)	Bunka Shutter Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	31
(1,500)	Bunka Shutter Co Ltd	Goldman Sachs	137
300	Calbee Inc	Bank of America Merrill Lynch	339
100	Calbee Inc	Goldman Sachs	85
2,800	Canon Electronics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(54)
4,600	Canon Electronics Inc	Goldman Sachs	(88)
1,600	Canon Inc	Goldman Sachs	(903)
(100)	Canon Marketing Japan Inc	Bank of America Merrill Lynch	106
(100)	Capcom Co Ltd	Morgan Stanley	(374)
(700)	Casio Computer Co Ltd	Goldman Sachs	705
(200)	Central Glass Co Ltd	Goldman Sachs	82
(100)	Central Security Patrols Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	24
(300)	Central Security Patrols Co Ltd	Goldman Sachs	72
(200)	Change Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,954
(300)	Change Inc	Morgan Stanley	403
1,000	Chatwork Co Ltd	Goldman Sachs	(3,309)
900	Chiba Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(147)
1,000	Chiba Bank Ltd	Goldman Sachs	(163)
5,100	Chiba Bank Ltd	Morgan Stanley	(1,565)
900	Chiyoda Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(535)
1,600	Chiyoda Co Ltd	Goldman Sachs	(952)
(4,000)	Chiyoda Corp	Bank of America Merrill Lynch	460
400	Chiyoda Integre Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(58)
700	Chiyoda Integre Co Ltd	Goldman Sachs	(101)
(1,100)	Chofu Seisakusho Co Ltd	Goldman Sachs	770
800	Chori Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(714)
600	Chori Co Ltd	Goldman Sachs	(535)
1,300	Chubu Electric Power Co Inc	Morgan Stanley	(917)
(700)	Chubu Shiryo Co Ltd	Goldman Sachs	584
(200)	Chudenko Corp	Bank of America Merrill Lynch	100
(9,000)	Chugoku Bank Ltd	Morgan Stanley	2,158
(1,000)	Chugoku Marine Paints Ltd	Goldman Sachs	(48)
(1,500)	Chukyo Bank Ltd	Goldman Sachs	1,036
3,900	CI Takiron Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,421
2,100	CI Takiron Corp	Goldman Sachs	765
4,200	Citizen Watch Co Ltd	Goldman Sachs	(549)
(1,700)	CKD Corp	Goldman Sachs	(2,250)
500	CMIC Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(153)
1,400	Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc	Goldman Sachs	(1,182)
2,800	Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc	Morgan Stanley	(3,733)
200	cocokara fine Inc	Goldman Sachs	507
700	COLOPL Inc	Goldman Sachs	(77)
(300)	Colowide Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	291
(6)	Comforia Residential REIT Inc	Bank of America Merrill Lynch	380
(1)	Comforia Residential REIT Inc	Goldman Sachs	15

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(300)	COMSYS Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	272
(600)	COMSYS Holdings Corp	Goldman Sachs	299
(1,000)	COMSYS Holdings Corp	Morgan Stanley	863
300	Comture Corp	Bank of America Merrill Lynch	711
500	Comture Corp	Goldman Sachs	1,185
3,000	CONEXIO Corp	Bank of America Merrill Lynch	317
3,200	CONEXIO Corp	Goldman Sachs	338
1,700	COOKPAD Inc	Bank of America Merrill Lynch	27
(700)	Cosmo Energy Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(65)
(800)	Cosmo Energy Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(11)
(600)	Cosmo Energy Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	276
9	CRE Logistics REIT Inc	Bank of America Merrill Lynch	(26)
23	CRE Logistics REIT Inc	Goldman Sachs	(66)
(2,900)	Create Restaurants Holdings Inc	Goldman Sachs	1,280
900	Credit Saison Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	41
1,100	Credit Saison Co Ltd	Goldman Sachs	(559)
7,500	Credit Saison Co Ltd	Morgan Stanley	(360)
200	CyberAgent Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,822
100	CyberAgent Inc	Goldman Sachs	911
600	CyberAgent Inc	Morgan Stanley	3,568
(500)	Cybozu Inc	Bank of America Merrill Lynch	(371)
(800)	Cybozu Inc	Goldman Sachs	(305)
(900)	Cybozu Inc	Morgan Stanley	(294)
1,100	Dai Nippon Printing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(506)
1,500	Dai Nippon Printing Co Ltd	Goldman Sachs	(691)
1,700	Dai Nippon Printing Co Ltd	Morgan Stanley	(1,207)
(1,100)	Daibiru Corp	Bank of America Merrill Lynch	(823)
(5,800)	Daibiru Corp	Goldman Sachs	(4,339)
600	Daicel Corp	Bank of America Merrill Lynch	(150)
700	Daicel Corp	Goldman Sachs	(279)
1,600	Daicel Corp	Morgan Stanley	(706)
500	Dai-Dan Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	115
100	Dai-Dan Co Ltd	Goldman Sachs	23
100	Daifuku Co Ltd	Goldman Sachs	688
100	Daifuku Co Ltd	Morgan Stanley	506
(400)	Daihen Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,305)
(600)	Daihen Corp	Goldman Sachs	(1,957)
200	Daiho Corp	Goldman Sachs	(19)
300	Daiichi Jitsugyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	129
600	Daiichi Jitsugyo Co Ltd	Goldman Sachs	259
2,100	Dai-ichi Life Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	26
7,000	Dai-ichi Life Holdings Inc	Morgan Stanley	(1,601)
(100)	Daikin Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(10)
(300)	Daikin Industries Ltd	Goldman Sachs	(29)
(600)	Daikin Industries Ltd	Morgan Stanley	691

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(100)	Daikokutenbussan Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	143
2,200	Dainichiseika Color & Chemicals Manufacturing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,574
2,800	Dainichiseika Color & Chemicals Manufacturing Co Ltd	Goldman Sachs	3,277
(300)	Daio Paper Corp	Goldman Sachs	(3)
200	Daishi Hokuetsu Financial Group Inc	Goldman Sachs	475
(4,683)	Daisy Corp	Goldman Sachs	6,109
200	Daito Trust Construction Co Ltd	Morgan Stanley	211
(4)	Daiwa House Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(261)
(2)	Daiwa House Investment Corp (REIT)	Morgan Stanley	(153)
2,100	Daiwa Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,390)
3,400	Daiwa Industries Ltd	Goldman Sachs	(2,250)
(4)	Daiwa Office Investment Corp (REIT)	Goldman Sachs	1,496
(1)	Daiwa Office Investment Corp (REIT)	Morgan Stanley	412
(300)	Daiwabo Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(547)
(2,200)	DCM Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	955
(1,500)	Demae-Can Co Ltd	Morgan Stanley	(5,611)
(300)	DeNA Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	54
(300)	DeNA Co Ltd	Goldman Sachs	233
(1,500)	DeNA Co Ltd	Morgan Stanley	303
(400)	Denka Co Ltd	Morgan Stanley	249
(400)	Denso Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,297
(1,200)	Denso Corp	Morgan Stanley	3,062
400	Dentsu Group Inc	Goldman Sachs	518
100	Dentsu Group Inc	Morgan Stanley	(38)
1,300	Descente Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,120)
1,900	Descente Ltd	Goldman Sachs	(3,098)
(200)	Dexerials Corp	Bank of America Merrill Lynch	(161)
(4,300)	Dexerials Corp	Goldman Sachs	(3,465)
1,200	DIC Corp	Bank of America Merrill Lynch	(714)
200	DIC Corp	Goldman Sachs	(119)
1,900	DIC Corp	Morgan Stanley	(146)
300	Dip Corp	Bank of America Merrill Lynch	(193)
400	Dip Corp	Goldman Sachs	(257)
300	Dip Corp	Morgan Stanley	(144)
100	Disco Corp	Bank of America Merrill Lynch	857
100	DKS Co Ltd	Goldman Sachs	82
3,100	DMG Mori Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,282)
(600)	Doutor Nichires Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	506
(1,200)	Doutor Nichires Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	1,025
(1,300)	Dowa Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	748
200	DTS Corp	Bank of America Merrill Lynch	24
(100)	DyDo Group Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	133
(400)	Eagle Industry Co Ltd	Goldman Sachs	(12)
(1,600)	Earth Corp	Goldman Sachs	3,376

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(200)	East Japan Railway Co	Bank of America Merrill Lynch	40
(300)	East Japan Railway Co	Goldman Sachs	(656)
(400)	East Japan Railway Co	Morgan Stanley	1,021
6,900	EDION Corp	Goldman Sachs	(1,986)
800	eGuarantee Inc	Bank of America Merrill Lynch	(737)
1,300	eGuarantee Inc	Goldman Sachs	(1,197)
(2,100)	Ehime Bank Ltd	Goldman Sachs	1,390
400	Eisai Co Ltd	Morgan Stanley	372
100	Eizo Corp	Goldman Sachs	172
(100)	Elan Corp	Bank of America Merrill Lynch	(87)
(100)	Elan Corp	Goldman Sachs	(124)
1,200	Electric Power Development Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,255)
4,500	Electric Power Development Co Ltd	Goldman Sachs	(4,705)
1,800	Electric Power Development Co Ltd	Morgan Stanley	(967)
(10,400)	ENEOS Holdings Inc	Goldman Sachs	1,469
1,800	Enigma Inc	Goldman Sachs	604
100	en-japan Inc	Goldman Sachs	43
(100)	Enplas Corp	Bank of America Merrill Lynch	77
1,000	EPS Holdings Inc	Goldman Sachs	(278)
300	eRex Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,499
1,600	eRex Co Ltd	Goldman Sachs	7,996
900	ESPEC Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,209
200	ESPEC Corp	Goldman Sachs	269
(2,500)	Exedy Corp	Goldman Sachs	2,158
(300)	Fanci Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,024)
(2,300)	Fanci Corp	Goldman Sachs	(8,076)
(800)	Fanci Corp	Morgan Stanley	(1,995)
200	FANUC Corp	Morgan Stanley	(144)
100	Fast Retailing Co Ltd	Goldman Sachs	3,715
300	Fast Retailing Co Ltd	Morgan Stanley	8,460
(700)	FCC Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	994
(2,400)	FCC Co Ltd	Goldman Sachs	3,387
5,100	Financial Products Group Co Ltd	Goldman Sachs	(98)
(300)	Foster Electric Co Ltd	Goldman Sachs	144
(400)	Freee KK	Bank of America Merrill Lynch	(3,244)
5	Frontier Real Estate Investment Corp (REIT)	Goldman Sachs	(96)
(100)	Fuji Co Ltd	Goldman Sachs	49
(600)	Fuji Corp/Aichi	Goldman Sachs	(777)
(400)	Fuji Electric Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(844)
(1,000)	Fuji Electric Co Ltd	Goldman Sachs	(2,110)
(1,000)	Fuji Electric Co Ltd	Morgan Stanley	(1,631)
(300)	Fuji Kyuko Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	441
3,400	Fuji Media Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	587
2,500	Fuji Media Holdings Inc	Goldman Sachs	432
1,800	Fuji Media Holdings Inc	Morgan Stanley	(190)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(3,300)	Fuji Oil Holdings Inc	Morgan Stanley	6,077
(100)	Fuji Seal International Inc	Bank of America Merrill Lynch	105
100	Fuji Soft Inc	Goldman Sachs	(460)
(100)	Fujibo Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	10
(700)	Fujibo Holdings Inc	Goldman Sachs	67
1,700	Fujicco Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,134)
900	Fujicco Co Ltd	Goldman Sachs	(570)
600	FUJIFILM Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(265)
200	FUJIFILM Holdings Corp	Morgan Stanley	(244)
(1,000)	Fujimi Inc	Goldman Sachs	(1,631)
(900)	Fujitec Co Ltd	Goldman Sachs	276
(100)	Fujitsu General Ltd	Bank of America Merrill Lynch	48
(400)	Fujitsu General Ltd	Goldman Sachs	192
(700)	Fujitsu General Ltd	Morgan Stanley	(604)
(600)	Fujitsu Ltd	Morgan Stanley	(5,813)
(1,900)	Fujiya Co Ltd	Goldman Sachs	1,826
100	Fukuda Corp	Bank of America Merrill Lynch	58
6	Fukuoka Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	305
3	Fukuoka Corp (Reit)	Goldman Sachs	153
(1,200)	Fukuoka Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,013
(3,900)	Fukuoka Financial Group Inc	Morgan Stanley	4,339
(100)	Fukushima Galilei Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	43
(400)	Fukuyama Transporting Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	908
(300)	Fukuyama Transporting Co Ltd	Goldman Sachs	770
(100)	Fukuyama Transporting Co Ltd	Morgan Stanley	326
1,200	Furukawa Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	46
2,100	Furukawa Co Ltd	Goldman Sachs	81
100	Furukawa Electric Co Ltd	Morgan Stanley	176
600	Fuso Chemical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,198
200	Fuso Chemical Co Ltd	Goldman Sachs	393
1,500	Futaba Corp	Bank of America Merrill Lynch	(104)
400	Futaba Corp	Goldman Sachs	1
200	Future Corp	Bank of America Merrill Lynch	140
300	Future Corp	Goldman Sachs	210
200	Fuyo General Lease Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	77
200	Fuyo General Lease Co Ltd	Goldman Sachs	5
1,200	Fuyo General Lease Co Ltd	Morgan Stanley	(806)
300	G-7 Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	587
300	G-7 Holdings Inc	Goldman Sachs	343
300	Gakken Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	224
200	Gecoss Corp	Bank of America Merrill Lynch	(73)
900	Gecoss Corp	Goldman Sachs	(328)
300	Genky DrugStores Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(518)
400	Genky DrugStores Co Ltd	Goldman Sachs	(691)
(300)	Geo Holdings Corp	Goldman Sachs	363

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
100	giftee Inc	Bank of America Merrill Lynch	(216)
400	giftee Inc	Goldman Sachs	(863)
(4)	Global One Real Estate Investment Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	27
(16)	Global One Real Estate Investment Corp (Reit)	Goldman Sachs	107
700	Glory Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(936)
200	Glory Ltd	Goldman Sachs	(276)
400	Glory Ltd	Morgan Stanley	(326)
(1)	GLP J-Reit (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(12)
(7)	GLP J-Reit (REIT)	Morgan Stanley	208
200	GMO Payment Gateway Inc	Goldman Sachs	3,530
900	Goldcrest Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	147
4,400	Goldcrest Co Ltd	Goldman Sachs	717
200	Grace Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,530
1,000	Gree Inc	Goldman Sachs	134
(400)	GS Yuasa Corp	Bank of America Merrill Lynch	(210)
(700)	GS Yuasa Corp	Morgan Stanley	(181)
900	G-Tekt Corp	Bank of America Merrill Lynch	35
1,500	G-Tekt Corp	Goldman Sachs	58
(700)	GungHo Online Entertainment Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,336)
(1,300)	GungHo Online Entertainment Inc	Morgan Stanley	(885)
1,700	Gunma Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(472)
13,000	Gunma Bank Ltd	Goldman Sachs	(3,578)
1,300	Gunma Bank Ltd	Morgan Stanley	(272)
(200)	Gunze Ltd	Goldman Sachs	317
1,500	Gurunavi Inc	Goldman Sachs	(199)
200	H.U. Group Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(36)
600	H.U. Group Holdings Inc	Goldman Sachs	(109)
700	H.U. Group Holdings Inc	Morgan Stanley	(557)
500	H2O Retailing Corp	Bank of America Merrill Lynch	(51)
500	H2O Retailing Corp	Goldman Sachs	(185)
(100)	Hakuhodo DY Holdings Inc	Goldman Sachs	(62)
600	Halows Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(489)
400	Halows Co Ltd	Goldman Sachs	(326)
(100)	Hamamatsu Photonics KK	Goldman Sachs	(211)
300	Hankyu Hanshin Holdings Inc	Goldman Sachs	(734)
100	Hankyu Hanshin Holdings Inc	Morgan Stanley	(341)
(4)	Hankyu Hanshin REIT Inc	Bank of America Merrill Lynch	115
(5)	Hankyu Hanshin REIT Inc	Goldman Sachs	144
(500)	Hanwa Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(470)
(600)	Hanwa Co Ltd	Goldman Sachs	(230)
300	Haseko Corp	Morgan Stanley	(144)
(4,400)	Hazama Ando Corp	Goldman Sachs	1,762
(300)	Heiwa Corp	Goldman Sachs	310
(100)	Heiwa Real Estate Co Ltd	Goldman Sachs	(201)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(6)	Heiwa Real Estate Inc (Reit)	Goldman Sachs	75
(200)	Heiwado Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	23
100	Heroz Inc	Bank of America Merrill Lynch	(39)
300	Heroz Inc	Goldman Sachs	(233)
400	Hiday Hidaka Corp	Bank of America Merrill Lynch	(292)
1,200	Hiday Hidaka Corp	Goldman Sachs	(875)
(400)	Hikari Tsushin Inc	Goldman Sachs	2,878
(100)	Hikari Tsushin Inc	Morgan Stanley	(767)
(3,000)	Hino Motors Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,151
(200)	Hino Motors Ltd	Goldman Sachs	77
(200)	Hioki EE Corp	Bank of America Merrill Lynch	(38)
(1,300)	Hirata Corp	Bank of America Merrill Lynch	(17,956)
(100)	Hirata Corp	Goldman Sachs	(1,381)
(1,000)	Hirogin Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	192
(2,300)	Hirogin Holdings Inc	Goldman Sachs	441
100	Hirose Electric Co Ltd	Morgan Stanley	67
(1,400)	HIS Co Ltd	Goldman Sachs	30
1,800	Hisaka Works Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(932)
800	Hisaka Works Ltd	Goldman Sachs	(414)
(300)	Hisamitsu Pharmaceutical Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(639)
200	Hitachi Capital Corp	Goldman Sachs	5
400	Hitachi Capital Corp	Morgan Stanley	(134)
1,100	Hitachi Construction Machinery Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	535
500	Hitachi Construction Machinery Co Ltd	Goldman Sachs	314
500	Hitachi Construction Machinery Co Ltd	Morgan Stanley	(321)
(200)	Hitachi Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(180)
(600)	Hitachi Ltd	Goldman Sachs	(457)
(900)	Hitachi Ltd	Morgan Stanley	129
(1,100)	Hitachi Metals Ltd	Morgan Stanley	(179)
100	Hitachi Transport System Ltd	Goldman Sachs	(288)
(800)	Hitachi Zosen Corp	Goldman Sachs	183
(100)	Hodogaya Chemical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(197)
(500)	Hodogaya Chemical Co Ltd	Goldman Sachs	(983)
400	Hogy Medical Co Ltd	Goldman Sachs	(153)
(5,600)	Hokkaido Electric Power Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,366
(17,500)	Hokkaido Electric Power Co Inc	Goldman Sachs	4,217
12,900	Hokuetsu Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,722)
16,800	Hokuetsu Corp	Goldman Sachs	(3,545)
1,000	Hokuhoku Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(115)
300	Hokuhoku Financial Group Inc	Goldman Sachs	(103)
(5,300)	Hokuto Corp	Goldman Sachs	3,457
400	Horiba Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,305)
200	Horiba Ltd	Goldman Sachs	(652)
300	Horiba Ltd	Morgan Stanley	29
100	Hoshizaki Corp	Bank of America Merrill Lynch	(221)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
200	Hoshizaki Corp	Morgan Stanley	(326)
(1,700)	Hosiden Corp	Goldman Sachs	65
(600)	Hosokawa Micron Corp	Goldman Sachs	(2,475)
(400)	House Foods Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	843
(100)	House Foods Group Inc	Goldman Sachs	201
100	Hoya Corp	Goldman Sachs	592
1,200	Hulic Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	147
1,700	Hulic Co Ltd	Morgan Stanley	(398)
(6)	Hulic Reit Inc (Reit)	Goldman Sachs	(63)
100	Hyakujushi Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(81)
900	Hyakujushi Bank Ltd	Goldman Sachs	(725)
(700)	Ibiden Co Ltd	Morgan Stanley	(1,846)
(1,800)	Ichibanya Co Ltd	Goldman Sachs	5,007
(600)	Ichikoh Industries Ltd	Goldman Sachs	(58)
(300)	Idec Corp	Bank of America Merrill Lynch	55
(1,400)	Idec Corp	Goldman Sachs	255
200	Idemitsu Kosan Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(55)
100	Idemitsu Kosan Co Ltd	Goldman Sachs	(30)
500	Idemitsu Kosan Co Ltd	Morgan Stanley	(230)
(1,100)	IDOM Inc	Bank of America Merrill Lynch	496
(1,800)	IDOM Inc	Goldman Sachs	811
(2,500)	Iida Group Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	303
(3,200)	Iida Group Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	541
(1,200)	Iida Group Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	1,262
900	Iino Kaiun Kaisha Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(20)
3,700	Iino Kaiun Kaisha Ltd	Goldman Sachs	(184)
(100)	Inaba Denki Sangyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	174
900	Inabata & Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(129)
4,100	Inabata & Co Ltd	Goldman Sachs	(590)
5	Industrial & Infrastructure Fund Investment Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(62)
1	Industrial & Infrastructure Fund Investment Corp (Reit)	Goldman Sachs	(12)
500	Ines Corp	Bank of America Merrill Lynch	(297)
(100)	Infocom Corp	Goldman Sachs	(39)
(500)	Information Services International-Dentsu Ltd	Goldman Sachs	(3,848)
7,700	Inpex Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,659
6,400	Inpex Corp	Morgan Stanley	(307)
100	Insource Co Ltd	Goldman Sachs	499
(200)	Internet Initiative Japan Inc	Goldman Sachs	16
(1,000)	I-PEX Inc	Bank of America Merrill Lynch	(125)
(300)	IR Japan Holdings Ltd	Goldman Sachs	(9,928)
(200)	Iriso Electronics Co Ltd	Goldman Sachs	1,103
(1,800)	Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd	Goldman Sachs	656
5,400	Ishihara Sangyo Kaisha Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,761)
2,700	Ishihara Sangyo Kaisha Ltd	Goldman Sachs	(881)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
1,300	Isuzu Motors Ltd	Bank of America Merrill Lynch	411
300	Ito En Ltd	Goldman Sachs	518
1,100	Ito En Ltd	Morgan Stanley	(2,216)
3	Itochu Advance Logistics Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(302)
33	Itochu Advance Logistics Investment Corp (REIT)	Goldman Sachs	(3,324)
(200)	ITOCHU Corp	Bank of America Merrill Lynch	193
(1,100)	ITOCHU Corp	Morgan Stanley	733
2,700	Itochu Enex Co Ltd	Goldman Sachs	492
(400)	Itoham Yonekyu Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	157
(3,000)	Itoham Yonekyu Holdings Inc	Morgan Stanley	1,611
400	Itokuro Inc	Goldman Sachs	66
(13,800)	Iyo Bank Ltd	Morgan Stanley	3,839
(400)	Izumi Co Ltd	Morgan Stanley	269
2,200	J Front Retailing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(865)
1,100	J Front Retailing Co Ltd	Goldman Sachs	(414)
1,300	JAC Recruitment Co Ltd	Goldman Sachs	3,105
1,100	Jaccs Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(274)
2,900	Jaccs Co Ltd	Goldman Sachs	(723)
(300)	JAFCO Group Co Ltd	Goldman Sachs	633
200	Japan Airlines Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	75
(300)	Japan Airport Terminal Co Ltd	Goldman Sachs	(806)
(200)	Japan Airport Terminal Co Ltd	Morgan Stanley	115
500	Japan Aviation Electronics Industry Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(248)
200	Japan Aviation Electronics Industry Ltd	Morgan Stanley	(44)
400	Japan Elevator Service Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,400
1,000	Japan Elevator Service Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	3,501
8	Japan Excellent Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	200
8	Japan Excellent Inc (REIT)	Goldman Sachs	200
75	Japan Hotel Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(212)
300	Japan Lifeline Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	56
600	Japan Lifeline Co Ltd	Goldman Sachs	251
(9)	Japan Logistics Fund Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	205
(4)	Japan Logistics Fund Inc (Reit)	Goldman Sachs	(62)
(13)	Japan Logistics Fund Inc (Reit)	Morgan Stanley	62
900	Japan Material Co Ltd	Goldman Sachs	37
(300)	Japan Petroleum Exploration Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	260
(300)	Japan Petroleum Exploration Co Ltd	Goldman Sachs	232
3,700	Japan Post Bank Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3,762)
9,000	Japan Post Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4,380)
2,200	Japan Post Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(1,215)
12,100	Japan Post Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(5,397)
100	Japan Post Insurance Co Ltd	Goldman Sachs	(58)
1,100	Japan Post Insurance Co Ltd	Morgan Stanley	(844)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
9	Japan Prime Realty Investment Corp (REIT)	Morgan Stanley	475
(400)	Japan Pulp & Paper Co Ltd	Goldman Sachs	1,592
(1)	Japan Real Estate Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(58)
7	Japan Retail Fund Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	209
2	Japan Retail Fund Investment Corp (REIT)	Goldman Sachs	38
(1,000)	Japan Steel Works Ltd	Goldman Sachs	(258)
1,000	Japan Tobacco Inc	Bank of America Merrill Lynch	(358)
3,900	Japan Tobacco Inc	Morgan Stanley	(1,646)
(1,100)	Japan Wool Textile Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	53
(5,500)	Japan Wool Textile Co Ltd	Goldman Sachs	264
(400)	JCR Pharmaceuticals Co Ltd	Morgan Stanley	238
100	JDC Corp	Bank of America Merrill Lynch	(25)
700	JDC Corp	Goldman Sachs	(175)
(500)	JFE Holdings Inc	Goldman Sachs	(19)
(2,800)	JFE Holdings Inc	Morgan Stanley	164
(300)	JGC Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	17
(2,100)	JGC Holdings Corp	Morgan Stanley	786
100	JINS Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(155)
400	JM Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	476
300	JM Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	357
(100)	JMDC Inc	Goldman Sachs	(161)
500	J-Oil Mills Inc	Goldman Sachs	(839)
1,000	Joshin Denki Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,122
300	Joshin Denki Co Ltd	Goldman Sachs	337
(2,700)	Joyful Honda Co Ltd	Goldman Sachs	2,253
1,600	JSP Corp	Bank of America Merrill Lynch	(338)
2,700	JSP Corp	Goldman Sachs	(570)
(500)	JSR Corp	Goldman Sachs	(1,055)
(400)	JSR Corp	Morgan Stanley	(203)
1,000	JTEKT Corp	Morgan Stanley	(489)
400	Juroku Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(292)
700	Juroku Bank Ltd	Goldman Sachs	(510)
(200)	Justsystems Corp	Bank of America Merrill Lynch	518
(200)	Justsystems Corp	Goldman Sachs	518
(700)	Justsystems Corp	Morgan Stanley	940
(2,500)	JVCKenwood Corp	Bank of America Merrill Lynch	408
500	K&O Energy Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5)
(500)	Kadokawa Corp	Bank of America Merrill Lynch	(336)
(400)	Kadokawa Corp	Goldman Sachs	(269)
(1,200)	Kadokawa Corp	Morgan Stanley	(691)
700	Kaga Electronics Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	725
1,300	Kaga Electronics Co Ltd	Goldman Sachs	1,347
(700)	Kagome Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,175

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(1,500)	Kagome Co Ltd	Goldman Sachs	2,989
(800)	Kagome Co Ltd	Morgan Stanley	2,187
(3,600)	Kajima Corp	Bank of America Merrill Lynch	(846)
(3,400)	Kajima Corp	Morgan Stanley	522
200	Kakaku.com Inc	Bank of America Merrill Lynch	32
400	Kakaku.com Inc	Goldman Sachs	(848)
100	Kakaku.com Inc	Morgan Stanley	(4)
(500)	Kaken Pharmaceutical Co Ltd	Morgan Stanley	216
300	Kamakura Shinsho Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(54)
900	Kamei Corp	Bank of America Merrill Lynch	(129)
900	Kamei Corp	Goldman Sachs	(129)
1,600	Kamigumi Co Ltd	Morgan Stanley	(1,949)
(900)	Kanamoto Co Ltd	Goldman Sachs	1,045
(200)	Kandenken Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2
(200)	Kandenken Co Ltd	Morgan Stanley	29
(1,000)	Kanematsu Corp	Bank of America Merrill Lynch	472
(800)	Kanematsu Corp	Goldman Sachs	492
(400)	Kanematsu Electronics Ltd	Bank of America Merrill Lynch	742
(1,200)	Kansai Electric Power Co Inc	Goldman Sachs	475
(1,000)	Kansai Mirai Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	163
(4,200)	Kansai Mirai Financial Group Inc	Goldman Sachs	685
(8,700)	Kansai Mirai Financial Group Inc	Morgan Stanley	2,253
600	Kansai Paint Co Ltd	Morgan Stanley	576
(4,100)	Kansai Super Market Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,298
1,600	Kanto Denka Kogyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(292)
800	Kao Corp	Goldman Sachs	(721)
2,700	Kao Corp	Morgan Stanley	(5,723)
(2,800)	Kappa Create Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,149
(100)	Kappa Create Co Ltd	Goldman Sachs	77
(300)	Katakura Industries Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(190)
(2,700)	Katakura Industries Co Ltd	Goldman Sachs	(1,709)
200	Katitas Co Ltd	Goldman Sachs	(59)
100	Kato Sangyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(34)
400	Kawasaki Heavy Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(234)
900	Kawasaki Heavy Industries Ltd	Goldman Sachs	(527)
400	Kawasaki Heavy Industries Ltd	Morgan Stanley	(326)
500	Kawasaki Kisen Kaisha Ltd	Goldman Sachs	640
1,000	KDDI Corp	Morgan Stanley	(206)
(300)	Keihan Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(950)
(400)	Keihan Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(1,266)
(300)	Keihanshin Building Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	610
(200)	Keihanshin Building Co Ltd	Goldman Sachs	407
(400)	Keikyu Corp	Bank of America Merrill Lynch	(119)
(1,100)	Keikyu Corp	Morgan Stanley	886
(100)	Keio Corp	Bank of America Merrill Lynch	153

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(300)	Keio Corp	Goldman Sachs	576
(300)	Keio Corp	Morgan Stanley	1,784
400	Keisei Electric Railway Co Ltd	Goldman Sachs	(900)
(7,200)	Keiyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,588
(6,800)	Kenedix Inc	Goldman Sachs	(12,719)
(4)	Kenedix Residential Next Investment Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(180)
(3)	Kenedix Retail REIT Corp	Goldman Sachs	(440)
(300)	Kewpie Corp	Bank of America Merrill Lynch	230
(900)	Kewpie Corp	Goldman Sachs	691
(800)	Kewpie Corp	Morgan Stanley	1,302
(1,000)	Key Coffee Inc	Goldman Sachs	1,065
100	Keyence Corp	Goldman Sachs	221
300	Keyence Corp	Morgan Stanley	3,079
(900)	KH Neochem Co Ltd	Goldman Sachs	(302)
(500)	Kikkoman Corp	Bank of America Merrill Lynch	687
(400)	Kinden Corp	Bank of America Merrill Lynch	146
(400)	Kinden Corp	Goldman Sachs	146
(700)	Kinden Corp	Morgan Stanley	450
(3,200)	Kintetsu Department Store Co Ltd	Goldman Sachs	4,604
(300)	Kintetsu Group Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	216
(400)	Kintetsu Group Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	1,189
(600)	Kintetsu World Express Inc	Goldman Sachs	328
200	Kisoji Co Ltd	Goldman Sachs	(338)
400	Kissei Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(50)
500	Kissei Pharmaceutical Co Ltd	Goldman Sachs	(62)
400	Kissei Pharmaceutical Co Ltd	Morgan Stanley	(31)
7,000	Kitanotatsujin Corp	Goldman Sachs	(940)
(400)	Kiyo Bank Ltd	Goldman Sachs	357
(4,100)	KNT-CT Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(747)
(200)	Koa Corp	Bank of America Merrill Lynch	(67)
(1,300)	Koa Corp	Goldman Sachs	(436)
500	Koatsu Gas Kogyo Co Ltd	Goldman Sachs	(297)
300	Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd	Morgan Stanley	1,813
(5,700)	Kobe Steel Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(383)
(300)	Kobe Steel Ltd	Morgan Stanley	(14)
(2,000)	Koei Tecmo Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(4,029)
400	Kohnan Shoji Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(825)
(300)	Koito Manufacturing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,341
200	Kokuyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(96)
100	Kokuyo Co Ltd	Goldman Sachs	(84)
1,100	Kokuyo Co Ltd	Morgan Stanley	(802)
100	Komatsu Ltd	Bank of America Merrill Lynch	7
100	Komatsu Ltd	Goldman Sachs	(11)
300	Komatsu Ltd	Morgan Stanley	(82)
(1,400)	KOMEDA Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(70)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(400)	Komeri Co Ltd	Goldman Sachs	311
(700)	Konami Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,708)
(1,200)	Konami Holdings Corp	Goldman Sachs	(2,650)
(400)	Konami Holdings Corp	Morgan Stanley	(806)
10,300	Konica Minolta Inc	Goldman Sachs	2,569
20,200	Konica Minolta Inc	Morgan Stanley	3,294
2,400	Konoike Transport Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,335)
2,900	Konoike Transport Co Ltd	Goldman Sachs	(1,613)
200	Kose Corp	Bank of America Merrill Lynch	950
100	Kose Corp	Goldman Sachs	153
300	Kose Corp	Morgan Stanley	432
5,700	Koshidaka Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(656)
1,700	Koshidaka Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(196)
(200)	Kourakuen Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	59
100	Krosaki Harima Corp	Bank of America Merrill Lynch	643
1,200	Krosaki Harima Corp	Goldman Sachs	7,896
(500)	K's Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	331
(1,800)	K's Holdings Corp	Morgan Stanley	915
400	Kumagai Gumi Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(434)
1,700	Kumagai Gumi Co Ltd	Goldman Sachs	(1,843)
(6,400)	Kumiai Chemical Industry Co Ltd	Goldman Sachs	2,640
100	Kura Sushi Inc	Bank of America Merrill Lynch	(422)
1,000	Kura Sushi Inc	Goldman Sachs	(3,366)
3,700	Kuraray Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,449)
2,400	Kuraray Co Ltd	Goldman Sachs	(1,588)
1,400	Kuraray Co Ltd	Morgan Stanley	(913)
(900)	Kureha Corp	Goldman Sachs	(2,500)
(300)	Kurita Water Industries Ltd	Goldman Sachs	(849)
(1,400)	KYB Corp	Goldman Sachs	134
(200)	Kyocera Corp	Morgan Stanley	270
900	Kyokuto Kaihatsu Kogyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(294)
700	Kyokuto Kaihatsu Kogyo Co Ltd	Goldman Sachs	(228)
(1,100)	KYORIN Holdings Inc	Goldman Sachs	84
100	Kyoritsu Maintenance Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(15)
700	Kyoritsu Maintenance Co Ltd	Morgan Stanley	(436)
(100)	Kyowa Exeo Corp	Bank of America Merrill Lynch	46
(400)	Kyowa Kirin Co Ltd	Morgan Stanley	(58)
(300)	Kyudenko Corp	Bank of America Merrill Lynch	219
(500)	Kyudenko Corp	Goldman Sachs	599
(300)	Kyudenko Corp	Morgan Stanley	317
(400)	Kyushu Electric Power Co Inc	Goldman Sachs	259
(10,700)	Kyushu Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,182
(200)	Kyushu Financial Group Inc	Goldman Sachs	59
(100)	Kyushu Railway Co	Bank of America Merrill Lynch	128
400	LAC Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(19)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
1	LaSalle Logiport REIT (Reit)	Morgan Stanley	(12)
(600)	Lasertec Corp	Bank of America Merrill Lynch	(5,122)
100	Lawson Inc	Bank of America Merrill Lynch	(364)
1,700	Lawson Inc	Morgan Stanley	(3,506)
(11,900)	Leopalace21 Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,484
(600)	Life Corp	Goldman Sachs	(1,065)
700	LIFULL Co Ltd	Goldman Sachs	(38)
(400)	LINE Corp	Morgan Stanley	-
4,100	Link And Motivation Inc	Goldman Sachs	747
1,000	Lintec Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,144)
1,000	Lintec Corp	Goldman Sachs	(1,266)
600	Lintec Corp	Morgan Stanley	(380)
(2,100)	Lion Corp	Bank of America Merrill Lynch	(325)
(1,000)	Lion Corp	Goldman Sachs	(173)
(300)	Lion Corp	Morgan Stanley	325
200	Litalico Inc	Goldman Sachs	(10)
(1,200)	LIXIL Group Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,151)
(1,100)	LIXIL Group Corp	Goldman Sachs	(1,055)
(900)	LIXIL Group Corp	Morgan Stanley	52
300	M&A Capital Partners Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	950
300	M&A Capital Partners Co Ltd	Goldman Sachs	950
(700)	Macnica Fuji Electronics Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(309)
(5,300)	Macnica Fuji Electronics Holdings Inc	Goldman Sachs	(2,339)
(1,200)	Macromill Inc	Bank of America Merrill Lynch	91
300	Maeda Corp	Bank of America Merrill Lynch	(120)
500	Maeda Corp	Goldman Sachs	(133)
300	Maeda Corp	Morgan Stanley	(124)
400	Maeda Kosen Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,012)
900	Maeda Kosen Co Ltd	Goldman Sachs	(2,645)
(600)	Maeda Road Construction Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	866
(100)	Makino Milling Machine Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	38
(200)	Makino Milling Machine Co Ltd	Goldman Sachs	77
(400)	Makita Corp	Goldman Sachs	85
200	Mani Inc	Bank of America Merrill Lynch	(235)
200	Mani Inc	Goldman Sachs	(430)
900	Mani Inc	Morgan Stanley	78
600	Mars Group Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(386)
(5,000)	Marubeni Corp	Bank of America Merrill Lynch	189
(5,300)	Marubeni Corp	Goldman Sachs	97
(700)	Marubeni Corp	Morgan Stanley	179
500	Marudai Food Co Ltd	Goldman Sachs	(347)
1,400	Marui Group Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,229)
600	Marui Group Co Ltd	Morgan Stanley	(483)
2,900	Marusan Securities Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(223)
800	Marusan Securities Co Ltd	Goldman Sachs	(61)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(300)	Maruwa Co Ltd	Goldman Sachs	(1,611)
400	Maruwa Unyu Kikan Co Ltd	Goldman Sachs	940
1,400	Marvelous Inc	Goldman Sachs	430
1,100	Matsuda Sangyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	633
2,000	Matsuda Sangyo Co Ltd	Goldman Sachs	1,151
(400)	Matsui Securities Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	153
(900)	Matsui Securities Co Ltd	Goldman Sachs	345
(500)	Matsui Securities Co Ltd	Morgan Stanley	148
(100)	Matsumotokiyoshi Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	78
(1,300)	Matsuya Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	611
(1,600)	Matsuya Co Ltd	Goldman Sachs	752
(200)	Matsuyafoods Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	157
500	Max Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(275)
800	Max Co Ltd	Goldman Sachs	(760)
(1,400)	Maxell Holdings Ltd	Goldman Sachs	(603)
(300)	McDonald's Holdings Co Japan Ltd	Bank of America Merrill Lynch	668
(4,100)	MCJ Co Ltd	Goldman Sachs	(2,871)
6	MCUBS MidCity Investment Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(61)
9	MCUBS MidCity Investment Corp (Reit)	Goldman Sachs	(86)
7,300	Mebuki Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,400)
11,400	Mebuki Financial Group Inc	Morgan Stanley	(1,422)
300	Media Do Co Ltd	Goldman Sachs	1,698
(100)	Medipal Holdings Corp	Goldman Sachs	(3)
(1,100)	Medipal Holdings Corp	Morgan Stanley	644
(600)	Medley Inc	Morgan Stanley	921
100	Megachips Corp	Bank of America Merrill Lynch	99
(300)	Meidensha Corp	Bank of America Merrill Lynch	(348)
(800)	Meidensha Corp	Goldman Sachs	(929)
(300)	MEIJI Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	564
(200)	MEIJI Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	668
(800)	MEIJI Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	2,225
(200)	Meiko Electronics Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	77
(2,200)	Meiko Network Japan Co Ltd	Goldman Sachs	1,000
(1,500)	Meisei Industrial Co Ltd	Goldman Sachs	1,022
200	Meitec Corp	Bank of America Merrill Lynch	(307)
300	Meitec Corp	Goldman Sachs	(514)
(400)	Melco Holdings Inc	Goldman Sachs	(576)
(600)	Mercari Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,004)
(400)	Mercari Inc	Morgan Stanley	(767)
(400)	METAWATER Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	219
(700)	METAWATER Co Ltd	Goldman Sachs	383
(400)	Micronics Japan Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	46
(15,900)	Mie Kotsu Group Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	7,473
(2,300)	Mie Kotsu Group Holdings Inc	Goldman Sachs	1,081
(400)	Milbon Co Ltd	Goldman Sachs	(576)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(100)	Mimasu Semiconductor Industry Co Ltd	Goldman Sachs	(205)
100	MINEBEA MITSUMI Inc	Goldman Sachs	172
1,100	MINEBEA MITSUMI Inc	Morgan Stanley	496
(4,200)	Ministop Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3,102
(15)	Mirai Corp (Reit)	Goldman Sachs	(58)
(400)	Mirait Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	345
2,500	Miroku Jyoho Service Co Ltd	Goldman Sachs	(2,997)
(700)	MISUMI Group Inc	Morgan Stanley	302
(100)	Mitsubishi Corp	Bank of America Merrill Lynch	110
(600)	Mitsubishi Corp	Morgan Stanley	558
(3,100)	Mitsubishi Electric Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,849)
(3,500)	Mitsubishi Electric Corp	Goldman Sachs	(2,790)
(4,000)	Mitsubishi Electric Corp	Morgan Stanley	(499)
(2,300)	Mitsubishi Estate Co Ltd	Goldman Sachs	(930)
(4,200)	Mitsubishi Estate Co Ltd	Morgan Stanley	1,853
3	Mitsubishi Estate Logistics Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(86)
(600)	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,790)
(2,600)	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	Goldman Sachs	(7,756)
(2,800)	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	Morgan Stanley	(5,506)
(700)	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,511
(1,000)	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Goldman Sachs	1,980
(1,900)	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Morgan Stanley	4,820
(1,100)	Mitsubishi Logisnext Co Ltd	Goldman Sachs	(1,277)
(400)	Mitsubishi Logistics Corp	Bank of America Merrill Lynch	537
(3,000)	Mitsubishi Logistics Corp	Morgan Stanley	2,446
2,000	Mitsubishi Materials Corp	Bank of America Merrill Lynch	(921)
900	Mitsubishi Materials Corp	Goldman Sachs	(414)
2,700	Mitsubishi Materials Corp	Morgan Stanley	(466)
1,900	Mitsubishi Motors Corp	Bank of America Merrill Lynch	(135)
5,300	Mitsubishi Motors Corp	Goldman Sachs	(712)
3,100	Mitsubishi Motors Corp	Morgan Stanley	(238)
1,300	Mitsubishi Pencil Co Ltd	Goldman Sachs	(1,122)
(100)	Mitsubishi Research Institute Inc	Goldman Sachs	105
(100)	Mitsubishi Shokuhin Co Ltd	Morgan Stanley	42
16,900	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	Goldman Sachs	(4,536)
27,200	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	Morgan Stanley	(5,975)
9,900	Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	190
31,800	Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co Ltd	Goldman Sachs	610
20,000	Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co Ltd	Morgan Stanley	(1,918)
400	Mitsuboshi Belting Ltd	Goldman Sachs	(376)
(2,500)	Mitsui & Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,247
(3,800)	Mitsui & Co Ltd	Morgan Stanley	3,736
(1,700)	Mitsui Chemicals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(16)
(800)	Mitsui Chemicals Inc	Goldman Sachs	(55)
(700)	Mitsui Chemicals Inc	Morgan Stanley	517

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(2,000)	Mitsui E&S Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	882
200	Mitsui Fudosan Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	100
1,200	Mitsui Fudosan Co Ltd	Goldman Sachs	599
4	Mitsui Fudosan Logistics Park Inc (REIT)	Morgan Stanley	(192)
(1,100)	Mitsui High-Tec Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,381)
(500)	Mitsui Mining & Smelting Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	297
(300)	Mitsui Mining & Smelting Co Ltd	Goldman Sachs	178
(500)	Mitsui Mining & Smelting Co Ltd	Morgan Stanley	(211)
(1,100)	Mitsui OSK Lines Ltd	Goldman Sachs	(823)
(1,500)	Mitsui OSK Lines Ltd	Morgan Stanley	(849)
1,500	Mitsui Sugar Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(313)
1,200	Mitsui Sugar Co Ltd	Goldman Sachs	(275)
(300)	Mitsui-Soko Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(243)
(100)	Mitsui-Soko Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(262)
(600)	Mitsuuroko Group Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	201
(3,000)	Mitsuuroko Group Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	1,007
100	Miura Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	57
(800)	Mixi Inc	Goldman Sachs	437
(2,700)	Mixi Inc	Morgan Stanley	(570)
(2,100)	Mizuho Financial Group Inc	Goldman Sachs	1,328
(1,100)	Mizuho Financial Group Inc	Morgan Stanley	976
600	Mizuho Leasing Co Ltd	Goldman Sachs	(379)
200	Mizuno Corp	Goldman Sachs	(180)
(100)	Mochida Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	105
(100)	Mochida Pharmaceutical Co Ltd	Morgan Stanley	82
(600)	Modec Inc	Goldman Sachs	(460)
(21,000)	Monex Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(15,309)
(1,000)	Money Forward Inc	Bank of America Merrill Lynch	(291)
500	MonotaRO Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4,124
200	MonotaRO Co Ltd	Goldman Sachs	1,650
400	MonotaRO Co Ltd	Morgan Stanley	2,686
3	Mori Hills Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	147
6	Mori Trust Hotel Reit Inc (Reit)	Goldman Sachs	17
5	Mori Trust Sogo Reit Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	29
4	Mori Trust Sogo Reit Inc (REIT)	Goldman Sachs	(96)
300	Morinaga & Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(878)
500	Morinaga & Co Ltd	Goldman Sachs	(1,463)
100	Morinaga & Co Ltd	Morgan Stanley	(120)
(2,700)	Morinaga Milk Industry Co Ltd	Morgan Stanley	5,698
200	MOS Food Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(176)
300	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(510)
400	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	Goldman Sachs	(790)
300	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	Morgan Stanley	(483)
500	Murata Manufacturing Co Ltd	Goldman Sachs	4,772
100	Murata Manufacturing Co Ltd	Morgan Stanley	581

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(1,200)	Musashi Seimitsu Industry Co Ltd	Goldman Sachs	(760)
900	Musashino Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(319)
500	Musashino Bank Ltd	Goldman Sachs	(177)
300	Nabtesco Corp	Bank of America Merrill Lynch	811
500	Nabtesco Corp	Goldman Sachs	1,308
800	Nabtesco Corp	Morgan Stanley	1,716
(500)	Nachi-Fujikoshi Corp	Bank of America Merrill Lynch	695
(2,300)	Nachi-Fujikoshi Corp	Goldman Sachs	3,199
100	Nagatanien Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(179)
200	Nagatanien Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(359)
(100)	Nagoya Railroad Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	204
(800)	Nagoya Railroad Co Ltd	Goldman Sachs	1,634
(300)	Nagoya Railroad Co Ltd	Morgan Stanley	613
(400)	Nankai Electric Railway Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,033
(200)	Nankai Electric Railway Co Ltd	Goldman Sachs	304
(200)	Nankai Electric Railway Co Ltd	Morgan Stanley	610
600	Nanto Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(495)
200	Nanto Bank Ltd	Goldman Sachs	(165)
1,700	NEC Capital Solutions Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(489)
3,800	NEC Capital Solutions Ltd	Goldman Sachs	(1,093)
(800)	NEC Corp	Bank of America Merrill Lynch	(998)
100	NET One Systems Co Ltd	Goldman Sachs	230
200	NET One Systems Co Ltd	Morgan Stanley	77
5,600	Neturen Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,665)
4,000	Neturen Co Ltd	Goldman Sachs	(1,189)
500	Nexon Co Ltd	Morgan Stanley	1,650
300	Nextage Co Ltd	Goldman Sachs	178
300	NGK Insulators Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(81)
100	NGK Spark Plug Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	59
100	NGK Spark Plug Co Ltd	Goldman Sachs	92
500	NGK Spark Plug Co Ltd	Morgan Stanley	77
(200)	NH Foods Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(77)
(200)	NH Foods Ltd	Goldman Sachs	(77)
(700)	NH Foods Ltd	Morgan Stanley	1,074
(200)	NHK Spring Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	84
(1,100)	NHK Spring Co Ltd	Morgan Stanley	253
(100)	Nichias Corp	Bank of America Merrill Lynch	(49)
(1,200)	Nichias Corp	Goldman Sachs	(1,488)
(900)	Nichiban Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,252
(1,900)	Nichiban Co Ltd	Goldman Sachs	2,643
(1,300)	Nichicon Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,247)
(4,300)	Nichicon Corp	Goldman Sachs	(4,125)
(600)	Nichiden Corp	Bank of America Merrill Lynch	247
(600)	Nichiden Corp	Goldman Sachs	247
(700)	Nichiha Corp	Bank of America Merrill Lynch	(408)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(1,100)	Nichiha Corp	Goldman Sachs	(1,319)
1,600	Nidec Corp	Morgan Stanley	21,102
(500)	Nifco Inc	Goldman Sachs	(743)
(100)	Nifco Inc	Morgan Stanley	(10)
200	Nihon Chouzai Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(336)
1,900	Nihon Chouzai Co Ltd	Goldman Sachs	(351)
100	Nihon Kohden Corp	Bank of America Merrill Lynch	(221)
1,500	Nihon Kohden Corp	Goldman Sachs	(3,309)
300	Nihon Kohden Corp	Morgan Stanley	(388)
100	Nihon Trim Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	364
(500)	Nihon Unisys Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,177)
(200)	Nihon Unisys Ltd	Goldman Sachs	(584)
(500)	Nihon Unisys Ltd	Morgan Stanley	(432)
(300)	Nikkiso Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	43
(3,500)	Nikkiso Co Ltd	Goldman Sachs	504
1,100	Nikkon Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	63
4,200	Nikkon Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	242
5,100	Nikon Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4,011)
3,000	Nikon Corp	Goldman Sachs	(2,360)
1,800	Nikon Corp	Morgan Stanley	(708)
(700)	Nippo Corp	Bank of America Merrill Lynch	764
(1,100)	Nippo Corp	Goldman Sachs	1,298
(1,900)	Nippo Corp	Morgan Stanley	601
(3)	Nippon Accommodations Fund Inc (REIT)	Morgan Stanley	86
1,200	Nippon Beet Sugar Manufacturing Co Ltd	Goldman Sachs	(1,037)
(400)	Nippon Electric Glass Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(184)
(1,000)	Nippon Electric Glass Co Ltd	Goldman Sachs	(500)
(200)	Nippon Electric Glass Co Ltd	Morgan Stanley	(106)
(300)	Nippon Express Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	593
(200)	Nippon Express Co Ltd	Goldman Sachs	344
(400)	Nippon Express Co Ltd	Morgan Stanley	959
(200)	Nippon Fine Chemical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	109
(100)	Nippon Fine Chemical Co Ltd	Goldman Sachs	55
(500)	Nippon Gas Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	186
(200)	Nippon Gas Co Ltd	Goldman Sachs	(19)
600	Nippon Kayaku Co Ltd	Goldman Sachs	(104)
2,100	Nippon Kayaku Co Ltd	Morgan Stanley	(544)
(700)	Nippon Koei Co Ltd	Goldman Sachs	497
550	Nippon Light Metal Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	139
3,080	Nippon Light Metal Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(38)
3,900	Nippon Paper Industries Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3,928)
2,000	Nippon Paper Industries Co Ltd	Goldman Sachs	(2,011)
1,000	Nippon Paper Industries Co Ltd	Morgan Stanley	(793)
(6)	NIPPON REIT Investment Corp	Goldman Sachs	(230)
1,000	Nippon Seiki Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(499)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
700	Nippon Seiki Co Ltd	Goldman Sachs	(349)
(300)	Nippon Sharyo Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(58)
(100)	Nippon Sharyo Ltd	Goldman Sachs	(19)
300	Nippon Shinyaku Co Ltd	Goldman Sachs	29
100	Nippon Shokubai Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(155)
(300)	Nippon Signal Company Ltd	Goldman Sachs	65
100	Nippon Soda Co Ltd	Goldman Sachs	1
(1,200)	Nippon Steel Corp	Morgan Stanley	6
(100)	Nippon Steel Trading Corp	Goldman Sachs	(298)
(700)	Nippon Suisan Kaisha Ltd	Bank of America Merrill Lynch	195
(5,700)	Nippon Suisan Kaisha Ltd	Goldman Sachs	1,586
400	Nippon Telegraph & Telephone Corp	Goldman Sachs	(113)
3,900	Nippon Telegraph & Telephone Corp	Morgan Stanley	131
1,000	Nippon Thompson Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(182)
1,000	Nippon Thompson Co Ltd	Goldman Sachs	(182)
(1,000)	Nipro Corp	Bank of America Merrill Lynch	381
(1,500)	Nipro Corp	Goldman Sachs	577
(700)	Nipro Corp	Morgan Stanley	117
200	Nishimatsu Construction Co Ltd	Goldman Sachs	(81)
800	Nishimatsuya Chain Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,120)
1,200	Nishimatsuya Chain Co Ltd	Goldman Sachs	(1,681)
600	Nishi-Nippon Financial Holdings Inc	Goldman Sachs	46
(100)	Nishi-Nippon Railroad Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	164
100	Nishio Rent All Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(154)
2,200	Nishio Rent All Co Ltd	Goldman Sachs	(3,397)
(200)	Nissan Chemical Corp	Bank of America Merrill Lynch	141
(1,900)	Nissan Motor Co Ltd	Goldman Sachs	(428)
(4,400)	Nissan Motor Co Ltd	Morgan Stanley	452
(200)	Nissan Shatai Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	104
(500)	Nissan Shatai Co Ltd	Goldman Sachs	259
(300)	Nissan Shatai Co Ltd	Morgan Stanley	104
(400)	Nissei ASB Machine Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,535)
(1,700)	Nissha Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(815)
(2,400)	Nissha Co Ltd	Goldman Sachs	(1,151)
100	Nisshin Oillio Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(71)
1,100	Nisshinbo Holdings Inc	Morgan Stanley	(317)
700	Nissin Electric Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(107)
800	Nissin Electric Co Ltd	Goldman Sachs	(123)
100	Nissin Foods Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(38)
100	Nissin Foods Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(38)
100	Nissin Foods Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(115)
(200)	Nitori Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(1,976)
500	Nitta Corp	Bank of America Merrill Lynch	(182)
500	Nitta Corp	Goldman Sachs	(182)
(100)	Nittetsu Mining Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(289)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(100)	Nitto Boseki Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(120)
(200)	Nitto Denko Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,132)
(100)	Nitto Denko Corp	Goldman Sachs	(566)
(200)	Nitto Kogyo Corp	Bank of America Merrill Lynch	48
100	Noevir Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(297)
(100)	NOF Corp	Bank of America Merrill Lynch	(54)
(100)	NOF Corp	Goldman Sachs	(265)
(300)	Nohmi Bosai Ltd	Goldman Sachs	547
(300)	Nojima Corp	Bank of America Merrill Lynch	777
(100)	Nojima Corp	Goldman Sachs	259
600	NOK Corp	Morgan Stanley	(593)
700	Nomura Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	87
8,900	Nomura Co Ltd	Goldman Sachs	1,110
(300)	Nomura Holdings Inc	Goldman Sachs	10
(6,700)	Nomura Holdings Inc	Morgan Stanley	270
100	Nomura Real Estate Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	265
1,000	Nomura Real Estate Holdings Inc	Goldman Sachs	2,647
500	Nomura Real Estate Holdings Inc	Morgan Stanley	623
9	Nomura Real Estate Master Fund Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	256
1	Nomura Real Estate Master Fund Inc (REIT)	Goldman Sachs	29
300	Nomura Research Institute Ltd	Morgan Stanley	99
1,000	Noritake Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(710)
2,400	Noritake Co Ltd	Goldman Sachs	(1,704)
500	Noritsu Koki Co Ltd	Goldman Sachs	(129)
(200)	Noritz Corp	Bank of America Merrill Lynch	196
(13,400)	North Pacific Bank Ltd	Goldman Sachs	1,424
300	NS Solutions Corp	Goldman Sachs	(101)
300	NS Solutions Corp	Morgan Stanley	216
900	NS United Kaiun Kaisha Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(423)
600	NS United Kaiun Kaisha Ltd	Goldman Sachs	(282)
700	NSK Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(228)
500	NSK Ltd	Morgan Stanley	(221)
4,900	NTN Corp	Goldman Sachs	(649)
100	Obara Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	43
(6,600)	Obayashi Corp	Bank of America Merrill Lynch	939
(6,500)	Obayashi Corp	Goldman Sachs	688
(5,000)	Obayashi Corp	Morgan Stanley	2,696
(100)	OBIC Business Consultants Co Ltd	Goldman Sachs	(318)
(200)	Obic Co Ltd	Morgan Stanley	(2,878)
(600)	Odakyu Electric Railway Co Ltd	Goldman Sachs	(719)
(1,900)	Ogaki Kyoritsu Bank Ltd	Goldman Sachs	2,715
(300)	Oisix ra daichi Inc	Bank of America Merrill Lynch	(238)
2,300	Oji Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(397)
400	Oji Holdings Corp	Goldman Sachs	(69)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
500	Oji Holdings Corp	Morgan Stanley	(125)
(500)	Okabe Co Ltd	Goldman Sachs	139
3,000	Okamura Corp	Goldman Sachs	1,554
(1,200)	Oki Electric Industry Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	242
(5,700)	Oki Electric Industry Co Ltd	Goldman Sachs	1,148
(4,700)	Okinawa Electric Power Co Inc	Goldman Sachs	6,402
(100)	OKUMA Corp	Goldman Sachs	(106)
(400)	OKUMA Corp	Morgan Stanley	115
100	Okumura Corp	Bank of America Merrill Lynch	(59)
(1,600)	Okuwa Co Ltd	Goldman Sachs	1,197
(700)	Olympus Corp	Bank of America Merrill Lynch	(353)
(100)	Olympus Corp	Goldman Sachs	(50)
(300)	Olympus Corp	Morgan Stanley	(329)
400	Omron Corp	Bank of America Merrill Lynch	3,875
500	Omron Corp	Morgan Stanley	3,117
(3)	One Inc (Reit)	Goldman Sachs	(46)
(400)	Ono Pharmaceutical Co Ltd	Goldman Sachs	(545)
(1,100)	Ono Pharmaceutical Co Ltd	Morgan Stanley	(482)
(3,800)	Onward Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	911
600	Open Door Inc	Goldman Sachs	541
(200)	Open House Co Ltd	Goldman Sachs	(199)
(300)	Open House Co Ltd	Morgan Stanley	(432)
(200)	Optex Group Co Ltd	Goldman Sachs	(246)
(2,000)	Optim Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,141)
1,400	Optorun Co Ltd	Goldman Sachs	913
13,200	Orient Corp	Goldman Sachs	(506)
100	Oriental Land Co Ltd	Goldman Sachs	580
100	Oriental Land Co Ltd	Morgan Stanley	(168)
(400)	ORIX Corp	Morgan Stanley	298
(12)	Orix JREIT Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(184)
(1)	Orix JREIT Inc (REIT)	Goldman Sachs	(15)
(3)	Orix JREIT Inc (REIT)	Morgan Stanley	(32)
(500)	Osaka Gas Co Ltd	Goldman Sachs	919
(1,300)	Osaka Gas Co Ltd	Morgan Stanley	2,718
100	Osaka Soda Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(84)
100	Osaka Soda Co Ltd	Goldman Sachs	(84)
100	Osaka Steel Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	42
(1,200)	Osaki Electric Co Ltd	Goldman Sachs	127
1,800	OSJB Holdings Corp	Goldman Sachs	(259)
(200)	Otsuka Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	299
(1,200)	Outsourcing Inc	Goldman Sachs	184
(2,800)	Pacific Industrial Co Ltd	Goldman Sachs	(134)
300	Pacific Metals Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	95
200	Pacific Metals Co Ltd	Goldman Sachs	(59)
100	Pack Corp	Goldman Sachs	(110)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
500	PAL GROUP Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(193)
700	PAL GROUP Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(393)
(100)	PALTAC Corp	Morgan Stanley	29
(500)	Pan Pacific International Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	159
100	Park24 Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	23
2,200	Park24 Co Ltd	Goldman Sachs	(131)
200	Park24 Co Ltd	Morgan Stanley	(130)
(500)	Pasona Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	244
(600)	Penta-Ocean Construction Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	56
(2,400)	Penta-Ocean Construction Co Ltd	Goldman Sachs	242
(2,100)	Penta-Ocean Construction Co Ltd	Morgan Stanley	181
300	PeptiDream Inc	Goldman Sachs	1,616
900	PeptiDream Inc	Morgan Stanley	4,057
1,100	Persol Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(496)
100	PIA Corp	Bank of America Merrill Lynch	(135)
200	PIA Corp	Goldman Sachs	(270)
400	Pigeon Corp	Bank of America Merrill Lynch	(345)
1,200	Pigeon Corp	Goldman Sachs	(1,036)
200	Pigeon Corp	Morgan Stanley	(38)
500	Pilot Corp	Bank of America Merrill Lynch	(485)
500	Pilot Corp	Goldman Sachs	(532)
400	Pilot Corp	Morgan Stanley	(579)
300	PKSHA Technology Inc	Goldman Sachs	(22)
700	Pola Orbis Holdings Inc	Morgan Stanley	363
(5)	Premier Investment Corp (REIT)	Goldman Sachs	(197)
1,500	Press Kogyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	187
3,500	Press Kogyo Co Ltd	Goldman Sachs	436
(400)	Pressance Corp	Bank of America Merrill Lynch	(15)
500	Prestige International Inc	Goldman Sachs	(62)
(2,800)	Prima Meat Packers Ltd	Goldman Sachs	2,095
900	QoI Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(777)
1,400	QoI Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(1,018)
(300)	Raito Kogyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(81)
(600)	Raito Kogyo Co Ltd	Goldman Sachs	(102)
200	Raksul Inc	Bank of America Merrill Lynch	(691)
100	Raksul Inc	Goldman Sachs	(345)
300	Rakus Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	270
500	Rakus Co Ltd	Morgan Stanley	173
(3,500)	Rakuten Inc	Goldman Sachs	(1,710)
(200)	Rakuten Inc	Morgan Stanley	(19)
2,600	Raysum Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,222
6,400	Raysum Co Ltd	Goldman Sachs	3,008
700	Recruit Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,480)
500	Recruit Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(1,391)
1,600	Recruit Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(3,422)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
1,800	Renesas Electronics Corp	Bank of America Merrill Lynch	(229)
400	RENOVA Inc	Goldman Sachs	975
14,800	Resona Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,094)
9,800	Resona Holdings Inc	Goldman Sachs	(1,282)
13,200	Resona Holdings Inc	Morgan Stanley	(2,836)
(400)	Restar Holdings Corp	Goldman Sachs	64
(400)	Rheon Automatic Machinery Co Ltd	Goldman Sachs	299
2,500	Ricoh Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	808
900	Ricoh Co Ltd	Morgan Stanley	-
2,200	Ricoh Leasing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,709)
1,300	Ricoh Leasing Co Ltd	Goldman Sachs	(1,010)
1,100	Riken Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,321)
1,700	Riken Corp	Goldman Sachs	(3,587)
1,000	Riken Vitamin Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,146)
3,500	Riken Vitamin Co Ltd	Goldman Sachs	(5,707)
(400)	Ringer Hut Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	299
200	Rinnai Corp	Bank of America Merrill Lynch	806
300	Riso Kagaku Corp	Goldman Sachs	279
(900)	Riso Kyoiku Co Ltd	Goldman Sachs	121
700	Rock Field Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(712)
3,100	Rock Field Co Ltd	Goldman Sachs	(3,152)
(700)	Rohto Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(31)
(200)	Rohto Pharmaceutical Co Ltd	Morgan Stanley	(115)
(300)	Rokko Butter Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	55
2,200	Round One Corp	Goldman Sachs	549
(1,000)	Royal Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	894
(800)	Royal Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	829
(300)	RS Technologies Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,834)
(200)	RS Technologies Co Ltd	Goldman Sachs	(1,890)
200	Ryobi Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2
500	Ryobi Ltd	Goldman Sachs	5
400	Ryohin Keikaku Co Ltd	Morgan Stanley	(572)
900	Ryoyo Electro Corp	Goldman Sachs	(2,141)
(200)	S Foods Inc	Bank of America Merrill Lynch	292
(500)	S Foods Inc	Goldman Sachs	647
(400)	Saizeriya Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	341
(3,500)	Saizeriya Co Ltd	Goldman Sachs	2,988
200	Sakai Chemical Industry Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(205)
100	Sakai Chemical Industry Co Ltd	Goldman Sachs	(103)
100	Sakai Moving Service Co Ltd	Goldman Sachs	(48)
(300)	Sakata Seed Corp	Bank of America Merrill Lynch	633
(1,200)	Sakata Seed Corp	Goldman Sachs	2,532
2,600	SAMTY Co Ltd	Goldman Sachs	(2,693)
8	Samty Residential Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	271

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
27	Samty Residential Investment Corp (REIT)	Goldman Sachs	1,072
200	San-A Co Ltd	Goldman Sachs	(213)
2,000	Sangetsu Corp	Goldman Sachs	(2,091)
2,500	San-In Godo Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(456)
4,700	San-In Godo Bank Ltd	Goldman Sachs	(857)
(900)	Sanken Electric Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,079)
(200)	Sankyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	240
(300)	Sankyo Co Ltd	Goldman Sachs	304
(900)	Sankyo Co Ltd	Morgan Stanley	656
200	Sankyu Inc	Bank of America Merrill Lynch	(355)
400	Sankyu Inc	Goldman Sachs	(711)
1,200	Sankyu Inc	Morgan Stanley	(4,029)
200	Sanrio Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(340)
800	Sanrio Co Ltd	Goldman Sachs	(907)
3,200	Sanrio Co Ltd	Morgan Stanley	(3,223)
(200)	Sansan Inc	Morgan Stanley	58
200	Santen Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	48
900	Santen Pharmaceutical Co Ltd	Goldman Sachs	216
300	Santen Pharmaceutical Co Ltd	Morgan Stanley	127
300	Sanwa Holdings Corp	Morgan Stanley	(83)
200	Sanyo Chemical Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(49)
200	Sanyo Chemical Industries Ltd	Goldman Sachs	(48)
(100)	Sanyo Denki Co Ltd	Goldman Sachs	(293)
(900)	Sapporo Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,165
(400)	Sapporo Holdings Ltd	Goldman Sachs	518
100	Sawai Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(67)
100	Sawai Pharmaceutical Co Ltd	Goldman Sachs	(1)
100	Sawai Pharmaceutical Co Ltd	Morgan Stanley	(48)
(100)	SB Technology Corp	Bank of America Merrill Lynch	(188)
(900)	SBI Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,269)
(900)	SBI Holdings Inc	Morgan Stanley	(354)
(500)	SBS Holdings Inc	Goldman Sachs	(475)
100	SEC Carbon Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(230)
300	SEC Carbon Ltd	Goldman Sachs	(691)
(500)	Secom Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,326)
(2,100)	Sega Sammy Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,491
(1,400)	Sega Sammy Holdings Inc	Goldman Sachs	908
(1,100)	Sega Sammy Holdings Inc	Morgan Stanley	580
(900)	Seibu Holdings Inc	Morgan Stanley	1,200
(900)	Seikagaku Corp	Goldman Sachs	190
(1,000)	Seiko Epson Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,477)
(600)	Seiko Epson Corp	Morgan Stanley	(81)
(500)	Seiko Holdings Corp	Goldman Sachs	494
(1,300)	Seino Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,278
(100)	Seino Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	128

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(1,500)	Seiren Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,870
(4,600)	Seiren Co Ltd	Goldman Sachs	5,736
100	Sekisui Jushi Corp	Bank of America Merrill Lynch	9
4,700	Sekisui Kasei Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,352)
1,700	Sekisui Kasei Co Ltd	Goldman Sachs	(489)
(800)	Senko Group Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	207
2,100	Senshu Ikeda Holdings Inc	Goldman Sachs	(121)
(100)	Serverworks Co Ltd	Goldman Sachs	590
400	Seven & i Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(169)
400	Seven & i Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(284)
2,200	Seven Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(132)
13,500	Seven Bank Ltd	Goldman Sachs	(982)
(100)	SG Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(327)
(1,500)	Shibaura Machine Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,662)
(400)	Shibuya Corp	Goldman Sachs	(384)
(400)	SHIFT Inc	Morgan Stanley	(230)
(3,900)	Shiga Bank Ltd	Morgan Stanley	2,020
600	Shikoku Bank Ltd	Goldman Sachs	(265)
(3,400)	Shima Seiki Manufacturing Ltd	Goldman Sachs	2,772
(1,400)	Shimachu Co Ltd	Goldman Sachs	134
(600)	Shimachu Co Ltd	Morgan Stanley	58
(300)	Shimadzu Corp	Bank of America Merrill Lynch	(602)
(100)	Shimadzu Corp	Goldman Sachs	(97)
(800)	Shimizu Corp	Morgan Stanley	215
(400)	Shin Nippon Air Technologies Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	31
(700)	Shin Nippon Air Technologies Co Ltd	Goldman Sachs	54
1,100	Shindengen Electric Manufacturing Co Ltd	Goldman Sachs	(897)
400	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	5,185
7,300	Shin-Etsu Polymer Co Ltd	Goldman Sachs	70
(200)	Shinko Electric Industries Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(722)
(1,300)	Shinko Electric Industries Co Ltd	Goldman Sachs	(4,003)
(2,300)	Shinko Electric Industries Co Ltd	Morgan Stanley	(5,582)
3,100	Shinmaywa Industries Ltd	Goldman Sachs	(714)
1,700	Shinsei Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,907)
1,000	Shinsei Bank Ltd	Goldman Sachs	(973)
1,100	Shinsei Bank Ltd	Morgan Stanley	(1,023)
(100)	Ship Healthcare Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	19
400	Shiseido Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	379
2,400	Shiseido Co Ltd	Morgan Stanley	1,381
(9,700)	Shizuoka Gas Co Ltd	Goldman Sachs	-
(500)	SHO-BOND Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	1,427
(100)	SHO-BOND Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	317
(500)	Shochiku Co Ltd	Goldman Sachs	2,446
1,900	Shoei Co Ltd	Goldman Sachs	820
400	Shoei Foods Corp	Bank of America Merrill Lynch	(351)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
200	Shoei Foods Corp	Goldman Sachs	(201)
300	Showa Denko KK	Bank of America Merrill Lynch	(151)
600	Showa Denko KK	Goldman Sachs	(92)
100	Showa Denko KK	Morgan Stanley	(13)
(200)	Siix Corp	Bank of America Merrill Lynch	(31)
(800)	Sinanen Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	1,205
(7,200)	Sinfonia Technology Co Ltd	Goldman Sachs	(4,075)
2,400	Sinko Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,279
2,000	Sinko Industries Ltd	Goldman Sachs	1,899
3,400	Sintokogio Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(393)
3,000	Sintokogio Ltd	Goldman Sachs	(414)
(400)	SKY Perfect JSAT Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	36
100	Skylark Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(24)
100	SMC Corp	Bank of America Merrill Lynch	5,494
100	SMC Corp	Morgan Stanley	3,156
400	SMS Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,513
300	SMS Co Ltd	Morgan Stanley	619
(400)	Sodick Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	13
(400)	Sodick Co Ltd	Goldman Sachs	69
22,500	Sojitz Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,942)
15,400	Sojitz Corp	Goldman Sachs	(1,329)
14,400	Sojitz Corp	Morgan Stanley	(829)
(400)	Solasto Corp	Bank of America Merrill Lynch	326
400	Sompo Holdings Inc	Morgan Stanley	-
(600)	Sony Corp	Morgan Stanley	(1,232)
600	Sosei Group Corp	Goldman Sachs	147
1,000	Sourcenext Corp	Goldman Sachs	(95)
1,700	S-Pool Inc	Goldman Sachs	588
100	ST Corp	Goldman Sachs	33
1,700	St Marc Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(1,288)
300	Stanley Electric Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	144
100	Stanley Electric Co Ltd	Goldman Sachs	(12)
200	Stanley Electric Co Ltd	Morgan Stanley	10
58	Star Asia Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	839
25	Star Asia Investment Corp (REIT)	Goldman Sachs	360
(1,400)	Starts Corp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(886)
(2,600)	Starts Corp Inc	Goldman Sachs	(1,869)
100	Starzen Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(197)
600	Strike Co Ltd	Goldman Sachs	2,935
200	Studio Alice Co Ltd	Goldman Sachs	(286)
400	Subaru Corp	Goldman Sachs	(426)
500	Subaru Corp	Morgan Stanley	(710)
100	Sugi Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(106)
1,800	Sumitomo Chemical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(396)
16,400	Sumitomo Chemical Co Ltd	Morgan Stanley	(2,832)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
1,200	Sumitomo Corp	Morgan Stanley	(742)
(400)	Sumitomo Dainippon Pharma Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	139
(400)	Sumitomo Densetsu Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	972
(800)	Sumitomo Densetsu Co Ltd	Goldman Sachs	2,158
(2,200)	Sumitomo Electric Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,965
(600)	Sumitomo Electric Industries Ltd	Goldman Sachs	309
(1,500)	Sumitomo Electric Industries Ltd	Morgan Stanley	1,007
(300)	Sumitomo Forestry Co Ltd	Goldman Sachs	(127)
100	Sumitomo Heavy Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(135)
200	Sumitomo Heavy Industries Ltd	Goldman Sachs	(220)
(100)	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(129)
(1,100)	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	Goldman Sachs	(1,424)
2,900	Sumitomo Mitsui Construction Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(28)
4,300	Sumitomo Mitsui Construction Co Ltd	Goldman Sachs	(41)
1,400	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	Morgan Stanley	(2,310)
600	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(541)
2,600	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	Morgan Stanley	(5,013)
(200)	Sumitomo Osaka Cement Co Ltd	Goldman Sachs	480
(800)	Sumitomo Realty & Development Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(755)
(200)	Sumitomo Realty & Development Co Ltd	Goldman Sachs	(201)
(2,500)	Sumitomo Realty & Development Co Ltd	Morgan Stanley	3,069
1,300	Sumitomo Riko Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(436)
4,400	Sumitomo Riko Co Ltd	Goldman Sachs	(1,477)
8,300	Sumitomo Rubber Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(9,235)
1,900	Sumitomo Rubber Industries Ltd	Goldman Sachs	(2,114)
5,600	Sumitomo Rubber Industries Ltd	Morgan Stanley	(4,673)
100	Sumitomo Seika Chemicals Co Ltd	Goldman Sachs	427
(2,300)	Sumitomo Warehouse Co Ltd	Goldman Sachs	1,012
4,300	Sun Frontier Fudousan Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,732)
400	Sun Frontier Fudousan Co Ltd	Goldman Sachs	(161)
100	Sundrug Co Ltd	Morgan Stanley	144
600	Suntory Beverage & Food Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(408)
800	Suntory Beverage & Food Ltd	Goldman Sachs	(460)
300	Suntory Beverage & Food Ltd	Morgan Stanley	(345)
(2,100)	Suruga Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	388
(400)	Sushiro Global Holdings Ltd	Morgan Stanley	(153)
(100)	Suzuken Co Ltd	Morgan Stanley	(10)
(300)	Suzuki Motor Corp	Goldman Sachs	283
100	Systemex Corp	Bank of America Merrill Lynch	374
400	Systemex Corp	Goldman Sachs	1,496
300	Systemex Corp	Morgan Stanley	2,029
(400)	Systema Corp	Bank of America Merrill Lynch	(292)
(1,300)	Systema Corp	Goldman Sachs	(1,270)
800	T Hasegawa Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(767)
900	T Hasegawa Co Ltd	Goldman Sachs	(863)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(2,600)	T&D Holdings Inc	Goldman Sachs	(499)
(200)	T&D Holdings Inc	Morgan Stanley	65
(700)	Tachi-S Co Ltd	Goldman Sachs	269
(300)	Taiheiyō Cement Corp	Bank of America Merrill Lynch	426
(800)	Taiheiyō Cement Corp	Goldman Sachs	1,136
200	Taikisha Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(238)
(1,000)	Taiko Pharmaceutical Co Ltd	Goldman Sachs	739
(300)	Taisei Corp	Bank of America Merrill Lynch	(432)
(100)	Taisei Corp	Morgan Stanley	(38)
(100)	Taisho Pharmaceutical Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	4
(200)	Taiyō Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(800)
200	Taiyō Yuden Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,073
3,600	Takamatsu Construction Group Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4,544)
3,000	Takamatsu Construction Group Co Ltd	Goldman Sachs	(3,688)
(1,900)	Takara Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	449
(600)	Takara Holdings Inc	Goldman Sachs	299
(600)	Takara Holdings Inc	Morgan Stanley	75
(1,000)	Takara Leben Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	19
5	Takara Leben Real Estate Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	135
900	Takara Standard Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,027)
900	Takara Standard Co Ltd	Goldman Sachs	(815)
100	Takasago International Corp	Goldman Sachs	99
700	Takasago Thermal Engineering Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(477)
12,400	Takasago Thermal Engineering Co Ltd	Goldman Sachs	(8,445)
800	Takashimaya Co Ltd	Goldman Sachs	(669)
(700)	Takeuchi Manufacturing Co Ltd	Goldman Sachs	449
(200)	Taki Chemical Co Ltd	Goldman Sachs	652
(700)	Takuma Co Ltd	Goldman Sachs	213
400	Tama Home Co Ltd	Goldman Sachs	(111)
(300)	Tamron Co Ltd	Goldman Sachs	43
(1,200)	Tamura Corp	Goldman Sachs	(69)
4,200	Tanseisha Co Ltd	Goldman Sachs	(242)
200	TBS Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	117
(1,100)	TechMatrix Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,831)
400	TechnoPro Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,852
(200)	Teijin Ltd	Bank of America Merrill Lynch	129
(1,500)	Teijin Ltd	Goldman Sachs	1,020
(900)	Teijin Ltd	Morgan Stanley	622
(300)	Teikoku Sen-I Co Ltd	Goldman Sachs	365
200	Tekken Corp	Bank of America Merrill Lynch	(210)
400	Tekken Corp	Goldman Sachs	(316)
800	Tenma Corp	Bank of America Merrill Lynch	54
300	Tenma Corp	Goldman Sachs	20
800	T-Gaia Corp	Bank of America Merrill Lynch	61
1,300	T-Gaia Corp	Goldman Sachs	100

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
500	THK Co Ltd	Goldman Sachs	894
700	TIS Inc	Goldman Sachs	285
300	TIS Inc	Morgan Stanley	3
(600)	TKC Corp	Goldman Sachs	(978)
400	TKP Corp	Bank of America Merrill Lynch	(625)
200	TKP Corp	Goldman Sachs	(313)
(200)	Toa Corp	Bank of America Merrill Lynch	88
(3,800)	Tobu Railway Co Ltd	Morgan Stanley	13,851
(400)	Tocalo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(368)
(1,600)	Toda Corp	Goldman Sachs	338
(400)	Toda Corp	Morgan Stanley	77
100	Toei Animation Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	574
(100)	Toei Co Ltd	Goldman Sachs	319
100	Toenec Corp	Bank of America Merrill Lynch	53
(100)	Toho Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	29
(100)	Toho Gas Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(480)
(100)	Toho Gas Co Ltd	Goldman Sachs	(480)
(1,300)	Toho Gas Co Ltd	Morgan Stanley	2,993
(1,400)	Tohoku Electric Power Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	961
(1,400)	Tohoku Electric Power Co Inc	Goldman Sachs	938
(1,400)	Tohoku Electric Power Co Inc	Morgan Stanley	886
700	Tokai Carbon Co Ltd	Goldman Sachs	(470)
400	Tokai Carbon Co Ltd	Morgan Stanley	(246)
300	Tokai Corp	Bank of America Merrill Lynch	(49)
1,000	Tokai Corp	Goldman Sachs	(163)
(1,100)	TOKAI Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	855
(3,000)	TOKAI Holdings Corp	Goldman Sachs	2,331
(3,000)	Tokai Rika Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3,741
(1,800)	Tokai Rika Co Ltd	Goldman Sachs	2,244
(700)	Tokai Rika Co Ltd	Morgan Stanley	577
(2,200)	Tokai Tokyo Financial Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(338)
(14,800)	Tokai Tokyo Financial Holdings Inc	Goldman Sachs	(2,271)
(300)	Tokio Marine Holdings Inc	Goldman Sachs	247
(1,100)	Tokushu Tokai Paper Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(211)
(3,700)	Tokushu Tokai Paper Co Ltd	Goldman Sachs	(710)
(1,000)	Tokuyama Corp	Morgan Stanley	422
900	Tokyo Broadcasting System Holdings Inc	Goldman Sachs	527
3,600	Tokyo Broadcasting System Holdings Inc	Morgan Stanley	1,278
(300)	Tokyo Century Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,180)
(8,600)	Tokyo Dome Corp	Goldman Sachs	(34,398)
(5,400)	Tokyo Electric Power Co Holdings Inc	Morgan Stanley	932
(100)	Tokyo Gas Co Ltd	Goldman Sachs	254
(400)	Tokyo Gas Co Ltd	Morgan Stanley	1,101
400	Tokyo Kiraboshi Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(234)
200	Tokyo Kiraboshi Financial Group Inc	Goldman Sachs	(117)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
100	Tokyo Ohka Kogyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	278
(400)	Tokyo Seimitsu Co Ltd	Goldman Sachs	(702)
3,100	Tokyo Steel Manufacturing Co Ltd	Goldman Sachs	(773)
800	Tokyo Tatemono Co Ltd	Morgan Stanley	253
(100)	Tokyotokeiba Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(211)
(300)	Tokyotokeiba Co Ltd	Goldman Sachs	(211)
3,700	Tokyu Construction Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,065)
2,900	Tokyu Construction Co Ltd	Goldman Sachs	(835)
1,800	Tokyu Fudosan Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	140
1,100	Tokyu Fudosan Holdings Corp	Goldman Sachs	241
5,100	Tokyu Fudosan Holdings Corp	Morgan Stanley	(734)
(12)	Tokyu Inc (Reit)	Goldman Sachs	(645)
(4,800)	TOMONY Holdings Inc	Goldman Sachs	599
(400)	Tomy Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	73
(500)	Tomy Co Ltd	Goldman Sachs	91
(200)	Tonami Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	767
700	Toppan Forms Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(201)
600	Toppan Forms Co Ltd	Goldman Sachs	(173)
1,000	Toppan Printing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(326)
600	Topre Corp	Goldman Sachs	428
(500)	Toray Industries Inc	Goldman Sachs	97
(700)	Torii Pharmaceutical Co Ltd	Goldman Sachs	604
(400)	Tosei Corp	Goldman Sachs	(249)
1,600	Toshiba Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,667
400	Toshiba Corp	Morgan Stanley	(15)
(200)	Toshiba TEC Corp	Morgan Stanley	432
(1,000)	Tosho Co Ltd	Goldman Sachs	1,151
500	Tosoh Corp	Goldman Sachs	(414)
(300)	Totetsu Kogyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	230
(500)	Totetsu Kogyo Co Ltd	Goldman Sachs	315
(100)	TOTO Ltd	Goldman Sachs	(125)
(700)	TOTO Ltd	Morgan Stanley	(134)
500	Towa Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(197)
500	Towa Bank Ltd	Goldman Sachs	(165)
(400)	Toyo Ink SC Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	119
600	Toyo Seikan Group Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(547)
800	Toyo Seikan Group Holdings Ltd	Goldman Sachs	(729)
600	Toyo Seikan Group Holdings Ltd	Morgan Stanley	(311)
(200)	Toyo Suisan Kaisha Ltd	Bank of America Merrill Lynch	249
(300)	Toyo Suisan Kaisha Ltd	Goldman Sachs	374
(1,700)	Toyobo Co Ltd	Morgan Stanley	1,239
(900)	Toyoda Gosei Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	811
300	Toyota Boshoku Corp	Bank of America Merrill Lynch	(172)
200	Toyota Boshoku Corp	Morgan Stanley	(150)
(200)	Toyota Industries Corp	Goldman Sachs	(307)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(200)	Toyota Motor Corp	Goldman Sachs	595
(1,700)	Toyota Motor Corp	Morgan Stanley	7,044
100	TPR Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(119)
1,400	TPR Co Ltd	Goldman Sachs	(1,665)
(200)	Transcosmos Inc	Bank of America Merrill Lynch	403
300	Trend Micro Inc	Goldman Sachs	201
200	Tri Chemical Laboratories Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,782
100	Tri Chemical Laboratories Inc	Goldman Sachs	1,391
(800)	Trusco Nakayama Corp	Goldman Sachs	1,496
(300)	TS Tech Co Ltd	Goldman Sachs	201
5,700	TSI Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,586)
1,700	TSI Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(473)
3,200	Tsubaki Nakashima Co Ltd	Goldman Sachs	(1,535)
(200)	Tsubakimoto Chain Co	Goldman Sachs	(2)
(3,000)	Tsugami Corp	Goldman Sachs	(1,496)
(500)	Tsukui Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	178
(1,900)	Tsumura & Co	Goldman Sachs	5,831
(500)	Tsumura & Co	Morgan Stanley	911
(100)	TV Asahi Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	64
(500)	TV Asahi Holdings Corp	Goldman Sachs	285
(300)	TV Asahi Holdings Corp	Morgan Stanley	234
(100)	Tv Tokyo Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	144
200	UACJ Corp	Bank of America Merrill Lynch	129
(300)	Ube Industries Ltd	Goldman Sachs	58
(300)	Uchida Yoko Co Ltd	Goldman Sachs	460
(500)	Unicharm Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,185
(100)	Unicharm Corp	Goldman Sachs	237
300	United Arrows Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(33)
600	United Arrows Ltd	Goldman Sachs	(229)
(300)	UNITED Inc	Bank of America Merrill Lynch	(43)
700	United Super Markets Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(329)
600	United Super Markets Holdings Inc	Goldman Sachs	(282)
7	United Urban Investment Corp (REIT)	Goldman Sachs	(269)
(1,500)	Universal Entertainment Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,302)
400	Ushio Inc	Bank of America Merrill Lynch	(79)
(500)	USS Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	296
(500)	USS Co Ltd	Goldman Sachs	223
(100)	USS Co Ltd	Morgan Stanley	92
100	UT Group Co Ltd	Goldman Sachs	64
200	UUUM Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(19)
600	UUUM Co Ltd	Goldman Sachs	161
200	Uzabase Inc	Goldman Sachs	(307)
(200)	V Technology Co Ltd	Goldman Sachs	748
(600)	Valor Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(92)
(1,000)	Valor Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(191)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
200	Valqua Ltd	Bank of America Merrill Lynch	13
200	Valqua Ltd	Goldman Sachs	13
200	ValueCommerce Co Ltd	Goldman Sachs	556
400	Vector Inc	Bank of America Merrill Lynch	196
400	Vector Inc	Goldman Sachs	357
300	Vision Inc	Bank of America Merrill Lynch	176
(100)	Wacoal Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	110
(400)	Wacoal Holdings Corp	Goldman Sachs	441
(100)	Wacoal Holdings Corp	Morgan Stanley	59
(600)	Wacom Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,214)
(3,900)	Wacom Co Ltd	Goldman Sachs	(8,080)
2,700	Wakita & Co Ltd	Goldman Sachs	(906)
(3,200)	WATAMI Co Ltd	Goldman Sachs	4,052
200	Weathernews Inc	Bank of America Merrill Lynch	(595)
600	Weathernews Inc	Goldman Sachs	(1,784)
200	Welcia Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	71
500	Welcia Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	144
(100)	West Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(67)
300	West Japan Railway Co	Bank of America Merrill Lynch	(472)
300	Workman Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	-
200	Workman Co Ltd	Goldman Sachs	-
600	World Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(351)
4,100	World Co Ltd	Goldman Sachs	(2,399)
(2,600)	Wowow Inc	Bank of America Merrill Lynch	424
(200)	Wowow Inc	Goldman Sachs	33
3,200	Xebio Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(767)
3,000	Xebio Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(719)
600	Yahagi Construction Co Ltd	Goldman Sachs	(104)
500	Yakult Honsha Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(456)
(700)	YAMABIKO Corp	Goldman Sachs	(329)
500	YAMADA Consulting Group Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	56
800	YAMADA Consulting Group Co Ltd	Goldman Sachs	(107)
900	Yamada Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(104)
12,500	Yamada Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(839)
(1,000)	Yamaguchi Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	911
(1,900)	Yamaguchi Financial Group Inc	Morgan Stanley	1,239
4,700	Yamaha Motor Co Ltd	Morgan Stanley	586
2,900	YA-MAN Ltd	Goldman Sachs	13,407
500	Yamashin-Filter Corp	Bank of America Merrill Lynch	255
(200)	Yamato Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	62
(1,800)	Yamato Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	397
(100)	Yamato Kogyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(106)
200	Yamazaki Baking Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(160)
(300)	Yamazaki Corp	Bank of America Merrill Lynch	190
500	Yaoko Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(528)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
100	Yaoko Co Ltd	Morgan Stanley	86
1,900	Yaskawa Electric Corp	Bank of America Merrill Lynch	8,201
300	Yaskawa Electric Corp	Morgan Stanley	403
(900)	Yellow Hat Ltd	Goldman Sachs	388
4,400	Yodogawa Steel Works Ltd	Goldman Sachs	(4,305)
600	Yokogawa Bridge Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	127
900	Yokogawa Bridge Holdings Corp	Goldman Sachs	131
(600)	Yokogawa Electric Corp	Morgan Stanley	12
1,400	Yokohama Reito Co Ltd	Goldman Sachs	(712)
400	Yokohama Rubber Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(599)
2,100	Yokohama Rubber Co Ltd	Goldman Sachs	(3,142)
2,900	Yokohama Rubber Co Ltd	Morgan Stanley	(2,587)
300	Yokowo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	409
200	Yokowo Co Ltd	Goldman Sachs	(4)
(300)	Yomiuri Land Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	115
(700)	Yomiuri Land Co Ltd	Goldman Sachs	269
800	Yondoshi Holdings Inc	Goldman Sachs	(629)
(600)	Yorozu Corp	Bank of America Merrill Lynch	834
(700)	Yorozu Corp	Goldman Sachs	974
(700)	Yoshinoya Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	258
2,700	Yurtec Corp	Bank of America Merrill Lynch	(388)
8,800	Yurtec Corp	Goldman Sachs	(1,266)
400	Yushin Precision Equipment Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	246
5,100	Z Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	3,992
1,700	Z Holdings Corp	Goldman Sachs	894
(600)	Zenrin Co Ltd	Goldman Sachs	(58)
(900)	Zensho Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	1,642
(700)	Zensho Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	786
800	Zeon Corp	Bank of America Merrill Lynch	431
1,300	ZIGExN Co Ltd	Goldman Sachs	(28)
200	Zojirushi Corp	Goldman Sachs	(238)
300	ZOZO Inc	Goldman Sachs	382
100	Zuken Inc	Goldman Sachs	(93)
			(92,858)
	ジャージー		
198	Aptiv Plc	Bank of America Merrill Lynch	1,432
14	Aptiv Plc	Goldman Sachs	90
937	Aptiv Plc	Morgan Stanley	4,376
15,259	Centamin Plc	Morgan Stanley	888
(2)	Clarivate Plc	Bank of America Merrill Lynch	-
(537)	Clarivate Plc	Morgan Stanley	(328)
904	Experian Plc	Bank of America Merrill Lynch	(4,134)
203	Experian Plc	Goldman Sachs	(736)
3,104	Experian Plc	Morgan Stanley	(8,676)
284	Ferguson Plc	Bank of America Merrill Lynch	1,375

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	ジャージー(続き)		
(12,968)	Glencore Plc	Bank of America Merrill Lynch	(3,645)
(10,179)	Glencore Plc	Morgan Stanley	(2,235)
3,683	IWG Plc	Morgan Stanley	(725)
(54)	Janus Henderson Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	10
(118)	Janus Henderson Group Plc	Goldman Sachs	(128)
(2,399)	Man Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	62
(4,845)	Man Group Plc	Goldman Sachs	(30)
103	Mimecast Ltd	Bank of America Merrill Lynch	268
1,256	Mimecast Ltd	Goldman Sachs	261
1,934	Petrofac Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(37)
683	Quotient Ltd	Bank of America Merrill Lynch	676
(1,885)	WPP Plc	Bank of America Merrill Lynch	660
(6,933)	WPP Plc	Goldman Sachs	2,429
(4,758)	WPP Plc	Morgan Stanley	76
			<u>(8,071)</u>
	リベリア		
80	Royal Caribbean Cruises Ltd	Bank of America Merrill Lynch	384
795	Royal Caribbean Cruises Ltd	Morgan Stanley	3,522
			<u>3,906</u>
	ルクセンブルグ		
492	ADLER Group SA	Bank of America Merrill Lynch	519
104	ADLER Group SA	Goldman Sachs	110
(1,357)	APERAM SA	Bank of America Merrill Lynch	(2,361)
(1,151)	APERAM SA	Goldman Sachs	(1,905)
(193)	APERAM SA	Morgan Stanley	(46)
(4,023)	ArcelorMittal SA	Bank of America Merrill Lynch	(2,595)
(144)	ArcelorMittal SA	Goldman Sachs	(56)
(251)	B&S Group Sarl	Bank of America Merrill Lynch	(90)
(425)	B&S Group Sarl	Goldman Sachs	(153)
(471)	Befesa SA	Goldman Sachs	(2,599)
(2,021)	eDreams ODIGEO SA	Bank of America Merrill Lynch	(667)
290	Eurofins Scientific SE	Bank of America Merrill Lynch	(344)
60	Eurofins Scientific SE	Morgan Stanley	30
474	Grand City Properties SA	Morgan Stanley	68
3,750	L'Occitane International SA	Bank of America Merrill Lynch	13
1,250	L'Occitane International SA	Goldman Sachs	45
354	RTL Group SA	Bank of America Merrill Lynch	85
891	RTL Group SA	Goldman Sachs	328
366	RTL Group SA	Morgan Stanley	220
190	SES SA	Bank of America Merrill Lynch	(146)
242	SES SA	Goldman Sachs	(156)
1,744	SES SA	Morgan Stanley	(1,151)
(214)	Solutions 30 SE	Goldman Sachs	163
(20)	Spotify Technology SA	Goldman Sachs	(419)
(38)	Stabilus SA	Bank of America Merrill Lynch	(87)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	ルクセンブルグ(続き)		
(98)	Stabilus SA	Goldman Sachs	(223)
(2,312)	Tenaris SA	Bank of America Merrill Lynch	236
464	Trinseo SA	Goldman Sachs	46
			(11,135)
	マルタ		
235	Kambi Group Plc	Goldman Sachs	417
1,641	Kindred Group Plc SDR	Goldman Sachs	569
			986
	マーシャル諸島		
(1,519)	Dorian LPG Ltd	Goldman Sachs	(2,400)
(688)	Genco Shipping & Trading Ltd	Goldman Sachs	(213)
(832)	International Seaways Inc	Goldman Sachs	(358)
			(2,971)
	モーリシャス		
(171,900)	Golden Agri-Resources Ltd	Goldman Sachs	(714)
(190,800)	Golden Agri-Resources Ltd	Morgan Stanley	(999)
			(1,713)
	オランダ		
(684)	Aalberts NV	Morgan Stanley	(640)
354	ABN AMRO Bank NV - CVA	Bank of America Merrill Lynch	(32)
3,589	ABN AMRO Bank NV - CVA	Goldman Sachs	(362)
447	Accell Group NV	Bank of America Merrill Lynch	295
525	Accell Group NV	Goldman Sachs	346
(40)	Adyen NV	Bank of America Merrill Lynch	(346)
(7)	Adyen NV	Goldman Sachs	(21)
(42)	Adyen NV	Morgan Stanley	(1,738)
13,244	Aegon NV	Bank of America Merrill Lynch	2,846
380	Aegon NV	Goldman Sachs	53
8,679	Aegon NV	Morgan Stanley	1,353
765	AerCap Holdings NV	Bank of America Merrill Lynch	(269)
205	AerCap Holdings NV	Goldman Sachs	(78)
94	AerCap Holdings NV	Morgan Stanley	(145)
396	Akzo Nobel NV	Bank of America Merrill Lynch	846
42	Akzo Nobel NV	Morgan Stanley	67
(122)	AMG Advanced Metallurgical Group NV	Goldman Sachs	(13)
(1,245)	Arcadis NV	Goldman Sachs	(3,704)
(43)	ASM International NV	Bank of America Merrill Lynch	(164)
(239)	ASM International NV	Goldman Sachs	(3,367)
(137)	ASM International NV	Morgan Stanley	(1,734)
(25)	ASML Holding NV	Goldman Sachs	(854)
(155)	ASML Holding NV	Morgan Stanley	(1,645)
195	ASR Nederland NV	Morgan Stanley	(3)
295	Basic-Fit NV	Goldman Sachs	330
118	Basic-Fit NV	Morgan Stanley	71
(561)	BE Semiconductor Industries NV	Goldman Sachs	(2,850)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	オランダ(続き)		
335	Boskalis Westminster	Goldman Sachs	(52)
335	Brunel International NV	Bank of America Merrill Lynch	265
280	Brunel International NV	Goldman Sachs	222
(343)	Cementir Holding NV	Goldman Sachs	21
(1,267)	CNH Industrial NV	Morgan Stanley	(353)
75	Corbion NV	Bank of America Merrill Lynch	108
213	Core Laboratories NV	Bank of America Merrill Lynch	564
125	Core Laboratories NV	Goldman Sachs	(93)
46	COSMO Pharmaceuticals NV	Bank of America Merrill Lynch	46
62	COSMO Pharmaceuticals NV	Goldman Sachs	62
(189)	Elastic NV	Bank of America Merrill Lynch	(1,635)
(299)	Elastic NV	Goldman Sachs	(6,041)
(325)	Elastic NV	Morgan Stanley	(2,389)
562	Eurocommercial Properties NV	Bank of America Merrill Lynch	(418)
582	Eurocommercial Properties NV	Goldman Sachs	(433)
178	Euronext NV	Bank of America Merrill Lynch	331
140	Euronext NV	Goldman Sachs	260
563	Euronext NV	Morgan Stanley	1,587
(55)	EXOR NV	Morgan Stanley	(129)
(4,436)	Fiat Chrysler Automobiles NV	Goldman Sachs	(3,395)
(367)	Flow Traders	Bank of America Merrill Lynch	(167)
(125)	Flow Traders	Goldman Sachs	(75)
(266)	Flow Traders	Morgan Stanley	(134)
(471)	ForFarmers NV	Bank of America Merrill Lynch	(90)
(368)	ForFarmers NV	Goldman Sachs	(28)
(5,794)	Frank's International NV	Goldman Sachs	(232)
(1,118)	GrandVision NV	Goldman Sachs	(733)
(272)	Heineken Holding NV	Bank of America Merrill Lynch	1,468
(488)	Heineken Holding NV	Goldman Sachs	2,572
94	Heineken NV	Bank of America Merrill Lynch	(75)
83	IMCD NV	Goldman Sachs	319
122	IMCD NV	Morgan Stanley	541
(2,163)	ING Groep NV	Morgan Stanley	258
(529)	Intertrust NV	Bank of America Merrill Lynch	(165)
(267)	Intertrust NV	Goldman Sachs	(78)
(283)	JDE Peet's BV	Bank of America Merrill Lynch	326
(767)	JDE Peet's BV	Goldman Sachs	359
(2,300)	JDE Peet's BV	Morgan Stanley	3,161
151	Just Eat Takeaway.com NV	Bank of America Merrill Lynch	(333)
15	Just Eat Takeaway.com NV	Goldman Sachs	(42)
296	Just Eat Takeaway.com NV	Morgan Stanley	263
(362)	Koninklijke Ahold Delhaize NV	Bank of America Merrill Lynch	(379)
(1,331)	Koninklijke Ahold Delhaize NV	Goldman Sachs	(1,629)
(4,623)	Koninklijke Ahold Delhaize NV	Morgan Stanley	(4,880)
2,927	Koninklijke BAM Groep NV	Bank of America Merrill Lynch	(1,077)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	オランダ(続き)		
7,348	Koninklijke BAM Groep NV	Goldman Sachs	(1,065)
(13,257)	Koninklijke KPN NV	Morgan Stanley	(477)
1,123	Koninklijke Vopak NV	Goldman Sachs	603
1,152	Koninklijke Vopak NV	Morgan Stanley	442
(312)	LyondellBasell Industries NV 'A'	Goldman Sachs	136
(1,118)	NN Group NV	Bank of America Merrill Lynch	(19)
230	NSI NV (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	372
980	NSI NV (REIT)	Goldman Sachs	1,587
(538)	OCI NV	Bank of America Merrill Lynch	(923)
(725)	OCI NV	Goldman Sachs	(1,244)
(753)	OCI NV	Morgan Stanley	(551)
2,393	Playa Hotels & Resorts NV	Bank of America Merrill Lynch	933
925	PostNL NV	Bank of America Merrill Lynch	104
65	Prosus NV	Bank of America Merrill Lynch	278
517	Prosus NV	Goldman Sachs	(713)
388	Prosus NV	Morgan Stanley	67
(339)	Randstad NV	Morgan Stanley	(1,139)
106	RHI Magnesita NV	Bank of America Merrill Lynch	187
399	RHI Magnesita NV	Goldman Sachs	704
1,801	SBM Offshore NV	Goldman Sachs	651
1,117	SBM Offshore NV	Morgan Stanley	(67)
(107)	Shop Apotheke Europe NV	Goldman Sachs	(63)
192	SIF Holding NV	Goldman Sachs	212
23	Signify NV	Bank of America Merrill Lynch	(12)
891	Signify NV	Morgan Stanley	214
296	TKH Group NV	Goldman Sachs	46
102	uniQure NV	Bank of America Merrill Lynch	316
289	uniQure NV	Goldman Sachs	57
850	Wereldhave NV (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	551
604	Wolters Kluwer NV	Goldman Sachs	487
			(22,406)
	ニュージーランド		
1,219	a2 Milk Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	61
(7,711)	a2 Milk Co Ltd	Morgan Stanley	(2,119)
6,588	Air New Zealand Ltd	Bank of America Merrill Lynch	812
6,494	Auckland International Airport Ltd	Bank of America Merrill Lynch	585
615	Chorus Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(282)
(1,131)	Contact Energy Ltd	Morgan Stanley	(40)
85	Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	117
(16,038)	Fletcher Building Ltd	Morgan Stanley	(452)
28,860	Goodman Property Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(407)
1,427	Infratil Ltd	Bank of America Merrill Lynch	123
(47,300)	Kiwi Property Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3,999
(659)	Mercury NZ Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(54)
(2,822)	Meridian Energy Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(259)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	ニュージーランド(続き)		
(7,643)	Meridian Energy Ltd	Morgan Stanley	(2,477)
12,304	Pushpay Holdings Ltd	Goldman Sachs	(867)
585	Restaurant Brands New Zealand Ltd	Bank of America Merrill Lynch	-
358	Restaurant Brands New Zealand Ltd	Goldman Sachs	-
(1,530)	Ryman Healthcare Ltd	Bank of America Merrill Lynch	884
4,202	SKYCITY Entertainment Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(36)
2,615	Spark New Zealand Ltd	Goldman Sachs	(193)
7,566	Spark New Zealand Ltd	Morgan Stanley	240
(3,364)	Summerset Group Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	142
(11,971)	Synlait Milk Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,096
(450)	Xero Ltd	Goldman Sachs	(1,863)
1,352	Z Energy Ltd	Bank of America Merrill Lynch	10
10,261	Z Energy Ltd	Goldman Sachs	(1,083)
			<u>(2,063)</u>
	ノルウェー		
(87)	Adevinta ASA	Bank of America Merrill Lynch	(88)
(282)	Adevinta ASA	Goldman Sachs	(222)
(41)	Adevinta ASA	Morgan Stanley	(28)
114	Aker ASA 'A'	Bank of America Merrill Lynch	66
33	Aker ASA 'A'	Morgan Stanley	16
653	Aker BP ASA	Morgan Stanley	141
(48)	Atea ASA	Bank of America Merrill Lynch	(30)
(2,189)	Atea ASA	Goldman Sachs	(1,144)
255	Austevoll Seafood ASA	Bank of America Merrill Lynch	(81)
2,351	Austevoll Seafood ASA	Goldman Sachs	(748)
76	Bonheur ASA	Goldman Sachs	40
1,185	Borregaard ASA	Goldman Sachs	(458)
(693)	Crayon Group Holding ASA	Bank of America Merrill Lynch	82
(247)	Crayon Group Holding ASA	Goldman Sachs	45
557	DNB ASA	Bank of America Merrill Lynch	(170)
3,984	Elkem ASA	Bank of America Merrill Lynch	1,295
3,172	Equinor ASA	Bank of America Merrill Lynch	(1,946)
2,021	Equinor ASA	Goldman Sachs	1,104
153	Equinor ASA	Morgan Stanley	27
(2,117)	Europris ASA	Bank of America Merrill Lynch	(53)
(4,784)	Europris ASA	Goldman Sachs	(147)
(333)	Fjordkraft Holding ASA	Bank of America Merrill Lynch	11
(1,340)	Fjordkraft Holding ASA	Goldman Sachs	(168)
613	Leroy Seafood Group ASA	Bank of America Merrill Lynch	(68)
883	Mowi ASA	Bank of America Merrill Lynch	291
(2,281)	Norsk Hydro ASA	Goldman Sachs	(607)
(1,727)	Norsk Hydro ASA	Morgan Stanley	(12)
281	Norway Royal Salmon ASA	Bank of America Merrill Lynch	(460)
498	Norway Royal Salmon ASA	Goldman Sachs	(815)
1,761	Norwegian Finans Holding ASA	Bank of America Merrill Lynch	219

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
ノルウェー(続き)			
985	Norwegian Finans Holding ASA	Goldman Sachs	10
(916)	Ocean Yield ASA	Goldman Sachs	51
797	Orkla ASA	Bank of America Merrill Lynch	(268)
2,251	Orkla ASA	Goldman Sachs	(323)
9,834	Orkla ASA	Morgan Stanley	(804)
272	Sbanken ASA	Bank of America Merrill Lynch	28
1,572	Sbanken ASA	Goldman Sachs	161
(641)	Scatec ASA	Bank of America Merrill Lynch	(2,279)
(280)	Scatec ASA	Goldman Sachs	(1,362)
(1,242)	Scatec ASA	Morgan Stanley	(3,246)
251	Schibsted ASA 'A'	Morgan Stanley	20
443	Schibsted ASA 'B'	Bank of America Merrill Lynch	866
318	Schibsted ASA 'B'	Goldman Sachs	246
257	Schibsted ASA 'B'	Morgan Stanley	228
1,177	SpareBank 1 Nord Norge	Bank of America Merrill Lynch	124
3,715	SpareBank 1 Nord Norge	Goldman Sachs	241
737	SpareBank 1 SMN	Bank of America Merrill Lynch	92
9,584	SpareBank 1 SMN	Goldman Sachs	883
3,340	SpareBank 1 SR-Bank ASA	Bank of America Merrill Lynch	575
6,024	SpareBank 1 SR-Bank ASA	Goldman Sachs	643
2,148	Storebrand ASA	Morgan Stanley	68
3,741	Telenor ASA	Bank of America Merrill Lynch	(1,403)
943	Telenor ASA	Goldman Sachs	(218)
2,150	Telenor ASA	Morgan Stanley	(452)
301	TOMRA Systems ASA	Goldman Sachs	453
(2,390)	Veidekke ASA	Goldman Sachs	(760)
(1,199)	Wallenius Wilhelmsen ASA	Bank of America Merrill Lynch	54
(19)	Yara International ASA	Goldman Sachs	17
(1,464)	Yara International ASA	Morgan Stanley	1,114
			<u>(9,149)</u>
パナマ			
(196)	Norstar Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	9
(7)	Norstar Holdings Inc	Goldman Sachs	(5)
			<u>4</u>
パプアニューギニア			
1,359	Oil Search Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(90)
12,769	Oil Search Ltd	Goldman Sachs	(1,131)
1,264	Oil Search Ltd	Morgan Stanley	(65)
			<u>(1,286)</u>
パラグアイ			
(325)	EVERTEC Inc	Bank of America Merrill Lynch	183
38	EVERTEC Inc	Goldman Sachs	28
			<u>211</u>
ポルトガル			
(1,689)	Altri SGPS SA	Bank of America Merrill Lynch	(1,029)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	ポルトガル(続き)		
(14,048)	Altri SGPS SA	Goldman Sachs	(8,560)
(316)	Corticeira Amorim SGPS SA	Bank of America Merrill Lynch	(46)
(2,327)	CTT-Correios de Portugal SA	Bank of America Merrill Lynch	(412)
9,821	EDP - Energias de Portugal SA	Goldman Sachs	436
9,194	EDP - Energias de Portugal SA	Morgan Stanley	684
3,091	Navigator Co SA	Bank of America Merrill Lynch	734
13,205	Navigator Co SA	Goldman Sachs	3,136
(797)	NOS SGPS SA	Bank of America Merrill Lynch	(350)
(4,226)	NOS SGPS SA	Goldman Sachs	(1,259)
34	REN - Redes Energeticas Nacionais SGPS SA	Bank of America Merrill Lynch	(1)
38,513	REN - Redes Energeticas Nacionais SGPS SA	Goldman Sachs	(1,386)
(438)	Semapa-Sociedade de Investimento e Gestao	Bank of America Merrill Lynch	(557)
			<u>(8,610)</u>
	プエルトリコ		
89	Popular Inc	Bank of America Merrill Lynch	(82)
27	Popular Inc	Goldman Sachs	(52)
(1,038)	Triple-S Management Corp 'B'	Goldman Sachs	955
			<u>821</u>
	シンガポール		
77	Ascendas Real Estate Investment Trust (REIT)	Goldman Sachs	1
21,000	Ascendas Real Estate Investment Trust (REIT)	Morgan Stanley	(942)
891	Ascendas Real Estate Investment Trust (REIT)	Morgan Stanley	(7)
(41,600)	Ascott Residence Trust (Unit)	Bank of America Merrill Lynch	(1,193)
(2,100)	Ascott Residence Trust (Unit)	Morgan Stanley	(71)
700	CapitaLand Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(10)
4,900	CapitaLand Ltd	Morgan Stanley	(92)
3,800	CapitaLand Mall Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(127)
3,200	CapitaLand Mall Trust (REIT)	Goldman Sachs	(102)
200	City Developments Ltd	Bank of America Merrill Lynch	60
2,100	City Developments Ltd	Goldman Sachs	628
500	City Developments Ltd	Morgan Stanley	(37)
(9,300)	ComfortDelGro Corp Ltd	Morgan Stanley	-
(300)	DBS Group Holdings Ltd	Goldman Sachs	37
(9,100)	DBS Group Holdings Ltd	Morgan Stanley	(885)
652	Flex Ltd	Bank of America Merrill Lynch	228
480	Flex Ltd	Morgan Stanley	29
12,600	Frasers Centrepoint Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(174)
16,200	Frasers Centrepoint Trust (REIT)	Goldman Sachs	44
15,000	Frasers Logistics & Commercial Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	1,122
15,100	Frasers Logistics & Commercial Trust (REIT)	Goldman Sachs	1,129

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	シンガポール(続き)		
36,100	Frasers Logistics & Commercial Trust (REIT)	Morgan Stanley	1,889
(22,200)	Genting Singapore Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(223)
(103,200)	Genting Singapore Ltd	Morgan Stanley	1,157
(10,300)	Hutchison Port Holdings Trust (Unit)	Morgan Stanley	15
7,700	Jardine Cycle & Carriage Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3,339)
200	Jardine Cycle & Carriage Ltd	Goldman Sachs	(303)
700	Jardine Cycle & Carriage Ltd	Morgan Stanley	(1,187)
251	Kenon Holdings Ltd	Goldman Sachs	113
4,100	Keppel DC (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(260)
5,500	Keppel DC (REIT)	Morgan Stanley	(275)
900	Mapletree Commercial Trust (REIT)	Morgan Stanley	(29)
1,800	Mapletree Industrial Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(97)
4,300	Mapletree Industrial Trust (REIT)	Goldman Sachs	(237)
2,700	Mapletree Industrial Trust (REIT)	Morgan Stanley	(141)
8,500	Mapletree Logistics Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(89)
35,600	Mapletree Logistics Trust (REIT)	Goldman Sachs	(331)
17,000	Mapletree Logistics Trust (REIT)	Morgan Stanley	(127)
9,800	Mapletree North Asia Commercial Trust (REIT)	Morgan Stanley	(245)
12,100	NetLink NBN Trust (Unit)	Goldman Sachs	(66)
20,000	Olam International Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,944
32,000	Olam International Ltd	Goldman Sachs	3,110
7,500	Olam International Ltd	Morgan Stanley	280
(600)	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(107)
(5,300)	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	Goldman Sachs	(1,466)
(8,100)	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	Morgan Stanley	455
(5,200)	Parkway Life Real Estate Investment Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	39
2,900	SATS Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(13)
6,200	SATS Ltd	Goldman Sachs	166
1,100	SATS Ltd	Morgan Stanley	49
(27,600)	Sembcorp Industries Ltd	Goldman Sachs	(2,773)
78,500	Sembcorp Marine Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,844
114,800	Sembcorp Marine Ltd	Goldman Sachs	2,809
118,800	Sembcorp Marine Ltd	Morgan Stanley	1,066
5,900	Singapore Airlines Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,073
22,400	Singapore Post Ltd	Bank of America Merrill Lynch	167
73,500	Singapore Post Ltd	Goldman Sachs	550
122,600	Singapore Post Ltd	Morgan Stanley	(1,833)
22,000	Singapore Press Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,632
3,800	Singapore Technologies Engineering Ltd	Goldman Sachs	227
(13,500)	Singapore Telecommunications Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(808)
(29,100)	Singapore Telecommunications Ltd	Morgan Stanley	1,523
(8,600)	StarHub Ltd	Morgan Stanley	257
(10,900)	Suntec Real Estate Investment Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(82)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	シンガポール(続き)		
(3,200)	UOL Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	140
(4,900)	UOL Group Ltd	Goldman Sachs	24
(3,500)	UOL Group Ltd	Morgan Stanley	602
1,900	Venture Corp Ltd	Morgan Stanley	(696)
(900)	Wilmar International Ltd	Goldman Sachs	85
(1,000)	Wing Tai Holdings Ltd	Morgan Stanley	(7)
			8,120
	スペイン		
62	Acciona SA	Bank of America Merrill Lynch	584
168	Acciona SA	Goldman Sachs	1,548
46	Acciona SA	Morgan Stanley	397
(333)	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	Goldman Sachs	(443)
(1,250)	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	Morgan Stanley	(1,065)
(1,574)	Aedas Homes SA	Goldman Sachs	(378)
(85)	Aena SME SA	Morgan Stanley	602
(1,246)	Almirall SA	Morgan Stanley	(209)
(743)	Atresmedia Corp de Medios de Comunicacion SA	Bank of America Merrill Lynch	(2)
44,326	Banco de Sabadell SA	Goldman Sachs	(4,461)
75,890	Banco de Sabadell SA	Morgan Stanley	(6,919)
3,108	Banco Santander SA	Bank of America Merrill Lynch	(32)
18,489	Banco Santander SA	Goldman Sachs	2,572
14,311	Banco Santander SA	Morgan Stanley	1,725
(5,336)	Banco Santander SA	Morgan Stanley	(28)
1,638	Bankinter SA	Goldman Sachs	(196)
1,699	Bankinter SA	Morgan Stanley	(315)
776	CIE Automotive SA	Morgan Stanley	335
252	Construcciones y Auxiliar de Ferrocarriles SA	Goldman Sachs	725
(80)	Corp Financiera Alba SA	Bank of America Merrill Lynch	(369)
1,786	Ebro Foods SA	Goldman Sachs	2,271
(262)	Enagas SA	Goldman Sachs	(151)
(626)	Enagas SA	Morgan Stanley	(203)
(2,028)	Endesa SA	Bank of America Merrill Lynch	487
(444)	Euskaltel SA	Goldman Sachs	(468)
(2,622)	Faes Farma SA	Goldman Sachs	(267)
(783)	Ferrovial SA	Morgan Stanley	(85)
(7)	Ferrovial SA	Morgan Stanley	(197)
330	Fluidra SA	Goldman Sachs	491
3,834	Gestamp Automocion SA	Goldman Sachs	1,242
(85)	Grupo Catalana Occidente SA	Bank of America Merrill Lynch	(117)
(1,856)	Grupo Empresarial San Jose SA	Goldman Sachs	(924)
321	Indra Sistemas SA	Bank of America Merrill Lynch	(36)
1,976	Industria de Diseno Textil SA	Morgan Stanley	(722)
(1,286)	Inmobiliaria Colonial Socimi SA (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	679

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
スペイン(続き)			
(562)	Lar Espana Real Estate Socimi SA (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(465)
(240)	Lar Espana Real Estate Socimi SA (Reit)	Goldman Sachs	(199)
7,820	Mapfre SA	Morgan Stanley	403
3,599	Mediaset Espana Comunicacion SA	Bank of America Merrill Lynch	4
951	Mediaset Espana Comunicacion SA	Goldman Sachs	(55)
2,677	Melia Hotels International SA	Goldman Sachs	1,124
(870)	Metrovacesa SA	Bank of America Merrill Lynch	83
(3,025)	Metrovacesa SA	Goldman Sachs	290
(69)	Miquel y Costas & Miquel SA	Goldman Sachs	8
737	Naturgy Energy Group SA	Goldman Sachs	264
(270)	Neinor Homes SA	Bank of America Merrill Lynch	45
(1,376)	Neinor Homes SA	Goldman Sachs	231
(1,118)	Prosegur Cia de Seguridad SA	Goldman Sachs	38
(490)	Red Electrica Corp SA	Goldman Sachs	(376)
3,557	Sacyr SA	Goldman Sachs	93
(3,234)	Sacyr SA	Goldman Sachs	2
(750)	Solaria Energia y Medio Ambiente SA	Morgan Stanley	(1,242)
(264)	Talgo SA	Bank of America Merrill Lynch	(19)
775	Tecnicas Reunidas SA	Goldman Sachs	(82)
(7,246)	Telefonica SA	Morgan Stanley	(3,433)
(139)	Viscofan SA	Goldman Sachs	158
			(7,057)
国際機関(Supranational)			
14,000	HKT Trust & HKT Ltd (Unit)	Bank of America Merrill Lynch	(72)
11,000	HKT Trust & HKT Ltd (Unit)	Morgan Stanley	(114)
417	Unibail-Rodamco-Westfield (REIT)	Morgan Stanley	1,341
			1,155
スウェーデン			
341	AAK AB	Bank of America Merrill Lynch	(422)
137	AAK AB	Goldman Sachs	(275)
708	AAK AB	Morgan Stanley	(513)
1,515	AddTech AB 'B'	Goldman Sachs	(357)
524	AF Poyry AB	Bank of America Merrill Lynch	659
775	AF Poyry AB	Goldman Sachs	1,078
(160)	Alfa Laval AB	Bank of America Merrill Lynch	(3)
(1,169)	Alfa Laval AB	Morgan Stanley	669
(1,036)	Alimak Group AB	Goldman Sachs	73
(708)	Ambea AB	Bank of America Merrill Lynch	(17)
(2,625)	Ambea AB	Goldman Sachs	(62)
2,157	Atlas Copco AB 'A'	Morgan Stanley	(2,339)
343	Atlas Copco AB 'B'	Morgan Stanley	(311)
625	Atrium Ljungberg AB 'B'	Goldman Sachs	(177)
(1,959)	Attendo AB	Bank of America Merrill Lynch	143
(2,796)	Attendo AB	Goldman Sachs	204

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	スウェーデン(続き)		
(1,511)	Avanza Bank Holding AB	Goldman Sachs	(1,817)
1,823	Axfood AB	Bank of America Merrill Lynch	(431)
116	Axfood AB	Goldman Sachs	(69)
2,283	Axfood AB	Morgan Stanley	(458)
347	Betsson AB	Bank of America Merrill Lynch	225
3,397	Betsson AB	Goldman Sachs	2,202
3,996	Bilia AB 'A'	Goldman Sachs	(2,689)
624	Bonava AB 'B'	Goldman Sachs	(147)
(508)	Boozt AB	Goldman Sachs	(584)
(1,710)	Bravida Holding AB	Goldman Sachs	148
380	Bufab AB	Bank of America Merrill Lynch	1,407
24	Bufab AB	Goldman Sachs	8
83	Bure Equity AB	Bank of America Merrill Lynch	9
761	Bure Equity AB	Goldman Sachs	389
135	Camurus AB	Goldman Sachs	24
(507)	Castellum AB	Bank of America Merrill Lynch	12
(1,077)	Castellum AB	Goldman Sachs	327
(123)	Catena AB	Bank of America Merrill Lynch	145
115	Cellavision AB	Goldman Sachs	176
(380)	Cibus Nordic Real Estate AB	Bank of America Merrill Lynch	(91)
(812)	Cibus Nordic Real Estate AB	Goldman Sachs	(347)
1,393	Clas Ohlson AB 'B'	Goldman Sachs	119
(2,726)	Cloetta AB 'B'	Goldman Sachs	52
213	Collector AB	Bank of America Merrill Lynch	(17)
3,643	Collector AB	Goldman Sachs	(440)
(1,703)	Coor Service Management Holding AB	Goldman Sachs	(80)
(8)	Creades AB 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(10)
(141)	Creades AB 'A'	Goldman Sachs	(183)
363	Dios Fastigheter AB	Bank of America Merrill Lynch	156
2,706	Dios Fastigheter AB	Goldman Sachs	1,164
(47)	Duni AB	Bank of America Merrill Lynch	(66)
(314)	Duni AB	Goldman Sachs	(444)
(543)	Dustin Group AB	Bank of America Merrill Lynch	(128)
(5,370)	Dustin Group AB	Goldman Sachs	(1,331)
(4,386)	Electrolux AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	930
(1,038)	Electrolux AB 'B'	Goldman Sachs	232
(2,426)	Electrolux AB 'B'	Morgan Stanley	(143)
622	Electrolux Professional AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	277
923	Electrolux Professional AB 'B'	Goldman Sachs	266
1,032	Elekta AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	711
2,434	Elekta AB 'B'	Morgan Stanley	2,927
(674)	Embracer Group AB	Bank of America Merrill Lynch	654
(1,613)	Embracer Group AB	Goldman Sachs	(64)
(1,748)	Embracer Group AB	Morgan Stanley	(2,081)
2,134	Epiroc AB 'A'	Morgan Stanley	(485)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	スウェーデン(続き)		
(485)	EQT AB	Goldman Sachs	51
(203)	Evolution Gaming Group AB	Morgan Stanley	(1,562)
(82)	Fabege AB	Goldman Sachs	(1)
(1,012)	Fabege AB	Morgan Stanley	(471)
(7,491)	Fingerprint Cards AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(327)
(486)	Getinge AB 'B'	Morgan Stanley	(74)
(1,287)	Granges AB	Bank of America Merrill Lynch	698
(1,287)	Granges AB	Bank of America Merrill Lynch	(1,974)
(975)	Granges AB	Goldman Sachs	529
(975)	Granges AB	Goldman Sachs	(1,495)
(259)	Hennes & Mauritz AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	36
(652)	Hexagon AB 'B'	Morgan Stanley	(968)
(3,964)	Hexpol AB	Morgan Stanley	(794)
1,164	HMS Networks AB	Goldman Sachs	1,647
(321)	Hufvudstaden AB 'A'	Bank of America Merrill Lynch	37
(486)	Hufvudstaden AB 'A'	Goldman Sachs	22
(5,107)	Husqvarna AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(277)
(192)	Husqvarna AB 'B'	Morgan Stanley	(15)
185	ICA Gruppen AB	Bank of America Merrill Lynch	124
596	ICA Gruppen AB	Goldman Sachs	122
570	ICA Gruppen AB	Morgan Stanley	566
(1,646)	Industrivarden AB 'C'	Bank of America Merrill Lynch	(1,173)
(314)	Industrivarden AB 'C'	Goldman Sachs	(158)
(121)	Industrivarden AB 'C'	Morgan Stanley	(83)
297	Indutrade AB	Morgan Stanley	854
113	Instalco AB	Goldman Sachs	35
621	Intrum AB	Bank of America Merrill Lynch	(2,372)
704	Intrum AB	Goldman Sachs	(2,332)
483	Intrum AB	Morgan Stanley	(228)
(911)	Investment AB Latour 'B'	Morgan Stanley	(558)
(212)	Inwido AB	Bank of America Merrill Lynch	(55)
(1,444)	Inwido AB	Goldman Sachs	(375)
(124)	JM AB	Bank of America Merrill Lynch	100
(77)	JM AB	Goldman Sachs	103
(508)	Karo Pharma AB	Goldman Sachs	(85)
454	Kinnevik AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	628
184	L E Lundbergforetagen AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(156)
270	L E Lundbergforetagen AB 'B'	Morgan Stanley	(280)
57	Lifco AB 'B'	Morgan Stanley	175
(1,341)	Lindab International AB	Goldman Sachs	553
169	Loomis AB	Bank of America Merrill Lynch	179
902	Loomis AB	Goldman Sachs	595
1,321	Loomis AB	Morgan Stanley	716
(1,004)	Lundin Energy AB	Bank of America Merrill Lynch	(83)
(25)	Mekonomen AB	Bank of America Merrill Lynch	15

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	スウェーデン(続き)		
(2,335)	Mekonomen AB	Goldman Sachs	1,404
485	Modern Times Group MTG AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(242)
1,339	Modern Times Group MTG AB 'B'	Goldman Sachs	268
(764)	Munters Group AB	Bank of America Merrill Lynch	(72)
(1,522)	Munters Group AB	Goldman Sachs	(144)
(127)	Mycronic AB	Goldman Sachs	(76)
243	NCC AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(90)
(335)	Nibe Industrier AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(77)
(382)	Nibe Industrier AB 'B'	Goldman Sachs	(353)
958	Nobia AB	Goldman Sachs	37
(739)	Nobina AB	Bank of America Merrill Lynch	(174)
(169)	Nolato AB 'B'	Goldman Sachs	(240)
(68)	Nordic Entertainment Group AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	98
1,230	Nyfosa AB	Bank of America Merrill Lynch	7
1,912	Nyfosa AB	Goldman Sachs	46
1,665	Padox AB	Goldman Sachs	645
282	Padox AB	Morgan Stanley	82
102	Paradox Interactive AB	Bank of America Merrill Lynch	(70)
166	Paradox Interactive AB	Goldman Sachs	187
(494)	PowerCell Sweden AB	Bank of America Merrill Lynch	(1,363)
(841)	PowerCell Sweden AB	Goldman Sachs	(1,424)
(387)	PowerCell Sweden AB	Morgan Stanley	(91)
(12)	Ratos AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	-
(1,701)	Ratos AB 'B'	Goldman Sachs	(28)
1,052	Recipharm AB 'B'	Goldman Sachs	2,294
526	Resurs Holding AB	Bank of America Merrill Lynch	(3)
6,249	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB	Bank of America Merrill Lynch	(59)
504	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB	Goldman Sachs	(5)
4,371	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB	Morgan Stanley	(14)
(2,444)	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 'D'	Goldman Sachs	125
(512)	Scandi Standard AB	Goldman Sachs	(43)
2,855	Scandic Hotels Group AB	Bank of America Merrill Lynch	(51)
(6,032)	Securitas AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	3,377
(3,947)	Securitas AB 'B'	Goldman Sachs	2,210
(3,511)	Securitas AB 'B'	Morgan Stanley	1,097
(164)	Sinch AB	Goldman Sachs	(2,780)
2,403	Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A'	Morgan Stanley	181
(1,246)	Skanska AB 'B'	Morgan Stanley	235
4,640	SkiStar AB	Goldman Sachs	(2,461)
8,127	SSAB AB 'A'	Bank of America Merrill Lynch	783
18,624	SSAB AB 'A'	Goldman Sachs	1,120
24,784	SSAB AB 'A'	Morgan Stanley	3,740
(2,409)	SSAB AB 'B'	Goldman Sachs	(179)
(126)	Stillfront Group AB	Bank of America Merrill Lynch	(1,069)
(107)	Stillfront Group AB	Morgan Stanley	(1,009)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	スウェーデン(続き)		
1,320	Svenska Cellulosa AB SCA 'B'	Morgan Stanley	(91)
8,717	Svenska Handelsbanken AB 'A'	Morgan Stanley	1,716
37	Sweco AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(8)
1,083	Sweco AB 'B'	Goldman Sachs	(243)
681	Swedbank AB 'A'	Bank of America Merrill Lynch	59
737	Swedbank AB 'A'	Goldman Sachs	(10)
51	Swedish Match AB	Bank of America Merrill Lynch	(99)
42	Swedish Match AB	Goldman Sachs	96
905	Swedish Orphan Biovitrum AB	Bank of America Merrill Lynch	312
1,443	Tele2 AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	638
1,412	Tele2 AB 'B'	Morgan Stanley	558
(1,228)	Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(168)
(6,417)	Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B'	Goldman Sachs	(643)
207	Thule Group AB	Goldman Sachs	41
218	Troax Group AB	Bank of America Merrill Lynch	98
2,269	Troax Group AB	Goldman Sachs	1,016
(1,971)	Volvo AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	483
(738)	Volvo AB 'B'	Morgan Stanley	183
2,996	Wallenstam AB	Goldman Sachs	(1,201)
			<u>(750)</u>
	スイス		
165	Adecco Group AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	599
406	Adecco Group AG RegS	Morgan Stanley	1,213
(29)	Allreal Holding AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	99
(33)	Allreal Holding AG RegS	Goldman Sachs	4
(22)	ALSO Holding AG RegS	Goldman Sachs	(263)
(40)	APG SGA SA	Bank of America Merrill Lynch	(836)
(6)	APG SGA SA	Goldman Sachs	(125)
260	Arbonia AG	Bank of America Merrill Lynch	63
182	Arbonia AG	Goldman Sachs	(2)
(26)	Banque Cantonale Vaudoise RegS	Bank of America Merrill Lynch	112
(13)	Banque Cantonale Vaudoise RegS	Goldman Sachs	45
(271)	Banque Cantonale Vaudoise RegS	Morgan Stanley	1,049
1	Barry Callebaut AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	(64)
1	Belimo Holding AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(339)
4	Belimo Holding AG Reg	Goldman Sachs	(524)
(16)	Bell Food Group AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(204)
518	BKW AG	Goldman Sachs	(630)
275	Bobst Group SA RegS	Bank of America Merrill Lynch	913
486	Bobst Group SA RegS	Goldman Sachs	1,613
24	Bossard Holding AG Reg	Goldman Sachs	356
(48)	Bucher Industries AG Reg	Goldman Sachs	(542)
(95)	Burckhardt Compression Holding AG	Goldman Sachs	(1,156)
92	Cembra Money Bank AG	Bank of America Merrill Lynch	(458)
31	Cembra Money Bank AG	Goldman Sachs	(118)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	スイス(続き)		
20	Cembra Money Bank AG	Morgan Stanley	(75)
(1)	Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	Morgan Stanley	(6)
66	Chubb Ltd	Goldman Sachs	140
379	Chubb Ltd	Morgan Stanley	(152)
4,598	Cie Financiere Richemont SA	Morgan Stanley	967
97	Cie Financiere Richemont SA RegS	Bank of America Merrill Lynch	(54)
2,299	Cie Financiere Richemont SA RegS	Morgan Stanley	(560)
150	Clariant AG RegS	Morgan Stanley	40
(451)	Coca-Cola HBC AG	Bank of America Merrill Lynch	669
(866)	Coca-Cola HBC AG	Morgan Stanley	718
(112)	Comet Holding AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	(3,618)
(69)	Comet Holding AG RegS	Goldman Sachs	(2,192)
(20)	Conzzeta AG RegS	Goldman Sachs	(266)
394	Credit Suisse Group AG RegS	Goldman Sachs	259
3,538	Credit Suisse Group AG RegS	Morgan Stanley	920
(50)	dormakaba Holding AG	Goldman Sachs	(1,676)
110	Dufry AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	319
236	Dufry AG RegS	Morgan Stanley	856
(2,527)	EFG International AG	Bank of America Merrill Lynch	(140)
(1,945)	EFG International AG	Goldman Sachs	(108)
(11)	Emmi AG RegS	Goldman Sachs	102
(66)	EMS-Chemie Holding AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	(1,278)
(132)	EMS-Chemie Holding AG RegS	Goldman Sachs	(2,617)
(4)	EMS-Chemie Holding AG RegS	Morgan Stanley	(71)
(311)	Flughafen Zurich AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	34
(49)	Flughafen Zurich AG RegS	Goldman Sachs	5
7	Forbo Holding AG Reg	Goldman Sachs	(13)
(46)	Galenica AG	Bank of America Merrill Lynch	14
(205)	Galenica AG	Goldman Sachs	414
(33)	Galenica AG	Morgan Stanley	4
(1,747)	GAM Holding AG	Goldman Sachs	(197)
(210)	Garmin Ltd	Goldman Sachs	(2)
(548)	Garmin Ltd	Morgan Stanley	(871)
5	Geberit AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	(64)
42	Geberit AG RegS	Goldman Sachs	(539)
5	Georg Fischer AG Reg	Goldman Sachs	138
22	Givaudan SA RegS	Bank of America Merrill Lynch	1,497
20	Givaudan SA RegS	Goldman Sachs	1,358
30	Givaudan SA RegS	Morgan Stanley	3,352
(1)	Gurit Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	(304)
(22)	Gurit Holding AG	Goldman Sachs	(6,693)
(187)	Helvetia Holding AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	72
(188)	Helvetia Holding AG Reg	Goldman Sachs	161
(295)	Helvetia Holding AG Reg	Morgan Stanley	261
(255)	Huber + Suhner AG RegS	Goldman Sachs	(197)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	スイス(続き)		
198	Implenia AG Reg	Goldman Sachs	193
3	Interroll Holding AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(7)
131	Kardex AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	(89)
113	Kardex AG RegS	Goldman Sachs	(350)
17	Komax Holding AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	222
113	Kuehne + Nagel International AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	1,651
119	Kuehne + Nagel International AG RegS	Goldman Sachs	1,952
208	Kuehne + Nagel International AG RegS	Morgan Stanley	1,649
(631)	LafargeHolcim Ltd RegS	Bank of America Merrill Lynch	(1,019)
(76)	LafargeHolcim Ltd RegS	Goldman Sachs	(28)
(73)	LafargeHolcim Ltd RegS	Morgan Stanley	(113)
173	Landis+Gyr Group AG	Goldman Sachs	(340)
3	LEM Holding SA Reg	Goldman Sachs	(106)
(409)	Leonteq AG	Bank of America Merrill Lynch	1,199
(204)	Leonteq AG	Goldman Sachs	598
(325)	Logitech International SA RegS	Bank of America Merrill Lynch	(1,830)
(306)	Logitech International SA RegS	Goldman Sachs	(1,591)
(111)	Logitech International SA RegS	Morgan Stanley	(493)
52	Lonza Group AG RegS	Goldman Sachs	(1,139)
183	Lonza Group AG RegS	Morgan Stanley	3,906
(833)	Mobilezone Holding AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	85
(2,015)	Mobilezone Holding AG RegS	Goldman Sachs	201
(39)	Mobimo Holding AG Reg	Goldman Sachs	264
14	Nestle SA RegS	Bank of America Merrill Lynch	(4)
299	Nestle SA RegS	Goldman Sachs	(896)
21	Nestle SA RegS	Morgan Stanley	8
(741)	Novartis AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	(2,156)
(64)	Novartis AG RegS	Goldman Sachs	(190)
(1,371)	Novartis AG RegS	Morgan Stanley	(2,152)
184	OC Oerlikon Corp AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	132
1,253	OC Oerlikon Corp AG Reg	Morgan Stanley	492
(731)	Orascom Development Holding AG	Goldman Sachs	275
(12)	Orior AG	Bank of America Merrill Lynch	11
(234)	Orior AG	Goldman Sachs	200
(4)	Partners Group Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	(202)
(6)	Partners Group Holding AG	Goldman Sachs	(234)
(31)	Partners Group Holding AG	Morgan Stanley	(1,557)
22	Rieter Holding AG Reg	Goldman Sachs	92
(445)	Roche Holding AG	Morgan Stanley	369
(237)	Schindler Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	(734)
(308)	Schindler Holding AG	Goldman Sachs	(954)
8	Schindler Holding AG RegS	Goldman Sachs	(12)
48	Schindler Holding AG RegS	Morgan Stanley	(223)
(4)	Schweiter Technologies AG	Bank of America Merrill Lynch	(319)
(28)	Schweiter Technologies AG	Goldman Sachs	(1,670)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	スイス(続き)		
355	Sensirion Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	794
438	Sensirion Holding AG	Goldman Sachs	1,115
(44)	SFS Group AG	Goldman Sachs	(22)
(3)	SGS SA RegS	Morgan Stanley	40
(10)	Siegfried Holding AG Reg	Goldman Sachs	(269)
(7)	Siegfried Holding AG Reg	Morgan Stanley	(102)
83	Sika AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	83
1,759	Sika AG RegS	Morgan Stanley	(1,362)
237	Softwareone Holding AG	Goldman Sachs	52
1	St Galler Kantonalbank AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	(6)
31	St Galler Kantonalbank AG RegS	Goldman Sachs	(86)
(138)	Sulzer AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	96
(32)	Sulzer AG Reg	Goldman Sachs	(75)
(61)	Sulzer AG Reg	Morgan Stanley	14
(12)	Swiss Life Holding AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	(113)
(23)	Swiss Life Holding AG RegS	Goldman Sachs	(323)
(153)	Swiss Life Holding AG RegS	Morgan Stanley	(694)
(172)	Swiss Prime Site AG RegS	Goldman Sachs	542
534	Swiss Re AG	Morgan Stanley	(71)
(200)	Swissquote Group Holding SA Reg	Goldman Sachs	(457)
(169)	TE Connectivity Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(539)
(279)	TE Connectivity Ltd	Goldman Sachs	(910)
(372)	TE Connectivity Ltd	Morgan Stanley	(498)
19	Tecan Group AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(223)
19	Tecan Group AG Reg	Morgan Stanley	(84)
(3,336)	Transocean Ltd	Goldman Sachs	(2,685)
(59)	TX Group AG	Goldman Sachs	(509)
(833)	UBS Group AG RegS	Goldman Sachs	222
(5,968)	UBS Group AG RegS	Morgan Stanley	1,816
136	Valiant Holding AG RegS	Goldman Sachs	(271)
(101)	VAT Group AG	Bank of America Merrill Lynch	(1,173)
(78)	VAT Group AG	Goldman Sachs	(906)
(90)	Vetropack Holding AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	(448)
(209)	Vetropack Holding AG RegS	Goldman Sachs	(1,040)
(109)	Vifor Pharma AG	Bank of America Merrill Lynch	(1,116)
(221)	Vifor Pharma AG	Goldman Sachs	(2,234)
(202)	Vifor Pharma AG	Morgan Stanley	(2,592)
88	Vontobel Holding AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(126)
(79)	VZ Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	149
(122)	VZ Holding AG	Goldman Sachs	229
(27)	V-ZUG Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	(152)
(186)	V-ZUG Holding AG	Goldman Sachs	(1,049)
(60)	Zehnder Group AG	Goldman Sachs	7
(88)	Zur Rose Group AG	Morgan Stanley	(673)
(40)	Zurich Insurance Group AG	Goldman Sachs	(558)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	スイス(続き)		
(283)	Zurich Insurance Group AG	Morgan Stanley	256
			(29,448)
	英国		
234	3i Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	16
3,177	3i Group Plc	Goldman Sachs	(1,551)
3,370	3i Group Plc	Morgan Stanley	(383)
248	AB Dynamics Plc	Bank of America Merrill Lynch	(834)
404	AB Dynamics Plc	Goldman Sachs	(1,335)
689	Abcam Plc	Bank of America Merrill Lynch	306
616	Abcam Plc	Goldman Sachs	141
1,290	Abcam Plc	Morgan Stanley	431
(2,042)	AG Barr Plc	Goldman Sachs	198
771	Aggreko Plc	Goldman Sachs	(26)
109	AJ Bell Plc	Bank of America Merrill Lynch	(28)
7,244	AJ Bell Plc	Goldman Sachs	(1,841)
(152)	Anglo American Plc	Bank of America Merrill Lynch	1
(2,685)	Anglo American Plc	Goldman Sachs	(4,183)
3,587	Anglo Pacific Group Plc	Goldman Sachs	(278)
873	Antofagasta Plc	Bank of America Merrill Lynch	1,332
1,099	Antofagasta Plc	Goldman Sachs	1,677
(1,941)	A0 World Plc	Goldman Sachs	886
(886)	Ascential Plc	Goldman Sachs	-
889	Ashtead Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	134
232	Ashtead Group Plc	Goldman Sachs	122
128	Ashtead Group Plc	Morgan Stanley	(41)
(1,181)	Associated British Foods Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1,090)
(1,101)	Associated British Foods Plc	Goldman Sachs	(1,016)
(2,022)	Associated British Foods Plc	Morgan Stanley	(2,920)
(1,305)	Atlantica Sustainable Infrastructure Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1,210)
(253)	Atlantica Sustainable Infrastructure Plc	Goldman Sachs	(225)
(590)	Atlantica Sustainable Infrastructure Plc	Morgan Stanley	(1,109)
(65)	Atlassian Corp Plc 'A'	Goldman Sachs	(2,387)
(176)	Atlassian Corp Plc 'A'	Morgan Stanley	(2,663)
2,446	Auto Trader Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	333
348	Auto Trader Group Plc	Goldman Sachs	20
6,694	Auto Trader Group Plc	Morgan Stanley	877
(1,363)	Avast Plc	Goldman Sachs	(188)
190	AVEVA Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2,172)
147	AVEVA Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	2,195
50	AVEVA Group Plc	Goldman Sachs	(582)
38	AVEVA Group Plc	Goldman Sachs	567
287	AVEVA Group Plc	Morgan Stanley	(3,316)
223	AVEVA Group Plc	Morgan Stanley	3,330

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	英国(続き)		
(1,972)	Aviva Plc	Bank of America Merrill Lynch	(256)
(795)	Aviva Plc	Goldman Sachs	(81)
(11,311)	Aviva Plc	Morgan Stanley	(166)
2,756	Babcock International Group Plc	Goldman Sachs	1,359
3,710	Babcock International Group Plc	Morgan Stanley	387
(3,207)	BAE Systems Plc	Bank of America Merrill Lynch	(247)
(9,046)	BAE Systems Plc	Goldman Sachs	(514)
(13,910)	BAE Systems Plc	Morgan Stanley	3,274
(1,261)	Balfour Beatty Plc	Bank of America Merrill Lynch	(27)
550	Bank of Georgia Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	13
948	Bank of Georgia Group Plc	Goldman Sachs	167
(6,602)	Barclays Plc	Bank of America Merrill Lynch	53
(11,273)	Barclays Plc	Goldman Sachs	435
(63,644)	Barclays Plc	Morgan Stanley	2,860
(3,584)	Barratt Developments Plc	Morgan Stanley	1,122
1,035	Beazley Plc	Bank of America Merrill Lynch	(177)
3,150	Beazley Plc	Morgan Stanley	(185)
225	Bellway Plc	Goldman Sachs	(361)
535	Bellway Plc	Morgan Stanley	(1,502)
(1,404)	Biffa Plc	Bank of America Merrill Lynch	141
1,183	Big Yellow Group Plc (REIT)	Goldman Sachs	(174)
529	Bodycote Plc	Bank of America Merrill Lynch	(418)
2,410	Bodycote Plc	Goldman Sachs	(792)
(15,264)	BP Plc	Goldman Sachs	(911)
(18,984)	BP Plc	Morgan Stanley	(533)
(1,002)	Brewin Dolphin Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	(32)
(1,015)	British American Tobacco Plc	Bank of America Merrill Lynch	2,440
(120)	British American Tobacco Plc	Goldman Sachs	335
(333)	British American Tobacco Plc	Morgan Stanley	254
3,038	Britvic Plc	Morgan Stanley	(386)
(13,191)	BT Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	1,535
(8,182)	BT Group Plc	Goldman Sachs	496
(11,595)	BT Group Plc	Morgan Stanley	225
460	Burberry Group Plc	Goldman Sachs	1,159
1,084	Burberry Group Plc	Morgan Stanley	1,080
(2,136)	Calisen Plc	Goldman Sachs	(428)
(436)	Cardtronics Plc 'A'	Goldman Sachs	(1,077)
4,311	Central Asia Metals Plc	Bank of America Merrill Lynch	1,061
6,392	Central Asia Metals Plc	Goldman Sachs	1,573
(3,641)	Centrica Plc	Goldman Sachs	33
472	Ceres Power Holdings Plc	Goldman Sachs	653
373	Clinigen Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	67
(558)	Close Brothers Group Plc	Goldman Sachs	655
(1,298)	CMC Markets Plc	Goldman Sachs	(64)
(1,504)	Compass Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	855

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	英国(続き)		
(229)	Computacenter Plc	Bank of America Merrill Lynch	35
(916)	Computacenter Plc	Goldman Sachs	514
5,979	Countryside Properties Plc	Goldman Sachs	(322)
(379)	Cranswick Plc	Goldman Sachs	(98)
1,672	Crest Nicholson Holdings Plc	Goldman Sachs	(407)
430	Croda International Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1,047)
362	Croda International Plc	Goldman Sachs	(82)
592	Croda International Plc	Morgan Stanley	(1,083)
1,471	Cushman & Wakefield Plc	Goldman Sachs	603
(1,296)	CVS Group Plc	Goldman Sachs	(2,426)
(1,923)	Daily Mail & General Trust Plc	Goldman Sachs	(51)
571	Dechra Pharmaceuticals Plc	Bank of America Merrill Lynch	(489)
914	Dechra Pharmaceuticals Plc	Goldman Sachs	(502)
313	Dechra Pharmaceuticals Plc	Morgan Stanley	100
(432)	Derwent London Plc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	1,283
(1,053)	Derwent London Plc (REIT)	Goldman Sachs	3,126
(32)	Diageo Plc	Goldman Sachs	11
(2,374)	Diageo Plc	Morgan Stanley	302
(442)	Diploma Plc	Goldman Sachs	(324)
(980)	Direct Line Insurance Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	58
(4,546)	Direct Line Insurance Group Plc	Morgan Stanley	432
6,350	Diversified Gas & Oil Plc	Goldman Sachs	(221)
15,551	Dixons Carphone Plc	Goldman Sachs	(707)
48,472	Dixons Carphone Plc	Morgan Stanley	(1,735)
3,725	Domino 's Pizza Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(219)
712	Domino 's Pizza Group Plc	Goldman Sachs	(42)
734	Domino 's Pizza Group Plc	Morgan Stanley	(35)
(5,461)	DS Smith Plc	Morgan Stanley	(97)
1,075	Electrocomponents Plc	Bank of America Merrill Lynch	(79)
(1,310)	EMIS Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(70)
(564)	EMIS Group Plc	Goldman Sachs	(30)
(940)	Euromoney Institutional Investor Plc	Bank of America Merrill Lynch	(105)
(840)	Euromoney Institutional Investor Plc	Goldman Sachs	(83)
(705)	Evraz Plc	Bank of America Merrill Lynch	55
5,244	Ferrexpo Plc	Goldman Sachs	1,178
6	Fevertree Drinks Plc	Bank of America Merrill Lynch	(9)
38	Fevertree Drinks Plc	Morgan Stanley	(55)
(643)	Frasers Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	268
(537)	Frasers Group Plc	Goldman Sachs	104
(5,802)	Frasers Group Plc	Morgan Stanley	3,493
(256)	Fresnillo Plc	Bank of America Merrill Lynch	197
(746)	Fresnillo Plc	Goldman Sachs	503
(2,151)	Fresnillo Plc	Morgan Stanley	834
320	Frontier Developments Plc	Goldman Sachs	342
413	Future Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1,801)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	英国(続き)		
263	Future Plc	Morgan Stanley	(1,161)
286	Gamesys Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	111
422	Gamesys Group Plc	Goldman Sachs	395
3,805	Gates Industrial Corp Plc	Bank of America Merrill Lynch	1,455
2,517	Gates Industrial Corp Plc	Goldman Sachs	1,007
971	GB Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(43)
1,690	GB Group Plc	Goldman Sachs	474
(6,124)	GCP Student Living Plc (Reit)	Goldman Sachs	(78)
(1,783)	Go-Ahead Group Plc	Goldman Sachs	2,239
(3,782)	Grainger Plc	Goldman Sachs	896
(1,532)	Great Portland Estates Plc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	1,278
(543)	Great Portland Estates Plc (REIT)	Goldman Sachs	453
(977)	Halfords Group Plc	Goldman Sachs	31
2,522	Halma Plc	Bank of America Merrill Lynch	(399)
2,121	Halma Plc	Morgan Stanley	(1,105)
802	Hargreaves Lansdown Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1,603)
1,995	Hargreaves Lansdown Plc	Goldman Sachs	(747)
2,378	Hays Plc	Goldman Sachs	(10)
(1,643)	Helical Plc	Bank of America Merrill Lynch	1,044
(1,592)	Helical Plc	Goldman Sachs	559
(373)	Hill & Smith Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	74
(1,204)	Hill & Smith Holdings Plc	Goldman Sachs	536
(4,095)	Hochschild Mining Plc	Bank of America Merrill Lynch	400
(911)	Hochschild Mining Plc	Goldman Sachs	(24)
2,034	HomeServe Plc	Morgan Stanley	(1,822)
1,763	Hotel Chocolat Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	884
5,973	Howden Joinery Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	67
1,024	Howden Joinery Group Plc	Goldman Sachs	54
2,401	Howden Joinery Group Plc	Morgan Stanley	(494)
3,687	Hunting Plc	Bank of America Merrill Lynch	(182)
3,697	Hunting Plc	Goldman Sachs	(183)
(4,510)	IG Design Group Plc	Goldman Sachs	(7,479)
(164)	IG Group Holdings Plc	Goldman Sachs	15
(2,761)	IG Group Holdings Plc	Morgan Stanley	314
(1,576)	IMI Plc	Bank of America Merrill Lynch	(199)
(150)	IMI Plc	Goldman Sachs	(18)
(197)	IMI Plc	Morgan Stanley	130
3,232	Inchcape Plc	Bank of America Merrill Lynch	280
(2,317)	Indivior Plc	Bank of America Merrill Lynch	707
4,181	Informa Plc	Goldman Sachs	(377)
(1,314)	IntegraFin Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	325
(2,985)	IntegraFin Holdings Plc	Goldman Sachs	514
129	InterContinental Hotels Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	358
105	InterContinental Hotels Group Plc	Morgan Stanley	-
(1,069)	Intermediate Capital Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1,078)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	英国(続き)		
(1,081)	Intermediate Capital Group Plc	Goldman Sachs	(1,272)
(3,249)	Intermediate Capital Group Plc	Morgan Stanley	2,303
814	International Game Technology Plc	Bank of America Merrill Lynch	1,237
1,054	International Game Technology Plc	Goldman Sachs	1,507
1,272	International Game Technology Plc	Morgan Stanley	(420)
(3,262)	Investec Plc	Goldman Sachs	80
(55)	iomart Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(5)
(81)	ITM Power Plc	Goldman Sachs	(139)
(11,692)	ITM Power Plc	Morgan Stanley	156
(53,838)	ITV Plc	Morgan Stanley	(1,843)
1,178	J D Wetherspoon Plc	Bank of America Merrill Lynch	745
2,922	J D Wetherspoon Plc	Goldman Sachs	1,758
9,240	J Sainsbury Plc	Bank of America Merrill Lynch	684
4,988	J Sainsbury Plc	Goldman Sachs	480
1,740	JD Sports Fashion Plc	Morgan Stanley	(868)
321	John Wood Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	81
3,118	John Wood Group Plc	Goldman Sachs	543
4,268	John Wood Group Plc	Morgan Stanley	725
279	Judges Scientific Plc	Bank of America Merrill Lynch	410
81	Judges Scientific Plc	Goldman Sachs	119
959	Jupiter Fund Management Plc	Bank of America Merrill Lynch	(175)
7,873	Jupiter Fund Management Plc	Goldman Sachs	(319)
(106)	Keywords Studios Plc	Goldman Sachs	(248)
(12,059)	Kingfisher Plc	Morgan Stanley	371
508	Land Securities Group Plc (REIT)	Goldman Sachs	(295)
1,624	Land Securities Group Plc (REIT)	Morgan Stanley	(496)
(3,511)	Learning Technologies Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(152)
(2,187)	Learning Technologies Group Plc	Goldman Sachs	(228)
(7,360)	Legal & General Group Plc	Goldman Sachs	(896)
(212)	Liberty Global Plc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	153
(213)	Liberty Global Plc 'A'	Goldman Sachs	83
34	LivaNova Plc	Bank of America Merrill Lynch	109
510	LivaNova Plc	Goldman Sachs	1,932
(113,065)	Lloyds Banking Group Plc	Morgan Stanley	1,055
(501)	London Stock Exchange Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	1,367
(378)	London Stock Exchange Group Plc	Morgan Stanley	(890)
4,845	LondonMetric Property Plc (REIT)	Goldman Sachs	(724)
(1,971)	M&G Plc	Bank of America Merrill Lynch	144
43,715	Marks & Spencer Group Plc	Goldman Sachs	665
862	Marks & Spencer Group Plc	Morgan Stanley	(85)
2,105	Mediclinic International Plc	Goldman Sachs	(211)
3,909	Meggitt Plc	Bank of America Merrill Lynch	(429)
(3,920)	Melrose Industries Plc	Bank of America Merrill Lynch	197
(7,420)	Melrose Industries Plc	Goldman Sachs	372
828	Micro Focus International Plc	Bank of America Merrill Lynch	(87)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	英国(続き)		
2,106	Mitchells & Butlers Plc	Bank of America Merrill Lynch	(180)
354	Mondi Plc	Bank of America Merrill Lynch	42
4,188	Moneysupermarket.com Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(390)
9,261	Moneysupermarket.com Group Plc	Goldman Sachs	(2,635)
9,275	Moneysupermarket.com Group Plc	Morgan Stanley	(1,712)
1,406	Morgan Sindall Group Plc	Goldman Sachs	338
(14)	Naked Wines Plc	Goldman Sachs	(18)
(7,013)	Naked Wines Plc	Morgan Stanley	(7,409)
6,762	National Express Group Plc	Goldman Sachs	552
(641)	Natwest Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(17)
(40,624)	Natwest Group Plc	Morgan Stanley	41
(2,531)	NCC Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(271)
(10,283)	NCC Group Plc	Goldman Sachs	(1,100)
2,639	Network International Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	(45)
7,339	Network International Holdings Plc	Goldman Sachs	(586)
1,149	Network International Holdings Plc	Morgan Stanley	(146)
630	Next Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1,536)
67	Next Plc	Morgan Stanley	(70)
2,166	Nielsen Holdings Plc	Morgan Stanley	356
726	Ninety One Plc	Bank of America Merrill Lynch	(132)
3,541	Ninety One Plc	Goldman Sachs	(846)
18	Numis Corp Plc	Goldman Sachs	3
(576)	Ocado Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	690
(526)	Ocado Group Plc	Goldman Sachs	263
(1,820)	On the Beach Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(459)
(1,404)	On the Beach Group Plc	Goldman Sachs	(242)
(1,062)	OSB Group Plc	Goldman Sachs	(28)
(2,375)	Pagegroup Plc	Bank of America Merrill Lynch	129
(491)	Pagegroup Plc	Goldman Sachs	193
660	Paragon Banking Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	67
1,279	Paragon Banking Group Plc	Goldman Sachs	130
374	Pearson Plc	Bank of America Merrill Lynch	15
154	Pennon Group Plc	Goldman Sachs	(24)
1,034	Pennon Group Plc	Morgan Stanley	(694)
(323)	Persimmon Plc	Bank of America Merrill Lynch	924
(1,556)	Persimmon Plc	Morgan Stanley	3,933
9,982	Pets at Home Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	4,352
2,872	Pets at Home Group Plc	Goldman Sachs	1,252
5,796	Pets at Home Group Plc	Morgan Stanley	388
(4,252)	Phoenix Group Holdings Plc	Morgan Stanley	1,990
(738)	Polypipe Group Plc	Goldman Sachs	158
(10,026)	Primary Health Properties Plc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	1,388
(15,692)	Primary Health Properties Plc (REIT)	Goldman Sachs	2,172
1,853	Prudential Plc	Bank of America Merrill Lynch	(376)
515	Prudential Plc	Morgan Stanley	(437)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	英国(続き)		
863	PZ Cussons Plc	Goldman Sachs	(4)
(57,780)	Quilter Plc	Bank of America Merrill Lynch	3,688
(19,061)	Quilter Plc	Goldman Sachs	1,279
(45,588)	Quilter Plc	Morgan Stanley	(1,463)
(171)	Rathbone Brothers Plc	Bank of America Merrill Lynch	155
22	Reckitt Benckiser Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(63)
850	Reckitt Benckiser Group Plc	Morgan Stanley	1,169
(3,836)	Redde Northgate Plc	Goldman Sachs	82
1,704	Redrow Plc	Bank of America Merrill Lynch	(602)
2,255	Redrow Plc	Goldman Sachs	(618)
3,035	Redrow Plc	Morgan Stanley	(786)
3,677	RELX Plc	Bank of America Merrill Lynch	352
1,248	RELX Plc	Morgan Stanley	17
(145)	Renishaw Plc	Bank of America Merrill Lynch	(107)
(24)	Renishaw Plc	Morgan Stanley	(30)
3,037	Rentokil Initial Plc	Bank of America Merrill Lynch	(667)
3,598	Rentokil Initial Plc	Goldman Sachs	(751)
15,396	Rentokil Initial Plc	Morgan Stanley	(1,091)
(5,157)	Restore Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1,103)
(6,838)	Restore Plc	Goldman Sachs	(1,462)
3,482	Rightmove Plc	Morgan Stanley	467
(264)	Rio Tinto Plc	Bank of America Merrill Lynch	(531)
(448)	Rio Tinto Plc	Goldman Sachs	(923)
(413)	Rio Tinto Plc	Morgan Stanley	(367)
2,903	Rotork Plc	Bank of America Merrill Lynch	(318)
2,418	Rotork Plc	Goldman Sachs	(265)
10,599	Rotork Plc	Morgan Stanley	(1,729)
1,462	Royal Dutch Shell Plc 'A'	Goldman Sachs	1,782
1,175	Royal Mail Plc	Morgan Stanley	112
2,204	RWS Holdings Plc	Goldman Sachs	(250)
676	Sabre Insurance Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(86)
2,533	Sabre Insurance Group Plc	Goldman Sachs	(322)
846	Saga Plc	Bank of America Merrill Lynch	(100)
6,887	Sage Group Plc	Goldman Sachs	(404)
(207)	Savills Plc	Bank of America Merrill Lynch	179
(733)	Schroders Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1,974)
(1,077)	Schroders Plc	Goldman Sachs	(3,039)
(1,600)	Schroders Plc	Morgan Stanley	(3,720)
1,724	Segro Plc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	281
1,933	Segro Plc (Reit)	Goldman Sachs	65
1,191	Segro Plc (Reit)	Morgan Stanley	191
285	Sensata Technologies Holding Plc	Bank of America Merrill Lynch	804
170	Sensata Technologies Holding Plc	Goldman Sachs	360
1,026	Sensata Technologies Holding Plc	Morgan Stanley	523
(5,037)	Serica Energy Plc	Bank of America Merrill Lynch	324

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益 / (損) (米ドル)
	英国（続き）		
(3,729)	Serica Energy Plc	Goldman Sachs	203
(670)	Severn Trent Plc	Bank of America Merrill Lynch	743
1,585	Shaftesbury Plc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(217)
5,209	Shaftesbury Plc (Reit)	Goldman Sachs	(950)
18,509	Signature Aviation Plc	Bank of America Merrill Lynch	(4,382)
1,069	Signature Aviation Plc	Goldman Sachs	(44)
1,382	Signature Aviation Plc	Morgan Stanley	(67)
(1,469)	Smart Metering Systems Plc	Goldman Sachs	(805)
543	Smiths Group Plc	Goldman Sachs	(791)
531	Smiths Group Plc	Morgan Stanley	(586)
760	Softcat Plc	Goldman Sachs	10
151	Spirax-Sarco Engineering Plc	Morgan Stanley	642
(8,850)	Spire Healthcare Group Plc	Goldman Sachs	(158)
1,704	Spirent Communications Plc	Bank of America Merrill Lynch	(20)
7,574	Spirent Communications Plc	Goldman Sachs	(152)
725	SSE Plc	Morgan Stanley	(17)
3,945	SSP Group Plc	Goldman Sachs	195
344	SSP Group Plc	Morgan Stanley	(134)
2,255	St James ' s Place Plc	Goldman Sachs	82
(1,934)	St Modwen Properties Plc	Bank of America Merrill Lynch	841
(3,412)	St Modwen Properties Plc	Goldman Sachs	1,483
(7,061)	Stagecoach Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(170)
(6,357)	Stagecoach Group Plc	Goldman Sachs	(153)
2,765	Standard Chartered Plc	Morgan Stanley	200
(3,574)	Standard Life Aberdeen Plc	Bank of America Merrill Lynch	(410)
(16,654)	Standard Life Aberdeen Plc	Morgan Stanley	(980)
(809)	Synthomer Plc	Bank of America Merrill Lynch	(10)
2,785	TechnipFMC Plc	Morgan Stanley	(56)
2,178	TI Fluid Systems Plc	Bank of America Merrill Lynch	105
1,396	TI Fluid Systems Plc	Goldman Sachs	67
413	TORM Plc	Bank of America Merrill Lynch	(11)
478	TORM Plc	Goldman Sachs	(96)
1,540	TP ICAP Plc	Bank of America Merrill Lynch	(52)
4,061	TP ICAP Plc	Goldman Sachs	(119)
1,429	Trainline Plc	Bank of America Merrill Lynch	104
(1,155)	Travis Perkins Plc	Bank of America Merrill Lynch	456
(1,371)	Travis Perkins Plc	Morgan Stanley	688
7,368	Tritax Big Box Plc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	30
8,246	Tritax Big Box Plc (REIT)	Goldman Sachs	25
351	Tronox Holdings Plc ' A '	Bank of America Merrill Lynch	73
215	Tronox Holdings Plc ' A '	Goldman Sachs	26
93	Ultra Electronics Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	10
(520)	Unilever Plc	Goldman Sachs	(1,581)
163	UNITE Group Plc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(178)
605	UNITE Group Plc (REIT)	Goldman Sachs	(659)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	英国(続き)		
2,973	UNITE Group Plc (REIT)	Morgan Stanley	(1,650)
(1,084)	United Utilities Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	292
(504)	United Utilities Group Plc	Goldman Sachs	135
(483)	United Utilities Group Plc	Morgan Stanley	59
(4,884)	Vectura Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(43)
(11,449)	Vectura Group Plc	Goldman Sachs	(1,219)
(1,176)	Vesuvius Plc	Bank of America Merrill Lynch	(255)
(587)	Vesuvius Plc	Goldman Sachs	(127)
(961)	Victoria Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1,709)
(430)	Victoria Plc	Goldman Sachs	(765)
(832)	Victrex Plc	Goldman Sachs	570
(673)	Victrex Plc	Morgan Stanley	765
(7,269)	Virgin Money UK Plc	Bank of America Merrill Lynch	1,372
3,200	Virgin Money UK Plc - CDI	Goldman Sachs	(753)
277	Vistry Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(37)
1,430	Vistry Group Plc	Goldman Sachs	220
1,952	Vistry Group Plc	Morgan Stanley	(692)
(10,006)	Vodafone Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(285)
(41,635)	Vodafone Group Plc	Goldman Sachs	1,693
(65,196)	Vodafone Group Plc	Morgan Stanley	(2,135)
(4,361)	Warehouse Reit Plc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(47)
(2,861)	Warehouse Reit Plc (Reit)	Goldman Sachs	20
44	Watkin Jones Plc	Bank of America Merrill Lynch	3
2,594	Watkin Jones Plc	Goldman Sachs	194
(172)	Weir Group Plc	Goldman Sachs	150
(1,111)	Weir Group Plc	Morgan Stanley	(208)
1,726	WH Smith Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1,331)
2,049	WH Smith Plc	Goldman Sachs	(829)
218	Whitbread Plc	Goldman Sachs	(230)
(571)	Workspace Group Plc (REIT)	Goldman Sachs	283
			(20,796)
	米国		
118	1-800-Flowers.com Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(64)
(324)	1Life Healthcare Inc	Goldman Sachs	(110)
145	2U Inc	Bank of America Merrill Lynch	71
427	2U Inc	Goldman Sachs	209
1,364	3D Systems Corp	Goldman Sachs	2,851
281	3M Co	Morgan Stanley	303
305	8x8 Inc	Bank of America Merrill Lynch	433
745	8x8 Inc	Goldman Sachs	1,058
2,136	A10 Networks Inc	Goldman Sachs	726
(303)	AAON Inc	Goldman Sachs	395
218	AAR Corp	Goldman Sachs	(103)
(257)	Aaron's Holdings Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(365)
(91)	Aaron's Holdings Co Inc	Goldman Sachs	(130)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(116)	Aaron's Holdings Co Inc	Morgan Stanley	77
(94)	Abbott Laboratories - CDI	Bank of America Merrill Lynch	494
(154)	Abbott Laboratories - CDI	Morgan Stanley	132
590	Abercrombie & Fitch Co 'A'	Bank of America Merrill Lynch	705
362	Abercrombie & Fitch Co 'A'	Goldman Sachs	992
41	ABIOMED Inc	Bank of America Merrill Lynch	(43)
40	ABIOMED Inc	Goldman Sachs	53
24	ABIOMED Inc	Morgan Stanley	126
(557)	ABM Industries Inc	Goldman Sachs	162
890	Acadia Realty Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	169
2,021	Acadia Realty Trust (REIT)	Goldman Sachs	384
516	Accel Entertainment Inc	Bank of America Merrill Lynch	(340)
1,112	Accel Entertainment Inc	Goldman Sachs	(812)
363	Accelerate Diagnostics Inc	Goldman Sachs	(247)
2,568	ACCO Brands Corp	Goldman Sachs	(51)
646	ACI Worldwide Inc	Goldman Sachs	1,004
123	ACM Research Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(37)
67	ACM Research Inc 'A'	Goldman Sachs	143
343	Activision Blizzard Inc	Bank of America Merrill Lynch	758
415	Activision Blizzard Inc	Goldman Sachs	920
537	Activision Blizzard Inc	Morgan Stanley	1,251
112	Acuity Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,502
22	Acuity Brands Inc	Goldman Sachs	292
73	Acuity Brands Inc	Morgan Stanley	493
(590)	Acushnet Holdings Corp	Goldman Sachs	(183)
7	Addus HomeCare Corp	Bank of America Merrill Lynch	(9)
368	Addus HomeCare Corp	Goldman Sachs	(985)
304	Adobe Inc	Morgan Stanley	4,587
(154)	ADT Inc	Goldman Sachs	(25)
(194)	ADT Inc	Morgan Stanley	17
(436)	Adtalem Global Education Inc	Bank of America Merrill Lynch	(289)
(738)	Adtalem Global Education Inc	Goldman Sachs	(728)
(426)	ADTRAN Inc	Bank of America Merrill Lynch	(105)
(2,274)	ADTRAN Inc	Goldman Sachs	(705)
(88)	Advance Auto Parts Inc	Morgan Stanley	(277)
(350)	Advanced Drainage Systems Inc	Goldman Sachs	58
49	Advanced Energy Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	9
96	Advanced Energy Industries Inc	Goldman Sachs	715
(1,393)	Advanced Micro Devices Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,903)
(534)	AdvanSix Inc	Goldman Sachs	(347)
(1,314)	AECOM	Morgan Stanley	(604)
(180)	Aegion Corp	Bank of America Merrill Lynch	17
(243)	Aegion Corp	Goldman Sachs	(92)
766	Aerie Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	66
(68)	AeroVironment Inc	Bank of America Merrill Lynch	124

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(41)	AeroVironment Inc	Goldman Sachs	(44)
14	Affiliated Managers Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6)
(117)	Aflac Inc	Goldman Sachs	(177)
(1,320)	Aflac Inc	Morgan Stanley	(383)
(2)	AGCO Corp	Goldman Sachs	7
(108)	AGCO Corp	Morgan Stanley	85
650	Agilent Technologies Inc	Morgan Stanley	1,612
(563)	Agilysys Inc	Goldman Sachs	(2,137)
51	Agree Realty Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	3
451	Agree Realty Corp (REIT)	Goldman Sachs	(884)
801	Agree Realty Corp (REIT)	Morgan Stanley	796
1,172	Air Lease Corp	Bank of America Merrill Lynch	(756)
430	Air Lease Corp	Morgan Stanley	(536)
54	Air Products and Chemicals Inc	Bank of America Merrill Lynch	664
129	Air Products and Chemicals Inc	Morgan Stanley	289
(277)	Air Transport Services Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(230)
(1,892)	Air Transport Services Group Inc	Goldman Sachs	(1,511)
(41)	Alamo Group Inc	Goldman Sachs	(129)
(235)	Alarm.com Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,093)
(475)	Alarm.com Holdings Inc	Goldman Sachs	(2,290)
(77)	Alarm.com Holdings Inc	Morgan Stanley	(526)
320	Alaska Air Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	771
426	Alaska Air Group Inc	Goldman Sachs	190
669	Alaska Air Group Inc	Morgan Stanley	983
123	Albany International Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	197
54	Albany International Corp 'A'	Goldman Sachs	112
(50)	Albemarle Corp	Bank of America Merrill Lynch	(485)
(101)	Albemarle Corp	Goldman Sachs	(858)
2,810	Albertsons Cos Inc 'A'	Morgan Stanley	(309)
376	Alector Inc	Goldman Sachs	199
(9)	Alexander's Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	41
(165)	Alexander's Inc (REIT)	Goldman Sachs	2,373
11	Align Technology Inc	Goldman Sachs	76
158	Allakos Inc	Morgan Stanley	29
12	Alleghany Corp	Bank of America Merrill Lynch	(140)
63	Alleghany Corp	Goldman Sachs	(866)
26	Alleghany Corp	Morgan Stanley	(315)
(1,160)	Allegheny Technologies Inc	Goldman Sachs	(696)
(49)	Allegiant Travel Co	Goldman Sachs	(697)
54	Alliance Data Systems Corp	Goldman Sachs	(47)
(273)	Alliant Energy Corp	Goldman Sachs	100
(398)	Allison Transmission Holdings Inc	Morgan Stanley	60
(1,808)	Allscripts Healthcare Solutions Inc	Goldman Sachs	(2,783)
(123)	Allstate Corp	Bank of America Merrill Lynch	(103)
(771)	Allstate Corp	Morgan Stanley	217

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
590	Ally Financial Inc	Goldman Sachs	82
78	Ally Financial Inc	Morgan Stanley	58
(387)	Altabancorp	Goldman Sachs	81
2	Altair Engineering Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	9
747	Altair Engineering Inc 'A'	Goldman Sachs	3,210
116	Alteryx Inc 'A'	Morgan Stanley	718
(207)	Altice USA Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(635)
(2,710)	Altice USA Inc 'A'	Morgan Stanley	2,257
(185)	Altra Industrial Motion Corp	Goldman Sachs	(141)
(2,585)	Altria Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,943
(433)	Altria Group Inc	Goldman Sachs	450
(585)	Altria Group Inc	Morgan Stanley	123
500	Amalgamated Bank 'A'	Bank of America Merrill Lynch	44
1,078	Amalgamated Bank 'A'	Goldman Sachs	(6)
(22)	Amazon.com Inc - CDI	Bank of America Merrill Lynch	(828)
(5)	Amazon.com Inc - CDI	Morgan Stanley	(393)
(563)	Ambac Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(107)
(3,488)	Ambac Financial Group Inc	Goldman Sachs	(663)
(679)	AMC Networks Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,660)
33	Amedisys Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11)
8	Amedisys Inc	Goldman Sachs	15
396	Ameren Corp	Morgan Stanley	(266)
119	Ameresco Inc 'A'	Goldman Sachs	(14)
1,333	American Airlines Group Inc	Goldman Sachs	1,728
(1,597)	American Assets Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	(2,619)
(579)	American Axle & Manufacturing Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(29)
362	American Campus Communities Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	11
506	American Campus Communities Inc (REIT)	Goldman Sachs	(271)
215	American Campus Communities Inc (REIT)	Morgan Stanley	(139)
791	American Eagle Outfitters Inc	Goldman Sachs	589
281	American Electric Power Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,183)
29	American Electric Power Co Inc	Goldman Sachs	(64)
393	American Electric Power Co Inc	Morgan Stanley	625
371	American Express Co	Morgan Stanley	1,788
(306)	American Finance Trust Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	98
(421)	American Homes 4 Rent 'A' (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	417
(12)	American National Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(30)
(323)	American National Group Inc	Goldman Sachs	(798)
(523)	American Public Education Inc	Bank of America Merrill Lynch	(152)
(457)	American Public Education Inc	Goldman Sachs	(188)
91	American States Water Co	Bank of America Merrill Lynch	(40)
257	American States Water Co	Goldman Sachs	136
345	American Tower Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(2,188)
66	American Tower Corp (REIT)	Morgan Stanley	234
(486)	American Vanguard Corp	Goldman Sachs	164

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
15	American Water Works Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	16
175	American Woodmark Corp	Goldman Sachs	168
(92)	America's Car-Mart Inc	Goldman Sachs	(284)
50	Americold Realty Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(115)
1,079	Americold Realty Trust (REIT)	Goldman Sachs	(2,807)
158	Americold Realty Trust (REIT)	Morgan Stanley	(17)
216	AMERISAFE Inc	Goldman Sachs	(724)
(287)	AmerisourceBergen Corp	Bank of America Merrill Lynch	670
(860)	AmerisourceBergen Corp	Morgan Stanley	(3,388)
(1,082)	Amkor Technology Inc	Goldman Sachs	(1,093)
158	AMN Healthcare Services Inc	Goldman Sachs	118
(1,341)	Amneal Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	174
460	Amphastar Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(479)
376	Amphastar Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(134)
(763)	Amphenol Corp 'A'	Goldman Sachs	(530)
(474)	Amphenol Corp 'A'	Morgan Stanley	109
62	Analog Devices Inc	Goldman Sachs	181
118	Analog Devices Inc	Morgan Stanley	356
(242)	Andersons Inc	Bank of America Merrill Lynch	29
(330)	Andersons Inc	Goldman Sachs	(291)
(1,357)	ANGI Homeservices Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,913)
(251)	ANGI Homeservices Inc 'A'	Morgan Stanley	(112)
(247)	ANI Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(136)
61	ANSYS Inc	Bank of America Merrill Lynch	729
178	ANSYS Inc	Goldman Sachs	2,288
113	ANSYS Inc	Morgan Stanley	2,359
624	Antero Midstream Corp	Bank of America Merrill Lynch	440
937	Antero Resources Corp	Goldman Sachs	295
(44)	Anthem Inc	Morgan Stanley	(196)
669	A0 Smith Corp	Bank of America Merrill Lynch	87
158	A0 Smith Corp	Goldman Sachs	21
2,101	A0 Smith Corp	Morgan Stanley	(2,017)
(482)	Apartment Investment and Management Co 'A' (REIT)	Morgan Stanley	111
(237)	Apogee Enterprises Inc	Bank of America Merrill Lynch	(119)
(469)	Apogee Enterprises Inc	Goldman Sachs	175
(200)	Apollo Medical Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	92
45	Appfolio Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	581
60	Appfolio Inc 'A'	Goldman Sachs	775
124	Appfolio Inc 'A'	Morgan Stanley	1,543
(486)	Appian Corp	Morgan Stanley	(15,071)
1,927	Apple Hospitality Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	756
490	Apple Hospitality Inc (REIT)	Goldman Sachs	249
(7)	Apple Inc	Goldman Sachs	7
(565)	Apple Inc	Morgan Stanley	(2,910)
(182)	Applied Industrial Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(646)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(624)	Applied Industrial Technologies Inc	Goldman Sachs	(2,028)
(2,489)	Applied Materials Inc	Morgan Stanley	789
196	Aprea Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,123
1,763	Aramark	Bank of America Merrill Lynch	1,564
442	Aramark	Goldman Sachs	344
196	Aramark	Morgan Stanley	(39)
(659)	ArcBest Corp	Goldman Sachs	(1,465)
1,612	Archer-Daniels-Midland Co	Morgan Stanley	2,015
844	Archrock Inc	Goldman Sachs	363
(646)	Arconic Corp	Goldman Sachs	814
(454)	Arcosa Inc	Goldman Sachs	218
2,483	Ares Management Corp 'A'	Goldman Sachs	1,055
(24)	Argan Inc	Bank of America Merrill Lynch	26
(608)	Argan Inc	Goldman Sachs	802
38	Arista Networks Inc	Bank of America Merrill Lynch	(97)
69	Arista Networks Inc	Morgan Stanley	(86)
(1,064)	Armada Hoffler Properties Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	43
(298)	Armada Hoffler Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	12
(170)	Armstrong World Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(106)
(73)	Armstrong World Industries Inc	Morgan Stanley	27
(1,570)	Array Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,770)
(877)	Arrow Electronics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,982)
(821)	Arrow Electronics Inc	Goldman Sachs	(3,727)
(1,135)	Arrow Electronics Inc	Morgan Stanley	(2,974)
(418)	Arrow Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	141
(887)	Arrow Financial Corp	Goldman Sachs	307
(224)	Arthur J Gallagher & Co	Bank of America Merrill Lynch	(22)
(42)	Arthur J Gallagher & Co	Goldman Sachs	19
(499)	Arthur J Gallagher & Co	Morgan Stanley	(180)
(407)	Artisan Partners Asset Management Inc 'A'	Goldman Sachs	(128)
49	Arvinas Inc	Bank of America Merrill Lynch	(70)
1,369	Arvinas Inc	Goldman Sachs	(926)
(627)	Asana Inc 'A'	Morgan Stanley	(4,239)
(285)	Asbury Automotive Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,679
(207)	Ashland Global Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	493
(596)	Ashland Global Holdings Inc	Goldman Sachs	2,324
(592)	Ashland Global Holdings Inc	Morgan Stanley	1,012
12	Aspen Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	98
226	Aspen Technology Inc	Goldman Sachs	1,846
247	Aspen Technology Inc	Morgan Stanley	170
938	Assembly Biosciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	356
1,042	Assembly Biosciences Inc	Goldman Sachs	396
2,497	Assetmark Financial Holdings Inc	Goldman Sachs	(1,573)
(3,071)	Associated Banc-Corp	Goldman Sachs	491
(151)	Astec Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(397)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(784)	Astec Industries Inc	Goldman Sachs	(1,813)
409	Astronics Corp	Goldman Sachs	1,039
482	AT&T Inc	Bank of America Merrill Lynch	78
1,053	AT&T Inc	Morgan Stanley	200
150	Atkore International Group Inc	Goldman Sachs	1,625
(321)	Atlantic Capital Bancshares Inc	Goldman Sachs	189
(3,153)	Atlantic Union Bankshares Corp	Goldman Sachs	599
(519)	Atlas Air Worldwide Holdings Inc	Goldman Sachs	(706)
(63)	Atmos Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	285
(183)	Atmos Energy Corp	Goldman Sachs	829
(87)	Atmos Energy Corp	Morgan Stanley	10
(181)	ATN International Inc	Bank of America Merrill Lynch	168
(378)	ATN International Inc	Goldman Sachs	352
202	AtriCure Inc	Bank of America Merrill Lynch	720
37	Atrion Corp	Goldman Sachs	(476)
(64)	Autoliv Inc	Goldman Sachs	27
(563)	AutoNation Inc	Morgan Stanley	73
(84)	AutoZone Inc	Morgan Stanley	446
(12)	Avalara Inc	Bank of America Merrill Lynch	(68)
(47)	Avalara Inc	Morgan Stanley	113
(140)	AvalonBay Communities Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	473
(132)	AvalonBay Communities Inc (REIT)	Goldman Sachs	788
(185)	AvalonBay Communities Inc (REIT)	Morgan Stanley	710
315	Avangrid Inc	Bank of America Merrill Lynch	(530)
1,063	Avangrid Inc	Goldman Sachs	(3,245)
251	Avangrid Inc	Morgan Stanley	193
1,585	Avantor Inc	Bank of America Merrill Lynch	557
196	Avantor Inc	Morgan Stanley	192
189	Avaya Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	57
192	Avaya Holdings Corp	Goldman Sachs	58
122	Avery Dennison Corp	Bank of America Merrill Lynch	242
119	Avery Dennison Corp	Goldman Sachs	(234)
180	Avery Dennison Corp	Morgan Stanley	567
(108)	Avient Corp	Bank of America Merrill Lynch	(57)
(935)	Avient Corp	Goldman Sachs	(496)
104	Avis Budget Group Inc	Goldman Sachs	(126)
1,483	Avista Corp	Goldman Sachs	(1,350)
1,470	Avita Therapeutics Inc - CDI	Bank of America Merrill Lynch	(270)
(632)	Avnet Inc	Bank of America Merrill Lynch	(518)
(758)	Avnet Inc	Goldman Sachs	(622)
(1,097)	Avnet Inc	Morgan Stanley	(1,108)
250	AvroBio Inc	Goldman Sachs	(593)
(159)	Axcelis Technologies Inc	Goldman Sachs	(132)
628	Axogen Inc	Goldman Sachs	(320)
451	Axonics Modulation Technologies Inc	Goldman Sachs	(568)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(149)	Axos Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(48)
(1,067)	Axos Financial Inc	Goldman Sachs	(341)
(34)	Axsome Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(24)
(397)	AZZ Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,302)
(2,434)	AZZ Inc	Goldman Sachs	(8,154)
489	B Riley Financial Inc	Goldman Sachs	2,577
(788)	B&G Foods Inc	Bank of America Merrill Lynch	(579)
(427)	Badger Meter Inc	Goldman Sachs	(369)
1,013	Baker Hughes Co	Bank of America Merrill Lynch	1,402
634	Baker Hughes Co	Goldman Sachs	407
6,228	Baker Hughes Co	Morgan Stanley	2,491
(267)	Bally's Corp	Goldman Sachs	779
(569)	Banc of California Inc	Goldman Sachs	283
723	BancFirst Corp	Goldman Sachs	437
256	Bancorp Inc	Goldman Sachs	110
(184)	BancorpSouth Bank	Bank of America Merrill Lynch	180
(610)	BancorpSouth Bank	Goldman Sachs	598
178	Bandwidth Inc 'A'	Morgan Stanley	(384)
(483)	Bank First Corp	Goldman Sachs	(715)
773	Bank of Hawaii Corp	Goldman Sachs	1,291
504	Bank of Marin Bancorp	Goldman Sachs	20
700	Bank OZK	Bank of America Merrill Lynch	30
69	Bank OZK	Goldman Sachs	(29)
449	Bank OZK	Morgan Stanley	(51)
(201)	BankUnited Inc	Goldman Sachs	34
(381)	Banner Corp	Bank of America Merrill Lynch	700
(581)	Bar Harbor Bankshares	Bank of America Merrill Lynch	825
(1,149)	Bar Harbor Bankshares	Goldman Sachs	1,632
694	Barnes Group Inc	Goldman Sachs	613
(981)	Barrett Business Services Inc	Goldman Sachs	2,629
66	Baxter International Inc	Goldman Sachs	31
45	Baxter International Inc	Morgan Stanley	26
244	Beacon Roofing Supply Inc	Bank of America Merrill Lynch	(166)
433	Beacon Roofing Supply Inc	Goldman Sachs	(164)
82	Becton Dickinson and Co	Bank of America Merrill Lynch	(149)
415	Becton Dickinson and Co	Goldman Sachs	(2,294)
130	Becton Dickinson and Co	Morgan Stanley	572
835	Bed Bath & Beyond Inc	Goldman Sachs	234
(401)	Belden Inc	Bank of America Merrill Lynch	(930)
(2,341)	Belden Inc	Goldman Sachs	(4,488)
391	BellRing Brands Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(129)
171	BellRing Brands Inc 'A'	Goldman Sachs	(55)
(73)	Benchmark Electronics Inc	Bank of America Merrill Lynch	28
(699)	Benchmark Electronics Inc	Goldman Sachs	(608)
(596)	Benefitfocus Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,937)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(1,053)	Benefitfocus Inc	Goldman Sachs	(3,422)
(58)	Berkshire Hathaway Inc 'B'	Goldman Sachs	176
(591)	Berkshire Hathaway Inc 'B'	Morgan Stanley	(307)
(290)	Best Buy Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,450
(964)	Best Buy Co Inc	Morgan Stanley	11,414
(308)	Beyond Meat Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,553)
(27)	Beyond Meat Inc	Goldman Sachs	(37)
(12,863)	BGC Partners Inc 'A'	Goldman Sachs	(4,631)
124	Big Lots Inc	Bank of America Merrill Lynch	355
(443)	BigCommerce Holdings Inc	Morgan Stanley	(634)
(73)	Bill.com Holdings Inc	Goldman Sachs	(905)
(109)	Bill.com Holdings Inc	Morgan Stanley	(391)
1,490	BioDelivery Sciences International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(224)
147	BioMarin Pharmaceutical Inc	Bank of America Merrill Lynch	667
151	BioMarin Pharmaceutical Inc	Morgan Stanley	430
12	Bio-Rad Laboratories Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(227)
3	Bio-Rad Laboratories Inc 'A'	Goldman Sachs	40
79	Bio-Rad Laboratories Inc 'A'	Morgan Stanley	(325)
(94)	BioTelemetry Inc	Bank of America Merrill Lynch	(224)
(91)	BioTelemetry Inc	Goldman Sachs	(196)
220	BJ's Restaurants Inc	Bank of America Merrill Lynch	(401)
79	BJ's Restaurants Inc	Goldman Sachs	(161)
(1,343)	BJ's Wholesale Club Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,810
(81)	BJ's Wholesale Club Holdings Inc	Morgan Stanley	(8)
154	Black Diamond Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	40
91	Black Diamond Therapeutics Inc	Goldman Sachs	12
312	Black Hills Corp	Morgan Stanley	87
224	Black Knight Inc	Morgan Stanley	168
150	Blackbaud Inc	Goldman Sachs	(107)
(100)	Blackline Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,580)
(117)	Blackline Inc	Goldman Sachs	(1,805)
(104)	Blackline Inc	Morgan Stanley	(963)
189	Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (REIT)	Morgan Stanley	(286)
(1,356)	Bloom Energy Corp 'A'	Morgan Stanley	563
279	Bloomin' Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	169
(242)	Blucora Inc	Bank of America Merrill Lynch	(133)
1,403	Blue Bird Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,824
809	Blue Bird Corp	Goldman Sachs	1,052
105	Boeing Co	Goldman Sachs	663
214	Boeing Co	Morgan Stanley	854
(301)	Boingo Wireless Inc	Bank of America Merrill Lynch	(31)
(659)	Boingo Wireless Inc	Goldman Sachs	(47)
(358)	Boise Cascade Co	Bank of America Merrill Lynch	(240)
177	BOK Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(95)
1,249	BOK Financial Corp	Goldman Sachs	(1,320)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(295)	Bonanza Creek Energy Inc	Goldman Sachs	115
6	Booking Holdings Inc	Morgan Stanley	57
202	Boot Barn Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(263)
75	Boot Barn Holdings Inc	Goldman Sachs	22
(51)	Booz Allen Hamilton Holding Corp	Goldman Sachs	39
(216)	Booz Allen Hamilton Holding Corp	Morgan Stanley	91
1,094	BorgWarner Inc	Morgan Stanley	(120)
(10)	Boston Beer Co Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	522
(26)	Boston Beer Co Inc 'A'	Goldman Sachs	1,341
(8)	Boston Beer Co Inc 'A'	Morgan Stanley	345
325	Boston Omaha Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	505
(491)	Boston Properties Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(2,393)
(101)	Boston Properties Inc (REIT)	Morgan Stanley	(155)
1,676	Boston Scientific Corp	Bank of America Merrill Lynch	(7,385)
37	Boston Scientific Corp	Goldman Sachs	(3)
1,380	Boston Scientific Corp	Morgan Stanley	(152)
(67)	Bottomline Technologies DE Inc	Bank of America Merrill Lynch	(103)
1,554	Box Inc 'A'	Goldman Sachs	2,642
211	Boyd Gaming Corp	Goldman Sachs	687
360	Boyd Gaming Corp	Morgan Stanley	295
1,199	Brady Corp 'A'	Goldman Sachs	(1,894)
1,487	Brandywine Realty Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	492
2,775	Brandywine Realty Trust (REIT)	Goldman Sachs	249
401	Bridge Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	585
652	Bridge Bancorp Inc	Goldman Sachs	1,102
401	Brigham Minerals Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(132)
2,047	Brigham Minerals Inc 'A'	Goldman Sachs	(676)
56	Bright Horizons Family Solutions Inc	Goldman Sachs	103
227	Bright Horizons Family Solutions Inc	Morgan Stanley	804
636	Brighthouse Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,361
1,260	Brighthouse Financial Inc	Goldman Sachs	2,675
307	Brighthouse Financial Inc	Morgan Stanley	(43)
(450)	BrightSphere Investment Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(27)
(1,710)	BrightSphere Investment Group Inc	Goldman Sachs	(103)
967	BrightView Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(609)
1,275	BrightView Holdings Inc	Goldman Sachs	(803)
220	Brinker International Inc	Goldman Sachs	81
(5)	Broadcom Inc	Goldman Sachs	(20)
77	Broadridge Financial Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	(109)
(1,571)	Brookdale Senior Living Inc	Goldman Sachs	(660)
137	Brooks Automation Inc	Morgan Stanley	(24)
(1,725)	Brown & Brown Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,209
(33)	Brown & Brown Inc	Goldman Sachs	81
(144)	Brunswick Corp	Goldman Sachs	(429)
(449)	Brunswick Corp	Morgan Stanley	1,064

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(1,646)	Bryn Mawr Bank Corp	Goldman Sachs	423
200	Buckle Inc	Goldman Sachs	(172)
(493)	Builders FirstSource Inc	Bank of America Merrill Lynch	(110)
(985)	Builders FirstSource Inc	Morgan Stanley	(1,015)
113	Burlington Stores Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,399)
100	Burlington Stores Inc	Goldman Sachs	(656)
34	Burlington Stores Inc	Morgan Stanley	(330)
301	Byline Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	36
349	Byline Bancorp Inc	Goldman Sachs	-
18	Cable One Inc	Bank of America Merrill Lynch	(988)
7	Cable One Inc	Morgan Stanley	59
(517)	Cabot Corp	Goldman Sachs	(414)
732	Cabot Oil & Gas Corp	Bank of America Merrill Lynch	572
(77)	CACI International Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	34
(140)	CACI International Inc 'A'	Goldman Sachs	158
(155)	CACI International Inc 'A'	Morgan Stanley	124
493	Cactus Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(49)
939	Cactus Inc 'A'	Goldman Sachs	(94)
559	Cadence Design Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	928
897	Cadence Design Systems Inc	Goldman Sachs	3,980
298	Cadence Design Systems Inc	Morgan Stanley	1,784
328	Cadiz Inc	Bank of America Merrill Lynch	44
175	Caesars Entertainment Inc	Bank of America Merrill Lynch	991
107	Caesars Entertainment Inc	Goldman Sachs	628
361	Caesars Entertainment Inc	Morgan Stanley	780
128	CAI International Inc	Bank of America Merrill Lynch	221
(377)	Calavo Growers Inc	Bank of America Merrill Lynch	(64)
(446)	Calavo Growers Inc	Goldman Sachs	(16)
(136)	California Water Service Group	Goldman Sachs	476
326	Calix Inc	Goldman Sachs	(548)
2,444	Callaway Golf Co	Bank of America Merrill Lynch	7,576
(216)	Cal-Maine Foods Inc	Goldman Sachs	363
574	Camden National Corp	Bank of America Merrill Lynch	(712)
1,520	Camden National Corp	Goldman Sachs	(1,885)
274	Camden Property Trust (REIT)	Morgan Stanley	(79)
(195)	Campbell Soup Co	Bank of America Merrill Lynch	(17)
(39)	Campbell Soup Co	Goldman Sachs	5
338	Camping World Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	(292)
170	Cannae Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	97
80	Cannae Holdings Inc	Goldman Sachs	(24)
50	Cantel Medical Corp	Bank of America Merrill Lynch	169
249	Cantel Medical Corp	Goldman Sachs	595
349	Capital One Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	564
94	Capital One Financial Corp	Morgan Stanley	86
(917)	Cardinal Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,436

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(879)	Cardinal Health Inc	Goldman Sachs	1,675
418	Cardiovascular Systems Inc	Goldman Sachs	(212)
91	Cardlytics Inc	Goldman Sachs	334
902	Cargurus Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,243
441	Cargurus Inc	Goldman Sachs	1,127
290	CarMax Inc	Bank of America Merrill Lynch	(99)
120	CarMax Inc	Goldman Sachs	(60)
951	CarMax Inc	Morgan Stanley	(2,111)
(862)	Carpenter Technology Corp	Bank of America Merrill Lynch	112
(291)	Carpenter Technology Corp	Goldman Sachs	142
230	Carriage Services Inc	Goldman Sachs	(230)
1,119	Carrier Global Corp	Goldman Sachs	(839)
146	Carrier Global Corp	Morgan Stanley	(96)
(312)	Cars.com Inc	Bank of America Merrill Lynch	65
(529)	Cars.com Inc	Goldman Sachs	(425)
(188)	Carvana Co	Bank of America Merrill Lynch	(4,828)
637	Casa Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	319
267	Casa Systems Inc	Goldman Sachs	134
273	Casella Waste Systems Inc 'A'	Goldman Sachs	(429)
235	Casey's General Stores Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,064)
301	Casey's General Stores Inc	Morgan Stanley	(870)
(200)	Cass Information Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(38)
(1,536)	Cass Information Systems Inc	Goldman Sachs	(292)
233	Castle Biosciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	(625)
79	Castle Biosciences Inc	Goldman Sachs	(417)
472	Catalent Inc	Bank of America Merrill Lynch	529
(971)	CatchMark Timber Trust Inc 'A' (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	29
(1,692)	CatchMark Timber Trust Inc 'A' (REIT)	Goldman Sachs	51
26	Caterpillar Inc	Bank of America Merrill Lynch	(72)
106	Caterpillar Inc	Goldman Sachs	112
88	Caterpillar Inc	Morgan Stanley	(47)
(216)	Cathay General Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	310
(1,038)	Cathay General Bancorp	Goldman Sachs	(143)
(31)	Cavco Industries Inc	Goldman Sachs	395
474	CBIZ Inc	Goldman Sachs	(14)
219	CBRE Group Inc 'A'	Morgan Stanley	291
(231)	CBTX Inc	Bank of America Merrill Lynch	116
1,177	CDK Global Inc	Morgan Stanley	2,324
(57)	CDW Corp	Bank of America Merrill Lynch	479
(590)	CDW Corp	Morgan Stanley	319
187	Centene Corp	Bank of America Merrill Lynch	(126)
240	Centene Corp	Goldman Sachs	(1,090)
109	Centene Corp	Morgan Stanley	(51)
1,664	Central Garden & Pet Co	Goldman Sachs	(915)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
922	Central Garden & Pet Co 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(290)
413	Central Garden & Pet Co 'A'	Goldman Sachs	(130)
(812)	Century Aluminum Co	Goldman Sachs	(19)
(56)	Century Bancorp Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	371
(164)	Century Bancorp Inc 'A'	Goldman Sachs	1,087
35	Century Communities Inc	Bank of America Merrill Lynch	31
110	Century Communities Inc	Goldman Sachs	(89)
(5,075)	CenturyLink Inc	Goldman Sachs	(2,335)
(172)	CenturyLink Inc	Morgan Stanley	(10)
98	Cerence Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,465
(458)	Ceridian HCM Holding Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,608)
(7)	Ceridian HCM Holding Inc	Morgan Stanley	(14)
147	Cerner Corp	Bank of America Merrill Lynch	(178)
232	Cerner Corp	Goldman Sachs	(281)
48	Cerner Corp	Morgan Stanley	21
(301)	CF Industries Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	247
(794)	CF Industries Holdings Inc	Morgan Stanley	(1,644)
15	CH Robinson Worldwide Inc	Bank of America Merrill Lynch	3
314	CH Robinson Worldwide Inc	Morgan Stanley	292
1,018	ChampionX Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,130
24	ChampionX Corp	Goldman Sachs	100
92	Change Healthcare Inc	Bank of America Merrill Lynch	57
1,745	Change Healthcare Inc	Morgan Stanley	628
(462)	ChannelAdvisor Corp	Bank of America Merrill Lynch	(311)
(372)	ChannelAdvisor Corp	Goldman Sachs	(364)
21	Charles River Laboratories International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(129)
88	Charles River Laboratories International Inc	Morgan Stanley	16
47	Chart Industries Inc	Goldman Sachs	(81)
(2)	Charter Communications Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(10)
(59)	Charter Communications Inc 'A'	Morgan Stanley	(268)
(25)	Chase Corp	Goldman Sachs	25
(1,564)	Chatham Lodging Trust (REIT)	Goldman Sachs	(1,032)
134	Cheesecake Factory Inc	Bank of America Merrill Lynch	286
2,390	Cheesecake Factory Inc	Goldman Sachs	1,624
522	Chefs' Warehouse Inc	Goldman Sachs	1,099
(430)	Chegg Inc	Morgan Stanley	(1,227)
(5)	Chemed Corp	Goldman Sachs	(32)
(148)	Chemours Co	Bank of America Merrill Lynch	(322)
(653)	Chemours Co	Goldman Sachs	(827)
725	Cheniere Energy Inc	Morgan Stanley	1,936
(351)	Chesapeake Utilities Corp	Goldman Sachs	1,356
59	Chevron Corp	Bank of America Merrill Lynch	(260)
(178)	Chewy Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,987)
(172)	Chewy Inc 'A'	Goldman Sachs	(1,914)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(109)	Chewy Inc 'A'	Morgan Stanley	(675)
19	Children's Place Inc	Bank of America Merrill Lynch	75
95	Children's Place Inc	Goldman Sachs	851
16	Chipotle Mexican Grill Inc	Bank of America Merrill Lynch	369
41	Chipotle Mexican Grill Inc	Goldman Sachs	(258)
8	Chipotle Mexican Grill Inc	Morgan Stanley	22
72	Choice Hotels International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(407)
151	Choice Hotels International Inc	Goldman Sachs	(298)
8	Choice Hotels International Inc	Morgan Stanley	(1)
(118)	Church & Dwight Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	201
(470)	Church & Dwight Co Inc	Goldman Sachs	799
100	Churchill Downs Inc	Morgan Stanley	(740)
184	Ciena Corp	Bank of America Merrill Lynch	157
(163)	Cigna Corp	Morgan Stanley	(740)
(565)	Cinemark Holdings Inc	Goldman Sachs	(870)
(780)	Cisco Systems Inc	Morgan Stanley	116
575	Citigroup Inc	Goldman Sachs	3,115
2,210	Citigroup Inc	Morgan Stanley	6,166
(418)	Citrix Systems Inc	Morgan Stanley	(694)
(101)	City Holding Co	Bank of America Merrill Lynch	134
(230)	City Holding Co	Goldman Sachs	514
(2,133)	Clear Channel Outdoor Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(52)
(199)	Clearwater Paper Corp	Goldman Sachs	375
126	Clearway Energy Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(37)
273	Clearway Energy Inc 'A'	Goldman Sachs	(36)
(214)	Clearway Energy Inc 'C'	Goldman Sachs	77
(153)	Clorox Co	Morgan Stanley	(84)
355	Cloudera Inc	Goldman Sachs	337
234	Cloudflare Inc 'A'	Goldman Sachs	217
56	CMC Materials Inc	Goldman Sachs	(89)
952	CMS Energy Corp	Morgan Stanley	343
3,561	CNB Financial Corp	Goldman Sachs	3,597
(733)	CNO Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(638)
(5,636)	CNO Financial Group Inc	Goldman Sachs	(4,903)
828	CNX Resources Corp	Goldman Sachs	199
(201)	Coca-Cola Consolidated Inc	Goldman Sachs	955
1,193	Coeur Mining Inc	Goldman Sachs	(246)
65	Cogent Communications Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	33
65	Cogent Communications Holdings Inc	Morgan Stanley	21
838	Cognex Corp	Morgan Stanley	3,000
174	Cohen & Steers Inc	Goldman Sachs	595
37	Coherent Inc	Bank of America Merrill Lynch	60
85	Coherent Inc	Goldman Sachs	(131)
316	Coherent Inc	Morgan Stanley	(441)
(644)	Cohu Inc	Bank of America Merrill Lynch	(316)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(486)	Cohu Inc	Goldman Sachs	(192)
635	Colfax Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,124
(540)	Colgate-Palmolive Co	Morgan Stanley	(142)
141	Collegium Pharmaceutical Inc	Bank of America Merrill Lynch	92
793	Collegium Pharmaceutical Inc	Goldman Sachs	167
1,286	Colony Capital Inc (REIT)	Goldman Sachs	43
(1,038)	Columbia Banking System Inc	Goldman Sachs	1,922
(209)	Columbia Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	17
(3,524)	Columbia Financial Inc	Goldman Sachs	282
1,193	Columbia Property Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	793
1,734	Columbia Sportswear Co	Bank of America Merrill Lynch	3,141
430	Columbia Sportswear Co	Goldman Sachs	521
1,069	Columbia Sportswear Co	Morgan Stanley	(2,811)
105	Columbus McKinnon Corp	Goldman Sachs	103
142	Comerica Inc	Bank of America Merrill Lynch	(136)
516	Comerica Inc	Goldman Sachs	(599)
1,316	Comerica Inc	Morgan Stanley	(1,342)
(191)	Comfort Systems USA Inc	Goldman Sachs	(82)
107	Commerce Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	(245)
124	Commerce Bancshares Inc	Goldman Sachs	(376)
(651)	Commercial Metals Co	Goldman Sachs	717
(1,579)	Community Health Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,153)
390	Community Healthcare Trust Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(242)
592	Community Healthcare Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	(367)
65	Community Trust Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(53)
525	Community Trust Bancorp Inc	Goldman Sachs	(425)
(459)	CommVault Systems Inc	Goldman Sachs	(1,476)
(325)	Compass Minerals International Inc	Goldman Sachs	(211)
(451)	Computer Programs and Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	322
(248)	Computer Programs and Systems Inc	Goldman Sachs	102
(270)	Comtech Telecommunications Corp	Bank of America Merrill Lynch	(190)
(1,414)	Comtech Telecommunications Corp	Goldman Sachs	(3,408)
(1,348)	Conagra Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	567
(164)	Conagra Brands Inc	Goldman Sachs	27
(306)	Conagra Brands Inc	Morgan Stanley	(52)
3,240	Conduent Inc	Goldman Sachs	907
25	CONMED Corp	Bank of America Merrill Lynch	(30)
1,072	ConnectOne Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	662
(381)	ConocoPhillips	Bank of America Merrill Lynch	(345)
(259)	ConocoPhillips	Goldman Sachs	224
(330)	ConocoPhillips	Morgan Stanley	281
(3,178)	Consolidated Communications Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(985)
(3,436)	Consolidated Communications Holdings Inc	Goldman Sachs	(1,065)
524	Consolidated Edison Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,602)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
481	Consolidated Edison Inc	Goldman Sachs	(2,566)
764	Consolidated Edison Inc	Morgan Stanley	(290)
(189)	Construction Partners Inc 'A'	Goldman Sachs	96
1,200	Continental Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,693
1,697	Continental Resources Inc	Goldman Sachs	3,787
901	Continental Resources Inc	Morgan Stanley	(117)
287	Cooper Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,075)
84	Cooper Cos Inc	Goldman Sachs	(351)
107	Cooper Cos Inc	Morgan Stanley	709
(202)	Cooper Tire & Rubber Co	Bank of America Merrill Lynch	88
(1,158)	Cooper Tire & Rubber Co	Goldman Sachs	1,465
366	Copart Inc	Bank of America Merrill Lynch	(371)
599	Copart Inc	Goldman Sachs	(606)
710	Copart Inc	Morgan Stanley	1,264
(558)	Corcept Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,216)
(1,457)	Corcept Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(5,338)
(2,140)	CoreCivic Inc (REIT)	Goldman Sachs	(2,033)
(927)	Core-Mark Holding Co Inc	Goldman Sachs	3,958
438	Cornerstone Building Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	158
578	Cornerstone Building Brands Inc	Goldman Sachs	208
168	Cornerstone OnDemand Inc	Bank of America Merrill Lynch	331
1,233	Cornerstone OnDemand Inc	Goldman Sachs	3,514
(369)	Corteva Inc	Bank of America Merrill Lynch	(391)
(1,447)	Corteva Inc	Morgan Stanley	(952)
57	Cortexyme Inc	Bank of America Merrill Lynch	(143)
79	Cortexyme Inc	Goldman Sachs	(198)
(123)	CorVel Corp	Bank of America Merrill Lynch	84
33	CoStar Group Inc	Morgan Stanley	202
(48)	Costco Wholesale Corp	Goldman Sachs	74
(1,596)	Coty Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,353)
(571)	Coty Inc 'A'	Goldman Sachs	(578)
(430)	Coty Inc 'A'	Morgan Stanley	116
(4)	Coupa Software Inc	Bank of America Merrill Lynch	(61)
(14)	Coupa Software Inc	Morgan Stanley	(265)
(963)	Cousins Properties Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(1,327)
(275)	Cousins Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	(371)
(1,796)	Cousins Properties Inc (REIT)	Morgan Stanley	(287)
(2,901)	Covanta Holding Corp	Goldman Sachs	(2,292)
(336)	Cowen Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(144)
886	Cracker Barrel Old Country Store Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,357
560	Cracker Barrel Old Country Store Inc	Goldman Sachs	2,248
(398)	Crane Co	Bank of America Merrill Lynch	472
(134)	Crane Co	Goldman Sachs	(364)
(185)	Crane Co	Morgan Stanley	(281)
3,841	Crawford & Co 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(2,228)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
2,469	Crawford & Co 'A'	Goldman Sachs	(1,432)
52	Credit Acceptance Corp	Bank of America Merrill Lynch	(898)
45	Credit Acceptance Corp	Goldman Sachs	(738)
87	Credit Acceptance Corp	Morgan Stanley	887
(74)	Cree Inc	Goldman Sachs	(63)
(273)	Cree Inc	Morgan Stanley	(925)
781	Crinetics Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	31
297	CrossFirst Bankshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	(102)
(63)	Crowdstrike Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,096)
(132)	Crowdstrike Holdings Inc 'A'	Morgan Stanley	(760)
236	Crown Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(52)
184	CryoLife Inc	Goldman Sachs	12
1,065	CryoPort Inc	Goldman Sachs	3,191
86	CryoPort Inc	Morgan Stanley	244
384	CSG Systems International Inc	Goldman Sachs	(44)
(415)	CSW Industrials Inc	Goldman Sachs	1,963
(110)	CSX Corp	Bank of America Merrill Lynch	145
(381)	CSX Corp	Goldman Sachs	283
(1,126)	CSX Corp	Morgan Stanley	443
(407)	CTS Corp	Bank of America Merrill Lynch	326
(2,057)	CTS Corp	Goldman Sachs	1,399
(468)	CubeSmart (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	992
(681)	CubeSmart (REIT)	Goldman Sachs	37
(268)	CubeSmart (REIT)	Morgan Stanley	121
98	Cubic Corp	Goldman Sachs	(283)
364	Cue Biopharma Inc	Goldman Sachs	735
37	Cummins Inc	Bank of America Merrill Lynch	(178)
512	Cummins Inc	Goldman Sachs	(2,005)
106	Cummins Inc	Morgan Stanley	(765)
(227)	Curtiss-Wright Corp	Goldman Sachs	(628)
(538)	CVB Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	716
1,198	CVR Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	269
854	CVR Energy Inc	Goldman Sachs	298
(257)	CVS Health Corp	Goldman Sachs	(228)
(778)	CVS Health Corp	Morgan Stanley	(965)
225	CyrusOne Inc (REIT)	Morgan Stanley	(169)
673	Dana Inc	Bank of America Merrill Lynch	(94)
1,020	Dana Inc	Goldman Sachs	(143)
390	Danaher Corp	Morgan Stanley	164
13	Darden Restaurants Inc	Bank of America Merrill Lynch	(72)
(150)	DaVita Inc	Bank of America Merrill Lynch	(77)
(1,027)	DaVita Inc	Goldman Sachs	3,105
84	Deckers Outdoor Corp	Bank of America Merrill Lynch	709
75	Deckers Outdoor Corp	Goldman Sachs	775
80	Deckers Outdoor Corp	Morgan Stanley	55

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
46	Deere & Co	Bank of America Merrill Lynch	44
153	Deere & Co	Morgan Stanley	329
2,619	Delek US Holdings Inc	Goldman Sachs	(1,493)
(42)	Dell Technologies Inc 'C'	Morgan Stanley	60
47	Delta Air Lines Inc	Bank of America Merrill Lynch	115
244	Delta Air Lines Inc	Morgan Stanley	346
(542)	Deluxe Corp	Bank of America Merrill Lynch	(70)
(731)	Deluxe Corp	Goldman Sachs	(95)
500	Denny's Corp	Bank of America Merrill Lynch	80
3,171	Denny's Corp	Goldman Sachs	507
(380)	DENTSPLY SIRONA Inc	Morgan Stanley	(126)
3,296	Designer Brands Inc 'A'	Goldman Sachs	3,856
97	DexCom Inc	Morgan Stanley	81
(28)	Diamond Hill Investment Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	31
(574)	Diamond Hill Investment Group Inc	Goldman Sachs	8,720
539	Diamondback Energy Inc	Goldman Sachs	2,993
41	Diamondback Energy Inc	Morgan Stanley	(82)
3,145	DiamondRock Hospitality Co (REIT)	Goldman Sachs	3,145
(126)	Dick's Sporting Goods Inc	Bank of America Merrill Lynch	115
(80)	Dick's Sporting Goods Inc	Goldman Sachs	(32)
2	Digital Realty Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	(14)
141	Digital Turbine Inc	Bank of America Merrill Lynch	584
232	Dillard's Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	180
73	Dine Brands Global Inc	Bank of America Merrill Lynch	(43)
326	Dine Brands Global Inc	Goldman Sachs	(554)
(614)	Diodes Inc	Goldman Sachs	(1,175)
18	Discover Financial Services	Goldman Sachs	(9)
1,946	Discovery Inc 'A'	Morgan Stanley	1,187
2,028	Discovery Inc 'C'	Goldman Sachs	4,908
863	Discovery Inc 'C'	Morgan Stanley	388
(1,553)	DISH Network Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(4,224)
(1,983)	Diversified Healthcare Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(799)
(1,737)	Diversified Healthcare Trust (REIT)	Goldman Sachs	(1,190)
212	DMC Global Inc	Bank of America Merrill Lynch	70
298	Dolby Laboratories Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	37
259	Dolby Laboratories Inc 'A'	Morgan Stanley	517
(51)	Dollar General Corp	Bank of America Merrill Lynch	(192)
(146)	Dollar Tree Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,921)
183	Dominion Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	108
260	Domo Inc 'B'	Goldman Sachs	1,082
160	Domtar Corp	Bank of America Merrill Lynch	275
1,954	Donegal Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(723)
3,774	Donegal Group Inc 'A'	Goldman Sachs	(1,396)
(17)	Dorman Products Inc	Bank of America Merrill Lynch	65
(53)	Dorman Products Inc	Goldman Sachs	204

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
134	Douglas Dynamics Inc	Goldman Sachs	222
(1,166)	Douglas Emmett Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	577
(647)	Douglas Emmett Inc (REIT)	Goldman Sachs	438
(906)	Douglas Emmett Inc (REIT)	Morgan Stanley	988
(587)	Dow Inc	Bank of America Merrill Lynch	(358)
(76)	Dow Inc	Goldman Sachs	1
(895)	Dow Inc	Morgan Stanley	1,253
(770)	DR Horton Inc	Bank of America Merrill Lynch	768
(13)	DR Horton Inc	Goldman Sachs	(10)
(160)	DR Horton Inc	Morgan Stanley	376
(236)	DraftKings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,149)
(296)	DraftKings Inc 'A'	Morgan Stanley	(1,442)
(159)	Dril-Quip Inc	Bank of America Merrill Lynch	56
(292)	Dril-Quip Inc	Goldman Sachs	280
(66)	Dropbox Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(73)
(547)	Dropbox Inc 'A'	Goldman Sachs	(629)
(231)	Dropbox Inc 'A'	Morgan Stanley	(181)
225	DSP Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	122
221	DSP Group Inc	Goldman Sachs	119
(196)	DTE Energy Co	Bank of America Merrill Lynch	1,053
(448)	DTE Energy Co	Goldman Sachs	3,109
(473)	DTE Energy Co	Morgan Stanley	1,017
69	Ducommun Inc	Bank of America Merrill Lynch	485
116	Duke Realty Corp (REIT)	Morgan Stanley	19
158	Dun & Bradstreet Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(239)
1,159	Dun & Bradstreet Holdings Inc	Goldman Sachs	(1,750)
1,698	Dun & Bradstreet Holdings Inc	Morgan Stanley	(1,002)
2,903	Durect Corp	Bank of America Merrill Lynch	116
3,621	Durect Corp	Goldman Sachs	145
78	DXC Technology Co	Bank of America Merrill Lynch	(74)
299	DXC Technology Co	Goldman Sachs	83
68	DXC Technology Co	Morgan Stanley	23
(172)	DXP Enterprises Inc	Goldman Sachs	163
(89)	Dycom Industries Inc	Goldman Sachs	664
(1,073)	Dynatrace Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,152)
(593)	Dynatrace Inc	Goldman Sachs	(1,651)
(210)	Dynatrace Inc	Morgan Stanley	(540)
(321)	Eagle Materials Inc	Morgan Stanley	610
54	Eagle Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(42)
174	Eagle Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(96)
69	East West Bancorp Inc	Goldman Sachs	46
473	East West Bancorp Inc	Morgan Stanley	(121)
565	Easterly Government Properties Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(158)
1,725	Easterly Government Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	(386)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(249)	EastGroup Properties Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	1,549
(272)	EastGroup Properties Inc (REIT)	Morgan Stanley	(64)
(57)	Eastman Chemical Co	Bank of America Merrill Lynch	214
(98)	Eastman Chemical Co	Goldman Sachs	(7)
(37)	Eastman Chemical Co	Morgan Stanley	27
(284)	eBay Inc	Bank of America Merrill Lynch	(476)
(1,150)	eBay Inc	Morgan Stanley	(374)
(387)	Ebix Inc	Goldman Sachs	(1,598)
271	Echo Global Logistics Inc	Goldman Sachs	-
(1,739)	EchoStar Corp 'A'	Goldman Sachs	3,913
36	Ecolab Inc	Bank of America Merrill Lynch	403
(1)	Ecolab Inc	Goldman Sachs	(29)
264	Ecolab Inc	Morgan Stanley	2,054
142	Edgewell Personal Care Co	Goldman Sachs	3
866	Edwards Lifesciences Corp	Morgan Stanley	(468)
82	eHealth Inc	Bank of America Merrill Lynch	214
243	eHealth Inc	Goldman Sachs	2,228
1,215	El Pollo Loco Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(326)
980	El Pollo Loco Holdings Inc	Goldman Sachs	(395)
2,278	Elanco Animal Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,333
148	Elanco Animal Health Inc	Goldman Sachs	45
(144)	Electronic Arts Inc	Bank of America Merrill Lynch	(956)
(313)	Electronic Arts Inc	Morgan Stanley	(1,501)
(1,806)	Element Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,851)
(95)	Element Solutions Inc	Goldman Sachs	(1)
(875)	Element Solutions Inc	Morgan Stanley	(372)
352	elf Beauty Inc	Goldman Sachs	(46)
(54)	Eli Lilly and Co	Bank of America Merrill Lynch	(33)
(111)	EMCOR Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(339)
(264)	EMCOR Group Inc	Goldman Sachs	(692)
(342)	EMCOR Group Inc	Morgan Stanley	(332)
61	Emerson Electric Co	Bank of America Merrill Lynch	(155)
568	Emerson Electric Co	Goldman Sachs	(147)
(567)	Empire State Realty Trust Inc 'A' (REIT)	Goldman Sachs	(737)
(386)	Employers Holdings Inc	Goldman Sachs	1,397
(87)	Encompass Health Corp	Bank of America Merrill Lynch	78
(126)	Encompass Health Corp	Goldman Sachs	(82)
(481)	Encompass Health Corp	Morgan Stanley	(154)
(479)	Encore Wire Corp	Bank of America Merrill Lynch	924
(497)	Encore Wire Corp	Goldman Sachs	959
(2,272)	Endurance International Group Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(65)
952	Energy Recovery Inc	Bank of America Merrill Lynch	333
428	Energy Recovery Inc	Goldman Sachs	150
185	Enerpac Tool Group Corp	Goldman Sachs	128

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
107	EnerSys	Morgan Stanley	21
(3,761)	EnLink Midstream LLC (Unit)	Bank of America Merrill Lynch	(2,915)
(404)	Ennis Inc	Bank of America Merrill Lynch	53
(697)	Ennis Inc	Goldman Sachs	121
(241)	Enova International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(133)
(434)	Enova International Inc	Goldman Sachs	(198)
(159)	Enphase Energy Inc	Goldman Sachs	(2,518)
102	EnPro Industries Inc	Goldman Sachs	21
(347)	Ensign Group Inc	Goldman Sachs	(899)
(208)	Entegris Inc	Bank of America Merrill Lynch	(706)
(289)	Entegris Inc	Morgan Stanley	(367)
(199)	Entergy Corp	Bank of America Merrill Lynch	(46)
(313)	Entergy Corp	Goldman Sachs	365
(222)	Entergy Corp	Morgan Stanley	(44)
137	Enterprise Financial Services Corp	Bank of America Merrill Lynch	(63)
275	Enterprise Financial Services Corp	Goldman Sachs	(307)
264	Envista Holdings Corp	Goldman Sachs	367
396	Envista Holdings Corp	Morgan Stanley	289
(113)	EOG Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	(585)
(945)	EOG Resources Inc	Goldman Sachs	(3,178)
(534)	EOG Resources Inc	Morgan Stanley	(27)
22	EPAM Systems Inc	Goldman Sachs	(66)
153	EPAM Systems Inc	Morgan Stanley	(2,425)
320	ePlus Inc	Goldman Sachs	1,456
605	EQT Corp	Morgan Stanley	(12)
(106)	Equifax Inc	Bank of America Merrill Lynch	541
(88)	Equifax Inc	Goldman Sachs	(84)
(69)	Equifax Inc	Morgan Stanley	291
77	Equinix Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(3,363)
55	Equinix Inc (REIT)	Goldman Sachs	(2,709)
11	Equinix Inc (REIT)	Morgan Stanley	(62)
312	Equitable Holdings Inc	Goldman Sachs	(7)
928	Equitable Holdings Inc	Morgan Stanley	909
7,892	Equitrans Midstream Corp	Bank of America Merrill Lynch	10,802
125	Equitrans Midstream Corp	Goldman Sachs	99
(960)	Equity Commonwealth (REIT)	Goldman Sachs	490
(3,090)	Equity Commonwealth (REIT)	Morgan Stanley	31
(496)	Equity LifeStyle Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	37
(439)	Equity Residential (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	1,245
10	Erie Indemnity Co 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(41)
974	ESCO Technologies Inc	Goldman Sachs	(1,987)
257	Essential Properties Realty Trust Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	23
1,723	Essential Properties Realty Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	439
62	Essential Utilities Inc	Bank of America Merrill Lynch	74

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
556	Essential Utilities Inc	Goldman Sachs	(139)
742	Essential Utilities Inc	Morgan Stanley	846
(185)	Essex Property Trust Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	2,522
95	Estee Lauder Cos Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,383)
343	Estee Lauder Cos Inc 'A'	Goldman Sachs	(2,865)
293	Estee Lauder Cos Inc 'A'	Morgan Stanley	1,049
283	Ethan Allen Interiors Inc	Goldman Sachs	229
(85)	Etsy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,584)
(59)	Etsy Inc	Goldman Sachs	(1,039)
(109)	Etsy Inc	Morgan Stanley	(178)
372	Eventbrite Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	17
(15)	Everbridge Inc	Bank of America Merrill Lynch	(44)
(28)	Everbridge Inc	Morgan Stanley	(71)
(23)	Evercore Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(88)
(530)	Evercore Inc 'A'	Goldman Sachs	(2,025)
(822)	Evergy Inc	Goldman Sachs	1,586
305	Everi Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(15)
1,561	Everi Holdings Inc	Goldman Sachs	62
79	EverQuote Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(95)
419	EverQuote Inc 'A'	Goldman Sachs	(863)
161	Eversource Energy	Bank of America Merrill Lynch	(1,021)
206	Eversource Energy	Goldman Sachs	(1,306)
393	Eversource Energy	Morgan Stanley	118
209	Evo Payments Inc 'A'	Goldman Sachs	(300)
(334)	Evolent Health Inc 'A'	Goldman Sachs	(481)
322	Evoqua Water Technologies Corp	Bank of America Merrill Lynch	(327)
155	Evoqua Water Technologies Corp	Goldman Sachs	(274)
(48)	Exelon Corp	Bank of America Merrill Lynch	10
(416)	Exelon Corp	Goldman Sachs	248
(384)	Exelon Corp	Morgan Stanley	54
(42)	ExlService Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	1
(169)	ExlService Holdings Inc	Goldman Sachs	(189)
161	eXp World Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(94)
56	Expedia Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	52
194	Expedia Group Inc	Goldman Sachs	250
316	Expedia Group Inc	Morgan Stanley	419
275	Expeditors International of Washington Inc	Morgan Stanley	33
(219)	Exponent Inc	Bank of America Merrill Lynch	(181)
(124)	Exponent Inc	Morgan Stanley	(139)
2,107	Extended Stay America Inc (Unit)	Goldman Sachs	893
(508)	Extra Space Storage Inc (REIT)	Morgan Stanley	(107)
2,780	Exxon Mobil Corp	Morgan Stanley	(2,279)
98	F5 Networks Inc	Bank of America Merrill Lynch	(47)
158	F5 Networks Inc	Morgan Stanley	(242)
232	FactSet Research Systems Inc	Morgan Stanley	4,376

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
59	Fair Isaac Corp	Morgan Stanley	(732)
(64)	FARO Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(27)
(297)	FARO Technologies Inc	Goldman Sachs	91
(50)	Fastenal Co	Goldman Sachs	(16)
(269)	Fastenal Co	Morgan Stanley	(274)
(502)	Fastly Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(3,260)
(243)	Fastly Inc 'A'	Morgan Stanley	(488)
449	FB Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	4
1,425	FB Financial Corp	Goldman Sachs	14
(1,772)	FBL Financial Group Inc 'A'	Goldman Sachs	(496)
538	Federal Agricultural Mortgage Corp 'C'	Bank of America Merrill Lynch	(990)
1,615	Federal Agricultural Mortgage Corp 'C'	Goldman Sachs	(2,972)
121	Federal Signal Corp	Bank of America Merrill Lynch	(148)
1,792	Federal Signal Corp	Goldman Sachs	(2,186)
(1,973)	Federated Hermes Inc	Goldman Sachs	1,302
22	FedEx Corp	Goldman Sachs	(117)
321	FedEx Corp	Morgan Stanley	568
(3,623)	Ferro Corp	Bank of America Merrill Lynch	(797)
(53)	Fidelity National Information Services Inc	Goldman Sachs	(19)
(275)	Fidelity National Information Services Inc	Morgan Stanley	(531)
1,208	Financial Institutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	60
505	Financial Institutions Inc	Goldman Sachs	25
(2,449)	FireEye Inc	Morgan Stanley	(465)
426	First American Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	141
299	First American Financial Corp	Goldman Sachs	(23)
31	First American Financial Corp	Morgan Stanley	(26)
(310)	First Bancorp/Southern Pines NC	Bank of America Merrill Lynch	326
(1,695)	First Bancorp/Southern Pines NC	Goldman Sachs	1,800
(370)	First Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	292
(331)	First Busey Corp	Goldman Sachs	152
178	First Financial Bankshares Inc	Goldman Sachs	(103)
(84)	First Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(51)
(417)	First Financial Corp	Goldman Sachs	9
(801)	First Foundation Inc	Goldman Sachs	(368)
3,723	First Horizon National Corp	Bank of America Merrill Lynch	968
622	First Horizon National Corp	Goldman Sachs	210
944	First Horizon National Corp	Morgan Stanley	368
(141)	First Industrial Realty Trust Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	128
(253)	First Industrial Realty Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	174
(240)	First Industrial Realty Trust Inc (REIT)	Morgan Stanley	2
(99)	First Interstate BancSystem Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	90

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(1,260)	First Merchants Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,122)
1	First Mid Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	1
292	First Mid Bancshares Inc	Goldman Sachs	365
(84)	First of Long Island Corp	Goldman Sachs	22
(553)	First Solar Inc	Morgan Stanley	(3,771)
(571)	FirstCash Inc	Goldman Sachs	196
45	FirstEnergy Corp	Bank of America Merrill Lynch	(55)
539	FirstEnergy Corp	Morgan Stanley	(534)
381	Fiserv Inc	Morgan Stanley	872
98	Five Below Inc	Bank of America Merrill Lynch	376
43	Five Below Inc	Goldman Sachs	215
199	Five Below Inc	Morgan Stanley	159
45	Five9 Inc	Bank of America Merrill Lynch	374
94	Five9 Inc	Goldman Sachs	1,114
9	Five9 Inc	Morgan Stanley	40
50	Flagstar Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	19
3,542	Flagstar Bancorp Inc	Goldman Sachs	1,328
67	FleetCor Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	95
65	FleetCor Technologies Inc	Goldman Sachs	423
35	FleetCor Technologies Inc	Morgan Stanley	461
227	Flexion Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(101)
251	FLIR Systems Inc	Goldman Sachs	371
9	FLIR Systems Inc	Morgan Stanley	7
(58)	Floor & Decor Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	54
386	Flowserve Corp	Bank of America Merrill Lynch	(75)
419	Flowserve Corp	Goldman Sachs	399
208	Flowserve Corp	Morgan Stanley	(187)
75	Flushing Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	53
2,330	Flushing Financial Corp	Goldman Sachs	1,654
2,927	FNB Corp	Goldman Sachs	782
96	Focus Financial Partners Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	28
269	Focus Financial Partners Inc 'A'	Goldman Sachs	268
583	Foot Locker Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,047)
69	Foot Locker Inc	Goldman Sachs	(217)
498	Foot Locker Inc	Morgan Stanley	(215)
(721)	Forestar Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(310)
(842)	Forestar Group Inc	Goldman Sachs	(362)
(1,297)	FormFactor Inc	Goldman Sachs	(655)
839	Forrester Research Inc	Goldman Sachs	1,049
(179)	Forterra Inc	Goldman Sachs	11
(191)	Fortinet Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,110)
(120)	Fortinet Inc	Goldman Sachs	118
1	Fortive Corp	Goldman Sachs	(2)
(129)	Fortune Brands Home & Security Inc	Bank of America Merrill Lynch	81
(615)	Fortune Brands Home & Security Inc	Goldman Sachs	354

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(116)	Fortune Brands Home & Security Inc	Morgan Stanley	174
(103)	Forward Air Corp	Bank of America Merrill Lynch	56
(794)	Forward Air Corp	Goldman Sachs	429
118	Four Corners Property Trust Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(190)
1,338	Four Corners Property Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	(2,154)
158	Fox Corp ' B '	Bank of America Merrill Lynch	300
236	Fox Corp ' B '	Morgan Stanley	144
96	Fox Factory Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	706
13	Fox Factory Holding Corp	Goldman Sachs	34
157	Fox Factory Holding Corp	Morgan Stanley	352
52	Franklin Electric Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(30)
403	Franklin Electric Co Inc	Goldman Sachs	(251)
2,336	Franklin Resources Inc	Morgan Stanley	2,172
(1,265)	Franklin Street Properties Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	25
104	Freedom Holding Corp	Goldman Sachs	26
29	Freeport-McMoRan Inc	Bank of America Merrill Lynch	72
1,089	Freeport-McMoRan Inc	Goldman Sachs	2,712
441	Freeport-McMoRan Inc	Morgan Stanley	697
242	Freshpet Inc	Bank of America Merrill Lynch	489
40	Freshpet Inc	Morgan Stanley	(158)
110	frontdoor Inc	Bank of America Merrill Lynch	144
457	frontdoor Inc	Goldman Sachs	452
47	frontdoor Inc	Morgan Stanley	57
(223)	FRP Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(178)
148	FTI Consulting Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4)
128	FTI Consulting Inc	Goldman Sachs	31
55	FTI Consulting Inc	Morgan Stanley	12
(1,472)	Fulton Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	515
(1,544)	Fulton Financial Corp	Goldman Sachs	540
(916)	FutureFuel Corp	Goldman Sachs	137
434	G1 Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,606
(753)	GameStop Corp ' A '	Bank of America Merrill Lynch	(4,394)
2	Gaming and Leisure Properties Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(2)
302	Gaming and Leisure Properties Inc (REIT)	Morgan Stanley	(435)
306	Gap Inc	Goldman Sachs	(235)
472	Gartner Inc	Morgan Stanley	(423)
1,124	GATX Corp	Goldman Sachs	(1,461)
(1,454)	GCP Applied Technologies Inc	Goldman Sachs	1,643
(2,259)	General Electric Co	Goldman Sachs	(1,378)
(1,584)	General Electric Co	Morgan Stanley	(174)
(1,259)	General Mills Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,612
(432)	General Mills Inc	Morgan Stanley	471
(755)	General Motors Co	Bank of America Merrill Lynch	(694)
(1,558)	General Motors Co	Morgan Stanley	(93)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(157)	Genesco Inc	Goldman Sachs	104
225	GenMark Diagnostics Inc	Goldman Sachs	(31)
(863)	Gentex Corp	Bank of America Merrill Lynch	13
69	Gentherm Inc	Goldman Sachs	141
(369)	Genuine Parts Co	Goldman Sachs	856
(11)	Genuine Parts Co	Morgan Stanley	(1)
(2,482)	Genworth Financial Inc 'A'	Goldman Sachs	174
(1,677)	GEO Group Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(570)
(271)	German American Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	406
(509)	German American Bancorp Inc	Goldman Sachs	568
963	Getty Realty Corp (REIT)	Goldman Sachs	(713)
(230)	GFL Environmental Inc	Morgan Stanley	(189)
115	Gibraltar Industries Inc	Goldman Sachs	13
(371)	G-III Apparel Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	48
(324)	Glacier Bancorp Inc	Goldman Sachs	716
(1,606)	Glatfelter Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,012)
(4,447)	Glatfelter Corp	Goldman Sachs	(2,802)
7	Glaukos Corp	Bank of America Merrill Lynch	17
410	Glaukos Corp	Goldman Sachs	935
322	Global Medical Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(274)
1,702	Global Medical Inc (REIT)	Goldman Sachs	(977)
48	Global Payments Inc	Bank of America Merrill Lynch	246
35	Global Payments Inc	Morgan Stanley	102
(236)	Globe Life Inc	Bank of America Merrill Lynch	(203)
182	Globus Medical Inc 'A'	Morgan Stanley	278
76	Glu Mobile Inc	Bank of America Merrill Lynch	88
495	Glu Mobile Inc	Goldman Sachs	574
(225)	GMS Inc	Bank of America Merrill Lynch	190
(687)	GMS Inc	Goldman Sachs	896
174	GoDaddy Inc 'A'	Morgan Stanley	334
(103)	Goldman Sachs Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,204)
(7)	Goldman Sachs Group Inc	Morgan Stanley	(37)
401	GoodRx Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,076)
1,270	GoodRx Holdings Inc 'A'	Morgan Stanley	(2,489)
545	Goodyear Tire & Rubber Co	Bank of America Merrill Lynch	(121)
(62)	Goosehead Insurance Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(36)
(115)	Goosehead Insurance Inc 'A'	Goldman Sachs	323
(19)	Goosehead Insurance Inc 'A'	Morgan Stanley	31
(2,852)	GoPro Inc 'A'	Goldman Sachs	371
389	Gorman-Rupp Co	Goldman Sachs	(420)
334	Gossamer Bio Inc	Goldman Sachs	(27)
787	Graco Inc	Morgan Stanley	(559)
405	GrafTech International Ltd	Goldman Sachs	(82)
9	Graham Holdings Co 'B'	Bank of America Merrill Lynch	19
25	Grand Canyon Education Inc	Bank of America Merrill Lynch	(26)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
152	Grand Canyon Education Inc	Goldman Sachs	113
141	Grand Canyon Education Inc	Morgan Stanley	(136)
(125)	Granite Construction Inc	Bank of America Merrill Lynch	22
(379)	Granite Construction Inc	Goldman Sachs	(498)
(3,115)	Graphic Packaging Holding Co	Bank of America Merrill Lynch	(1,464)
(2,816)	Graphic Packaging Holding Co	Morgan Stanley	225
(214)	Gray Television Inc	Goldman Sachs	(29)
(1,889)	Great Lakes Dredge & Dock Corp	Bank of America Merrill Lynch	(132)
(283)	Great Southern Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	15
(663)	Great Southern Bancorp Inc	Goldman Sachs	43
591	Green Brick Partners Inc	Bank of America Merrill Lynch	(816)
349	Green Brick Partners Inc	Goldman Sachs	(237)
(402)	Green Dot Corp 'A'	Goldman Sachs	257
(255)	Greenbrier Cos Inc	Goldman Sachs	(38)
(382)	Greif Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(722)
(154)	Greif Inc 'A'	Goldman Sachs	(291)
102	Greif Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	34
880	Greif Inc 'B'	Goldman Sachs	290
331	Griffon Corp	Bank of America Merrill Lynch	359
(97)	Group 1 Automotive Inc	Bank of America Merrill Lynch	108
700	Guess? Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,764
60	Guidewire Software Inc	Goldman Sachs	848
121	Guidewire Software Inc	Morgan Stanley	701
(141)	H&E Equipment Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(63)
4,339	H&R Block Inc	Goldman Sachs	5,676
2,888	H&R Block Inc	Morgan Stanley	1,906
(257)	Hackett Group Inc	Goldman Sachs	15
108	Haemonetics Corp	Bank of America Merrill Lynch	125
15	Haemonetics Corp	Morgan Stanley	(70)
(117)	Hain Celestial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(38)
(1,597)	Hain Celestial Group Inc	Morgan Stanley	(449)
1,929	Halliburton Co	Bank of America Merrill Lynch	3,633
1,850	Halliburton Co	Goldman Sachs	3,700
2,207	Halliburton Co	Morgan Stanley	309
680	Hamilton Lane Inc 'A'	Goldman Sachs	(3,516)
(242)	Hancock Whitney Corp	Goldman Sachs	(86)
892	Hanesbrands Inc	Bank of America Merrill Lynch	707
(594)	Hanger Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,290)
(271)	Hanger Inc	Goldman Sachs	(522)
96	Hanover Insurance Group Inc	Goldman Sachs	(214)
232	Hanover Insurance Group Inc	Morgan Stanley	(162)
(2,152)	HarborOne Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	194
(1,239)	HarborOne Bancorp Inc	Goldman Sachs	112
304	Harley-Davidson Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,392
555	Harmonic Inc	Bank of America Merrill Lynch	189

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
1,167	Harmonic Inc	Goldman Sachs	336
426	Harsco Corp	Bank of America Merrill Lynch	630
220	Harsco Corp	Goldman Sachs	326
38	Hartford Financial Services Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(50)
426	Hartford Financial Services Group Inc	Morgan Stanley	(605)
60	Hasbro Inc	Bank of America Merrill Lynch	(72)
111	Hasbro Inc	Goldman Sachs	(44)
353	Hasbro Inc	Morgan Stanley	(473)
(197)	Haverty Furniture Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	468
161	Hawaiian Electric Industries Inc	Goldman Sachs	(171)
(108)	Hawkins Inc	Bank of America Merrill Lynch	330
(632)	Hawkins Inc	Goldman Sachs	1,656
(169)	Haynes International Inc	Bank of America Merrill Lynch	69
(651)	Haynes International Inc	Goldman Sachs	40
170	HB Fuller Co	Bank of America Merrill Lynch	(12)
117	HB Fuller Co	Goldman Sachs	(8)
(213)	HCA Healthcare Inc	Morgan Stanley	(454)
98	HCI Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(66)
406	HCI Group Inc	Goldman Sachs	(272)
271	Health Catalyst Inc	Bank of America Merrill Lynch	561
701	Health Catalyst Inc	Goldman Sachs	1,451
(106)	Healthcare Realty Trust Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	224
(1,706)	Healthcare Realty Trust Inc (REIT)	Morgan Stanley	188
(255)	Healthcare Services Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(143)
(942)	Healthcare Services Group Inc	Goldman Sachs	(528)
112	Healthcare Trust of America Inc 'A' (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(192)
1,033	Healthcare Trust of America Inc 'A' (REIT)	Goldman Sachs	(1,772)
521	HealthEquity Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,088
113	HealthEquity Inc	Goldman Sachs	277
183	HealthEquity Inc	Morgan Stanley	195
(396)	Healthpeak Properties Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	331
(52)	Healthpeak Properties Inc (REIT)	Morgan Stanley	5
882	HealthStream Inc	Bank of America Merrill Lynch	(164)
645	HealthStream Inc	Goldman Sachs	84
(355)	Heartland Express Inc	Goldman Sachs	31
(410)	Heartland Financial USA Inc	Goldman Sachs	(236)
1,767	Hecla Mining Co	Goldman Sachs	(48)
124	HEICO Corp	Morgan Stanley	(327)
(276)	HEICO Corp 'A'	Morgan Stanley	494
108	Heidrick & Struggles International Inc	Bank of America Merrill Lynch	59
245	Heidrick & Struggles International Inc	Goldman Sachs	(33)
2,302	Helix Energy Solutions Group Inc	Goldman Sachs	1,657
786	Helmerich & Payne Inc	Goldman Sachs	3,782
8	Henry Schein Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
804	Henry Schein Inc	Morgan Stanley	201
101	Herc Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(150)
63	Herc Holdings Inc	Goldman Sachs	(172)
(241)	Heritage Insurance Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	6
(1,042)	Heritage Insurance Holdings Inc	Goldman Sachs	226
917	Herman Miller Inc	Goldman Sachs	(990)
(104)	Hershey Co	Bank of America Merrill Lynch	523
(179)	Hershey Co	Goldman Sachs	1,060
(53)	Hershey Co	Morgan Stanley	(3)
142	Heska Corp	Goldman Sachs	203
385	Hess Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,405
13,990	Hewlett Packard Enterprise Co	Morgan Stanley	1,259
(536)	Hibbett Sports Inc	Goldman Sachs	(1,544)
(171)	Highwoods Properties Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(76)
(888)	Hillenbrand Inc	Goldman Sachs	(1,971)
182	Hill-Rom Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(35)
265	Hill-Rom Holdings Inc	Goldman Sachs	(101)
295	Hill-Rom Holdings Inc	Morgan Stanley	(732)
(1,462)	Hilltop Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(234)
309	Hilton Grand Vacations Inc	Bank of America Merrill Lynch	(89)
1,463	Hilton Grand Vacations Inc	Goldman Sachs	(561)
192	Hilton Worldwide Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	155
512	Hilton Worldwide Holdings Inc	Goldman Sachs	153
(347)	HNI Corp	Bank of America Merrill Lynch	195
(1,501)	HNI Corp	Goldman Sachs	867
312	HollyFrontier Corp	Goldman Sachs	(248)
1,746	HollyFrontier Corp	Morgan Stanley	(609)
(603)	Home BancShares Inc	Goldman Sachs	262
(651)	Home Depot Inc	Morgan Stanley	(1,273)
(888)	HomeStreet Inc	Goldman Sachs	1,474
(435)	HomeTrust Bancshares Inc	Goldman Sachs	309
(236)	Honeywell International Inc	Bank of America Merrill Lynch	628
(77)	Honeywell International Inc	Goldman Sachs	205
(221)	Honeywell International Inc	Morgan Stanley	(298)
(3,034)	Horizon Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(61)
(2,144)	Horizon Bancorp Inc	Goldman Sachs	(43)
78	Hormel Foods Corp	Bank of America Merrill Lynch	(318)
1,376	Hormel Foods Corp	Goldman Sachs	(2,020)
531	Hormel Foods Corp	Morgan Stanley	(1,689)
176	Host Hotels & Resorts Inc (REIT)	Morgan Stanley	(22)
1,456	Hostess Brands Inc	Goldman Sachs	(116)
(108)	Houlihan Lokey Inc	Bank of America Merrill Lynch	(33)
(362)	Houlihan Lokey Inc	Goldman Sachs	(112)
(166)	Houlihan Lokey Inc	Morgan Stanley	(403)
186	Howard Hughes Corp	Bank of America Merrill Lynch	173

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
44	Howard Hughes Corp	Goldman Sachs	52
272	Howard Hughes Corp	Morgan Stanley	(316)
(803)	Howmet Aerospace Inc	Bank of America Merrill Lynch	(867)
109	Hub Group Inc 'A'	Goldman Sachs	22
19	Hubbell Inc	Bank of America Merrill Lynch	44
131	Hubbell Inc	Goldman Sachs	410
95	HubSpot Inc	Morgan Stanley	2,253
(612)	Hudson Pacific Properties Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	9
(360)	Hudson Pacific Properties Inc (REIT)	Morgan Stanley	148
(26)	Humana Inc	Bank of America Merrill Lynch	609
(14)	Humana Inc	Goldman Sachs	2
(50)	Humana Inc	Morgan Stanley	210
3,190	Huntington Bancshares Inc	Goldman Sachs	1,276
438	Huntington Bancshares Inc	Morgan Stanley	110
(78)	Huntington Ingalls Industries Inc	Morgan Stanley	146
(166)	Huron Consulting Group Inc	Goldman Sachs	(244)
280	Hyatt Hotels Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	690
180	Hyatt Hotels Corp 'A'	Goldman Sachs	226
525	Hyatt Hotels Corp 'A'	Morgan Stanley	(366)
1,152	Hyllion Holdings Corp	Goldman Sachs	(4,975)
(242)	Hyster-Yale Materials Handling Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,157)
(109)	Hyster-Yale Materials Handling Inc	Goldman Sachs	(521)
176	IAA Inc	Bank of America Merrill Lynch	(41)
71	IAA Inc	Morgan Stanley	23
(147)	IAC/InterActiveCorp	Goldman Sachs	(812)
44	ICF International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(55)
115	ICF International Inc	Goldman Sachs	(298)
74	ICU Medical Inc	Bank of America Merrill Lynch	(86)
27	ICU Medical Inc	Goldman Sachs	(60)
2	ICU Medical Inc	Morgan Stanley	3
135	IDEX Corp	Goldman Sachs	(811)
61	IDEX Corp	Morgan Stanley	(130)
(1,177)	IES Holdings Inc	Goldman Sachs	977
2,006	iHeartMedia Inc 'A'	Goldman Sachs	3,470
(102)	II-VI Inc	Bank of America Merrill Lynch	(135)
(643)	II-VI Inc	Goldman Sachs	(4,610)
161	Illumina Inc	Morgan Stanley	1,851
52	Immunovant Inc	Bank of America Merrill Lynch	(12)
74	Immunovant Inc	Goldman Sachs	(103)
(522)	Independence Realty Trust Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	251
(835)	Independence Realty Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	605
(192)	Independent Bank Corp	Bank of America Merrill Lynch	44
36	Independent Bank Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(24)
308	Independent Bank Group Inc	Goldman Sachs	(478)
(2,274)	Industrial Logistics Properties Trust (REIT)	Goldman Sachs	273

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
1,833	Infinera Corp	Bank of America Merrill Lynch	3,188
229	Ingersoll Rand Inc	Bank of America Merrill Lynch	(119)
1,802	Ingersoll Rand Inc	Morgan Stanley	(421)
(227)	Ingevity Corp	Goldman Sachs	427
(235)	Ingles Markets Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	226
(456)	Ingles Markets Inc 'A'	Goldman Sachs	438
711	Ingredion Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,076
524	Ingredion Inc	Goldman Sachs	980
240	Ingredion Inc	Morgan Stanley	230
(310)	Innospec Inc	Goldman Sachs	17
(5,216)	Innoviva Inc	Goldman Sachs	1,121
198	Inogen Inc	Goldman Sachs	461
318	Inovalon Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	200
1,423	Inovalon Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	780
285	Insight Enterprises Inc	Goldman Sachs	31
111	Insperity Inc	Bank of America Merrill Lynch	(229)
176	Insperity Inc	Goldman Sachs	(212)
(145)	Installed Building Products Inc	Bank of America Merrill Lynch	247
(309)	Installed Building Products Inc	Goldman Sachs	(35)
(570)	Insteel Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,034
(630)	Insteel Industries Inc	Goldman Sachs	945
49	Insulet Corp	Bank of America Merrill Lynch	(177)
12	Insulet Corp	Goldman Sachs	(9)
28	Insulet Corp	Morgan Stanley	(461)
(224)	Intel Corp	Goldman Sachs	(167)
(1,139)	Intel Corp	Morgan Stanley	(32)
115	Inter Parfums Inc	Bank of America Merrill Lynch	(152)
523	Inter Parfums Inc	Goldman Sachs	(307)
(69)	Interactive Brokers Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	13
(272)	Interactive Brokers Group Inc 'A'	Goldman Sachs	74
(68)	Interactive Brokers Group Inc 'A'	Morgan Stanley	(35)
99	Intercept Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(24)
514	Intercept Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(352)
249	InterDigital Inc	Bank of America Merrill Lynch	(321)
(165)	International Bancshares Corp	Goldman Sachs	17
238	International Business Machines Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,245
45	International Business Machines Corp	Morgan Stanley	158
256	International Flavors & Fragrances Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,021)
369	International Flavors & Fragrances Inc	Goldman Sachs	(1,472)
573	International Flavors & Fragrances Inc	Morgan Stanley	(292)
(321)	International Money Express Inc	Goldman Sachs	94
(266)	International Paper Co	Bank of America Merrill Lynch	(67)
(511)	International Paper Co	Morgan Stanley	(102)
(510)	Interpublic Group of Cos Inc	Goldman Sachs	(495)
(1,456)	Interpublic Group of Cos Inc	Morgan Stanley	(757)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
189	Intersect ENT Inc	Goldman Sachs	197
20	Intuit Inc	Goldman Sachs	187
78	Intuit Inc	Morgan Stanley	(64)
621	Investors Bancorp Inc	Goldman Sachs	41
(64)	Investors Real Estate Trust (REIT)	Goldman Sachs	200
1,213	Invitation Homes Inc (REIT)	Morgan Stanley	752
55	IPG Photonics Corp	Bank of America Merrill Lynch	135
73	IPG Photonics Corp	Goldman Sachs	180
66	IPG Photonics Corp	Morgan Stanley	30
(83)	iRhythm Technologies Inc	Morgan Stanley	(101)
(172)	Iridium Communications Inc	Bank of America Merrill Lynch	(179)
(682)	Iridium Communications Inc	Goldman Sachs	(709)
(128)	Iridium Communications Inc	Morgan Stanley	(44)
513	iRobot Corp	Goldman Sachs	1,113
227	Iron Mountain Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	157
39	Iron Mountain Inc (REIT)	Goldman Sachs	27
2,095	Iron Mountain Inc (REIT)	Morgan Stanley	1,299
224	iStar Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(55)
423	Itron Inc	Goldman Sachs	2,472
(97)	ITT Inc	Bank of America Merrill Lynch	(154)
(585)	ITT Inc	Morgan Stanley	(614)
(42)	J&J Snack Foods Corp	Bank of America Merrill Lynch	116
(49)	J&J Snack Foods Corp	Goldman Sachs	472
133	J2 Global Inc	Goldman Sachs	(32)
(176)	Jabil Inc	Bank of America Merrill Lynch	40
(751)	Jabil Inc	Goldman Sachs	173
(2,312)	Jabil Inc	Morgan Stanley	(832)
45	Jack Henry & Associates Inc	Morgan Stanley	52
34	Jack in the Box Inc	Bank of America Merrill Lynch	(24)
105	Jack in the Box Inc	Goldman Sachs	(203)
41	Jacobs Engineering Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	6
227	Jacobs Engineering Group Inc	Goldman Sachs	(62)
43	Jacobs Engineering Group Inc	Morgan Stanley	123
(584)	JB Hunt Transport Services Inc	Morgan Stanley	(1,035)
1,169	JBG SMITH Properties (REIT)	Goldman Sachs	74
2,561	Jefferies Financial Group Inc	Goldman Sachs	(563)
339	JELD-WEN Holding Inc	Goldman Sachs	(80)
71	JetBlue Airways Corp	Morgan Stanley	(2)
(78)	John B Sanfilippo & Son Inc	Bank of America Merrill Lynch	131
(302)	John B Sanfilippo & Son Inc	Goldman Sachs	468
(30)	John Bean Technologies Corp	Bank of America Merrill Lynch	(277)
(36)	John Bean Technologies Corp	Goldman Sachs	(332)
(34)	John Bean Technologies Corp	Morgan Stanley	(60)
1,014	John Wiley & Sons Inc 'A'	Goldman Sachs	142
116	Johnson & Johnson	Goldman Sachs	11

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
553	Johnson Outdoors Inc 'A'	Goldman Sachs	(669)
174	Jones Lang LaSalle Inc	Bank of America Merrill Lynch	265
178	Jones Lang LaSalle Inc	Goldman Sachs	(491)
160	Jones Lang LaSalle Inc	Morgan Stanley	(42)
100	Juniper Networks Inc	Morgan Stanley	(6)
270	K12 Inc	Goldman Sachs	416
(186)	Kadant Inc	Goldman Sachs	729
(255)	Kaiser Aluminum Corp	Bank of America Merrill Lynch	(16)
(420)	Kaiser Aluminum Corp	Goldman Sachs	(112)
(801)	Kaman Corp	Goldman Sachs	(1,662)
111	Kansas City Southern	Bank of America Merrill Lynch	261
26	Kansas City Southern	Goldman Sachs	61
603	KAR Auction Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(92)
69	Karuna Therapeutics Inc	Goldman Sachs	233
341	Karyopharm Therapeutics Inc	Goldman Sachs	490
(674)	KB Home	Bank of America Merrill Lynch	423
(216)	KBR Inc	Bank of America Merrill Lynch	(266)
(1,103)	KBR Inc	Morgan Stanley	(397)
(4,054)	Kearny Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	527
(2,092)	Kearny Financial Corp	Goldman Sachs	272
126	Kellogg Co	Goldman Sachs	(495)
79	Kellogg Co	Morgan Stanley	(81)
(504)	Kelly Services Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(86)
(1,513)	Kelly Services Inc 'A'	Goldman Sachs	(257)
23	Kemper Corp	Goldman Sachs	101
42	Kennametal Inc	Bank of America Merrill Lynch	83
1,439	Kennametal Inc	Goldman Sachs	2,394
4,202	Kennedy-Wilson Holdings Inc	Goldman Sachs	1,891
355	KeyCorp	Bank of America Merrill Lynch	85
3,492	KeyCorp	Goldman Sachs	838
311	KeyCorp	Morgan Stanley	(87)
57	Keysight Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	45
387	Keysight Technologies Inc	Goldman Sachs	792
(92)	Kforce Inc	Bank of America Merrill Lynch	(44)
(1,310)	Kforce Inc	Goldman Sachs	(629)
(3)	Kilroy Realty Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	1
(248)	Kilroy Realty Corp (REIT)	Goldman Sachs	299
(171)	Kimball Electronics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10)
(268)	Kimball Electronics Inc	Goldman Sachs	(5)
770	Kimball International Inc 'B'	Goldman Sachs	(65)
(185)	Kimberly-Clark Corp	Bank of America Merrill Lynch	(19)
(44)	Kimberly-Clark Corp	Morgan Stanley	(78)
883	Kimco Realty Corp (REIT)	Morgan Stanley	(268)
267	Kinder Morgan Inc	Goldman Sachs	121
6,239	Kinder Morgan Inc	Morgan Stanley	(250)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(170)	Kinsale Capital Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,832)
(46)	Kinsale Capital Group Inc	Goldman Sachs	(544)
(142)	Kinsale Capital Group Inc	Morgan Stanley	(983)
(189)	Kirby Corp	Goldman Sachs	48
(3,196)	Kite Realty Group Trust (REIT)	Goldman Sachs	(511)
(121)	KLA Corp	Goldman Sachs	(180)
265	Knoll Inc	Bank of America Merrill Lynch	(92)
997	Knowles Corp	Bank of America Merrill Lynch	60
2,713	Knowles Corp	Goldman Sachs	163
1,760	Kohl ' s Corp	Morgan Stanley	2,006
103	Kontoor Brands Inc	Goldman Sachs	(42)
(92)	Korn Ferry	Bank of America Merrill Lynch	(132)
(1,719)	Korn Ferry	Goldman Sachs	(2,628)
(2,300)	Kosmos Energy Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(874)
(597)	Kraft Heinz Co	Bank of America Merrill Lynch	(203)
(2,525)	Kraft Heinz Co	Morgan Stanley	278
886	Kratos Defense & Security Solutions Inc	Goldman Sachs	328
(2,361)	Kroger Co	Bank of America Merrill Lynch	(764)
(2,832)	Kroger Co	Morgan Stanley	1,345
147	Kulicke & Soffa Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	304
(1,501)	L Brands Inc	Morgan Stanley	2,792
124	L3Harris Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	68
76	L3Harris Technologies Inc	Goldman Sachs	(186)
59	Laboratory Corp of America Holdings	Morgan Stanley	110
(808)	Lakeland Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	137
(554)	Lakeland Bancorp Inc	Goldman Sachs	94
(181)	Lakeland Financial Corp	Goldman Sachs	362
185	Lamb Weston Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(386)
90	Lamb Weston Holdings Inc	Goldman Sachs	(163)
301	Lamb Weston Holdings Inc	Morgan Stanley	650
(30)	Lancaster Colony Corp	Bank of America Merrill Lynch	282
(27)	Lancaster Colony Corp	Morgan Stanley	136
257	Landec Corp	Bank of America Merrill Lynch	23
638	Landec Corp	Goldman Sachs	42
(166)	Lands ' End Inc	Bank of America Merrill Lynch	(143)
(304)	Lands ' End Inc	Goldman Sachs	(467)
(528)	Landstar System Inc	Bank of America Merrill Lynch	993
(66)	Landstar System Inc	Morgan Stanley	(12)
(10)	Lannett Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	-
(3,286)	Lannett Co Inc	Goldman Sachs	99
940	Las Vegas Sands Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,873)
69	Las Vegas Sands Corp	Goldman Sachs	(63)
245	Las Vegas Sands Corp	Morgan Stanley	(597)
(346)	Lattice Semiconductor Corp	Bank of America Merrill Lynch	(81)
(734)	Lattice Semiconductor Corp	Goldman Sachs	(233)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(881)	Laureate Education Inc 'A'	Goldman Sachs	(145)
2,439	La-Z-Boy Inc	Goldman Sachs	1,024
(185)	LCI Industries	Goldman Sachs	(179)
(111)	Lear Corp	Morgan Stanley	(165)
(592)	Leidos Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(721)
(467)	Leidos Holdings Inc	Goldman Sachs	(327)
(365)	Leidos Holdings Inc	Morgan Stanley	383
95	LeMaitre Vascular Inc	Bank of America Merrill Lynch	170
464	LeMaitre Vascular Inc	Goldman Sachs	831
(770)	LendingClub Corp	Goldman Sachs	(113)
124	LendingTree Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,857)
16	LendingTree Inc	Goldman Sachs	(565)
105	LendingTree Inc	Morgan Stanley	27
(404)	Lennar Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	369
(74)	Lennar Corp 'A'	Goldman Sachs	(33)
(202)	Lennar Corp 'A'	Morgan Stanley	364
166	Lennox International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,821)
1,013	Levi Strauss & Co 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1,327
2,217	Levi Strauss & Co 'A'	Goldman Sachs	2,904
(3,518)	Lexington Realty Trust (REIT)	Goldman Sachs	1,930
115	LGI Homes Inc	Bank of America Merrill Lynch	(38)
199	LGI Homes Inc	Goldman Sachs	(118)
(80)	LHC Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,039
(65)	LHC Group Inc	Goldman Sachs	844
(42)	LHC Group Inc	Morgan Stanley	13
(130)	Liberty Broadband Corp	Bank of America Merrill Lynch	112
(412)	Liberty Broadband Corp	Morgan Stanley	363
(92)	Liberty Broadband Corp 'A'	Morgan Stanley	132
165	Liberty Media Corp-Liberty Braves 'A'	Goldman Sachs	129
(659)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	Morgan Stanley	389
214	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(190)
(239)	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C'	Goldman Sachs	349
(333)	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C'	Morgan Stanley	460
(1,693)	Liberty TripAdvisor Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(457)
1	Liberty TripAdvisor Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	-
276	Life Storage Inc (REIT)	Morgan Stanley	(63)
5,432	Limelight Networks Inc	Goldman Sachs	2,879
45	Lincoln Electric Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(39)
1,451	Lincoln National Corp	Bank of America Merrill Lynch	8,938
1,363	Lincoln National Corp	Goldman Sachs	8,296
665	Lincoln National Corp	Morgan Stanley	1,246
1,276	Lindblad Expeditions Holdings Inc	Goldman Sachs	1,046

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
168	Lindsay Corp	Bank of America Merrill Lynch	(683)
298	Lindsay Corp	Goldman Sachs	(961)
(137)	Lithia Motors Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(3,880)
(55)	Lithia Motors Inc 'A'	Goldman Sachs	(1,128)
(73)	Lithia Motors Inc 'A'	Morgan Stanley	(187)
(161)	Littelfuse Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,468)
(61)	Littelfuse Inc	Morgan Stanley	(312)
111	Live Oak Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	(140)
579	Live Oak Bancshares Inc	Goldman Sachs	(584)
834	Livent Corp	Goldman Sachs	492
(218)	LiveRamp Holdings Inc	Morgan Stanley	(344)
137	LKQ Corp	Bank of America Merrill Lynch	(29)
375	LKQ Corp	Goldman Sachs	91
42	LKQ Corp	Morgan Stanley	(62)
(208)	Louisiana-Pacific Corp	Bank of America Merrill Lynch	(47)
(465)	Louisiana-Pacific Corp	Goldman Sachs	(711)
(1,538)	Louisiana-Pacific Corp	Morgan Stanley	1,196
(1,484)	Lowe's Cos Inc	Morgan Stanley	2,705
(18)	LPL Financial Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	43
(193)	LPL Financial Holdings Inc	Goldman Sachs	(239)
(138)	LPL Financial Holdings Inc	Morgan Stanley	(48)
(34)	LTC Properties Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	4
(1,237)	LTC Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	136
62	Lululemon Athletica Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,007
77	Lululemon Athletica Inc	Morgan Stanley	1,202
59	Lumentum Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	159
161	Lumentum Holdings Inc	Goldman Sachs	473
388	Lumentum Holdings Inc	Morgan Stanley	431
2,046	Luminex Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,080
1,203	Luther Burbank Corp	Bank of America Merrill Lynch	(626)
3,417	Luther Burbank Corp	Goldman Sachs	(1,777)
884	Lyft Inc 'A'	Morgan Stanley	(486)
131	M&T Bank Corp	Bank of America Merrill Lynch	(153)
248	M&T Bank Corp	Morgan Stanley	258
58	M/I Homes Inc	Bank of America Merrill Lynch	(26)
2,356	Macerich Co (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	4,194
(1,402)	Mack-Cali Realty Corp (REIT)	Goldman Sachs	(224)
(376)	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	Goldman Sachs	(1,196)
70	Madison Square Garden Entertainment Corp	Bank of America Merrill Lynch	(239)
165	Madison Square Garden Entertainment Corp	Goldman Sachs	(586)
(583)	Madison Square Garden Sports Corp	Morgan Stanley	93
(198)	Magellan Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	978
(88)	Magellan Health Inc	Goldman Sachs	435
(205)	MagnaChip Semiconductor Corp	Bank of America Merrill Lynch	(45)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(298)	Magnite Inc	Bank of America Merrill Lynch	(189)
201	Malibu Boats Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	173
291	Malibu Boats Inc 'A'	Goldman Sachs	250
107	Manhattan Associates Inc	Bank of America Merrill Lynch	704
33	Manhattan Associates Inc	Morgan Stanley	79
281	Manitowoc Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(118)
793	Manitowoc Co Inc	Goldman Sachs	(333)
(309)	ManpowerGroup Inc	Bank of America Merrill Lynch	590
(535)	ManTech International Corp 'A'	Goldman Sachs	292
(3,157)	Marathon Oil Corp	Morgan Stanley	(126)
71	Marathon Petroleum Corp	Bank of America Merrill Lynch	174
266	Marathon Petroleum Corp	Goldman Sachs	192
73	Marathon Petroleum Corp	Morgan Stanley	(98)
2,526	Marcus & Millichap Inc	Goldman Sachs	1,743
255	MarineMax Inc	Goldman Sachs	21
(6)	MarketAxess Holdings Inc	Goldman Sachs	141
157	Marriott Vacations Worldwide Corp	Bank of America Merrill Lynch	302
629	Marriott Vacations Worldwide Corp	Goldman Sachs	(685)
152	Marriott Vacations Worldwide Corp	Morgan Stanley	(53)
389	Marsh & McLennan Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	(638)
64	Marsh & McLennan Cos Inc	Goldman Sachs	13
703	Marsh & McLennan Cos Inc	Morgan Stanley	520
(1,266)	Marten Transport Ltd	Goldman Sachs	669
(168)	Masco Corp	Bank of America Merrill Lynch	71
112	Masimo Corp	Bank of America Merrill Lynch	802
36	Masimo Corp	Morgan Stanley	231
149	Mastercard Inc 'A'	Goldman Sachs	(693)
227	Mastercard Inc 'A'	Morgan Stanley	851
578	Matador Resources Co	Bank of America Merrill Lynch	435
91	Match Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	302
72	Match Group Inc	Goldman Sachs	239
525	Match Group Inc	Morgan Stanley	(823)
(194)	Materion Corp	Goldman Sachs	133
705	Matrix Service Co	Goldman Sachs	219
(735)	Matson Inc	Goldman Sachs	(228)
(242)	Mattel Inc	Bank of America Merrill Lynch	(334)
(1,066)	Mattel Inc	Morgan Stanley	(288)
(275)	Matthews International Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(89)
(177)	Matthews International Corp 'A'	Goldman Sachs	54
(149)	Maxar Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(104)
(513)	Maxar Technologies Inc	Goldman Sachs	(718)
(174)	MaxLinear Inc	Bank of America Merrill Lynch	3
(1,208)	MBIA Inc	Goldman Sachs	(652)
(153)	McCormick & Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(197)
(13)	McCormick & Co Inc	Goldman Sachs	(27)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(105)	McCormick & Co Inc	Morgan Stanley	(299)
238	McDonald's Corp	Morgan Stanley	(267)
(68)	McGrath RentCorp	Bank of America Merrill Lynch	43
(158)	McGrath RentCorp	Goldman Sachs	100
(89)	McKesson Corp	Goldman Sachs	(201)
(102)	McKesson Corp	Morgan Stanley	(838)
131	MDC Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(21)
814	MDC Holdings Inc	Goldman Sachs	781
(778)	MDU Resources Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	55
(1,375)	MDU Resources Group Inc	Goldman Sachs	41
(1,582)	MDU Resources Group Inc	Morgan Stanley	(728)
67	Medallia Inc	Bank of America Merrill Lynch	153
249	Medallia Inc	Goldman Sachs	876
686	Media General Inc*,	Bank of America Merrill Lynch	-
2,359	Medical Properties Trust Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	346
196	Medical Properties Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	22
659	Medical Properties Trust Inc (REIT)	Morgan Stanley	105
(1,216)	MEDNAX Inc	Goldman Sachs	(195)
(106)	Medpace Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	272
(248)	Medpace Holdings Inc	Goldman Sachs	15
(1)	MercadoLibre Inc	Bank of America Merrill Lynch	(82)
158	Mercantile Bank Corp	Bank of America Merrill Lynch	(47)
258	Mercantile Bank Corp	Goldman Sachs	510
1	Mercer International Inc	Bank of America Merrill Lynch	-
1,069	Mercer International Inc	Goldman Sachs	486
184	Merchants Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	(166)
1,300	Merchants Bancorp	Goldman Sachs	(286)
(446)	Merck & Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	98
(83)	Merck & Co Inc	Goldman Sachs	21
(1,709)	Merck & Co Inc	Morgan Stanley	598
77	Mercury General Corp	Bank of America Merrill Lynch	(29)
1,747	Mercury General Corp	Goldman Sachs	(565)
174	Mercury Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	306
158	Mercury Systems Inc	Morgan Stanley	33
(366)	Meredith Corp	Goldman Sachs	(546)
197	Meridian Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(76)
75	Merit Medical Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	230
(408)	Meritage Homes Corp	Bank of America Merrill Lynch	594
(54)	Meritage Homes Corp	Goldman Sachs	112
(309)	Meritage Homes Corp	Morgan Stanley	856
100	Meritor Inc	Bank of America Merrill Lynch	45
827	Meritor Inc	Goldman Sachs	419
111	Mesa Laboratories Inc	Goldman Sachs	(1,759)
(353)	Meta Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	99
(1,085)	Methode Electronics Inc	Goldman Sachs	675

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(317)	MetLife Inc	Goldman Sachs	(177)
(2,529)	MetLife Inc	Morgan Stanley	860
(1,760)	MGE Energy Inc	Goldman Sachs	6,318
1,881	MGIC Investment Corp	Morgan Stanley	(273)
266	MGM Growth Properties LLC 'A' (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(125)
868	MGM Growth Properties LLC 'A' (REIT)	Goldman Sachs	(126)
215	MGM Resorts International	Bank of America Merrill Lynch	406
1,612	MGM Resorts International	Morgan Stanley	3,885
79	MGP Ingredients Inc	Bank of America Merrill Lynch	81
373	MGP Ingredients Inc	Goldman Sachs	384
(1,169)	Michaels Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,385)
(70)	Microchip Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(15)
(335)	Micron Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(982)
(904)	Micron Technology Inc	Morgan Stanley	(344)
(679)	Microsoft Corp	Morgan Stanley	(2,723)
(76)	MicroStrategy Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(2,895)
(34)	Mid-America Apartment Communities Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	184
(22)	Mid-America Apartment Communities Inc (REIT)	Goldman Sachs	180
(743)	Mid-America Apartment Communities Inc (REIT)	Morgan Stanley	(253)
5,035	Midland States Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(352)
6,372	Midland States Bancorp Inc	Goldman Sachs	(446)
57	Minerals Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	181
51	Mirati Therapeutics Inc	Morgan Stanley	162
(457)	Mitek Systems Inc	Goldman Sachs	484
682	Model N Inc	Goldman Sachs	1,800
259	Moelis & Co 'A'	Goldman Sachs	396
367	Molecular Templates Inc	Goldman Sachs	(228)
(164)	Molina Healthcare Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,717
(25)	Molina Healthcare Inc	Goldman Sachs	54
(146)	Molina Healthcare Inc	Morgan Stanley	32
200	Molson Coors Beverage Co 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(113)
821	Molson Coors Beverage Co 'B'	Goldman Sachs	1,461
139	Molson Coors Beverage Co 'B'	Morgan Stanley	311
190	Monarch Casino & Resort Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,154
59	Monarch Casino & Resort Inc	Goldman Sachs	363
(724)	Mondelez International Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	807
(313)	Mondelez International Inc 'A'	Goldman Sachs	485
(409)	Mondelez International Inc 'A'	Morgan Stanley	90
(67)	MongoDB Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,601)
(73)	MongoDB Inc	Goldman Sachs	(2,723)
(98)	MongoDB Inc	Morgan Stanley	(1,608)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
198	Monro Inc	Goldman Sachs	(88)
(353)	Monster Beverage Corp	Bank of America Merrill Lynch	(159)
(60)	Monster Beverage Corp	Morgan Stanley	3
332	Moody's Corp	Morgan Stanley	3,825
(541)	Moog Inc 'A'	Goldman Sachs	(1,092)
(370)	Morgan Stanley	Bank of America Merrill Lynch	(1,820)
(96)	Morgan Stanley	Goldman Sachs	(452)
400	Morningstar Inc	Goldman Sachs	(2,200)
(1,199)	Mosaic Co	Bank of America Merrill Lynch	214
(72)	Motorola Solutions Inc	Goldman Sachs	(240)
(89)	Motorola Solutions Inc	Morgan Stanley	(243)
190	Mr Cooper Group Inc	Goldman Sachs	306
31	MSA Safety Inc	Goldman Sachs	281
42	MSA Safety Inc	Morgan Stanley	55
(17)	MSC Industrial Direct Co Inc 'A'	Goldman Sachs	49
(982)	MSC Industrial Direct Co Inc 'A'	Morgan Stanley	2,867
(51)	MSCI Inc	Goldman Sachs	(630)
323	MSG Networks Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	342
302	MSG Networks Inc 'A'	Goldman Sachs	320
(348)	MTS Systems Corp	Goldman Sachs	(752)
(209)	Mueller Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	119
(2,719)	Mueller Industries Inc	Goldman Sachs	1,550
723	Mueller Water Products Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(29)
942	Murphy Oil Corp	Goldman Sachs	144
(280)	Murphy USA Inc	Morgan Stanley	1,025
12	Myers Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	4
310	Myers Industries Inc	Goldman Sachs	115
(276)	MYR Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(916)
(577)	MYR Group Inc	Goldman Sachs	(1,916)
448	NanoString Technologies Inc	Goldman Sachs	1,245
(183)	Napco Security Technologies Inc	Goldman Sachs	(227)
(153)	Nasdaq Inc	Morgan Stanley	(189)
(100)	National Beverage Corp	Bank of America Merrill Lynch	(9)
(27)	National Beverage Corp	Morgan Stanley	(16)
(1,020)	National CineMedia Inc	Goldman Sachs	(15)
32	National Fuel Gas Co	Bank of America Merrill Lynch	(9)
143	National Fuel Gas Co	Goldman Sachs	(40)
97	National Fuel Gas Co	Morgan Stanley	(12)
234	National Health Investors Inc (REIT)	Goldman Sachs	87
(115)	National HealthCare Corp	Bank of America Merrill Lynch	452
(267)	National HealthCare Corp	Goldman Sachs	1,685
549	National Instruments Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,197
96	National Instruments Corp	Goldman Sachs	209
329	National Instruments Corp	Morgan Stanley	234
1,309	National Oilwell Varco Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,279

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
121	National Oilwell Varco Inc	Goldman Sachs	100
(40)	National Presto Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(32)
896	National Research Corp	Goldman Sachs	(2,670)
(572)	National Retail Properties Inc (REIT)	Morgan Stanley	1,195
128	National Storage Affiliates Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(355)
1,226	National Storage Affiliates Trust (REIT)	Goldman Sachs	(3,396)
45	National Vision Holdings Inc	Goldman Sachs	56
(83)	National Western Life Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	649
(114)	National Western Life Group Inc 'A'	Goldman Sachs	891
357	Natus Medical Inc	Goldman Sachs	129
(2,420)	Navient Corp	Goldman Sachs	1,625
(57)	nCino Inc	Goldman Sachs	(35)
97	NCR Corp	Bank of America Merrill Lynch	(16)
706	Neenah Inc	Goldman Sachs	2,069
(891)	Nektar Therapeutics	Goldman Sachs	410
(1,416)	Nektar Therapeutics	Morgan Stanley	57
(126)	NetNet Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	471
(295)	NetNet Inc 'A'	Goldman Sachs	1,103
38	Neogen Corp	Goldman Sachs	10
13	NeoGenomics Inc	Bank of America Merrill Lynch	51
371	NeoGenomics Inc	Goldman Sachs	1,447
274	NeoGenomics Inc	Morgan Stanley	356
(633)	NeoPhotonics Corp	Goldman Sachs	(269)
(184)	NetApp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(245)
(440)	NetApp Inc	Goldman Sachs	(148)
85	Netflix Inc	Bank of America Merrill Lynch	600
17	Netflix Inc	Morgan Stanley	217
(738)	NetScout Systems Inc	Goldman Sachs	297
473	New Jersey Resources Corp	Goldman Sachs	(706)
182	New Relic Inc	Bank of America Merrill Lynch	679
99	New Relic Inc	Goldman Sachs	389
95	New Relic Inc	Morgan Stanley	271
2,724	New York Community Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,179
4,351	New York Community Bancorp Inc	Morgan Stanley	2,263
(1,684)	Newell Brands Inc	Goldman Sachs	(1,448)
(810)	Newell Brands Inc	Morgan Stanley	(575)
(3,593)	Newmark Group Inc 'A'	Goldman Sachs	(1,832)
2	NewMarket Corp	Bank of America Merrill Lynch	1
105	NewMarket Corp	Goldman Sachs	261
115	Newmont Corp	Morgan Stanley	31
(824)	News Corp 'A'	Goldman Sachs	(330)
(2,452)	News Corp 'A'	Morgan Stanley	270
133	NexPoint Residential Trust Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	60
393	Nexstar Media Group Inc 'A'	Morgan Stanley	(138)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
1,347	NextEra Energy Inc	Morgan Stanley	323
(320)	NextGen Healthcare Inc	Goldman Sachs	(686)
(834)	NexTier Oilfield Solutions Inc	Goldman Sachs	(234)
(1,472)	NIC Inc	Goldman Sachs	1,093
120	Nicolet Bankshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	26
406	Nicolet Bankshares Inc	Goldman Sachs	12
27	NIKE Inc 'B'	Goldman Sachs	47
1,007	NIKE Inc 'B'	Morgan Stanley	(131)
298	nLight Inc	Goldman Sachs	477
127	NMI Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(149)
882	NMI Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	(1,032)
269	Nordson Corp	Bank of America Merrill Lynch	(657)
14	Nordson Corp	Goldman Sachs	24
62	Nordson Corp	Morgan Stanley	125
(5)	Norfolk Southern Corp	Bank of America Merrill Lynch	19
(65)	Norfolk Southern Corp	Goldman Sachs	(59)
(275)	Norfolk Southern Corp	Morgan Stanley	(36)
(2,458)	Northern Oil and Gas Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,277)
(481)	Northern Trust Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,227)
(28)	Northern Trust Corp	Goldman Sachs	(71)
(442)	Northwest Bancshares Inc	Goldman Sachs	166
1,788	Northwest Natural Holding Co	Goldman Sachs	(1,126)
(506)	NOW Inc	Goldman Sachs	237
(67)	NRG Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(24)
(3,680)	NRG Energy Inc	Morgan Stanley	(8,096)
755	Nu Skin Enterprises Inc 'A'	Goldman Sachs	(310)
(1,161)	Nuance Communications Inc	Morgan Stanley	(1,196)
(232)	Nucor Corp	Bank of America Merrill Lynch	(446)
(1,661)	Nucor Corp	Morgan Stanley	(2,425)
(779)	Nutanix Inc 'A'	Morgan Stanley	724
488	NuVasive Inc	Bank of America Merrill Lynch	(126)
(46)	NV5 Global Inc	Goldman Sachs	(9)
37	NVIDIA Corp	Bank of America Merrill Lynch	(132)
29	NVIDIA Corp	Goldman Sachs	(172)
82	NVIDIA Corp	Morgan Stanley	709
(4)	NVR Inc	Morgan Stanley	192
89	Oak Street Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	166
756	Oak Street Health Inc	Goldman Sachs	817
220	Oak Street Health Inc	Morgan Stanley	365
1,009	Occidental Petroleum Corp	Goldman Sachs	1,844
804	Oceaneering International Inc	Goldman Sachs	498
4,197	OceanFirst Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,987)
529	Odonate Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	219
695	Odonate Therapeutics Inc	Goldman Sachs	209
(902)	ODP Corp	Goldman Sachs	(1,669)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(779)	Office Properties Income Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(413)
(1,340)	Office Properties Income Trust (REIT)	Goldman Sachs	(710)
(267)	OGE Energy Corp	Goldman Sachs	370
(1,269)	O-I Glass Inc	Goldman Sachs	38
9	Okta Inc	Bank of America Merrill Lynch	158
9	Okta Inc	Goldman Sachs	148
(72)	Old Dominion Freight Line Inc	Goldman Sachs	320
(69)	Old Dominion Freight Line Inc	Morgan Stanley	40
(2,401)	Old National Bancorp	Goldman Sachs	1,056
(380)	Old Republic International Corp	Goldman Sachs	76
(611)	Old Republic International Corp	Morgan Stanley	(43)
(792)	Olin Corp	Goldman Sachs	(952)
(79)	Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(204)
(146)	Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc	Goldman Sachs	(377)
45	Omega Flex Inc	Bank of America Merrill Lynch	317
40	Omega Flex Inc	Goldman Sachs	281
(492)	Omega Healthcare Investors Inc (REIT)	Morgan Stanley	(763)
1,768	Omeros Corp	Goldman Sachs	(582)
(19)	Omniceil Inc	Morgan Stanley	13
(697)	Omnicom Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,402)
253	ON Semiconductor Corp	Goldman Sachs	102
(755)	One Liberty Properties Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	30
(2,002)	One Liberty Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	80
435	OneMain Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	249
419	OneMain Holdings Inc	Goldman Sachs	34
234	OneMain Holdings Inc	Morgan Stanley	300
360	ONEOK Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,586
1,737	ONEOK Inc	Morgan Stanley	3,405
(1,489)	OneSpan Inc	Goldman Sachs	(2,055)
(469)	Onto Innovation Inc	Goldman Sachs	(1,139)
58	Ontrak Inc	Goldman Sachs	51
641	Open Lending Corp 'A'	Goldman Sachs	(287)
723	Option Care Health Inc	Goldman Sachs	103
(330)	Oracle Corp	Bank of America Merrill Lynch	(593)
(148)	Oracle Corp	Goldman Sachs	(162)
(713)	Oracle Corp	Morgan Stanley	(1,340)
1,667	OraSure Technologies Inc	Goldman Sachs	142
(61)	O'Reilly Automotive Inc	Morgan Stanley	223
269	Origin Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	109
451	Origin Bancorp Inc	Goldman Sachs	(18)
125	Ormat Technologies Inc	Goldman Sachs	425
328	Ormat Technologies Inc	Morgan Stanley	2,437
559	OrthoPediatrics Corp	Bank of America Merrill Lynch	(953)
452	OrthoPediatrics Corp	Goldman Sachs	(755)
222	Oshkosh Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,474

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
442	Oshkosh Corp	Morgan Stanley	(610)
1,025	OSI Systems Inc	Goldman Sachs	461
(126)	Otter Tail Corp	Goldman Sachs	192
325	Outfront Media Inc (REIT)	Goldman Sachs	19
150	Overstock.com Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,497
(197)	Owens Corning	Bank of America Merrill Lynch	99
129	Oxford Industries Inc	Goldman Sachs	759
(478)	PACCAR Inc	Morgan Stanley	968
78	Pacira BioSciences Inc	Goldman Sachs	(388)
(197)	Packaging Corp of America	Bank of America Merrill Lynch	(131)
(481)	Packaging Corp of America	Goldman Sachs	1,279
(103)	PacWest Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	(18)
(298)	PacWest Bancorp	Goldman Sachs	109
(6,771)	Palantir Technologies Inc 'A'	Morgan Stanley	(51,460)
161	Palomar Holdings Inc	Goldman Sachs	(891)
(247)	Papa John's International Inc	Goldman Sachs	(354)
(3,362)	Paramount Group Inc (REIT)	Goldman Sachs	(4,443)
(320)	Park Aerospace Corp	Goldman Sachs	(248)
(33)	Park National Corp	Bank of America Merrill Lynch	9
(910)	Park National Corp	Goldman Sachs	4,514
2,517	Parsons Corp	Goldman Sachs	(1,735)
(730)	Patterson-UTL Energy Inc	Goldman Sachs	(369)
(299)	Paychex Inc	Morgan Stanley	(299)
11	Paylocity Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	171
388	Paylocity Holding Corp	Morgan Stanley	1,552
(155)	PayPal Holdings Inc	Goldman Sachs	56
2,520	PBF Energy Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1,033
1,550	PBF Energy Inc 'A'	Goldman Sachs	636
319	PC Connection Inc	Goldman Sachs	13
1,105	PDF Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	927
1,102	Peapack-Gladstone Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,466
2,383	Peapack-Gladstone Financial Corp	Goldman Sachs	3,169
389	Pebblebrook Hotel Trust (REIT)	Goldman Sachs	533
113	Pegasystems Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,072
184	Pegasystems Inc	Goldman Sachs	1,746
(408)	Peloton Interactive Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(3,401)
(285)	Peloton Interactive Inc 'A'	Morgan Stanley	208
(173)	Pennant Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	228
219	PennyMac Financial Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	184
114	Penumbra Inc	Goldman Sachs	(1,408)
167	Penumbra Inc	Morgan Stanley	(5,065)
(1,072)	Peoples Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	397
(1,045)	Peoples Bancorp Inc	Goldman Sachs	387
543	People's United Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(58)
1,468	People's United Financial Inc	Morgan Stanley	(308)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(725)	Perdoceo Education Corp	Bank of America Merrill Lynch	370
(219)	Perficient Inc	Bank of America Merrill Lynch	96
(139)	Perficient Inc	Goldman Sachs	61
31	Performance Food Group Co	Morgan Stanley	(11)
(122)	Perspecta Inc	Bank of America Merrill Lynch	(71)
(205)	Perspecta Inc	Goldman Sachs	(63)
(3,515)	Perspecta Inc	Morgan Stanley	(598)
206	PetIQ Inc	Bank of America Merrill Lynch	410
583	PetIQ Inc	Goldman Sachs	1,160
(182)	PetMed Express Inc	Goldman Sachs	(152)
(938)	PG&E Corp	Morgan Stanley	-
(361)	PGT Innovations Inc	Bank of America Merrill Lynch	77
(599)	PGT Innovations Inc	Goldman Sachs	66
79	Phathom Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	10
693	Phibro Animal Health Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	423
807	Phibro Animal Health Corp 'A'	Goldman Sachs	492
(149)	Philip Morris International Inc	Goldman Sachs	339
(72)	Philip Morris International Inc	Morgan Stanley	73
486	Phillips 66	Bank of America Merrill Lynch	(651)
762	Phillips 66	Goldman Sachs	1,775
1,146	Phillips 66	Morgan Stanley	(2,097)
1,050	Phreesia Inc	Goldman Sachs	2,866
507	Physicians Realty Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(598)
508	Physicians Realty Trust (REIT)	Goldman Sachs	(599)
891	Physicians Realty Trust (REIT)	Morgan Stanley	(205)
(2,939)	Piedmont Office Realty Trust Inc 'A' (REIT)	Goldman Sachs	(940)
153	Pilgrim's Pride Corp	Bank of America Merrill Lynch	(30)
893	Pilgrim's Pride Corp	Goldman Sachs	(123)
311	Ping Identity Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	470
348	Ping Identity Holding Corp	Goldman Sachs	449
280	Pinnacle Financial Partners Inc	Morgan Stanley	62
150	Pinnacle West Capital Corp	Morgan Stanley	(86)
(944)	Pinterest Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(5,128)
(315)	Pioneer Natural Resources Co	Bank of America Merrill Lynch	(2,332)
(1,324)	Piper Sandler Cos	Goldman Sachs	(1,748)
(1,076)	Pitney Bowes Inc	Goldman Sachs	161
(120)	PJT Partners Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(10)
(201)	PJT Partners Inc 'A'	Goldman Sachs	(173)
3,272	Plains GP Holdings LP 'A'	Goldman Sachs	(943)
562	Planet Fitness Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1,644
406	Planet Fitness Inc 'A'	Goldman Sachs	2,331
378	Planet Fitness Inc 'A'	Morgan Stanley	1,338
116	Plantronics Inc	Bank of America Merrill Lynch	876
103	Plantronics Inc	Goldman Sachs	778
111	Plexus Corp	Bank of America Merrill Lynch	(81)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
184	Plexus Corp	Goldman Sachs	(62)
851	Pluralsight Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(123)
(37)	Polaris Inc	Bank of America Merrill Lynch	100
(153)	Polaris Inc	Goldman Sachs	413
(519)	Polaris Inc	Morgan Stanley	535
490	Portland General Electric Co	Bank of America Merrill Lynch	(730)
617	Portland General Electric Co	Goldman Sachs	(919)
348	Portland General Electric Co	Morgan Stanley	(10)
(770)	PotlatchDeltic Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(1,063)
(255)	PotlatchDeltic Corp (REIT)	Goldman Sachs	(352)
121	Powell Industries Inc	Goldman Sachs	56
(104)	Power Integrations Inc	Bank of America Merrill Lynch	(46)
(487)	Power Integrations Inc	Morgan Stanley	(643)
(398)	PPL Corp	Morgan Stanley	537
1,074	PQ Group Holdings Inc	Goldman Sachs	96
(76)	PRA Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	88
(793)	PRA Group Inc	Goldman Sachs	(582)
(43)	PRA Health Sciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	9
(49)	PRA Health Sciences Inc	Goldman Sachs	136
(29)	PRA Health Sciences Inc	Morgan Stanley	5
653	Preferred Bank	Bank of America Merrill Lynch	(718)
962	Preferred Bank	Goldman Sachs	(1,058)
27	Premier Inc 'A'	Goldman Sachs	16
1,826	Premier Inc 'A'	Morgan Stanley	1,169
289	Prestige Consumer Healthcare Inc	Goldman Sachs	29
(37)	PriceSmart Inc	Bank of America Merrill Lynch	1
(187)	Primerica Inc	Bank of America Merrill Lynch	(402)
(56)	Primerica Inc	Goldman Sachs	(122)
(7)	Primerica Inc	Morgan Stanley	2
(1,312)	Primoris Services Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,391)
(301)	Primoris Services Corp	Goldman Sachs	(319)
336	Principal Financial Group Inc	Morgan Stanley	(117)
(179)	ProAssurance Corp	Bank of America Merrill Lynch	30
(1,133)	Procter & Gamble Co	Bank of America Merrill Lynch	5,291
(335)	Procter & Gamble Co	Goldman Sachs	1,564
(1,065)	Procter & Gamble Co	Morgan Stanley	1,065
560	Progress Software Corp	Bank of America Merrill Lynch	(22)
686	Progress Software Corp	Goldman Sachs	(5)
92	Progyny Inc	Bank of America Merrill Lynch	626
767	Progyny Inc	Goldman Sachs	4,834
425	Prologis Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(1,135)
501	Prologis Inc (REIT)	Goldman Sachs	(1,124)
68	Prologis Inc (REIT)	Morgan Stanley	71
242	Proofpoint Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,256
88	Proofpoint Inc	Goldman Sachs	516

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
81	Proofpoint Inc	Morgan Stanley	641
(1,299)	ProPetro Holding Corp	Goldman Sachs	(935)
702	PROS Holdings Inc	Goldman Sachs	2,488
1,041	ProSight Global Inc	Bank of America Merrill Lynch	781
63	Prosperity Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	(74)
271	Proto Labs Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,713
155	Proto Labs Inc	Goldman Sachs	812
44	Proto Labs Inc	Morgan Stanley	196
867	Provention Bio Inc	Bank of America Merrill Lynch	277
816	Provention Bio Inc	Goldman Sachs	261
(185)	Providence Service Corp	Goldman Sachs	(1,643)
(164)	Provident Financial Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(141)
(1,070)	Provident Financial Services Inc	Goldman Sachs	(920)
775	Prudential Financial Inc	Goldman Sachs	(774)
30	PS Business Parks Inc (REIT)	Goldman Sachs	(106)
189	PTC Inc	Morgan Stanley	1,164
(122)	Public Service Enterprise Group Inc	Morgan Stanley	90
(141)	Public Storage (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(93)
(746)	PulteGroup Inc	Goldman Sachs	(701)
(310)	PulteGroup Inc	Morgan Stanley	153
182	Pure Storage Inc 'A'	Goldman Sachs	(128)
1,807	Pure Storage Inc 'A'	Morgan Stanley	(2,855)
197	PVH Corp	Bank of America Merrill Lynch	471
249	PVH Corp	Goldman Sachs	(462)
(150)	Q2 Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(374)
(251)	Q2 Holdings Inc	Goldman Sachs	(2,362)
(19)	Q2 Holdings Inc	Morgan Stanley	(8)
1,741	QAD Inc 'A'	Goldman Sachs	15,913
87	QCR Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(127)
821	QCR Holdings Inc	Goldman Sachs	(1,194)
(359)	Qorvo Inc	Goldman Sachs	(734)
725	QTS Realty Trust Inc 'A' (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(1,684)
564	QTS Realty Trust Inc 'A' (REIT)	Goldman Sachs	(1,342)
317	QTS Realty Trust Inc 'A' (REIT)	Morgan Stanley	(558)
69	Quaker Chemical Corp	Morgan Stanley	(130)
(523)	QUALCOMM Inc	Morgan Stanley	(918)
82	Qualys Inc	Goldman Sachs	290
(718)	Quanex Building Products Corp	Bank of America Merrill Lynch	(337)
(820)	Quanex Building Products Corp	Goldman Sachs	(95)
(143)	Quanta Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(66)
(1,787)	Quanta Services Inc	Morgan Stanley	(1,179)
375	Quanterix Corp	Goldman Sachs	(1,298)
(72)	Quest Diagnostics Inc	Morgan Stanley	(45)
305	Quotient Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	18
1,917	Quotient Technology Inc	Goldman Sachs	115

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(4,856)	Qurate Retail Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(6,324)
(871)	Qurate Retail Inc 'A'	Goldman Sachs	(1,470)
(275)	R1 RCM Inc	Goldman Sachs	(88)
2,402	Radian Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(26)
710	Radian Group Inc	Goldman Sachs	207
918	Radian Group Inc	Morgan Stanley	330
(226)	RadNet Inc	Goldman Sachs	81
600	Ralph Lauren Corp	Goldman Sachs	1,888
363	Ralph Lauren Corp	Morgan Stanley	937
(368)	Range Resources Corp	Goldman Sachs	(269)
1,658	Ranpak Holdings Corp 'A'	Goldman Sachs	(216)
796	Rapid7 Inc	Goldman Sachs	3,948
(1,597)	Rattler Midstream LP	Bank of America Merrill Lynch	(1,022)
(571)	Rattler Midstream LP	Goldman Sachs	(365)
3,037	Raven Industries Inc	Goldman Sachs	3,978
(56)	Raymond James Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(286)
(512)	Raymond James Financial Inc	Morgan Stanley	(1,198)
(218)	Rayonier Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	153
(447)	Rayonier Inc (REIT)	Goldman Sachs	126
(299)	RBC Bearings Inc	Morgan Stanley	215
1,461	RE/MAX Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	(1,578)
(620)	Realogy Holdings Corp	Goldman Sachs	8
121	RealReal Inc	Bank of America Merrill Lynch	117
1,618	RealReal Inc	Goldman Sachs	1,460
336	Realty Income Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(934)
455	Realty Income Corp (REIT)	Goldman Sachs	(1,474)
228	Realty Income Corp (REIT)	Morgan Stanley	78
165	Reata Pharmaceuticals Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(662)
31	Reata Pharmaceuticals Inc 'A'	Goldman Sachs	(321)
629	Red Rock Resorts Inc 'A'	Goldman Sachs	235
(195)	Redfin Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,192)
(857)	Redfin Corp	Goldman Sachs	(2,087)
(218)	Redfin Corp	Morgan Stanley	(685)
(8)	Regal Beloit Corp RegS	Bank of America Merrill Lynch	(19)
(170)	Regal Beloit Corp RegS	Goldman Sachs	(21)
(274)	Regal Beloit Corp RegS	Morgan Stanley	458
(449)	Regis Corp	Goldman Sachs	(89)
340	Reinsurance Group of America Inc	Bank of America Merrill Lynch	170
65	Reinsurance Group of America Inc	Morgan Stanley	(85)
(235)	Reliance Steel & Aluminum Co	Bank of America Merrill Lynch	127
(722)	Reliance Steel & Aluminum Co	Morgan Stanley	(332)
515	Relmada Therapeutics Inc	Goldman Sachs	891
(1,528)	Renasant Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,589
(116)	Renewable Energy Group Inc	Goldman Sachs	63
(267)	Rent-A-Center Inc	Goldman Sachs	(15)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
576	Republic Bancorp Inc 'A'	Goldman Sachs	(582)
(425)	Republic Services Inc	Goldman Sachs	1,815
(1,129)	Republic Services Inc	Morgan Stanley	914
(382)	Resideo Technologies Inc	Goldman Sachs	(604)
260	ResMed Inc	Bank of America Merrill Lynch	50
1,111	Resources Connection Inc	Bank of America Merrill Lynch	444
2,854	Resources Connection Inc	Goldman Sachs	1,142
(711)	Retail Opportunity Investments Corp (REIT)	Goldman Sachs	121
(310)	Retail Properties of America Inc 'A' (REIT)	Goldman Sachs	(43)
(638)	REV Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(230)
(344)	REV Group Inc	Goldman Sachs	(124)
197	Revance Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(123)
186	Revolve Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	400
(13)	REX American Resources Corp	Bank of America Merrill Lynch	93
(340)	REX American Resources Corp	Goldman Sachs	2,438
(217)	Rexford Industrial Realty Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	384
(900)	Rexford Industrial Realty Inc (REIT)	Morgan Stanley	675
(175)	Rexnord Corp	Bank of America Merrill Lynch	93
(722)	Rexnord Corp	Goldman Sachs	412
(337)	Rexnord Corp	Morgan Stanley	(24)
(51)	RH	Bank of America Merrill Lynch	(1,788)
(90)	RH	Morgan Stanley	(1,289)
(1,240)	Ribbon Communications Inc	Goldman Sachs	(2,381)
(1,501)	Rite Aid Corp	Bank of America Merrill Lynch	(304)
(44,984)	Rite Aid Corp	Morgan Stanley	(96,720)
200	RLI Corp	Goldman Sachs	(578)
(436)	RLJ Lodging Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(56)
(432)	RLJ Lodging Trust (REIT)	Goldman Sachs	(129)
(158)	RMR Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(587)
(515)	RMR Group Inc 'A'	Goldman Sachs	(2,165)
(958)	Robert Half International Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,303
(86)	Robert Half International Inc	Goldman Sachs	117
(630)	Robert Half International Inc	Morgan Stanley	372
(2,358)	Rocket Cos Inc 'A'	Morgan Stanley	660
195	Rocket Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	111
80	Rockwell Automation Inc	Bank of America Merrill Lynch	737
405	Rockwell Automation Inc	Goldman Sachs	3,431
16	Rockwell Automation Inc	Morgan Stanley	14
(21)	Rogers Corp	Goldman Sachs	32
(39)	Roper Technologies Inc	Goldman Sachs	(239)
(270)	Royal Gold Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,309
(1,439)	RPC Inc	Bank of America Merrill Lynch	376
(786)	RPM International Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,769
(418)	RPM International Inc	Goldman Sachs	1,505

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(812)	RPM International Inc	Morgan Stanley	1,882
(1,015)	RPT Realty (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(365)
(203)	Rush Enterprises Inc 'A'	Goldman Sachs	239
46	Rush Enterprises Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	-
124	Rush Enterprises Inc 'B'	Goldman Sachs	1
(505)	Ruth's Hospitality Group Inc	Goldman Sachs	(354)
85	Ryder System Inc	Bank of America Merrill Lynch	246
49	Ryder System Inc	Goldman Sachs	(12)
205	Ryman Hospitality Properties Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	726
(1,295)	Sabra Health Care Inc (REIT)	Goldman Sachs	(78)
(476)	Sabra Health Care Inc (REIT)	Morgan Stanley	(219)
389	Sabre Corp	Bank of America Merrill Lynch	(23)
1,058	Sabre Corp	Goldman Sachs	1,873
(81)	Saia Inc	Bank of America Merrill Lynch	(409)
(130)	Saia Inc	Goldman Sachs	(641)
(97)	Saia Inc	Morgan Stanley	(450)
(174)	Sailpoint Technologies Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(321)
(630)	Sailpoint Technologies Holdings Inc	Goldman Sachs	(1,839)
28	salesforce.com Inc	Goldman Sachs	(248)
(242)	Sally Beauty Holdings Inc	Goldman Sachs	(169)
14	Sanderson Farms Inc	Bank of America Merrill Lynch	17
126	Sanderson Farms Inc	Goldman Sachs	(48)
(596)	Sandy Spring Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(250)
(891)	Sandy Spring Bancorp Inc	Goldman Sachs	(374)
(1,030)	Sanmina Corp	Goldman Sachs	193
1,108	Santander Consumer USA Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(626)
74	Santander Consumer USA Holdings Inc	Morgan Stanley	(7)
(280)	Saul Centers Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(190)
(975)	Saul Centers Inc (REIT)	Goldman Sachs	(663)
54	SBA Communications Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	189
14	SBA Communications Corp (REIT)	Goldman Sachs	(174)
58	SBA Communications Corp (REIT)	Morgan Stanley	39
(107)	ScanSource Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2)
1,097	Schneider National Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(865)
2,072	Schneider National Inc 'B'	Goldman Sachs	(1,591)
(648)	Schnitzer Steel Industries Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(707)
(407)	Schnitzer Steel Industries Inc 'A'	Goldman Sachs	206
(223)	Scholastic Corp	Bank of America Merrill Lynch	(127)
(1,547)	Scholastic Corp	Goldman Sachs	48
(422)	Schrodinger Inc	Goldman Sachs	(3,614)
(301)	Schrodinger Inc	Morgan Stanley	(63)
(613)	Schweitzer-Mauduit International Inc	Goldman Sachs	1,661
(1,274)	Science Applications International Corp	Morgan Stanley	(752)
109	Scientific Games Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	237

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(170)	Scotts Miracle-Gro Co	Bank of America Merrill Lynch	(843)
(110)	Scotts Miracle-Gro Co	Goldman Sachs	(583)
(179)	Scotts Miracle-Gro Co	Morgan Stanley	(390)
(1)	Seaboard Corp	Goldman Sachs	(114)
740	SEACOR Holdings Inc	Goldman Sachs	141
(149)	Sealed Air Corp	Bank of America Merrill Lynch	27
(92)	Sealed Air Corp	Goldman Sachs	105
(232)	Sealed Air Corp	Morgan Stanley	37
1,467	SeaWorld Entertainment Inc	Goldman Sachs	2,978
776	Select Energy Services Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	279
(971)	Select Medical Holdings Corp	Goldman Sachs	338
(218)	Selective Insurance Group Inc	Goldman Sachs	(86)
(189)	Sempra Energy	Bank of America Merrill Lynch	1,060
(33)	Sempra Energy	Morgan Stanley	84
(470)	Semtech Corp	Bank of America Merrill Lynch	(631)
(255)	Semtech Corp	Goldman Sachs	(251)
(94)	Semtech Corp	Morgan Stanley	(24)
(868)	Sensient Technologies Corp	Goldman Sachs	1,024
941	Seritage Growth Properties (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	1,581
(531)	Service Corp International	Goldman Sachs	335
(723)	Service Properties Trust (REIT)	Goldman Sachs	(1,103)
39	ServiceNow Inc	Bank of America Merrill Lynch	701
50	ServiceNow Inc	Goldman Sachs	973
266	ServiceNow Inc	Morgan Stanley	2,891
141	ServisFirst Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	(152)
371	ServisFirst Bancshares Inc	Goldman Sachs	(399)
859	Shake Shack Inc 'A'	Goldman Sachs	1,869
(18)	Shenandoah Telecommunications Co	Bank of America Merrill Lynch	15
(862)	Shenandoah Telecommunications Co	Goldman Sachs	620
(18)	Sherwin-Williams Co	Bank of America Merrill Lynch	(58)
(2)	Sherwin-Williams Co	Goldman Sachs	(1)
(55)	Sherwin-Williams Co	Morgan Stanley	(191)
(19)	Shift4 Payments Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	13
(334)	Shift4 Payments Inc 'A'	Morgan Stanley	174
31	Shockwave Medical Inc	Bank of America Merrill Lynch	(22)
225	Shockwave Medical Inc	Goldman Sachs	350
321	Shoe Carnival Inc	Bank of America Merrill Lynch	586
332	Shoe Carnival Inc	Goldman Sachs	698
(53)	ShotSpotter Inc	Bank of America Merrill Lynch	26
(182)	ShotSpotter Inc	Goldman Sachs	(26)
(96)	Shutterstock Inc	Bank of America Merrill Lynch	(125)
(410)	Shyft Group Inc	Goldman Sachs	(627)
239	SI-BONE Inc	Bank of America Merrill Lynch	(119)
(674)	SIGA Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	23
228	Signature Bank	Morgan Stanley	1,428

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
39	Silicon Laboratories Inc	Goldman Sachs	(13)
161	Silicon Laboratories Inc	Morgan Stanley	49
322	Silk Road Medical Inc	Goldman Sachs	(1,157)
299	Simon Property Group Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	1,882
62	Simon Property Group Inc (REIT)	Goldman Sachs	(33)
124	Simon Property Group Inc (REIT)	Morgan Stanley	26
308	Simply Good Foods Co	Bank of America Merrill Lynch	(372)
246	Simply Good Foods Co	Goldman Sachs	(150)
(40)	Simpson Manufacturing Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	33
(224)	Simpson Manufacturing Co Inc	Goldman Sachs	567
128	Simulations Plus Inc	Goldman Sachs	(1,692)
(978)	Sinclair Broadcast Group Inc 'A'	Goldman Sachs	(2,875)
1,814	Sirius XM Holdings Inc	Goldman Sachs	209
6,207	Sirius XM Holdings Inc	Morgan Stanley	(466)
(834)	SITE Centers Corp (REIT)	Goldman Sachs	156
(54)	SiteOne Landscape Supply Inc	Goldman Sachs	(74)
74	Six Flags Entertainment Corp	Bank of America Merrill Lynch	171
1,041	Six Flags Entertainment Corp	Goldman Sachs	765
(30)	SJW Group	Bank of America Merrill Lynch	33
(630)	SJW Group	Goldman Sachs	651
662	Skechers USA Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	82
173	Skechers USA Inc 'A'	Goldman Sachs	83
5,054	Skechers USA Inc 'A'	Morgan Stanley	(606)
(308)	Skyline Champion Corp	Goldman Sachs	(788)
(421)	SkyWest Inc	Goldman Sachs	(1,067)
110	Skyworks Solutions Inc	Morgan Stanley	41
409	SL Green Realty Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(166)
73	Sleep Number Corp	Bank of America Merrill Lynch	68
580	Smartsheet Inc 'A'	Morgan Stanley	2,743
(431)	SmileDirectClub Inc	Bank of America Merrill Lynch	(738)
(431)	SmileDirectClub Inc	Goldman Sachs	(896)
(511)	SmileDirectClub Inc	Morgan Stanley	225
(811)	Smith & Wesson Brands Inc	Goldman Sachs	220
(468)	Snap Inc 'A'	Goldman Sachs	(2,844)
(549)	Snap Inc 'A'	Morgan Stanley	(253)
60	Snap-on Inc	Bank of America Merrill Lynch	196
94	Snap-on Inc	Goldman Sachs	340
107	Snap-on Inc	Morgan Stanley	(45)
(34)	Snowflake Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	345
(83)	SolarEdge Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	809
(60)	SolarEdge Technologies Inc	Goldman Sachs	(3,036)
(41)	SolarEdge Technologies Inc	Morgan Stanley	(676)
(1,642)	SolarWinds Corp	Goldman Sachs	(1,790)
(213)	Sonic Automotive Inc 'A'	Goldman Sachs	328
(31)	Sonoco Products Co	Goldman Sachs	(41)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(40)	Sonoco Products Co	Morgan Stanley	(58)
432	Sonos Inc	Goldman Sachs	1,884
1,177	South Jersey Industries Inc	Goldman Sachs	506
219	South State Corp	Bank of America Merrill Lynch	2
248	South State Corp	Goldman Sachs	(378)
236	South State Corp	Morgan Stanley	(87)
20	Southwest Gas Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(62)
60	Southwest Gas Holdings Inc	Morgan Stanley	(92)
(4,811)	Southwestern Energy Co	Goldman Sachs	(1,395)
(395)	SP Plus Corp	Goldman Sachs	99
(505)	SpartanNash Co	Bank of America Merrill Lynch	(225)
(901)	SpartanNash Co	Goldman Sachs	(413)
(55)	Spectrum Brands Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(101)
(238)	Spectrum Brands Holdings Inc	Goldman Sachs	(552)
(517)	Spire Inc	Goldman Sachs	(1,116)
331	Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	(272)
583	Spirit Airlines Inc	Goldman Sachs	1,111
249	Spirit Realty Capital Inc (REIT)	Goldman Sachs	275
(743)	Splunk Inc	Morgan Stanley	(3,121)
44	SpringWorks Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(7)
633	Sprout Social Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	2,861
(343)	Sprouts Farmers Market Inc	Bank of America Merrill Lynch	(163)
(295)	Sprouts Farmers Market Inc	Goldman Sachs	(140)
1,368	SPX Corp	Goldman Sachs	4,665
(122)	SPX FLOW Inc	Goldman Sachs	(194)
(70)	Square Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(193)
(15)	Square Inc 'A'	Goldman Sachs	(155)
(447)	SS&C Technologies Holdings Inc	Goldman Sachs	(1,475)
(1,600)	SS&C Technologies Holdings Inc	Morgan Stanley	(352)
(407)	St Joe Co	Bank of America Merrill Lynch	(218)
(634)	St Joe Co	Goldman Sachs	(885)
124	STAAR Surgical Co	Goldman Sachs	(380)
(73)	Stamps.com Inc	Goldman Sachs	(555)
(199)	Stamps.com Inc	Morgan Stanley	(1,160)
(283)	Standard Motor Products Inc	Goldman Sachs	458
(55)	Standex International Corp	Goldman Sachs	(8)
15	Starbucks Corp	Goldman Sachs	9
1,535	Starbucks Corp	Morgan Stanley	1,013
876	State Auto Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(666)
1,482	State Auto Financial Corp	Goldman Sachs	(1,126)
96	State Street Corp	Morgan Stanley	159
(3,715)	Steel Dynamics Inc	Morgan Stanley	(3,789)
1,344	Steelcase Inc 'A'	Goldman Sachs	(833)
(106)	Stericycle Inc	Bank of America Merrill Lynch	(15)
(227)	Stericycle Inc	Goldman Sachs	(32)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
403	Sterling Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	214
1,193	Sterling Bancorp	Goldman Sachs	353
(662)	Sterling Construction Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(218)
(845)	Sterling Construction Co Inc	Goldman Sachs	(279)
746	Steven Madden Ltd	Goldman Sachs	678
(4)	Stewart Information Services Corp	Bank of America Merrill Lynch	6
(1,361)	Stewart Information Services Corp	Goldman Sachs	1,965
(2,264)	Stifel Financial Corp	Morgan Stanley	(4,007)
227	Stitch Fix Inc 'A'	Goldman Sachs	1,332
530	Stitch Fix Inc 'A'	Morgan Stanley	2,030
(107)	Stock Yards Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	8
242	Stoneridge Inc	Bank of America Merrill Lynch	(40)
329	Stoneridge Inc	Goldman Sachs	118
(348)	StoneX Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(225)
(349)	StoneX Group Inc	Goldman Sachs	(130)
(37)	Strategic Education Inc	Goldman Sachs	(202)
(1,121)	Summit Hotel Properties Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(1,289)
(1,717)	Summit Hotel Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	(1,975)
233	Summit Materials Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(138)
695	Summit Materials Inc 'A'	Goldman Sachs	(92)
(209)	Sun Communities Inc (REIT)	Goldman Sachs	511
(166)	Sun Communities Inc (REIT)	Morgan Stanley	256
(907)	SunCoke Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(571)
(664)	SunCoke Energy Inc	Goldman Sachs	(418)
(122)	Sunrun Inc	Bank of America Merrill Lynch	(937)
(301)	Sunrun Inc	Morgan Stanley	(912)
(445)	Sunstone Hotel Investors Inc (REIT)	Goldman Sachs	(289)
(554)	Super Micro Computer Inc	Bank of America Merrill Lynch	100
(731)	Super Micro Computer Inc	Goldman Sachs	169
162	Supernus Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	111
182	Supernus Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	225
(439)	Surgery Partners Inc	Bank of America Merrill Lynch	(404)
(410)	Surgery Partners Inc	Goldman Sachs	(377)
(86)	SVB Financial Group	Morgan Stanley	(83)
269	SVMK Inc	Bank of America Merrill Lynch	138
1,088	SVMK Inc	Goldman Sachs	968
(160)	Switch Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(112)
(995)	Switch Inc 'A'	Morgan Stanley	(78)
103	Sykes Enterprises Inc	Bank of America Merrill Lynch	(43)
78	Synaptics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(160)
88	Synaptics Inc	Goldman Sachs	(34)
123	Synchrony Financial	Bank of America Merrill Lynch	109
187	Synchrony Financial	Goldman Sachs	139
213	Synchrony Financial	Morgan Stanley	185
(22)	Syneos Health Inc	Goldman Sachs	16

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(51)	Syneos Health Inc	Morgan Stanley	11
(114)	SYNNEX Corp	Bank of America Merrill Lynch	(872)
(216)	SYNNEX Corp	Goldman Sachs	(765)
(78)	SYNNEX Corp	Morgan Stanley	(257)
33	Synopsys Inc	Bank of America Merrill Lynch	71
30	Synopsys Inc	Goldman Sachs	348
285	Synovus Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	402
1,144	Synovus Financial Corp	Goldman Sachs	1,453
451	Synovus Financial Corp	Morgan Stanley	185
64	Sysco Corp	Bank of America Merrill Lynch	(66)
613	Sysco Corp	Goldman Sachs	(2,777)
141	Sysco Corp	Morgan Stanley	(152)
297	Systemax Inc	Bank of America Merrill Lynch	615
(246)	T Rowe Price Group Inc	Morgan Stanley	302
149	Tabula Rasa HealthCare Inc	Bank of America Merrill Lynch	49
629	Tabula Rasa HealthCare Inc	Goldman Sachs	208
1,141	Tactile Systems Technology Inc	Goldman Sachs	(1,015)
1,561	Talos Energy Inc	Goldman Sachs	1,577
25	Tandem Diabetes Care Inc	Goldman Sachs	(143)
224	Tandem Diabetes Care Inc	Morgan Stanley	(625)
30	Tapestry Inc	Bank of America Merrill Lynch	30
2,574	Tapestry Inc	Goldman Sachs	2,613
392	Tapestry Inc	Morgan Stanley	(221)
435	Targa Resources Corp	Goldman Sachs	(39)
(700)	Target Corp	Morgan Stanley	(371)
(435)	Taubman Centers Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(3)
243	Taylor Morrison Home Corp	Bank of America Merrill Lynch	231
420	Taylor Morrison Home Corp	Goldman Sachs	399
(207)	TEGNA Inc	Goldman Sachs	(27)
(1,423)	TEGNA Inc	Morgan Stanley	(342)
(1,513)	Tejon Ranch Co	Bank of America Merrill Lynch	521
(1,399)	Tejon Ranch Co	Goldman Sachs	329
(381)	Telephone and Data Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(383)
(1,143)	Telephone and Data Systems Inc	Goldman Sachs	(20)
(292)	Tempur Sealy International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(282)
(1,389)	Tempur Sealy International Inc	Goldman Sachs	(678)
(415)	Tempur Sealy International Inc	Morgan Stanley	53
(50)	Tenable Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(39)
(481)	Tenable Holdings Inc	Goldman Sachs	(409)
(118)	Tenet Healthcare Corp	Bank of America Merrill Lynch	(118)
(266)	Tenet Healthcare Corp	Goldman Sachs	(279)
762	Tennant Co	Goldman Sachs	427
703	Teradata Corp	Bank of America Merrill Lynch	687
1,090	Teradata Corp	Goldman Sachs	437
(216)	Teradyne Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
555	Terex Corp	Goldman Sachs	(356)
(95)	Terminix Global Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	85
(181)	Terreno Realty Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	254
(83)	Terreno Realty Corp (REIT)	Morgan Stanley	56
47	Tesla Inc	Bank of America Merrill Lynch	5,419
40	Tesla Inc	Goldman Sachs	7,334
74	Tesla Inc	Morgan Stanley	5,149
(292)	Tetra Tech Inc	Morgan Stanley	137
71	Texas Instruments Inc	Morgan Stanley	22
(97)	Texas Roadhouse Inc	Goldman Sachs	113
1,653	TFS Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,416
1,562	TFS Financial Corp	Goldman Sachs	1,351
73	Thermo Fisher Scientific Inc	Bank of America Merrill Lynch	695
59	Thermo Fisher Scientific Inc	Goldman Sachs	(346)
131	Thermo Fisher Scientific Inc	Morgan Stanley	2,061
(21)	Thor Industries Inc	Goldman Sachs	(45)
(92)	Timken Co	Bank of America Merrill Lynch	(63)
(347)	Timken Co	Goldman Sachs	(236)
(845)	Tivity Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,155)
2,105	TJX Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,157
1	TJX Cos Inc	Morgan Stanley	1
(133)	T-Mobile US Inc	Bank of America Merrill Lynch	(245)
(353)	T-Mobile US Inc	Goldman Sachs	(819)
(654)	T-Mobile US Inc	Morgan Stanley	(1,961)
(39)	Toll Brothers Inc	Goldman Sachs	4
(387)	Toll Brothers Inc	Morgan Stanley	121
218	Tompkins Financial Corp	Goldman Sachs	(514)
(1,280)	Tootsie Roll Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	209
(229)	TopBuild Corp	Bank of America Merrill Lynch	194
(322)	TopBuild Corp	Goldman Sachs	358
(339)	TopBuild Corp	Morgan Stanley	3,570
(164)	Toro Co	Bank of America Merrill Lynch	(127)
(115)	Toro Co	Goldman Sachs	(198)
(183)	Toro Co	Morgan Stanley	244
(4,082)	Towne Bank	Goldman Sachs	1,551
93	TPI Composites Inc	Bank of America Merrill Lynch	(29)
(7)	Tractor Supply Co	Goldman Sachs	(48)
(640)	Tractor Supply Co	Morgan Stanley	(3,744)
(25)	Trade Desk Inc 'A'	Goldman Sachs	(1,871)
24	Tradeweb Markets Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	4
121	Tradeweb Markets Inc 'A'	Goldman Sachs	21
(37)	TransUnion	Bank of America Merrill Lynch	99
(495)	TransUnion	Goldman Sachs	1,740
(649)	TransUnion	Morgan Stanley	1,480
460	Travelers Cos Inc	Morgan Stanley	(800)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(499)	Tredegar Corp	Bank of America Merrill Lynch	87
(2,217)	Tredegar Corp	Goldman Sachs	(1,289)
(133)	TreeHouse Foods Inc	Bank of America Merrill Lynch	(85)
(622)	TreeHouse Foods Inc	Goldman Sachs	(688)
(556)	Trex Co Inc	Goldman Sachs	241
(1,102)	TRI Pointe Group Inc	Goldman Sachs	672
(2,233)	Tribune Publishing Co	Goldman Sachs	357
1,002	Tricida Inc	Bank of America Merrill Lynch	186
(1,152)	TriCo Bancshares	Bank of America Merrill Lynch	(214)
(178)	TriMas Corp	Bank of America Merrill Lynch	110
(172)	TriMas Corp	Goldman Sachs	107
(156)	TriNet Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	55
(70)	TriNet Group Inc	Goldman Sachs	25
(325)	TriNet Group Inc	Morgan Stanley	(114)
(3,625)	Trinity Industries Inc	Goldman Sachs	(4,179)
564	TripAdvisor Inc	Goldman Sachs	(672)
383	TriState Capital Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(169)
2,909	TriState Capital Holdings Inc	Goldman Sachs	(1,280)
652	Triumph Group Inc	Goldman Sachs	1,545
(34)	TrueBlue Inc	Bank of America Merrill Lynch	(69)
(2,847)	TrueBlue Inc	Goldman Sachs	(5,751)
(1,478)	TrueCar Inc	Goldman Sachs	(355)
104	Truist Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(34)
302	Truist Financial Corp	Goldman Sachs	(222)
1,749	Truist Financial Corp	Morgan Stanley	1,644
284	Trupanion Inc	Goldman Sachs	2,511
(1,382)	Trustmark Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,755
(520)	Trustmark Corp	Goldman Sachs	660
(332)	TTEC Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,710)
(350)	TTEC Holdings Inc	Goldman Sachs	(1,482)
(742)	TTM Technologies Inc	Goldman Sachs	(428)
(530)	Tucows Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,246)
449	Turning Point Brands Inc	Goldman Sachs	(4)
(19)	Tutor Perini Corp	Bank of America Merrill Lynch	4
(637)	Tutor Perini Corp	Goldman Sachs	127
(60)	Twilio Inc 'A'	Morgan Stanley	(1,066)
1,495	Twitter Inc	Morgan Stanley	1,793
91	Tyler Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	191
275	Tyler Technologies Inc	Morgan Stanley	3,462
(809)	Tyson Foods Inc 'A'	Goldman Sachs	332
(217)	Tyson Foods Inc 'A'	Morgan Stanley	111
(499)	Uber Technologies Inc	Goldman Sachs	(639)
104	Ubiquiti Inc	Morgan Stanley	(44)
(416)	UDR Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(255)
(602)	UDR Inc (REIT)	Morgan Stanley	307

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(961)	UFP Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	86
(1,097)	UFP Industries Inc	Goldman Sachs	99
(476)	UFP Industries Inc	Morgan Stanley	576
14	Ulta Beauty Inc	Goldman Sachs	(64)
62	Ulta Beauty Inc	Morgan Stanley	(170)
(613)	Ultra Clean Holdings Inc	Goldman Sachs	(1,525)
(310)	UMB Financial Corp	Goldman Sachs	65
209	UMH Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	(54)
788	Umpqua Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(95)
188	Umpqua Holdings Corp	Goldman Sachs	(12)
2,392	Under Armour Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1,374
2,223	Under Armour Inc 'A'	Morgan Stanley	22
405	Under Armour Inc 'C'	Bank of America Merrill Lynch	(77)
2,629	Under Armour Inc 'C'	Goldman Sachs	1,754
145	UniFirst Corp	Goldman Sachs	(481)
(1,463)	Unisys Corp	Goldman Sachs	(1,127)
(227)	United Community Banks Inc	Goldman Sachs	136
(120)	United Fire Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	36
(394)	United Natural Foods Inc	Goldman Sachs	(410)
583	United Parcel Service Inc 'B'	Morgan Stanley	1,899
84	United Rentals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(652)
(536)	United States Cellular Corp	Goldman Sachs	51
(12)	United States Lime & Minerals Inc	Goldman Sachs	(90)
(1,806)	United States Steel Corp	Goldman Sachs	(6,032)
(437)	Uniti Group Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(363)
(2,376)	Uniti Group Inc (REIT)	Goldman Sachs	(1,972)
532	Unitil Corp	Goldman Sachs	1,394
44	Unity Software Inc	Goldman Sachs	30
1,292	Univar Solutions Inc	Goldman Sachs	(253)
(396)	Universal Corp	Bank of America Merrill Lynch	38
(2,360)	Universal Corp	Goldman Sachs	1,453
(554)	Universal Electronics Inc	Goldman Sachs	(2,237)
(63)	Universal Health Realty Income Trust (REIT)	Goldman Sachs	(210)
(560)	Universal Health Services Inc 'B'	Morgan Stanley	(84)
3,160	Universal Insurance Holdings Inc	Goldman Sachs	(284)
2,255	Univest Financial Corp	Goldman Sachs	(947)
3,349	Unum Group	Bank of America Merrill Lynch	3,987
5,382	Unum Group	Morgan Stanley	2,745
27	Upland Software Inc	Bank of America Merrill Lynch	56
734	Upland Software Inc	Goldman Sachs	2,439
(3,452)	Urban Edge Properties (REIT)	Goldman Sachs	(1,001)
1,049	Urban Outfitters Inc	Goldman Sachs	105
(2,167)	Urstadt Biddle Properties Inc 'A' (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(4,941)
(1,327)	Urstadt Biddle Properties Inc 'A' (REIT)	Goldman Sachs	(3,026)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
249	US Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	309
3,156	US Bancorp	Morgan Stanley	3,629
164	US Concrete Inc	Goldman Sachs	(116)
437	US Ecology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(109)
874	US Ecology Inc	Goldman Sachs	(219)
523	US Foods Holding Corp	Goldman Sachs	236
278	US Foods Holding Corp	Morgan Stanley	270
128	US Physical Therapy Inc	Goldman Sachs	(202)
190	USANA Health Sciences Inc	Goldman Sachs	(53)
121	Vail Resorts Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,465
113	Vail Resorts Inc	Morgan Stanley	570
266	Valero Energy Corp	Goldman Sachs	(264)
422	Valero Energy Corp	Morgan Stanley	(68)
1,931	Valley National Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	48
1,187	Valley National Bancorp	Goldman Sachs	30
2,525	Valley National Bancorp	Morgan Stanley	63
203	Valmont Industries Inc	Goldman Sachs	(128)
570	Valvoline Inc	Goldman Sachs	(32)
166	Varex Imaging Corp	Bank of America Merrill Lynch	330
136	Varonis Systems Inc	Morgan Stanley	169
(5,845)	Vector Group Ltd	Goldman Sachs	2,630
865	Vectrus Inc	Goldman Sachs	2,033
1,759	Veeco Instruments Inc	Goldman Sachs	1,812
477	Veoneer Inc	Goldman Sachs	845
144	VeriSign Inc	Goldman Sachs	200
(306)	Verizon Communications Inc	Goldman Sachs	144
(4,456)	Verizon Communications Inc	Morgan Stanley	(267)
289	Verra Mobility Corp	Bank of America Merrill Lynch	(56)
803	Verra Mobility Corp	Goldman Sachs	(389)
67	Vertex Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	187
230	Vertiv Holdings Co	Goldman Sachs	150
1,885	Vertiv Holdings Co	Morgan Stanley	(94)
330	VF Corp	Bank of America Merrill Lynch	677
452	VF Corp	Goldman Sachs	927
1,380	VF Corp	Morgan Stanley	(3,064)
2,290	ViacomCBS Inc 'B'	Morgan Stanley	1,168
98	Viad Corp	Bank of America Merrill Lynch	109
234	Viad Corp	Goldman Sachs	260
169	ViaSat Inc	Bank of America Merrill Lynch	(66)
866	ViaSat Inc	Goldman Sachs	(634)
(1,254)	Viavi Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	185
2,993	VICI Properties Inc (REIT)	Morgan Stanley	(2,215)
325	Vicor Corp	Goldman Sachs	959
(1,049)	Victory Capital Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	(52)
(1,596)	Virgin Galactic Holdings Inc	Morgan Stanley	(3,176)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(2,531)	VirnetX Holding Corp	Goldman Sachs	(506)
(636)	Virtu Financial Inc 'A'	Goldman Sachs	(23)
(96)	Virtus Investment Partners Inc	Goldman Sachs	170
208	Visa Inc 'A'	Goldman Sachs	(112)
557	Visa Inc 'A'	Morgan Stanley	568
(1,461)	Vishay Intertechnology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(671)
(1,036)	Vishay Intertechnology Inc	Goldman Sachs	(597)
(1,297)	Vishay Intertechnology Inc	Morgan Stanley	(396)
215	Vishay Precision Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	8
153	Vishay Precision Group Inc	Goldman Sachs	131
(44)	Visteon Corp	Goldman Sachs	(321)
(1,990)	Vistra Energy Corp	Goldman Sachs	1,075
132	VMware Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(766)
445	VMware Inc 'A'	Morgan Stanley	(3,996)
240	Vocera Communications Inc	Bank of America Merrill Lynch	557
399	Vocera Communications Inc	Goldman Sachs	926
(1,413)	Vonage Holdings Corp	Goldman Sachs	(192)
(271)	Voya Financial Inc	Morgan Stanley	(103)
704	Vroom Inc	Morgan Stanley	(648)
(1,805)	W&T Offshore Inc	Bank of America Merrill Lynch	(449)
(4,459)	W&T Offshore Inc	Goldman Sachs	(1,110)
(2,192)	Wabash National Corp	Goldman Sachs	(986)
(2,808)	Waddell & Reed Financial Inc 'A'	Goldman Sachs	1,011
101	Walker & Dunlop Inc	Bank of America Merrill Lynch	(167)
(103)	Walmart Inc	Bank of America Merrill Lynch	(93)
(36)	Walmart Inc	Morgan Stanley	15
294	Walt Disney Co	Bank of America Merrill Lynch	(978)
(2,060)	Warrior Met Coal Inc	Goldman Sachs	(494)
(262)	Washington Federal Inc	Goldman Sachs	293
(1,017)	Washington Real Estate Investment Trust (REIT)	Goldman Sachs	(590)
(212)	Washington Trust Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(76)
(506)	Washington Trust Bancorp Inc	Goldman Sachs	196
(127)	Waste Management Inc	Goldman Sachs	298
(733)	Waste Management Inc	Morgan Stanley	345
(850)	Waterstone Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	425
(4,391)	Waterstone Financial Inc	Goldman Sachs	2,195
(10)	Watsco Inc	Goldman Sachs	130
(350)	Watsco Inc	Morgan Stanley	4,522
1,188	Watts Water Technologies Inc 'A'	Goldman Sachs	(336)
(7)	Wayfair Inc 'A'	Goldman Sachs	(89)
(249)	Wayfair Inc 'A'	Morgan Stanley	215
(35)	WD-40 Co	Goldman Sachs	24
424	Webster Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	19
633	Webster Financial Corp	Morgan Stanley	152
(203)	WEC Energy Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,851

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(585)	Weingarten Realty Investors (REIT)	Goldman Sachs	439
14	Weis Markets Inc	Goldman Sachs	1
1,382	Welbilt Inc	Bank of America Merrill Lynch	136
1,893	Welbilt Inc	Goldman Sachs	528
338	Welltower Inc (REIT)	Morgan Stanley	254
322	Wendy's Co	Bank of America Merrill Lynch	(361)
176	Wendy's Co	Morgan Stanley	(19)
474	Werner Enterprises Inc	Goldman Sachs	(177)
(120)	WesBanco Inc	Bank of America Merrill Lynch	(79)
(1,846)	WesBanco Inc	Goldman Sachs	(1,218)
129	WESCO International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(68)
183	WESCO International Inc	Goldman Sachs	605
(464)	Westamerica Bancorp	Goldman Sachs	548
77	Western Alliance Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	(25)
652	Western Alliance Bancorp	Goldman Sachs	(713)
86	Western Alliance Bancorp	Morgan Stanley	52
(677)	Western Digital Corp	Bank of America Merrill Lynch	257
35	WEX Inc	Bank of America Merrill Lynch	(155)
(526)	Weyerhaeuser Co (REIT)	Goldman Sachs	123
(279)	Whirlpool Corp	Morgan Stanley	611
(509)	Whitestone REIT (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(56)
(654)	Whitestone REIT (REIT)	Goldman Sachs	(72)
(2,087)	WideOpenWest Inc	Goldman Sachs	(285)
(67)	Willdan Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	30
(225)	Willdan Group Inc	Goldman Sachs	101
1,657	Williams Cos Inc	Goldman Sachs	2,390
(220)	Williams-Sonoma Inc	Morgan Stanley	468
542	WillScot Mobile Mini Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(45)
725	WillScot Mobile Mini Holdings Corp	Goldman Sachs	22
623	WillScot Mobile Mini Holdings Corp	Morgan Stanley	(268)
(335)	Wingstop Inc	Goldman Sachs	2,906
319	Winnebago Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(138)
114	Wintrust Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	166
1,302	Wintrust Financial Corp	Goldman Sachs	580
(3,452)	WisdomTree Investments Inc	Bank of America Merrill Lynch	(915)
(1,357)	WisdomTree Investments Inc	Goldman Sachs	(360)
1,498	Wolverine World Wide Inc	Goldman Sachs	1,288
(13)	Workday Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(117)
(54)	Workday Inc 'A'	Goldman Sachs	102
(224)	Workday Inc 'A'	Morgan Stanley	(3,535)
(79)	World Acceptance Corp	Bank of America Merrill Lynch	(361)
(239)	World Acceptance Corp	Goldman Sachs	(1,081)
(481)	World Fuel Services Corp	Bank of America Merrill Lynch	34
(618)	World Fuel Services Corp	Goldman Sachs	43
732	World Wrestling Entertainment Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
168	World Wrestling Entertainment Inc 'A'	Goldman Sachs	56
144	World Wrestling Entertainment Inc 'A'	Morgan Stanley	131
(1,031)	Worthington Industries Inc	Goldman Sachs	2,175
(188)	WP Carey Inc (REIT)	Goldman Sachs	(72)
171	WR Berkley Corp	Bank of America Merrill Lynch	(124)
27	WR Berkley Corp	Goldman Sachs	(43)
(51)	WSFS Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	8
(728)	WSFS Financial Corp	Goldman Sachs	116
(27)	WW Grainger Inc	Bank of America Merrill Lynch	(40)
(100)	WW Grainger Inc	Morgan Stanley	18
269	WW International Inc	Goldman Sachs	732
(176)	Wyndham Destinations Inc	Goldman Sachs	76
815	Wyndham Hotels & Resorts Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,153
306	Wyndham Hotels & Resorts Inc	Goldman Sachs	508
34	Wyndham Hotels & Resorts Inc	Morgan Stanley	(6)
(2,145)	Xenia Hotels & Resorts Inc (REIT)	Goldman Sachs	(4,419)
600	Xerox Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(353)
(232)	XPO Logistics Inc	Goldman Sachs	(399)
194	Xylem Inc	Bank of America Merrill Lynch	367
924	Xylem Inc	Goldman Sachs	(537)
360	Xylem Inc	Morgan Stanley	684
(293)	Yelp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3)
(204)	Yelp Inc	Goldman Sachs	94
(170)	YETI Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(991)
(34)	YETI Holdings Inc	Goldman Sachs	(124)
(279)	YETI Holdings Inc	Morgan Stanley	(538)
619	Yext Inc	Bank of America Merrill Lynch	789
2,783	Yext Inc	Goldman Sachs	2,544
127	Y-mAbs Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	912
(135)	York Water Co	Bank of America Merrill Lynch	-
(443)	York Water Co	Goldman Sachs	388
(242)	Yum! Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	322
(49)	Yum! Brands Inc	Goldman Sachs	(96)
(253)	Yum! Brands Inc	Morgan Stanley	(190)
315	Zendesk Inc	Morgan Stanley	2,511
(110)	Zillow Group Inc 'C'	Bank of America Merrill Lynch	(107)
(211)	Zillow Group Inc 'C'	Goldman Sachs	477
(82)	Zimmer Biomet Holdings Inc	Goldman Sachs	51
679	Zions Bancorp NA	Bank of America Merrill Lynch	(62)
440	Zions Bancorp NA	Morgan Stanley	(13)
499	Zoetis Inc	Morgan Stanley	(1,667)
876	Zogenix Inc	Goldman Sachs	286
(54)	Zoom Video Communications Inc 'A'	Goldman Sachs	(1,056)
(35)	Zscaler Inc	Bank of America Merrill Lynch	(708)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(78)	Zscaler Inc	Morgan Stanley	(923)
109	Zumiez Inc	Bank of America Merrill Lynch	169
511	Zumiez Inc	Goldman Sachs	1,167
620	Zuora Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	451
2,473	Zuora Inc 'A'	Goldman Sachs	2,794
391	Zynex Inc	Goldman Sachs	199
4,404	Zynga Inc 'A'	Goldman Sachs	1,168
			<u>(67,945)</u>
合計			<u>(298,113)</u>

\* 当証券は投資運用会社と協議の上で評価されている。注記2(a)に詳述のとおり、当証券は会計期間末現在で公正価値評価、または算定が中止されている。

0.5米ドル未満の金額は端数切捨てにより0と表示されている。

## 金融デリバティブ商品

## 先物取引

契約数	契約通貨	契約 / 摘要	満期日	未実現純評価 益 / (損) (米ドル)
1	EUR	Amsterdam Index Futures March 2021	2020年12月	2,747
(16)	EUR	CAC40 Index Futures March 2021	2020年12月	(21,534)
33	USD	E-Mini Russell 2000 Index Futures March 2021	2020年12月	169,242
26	USD	E-Mini S&P 500 Index Futures December 2020	2020年12月	209,510
(18)	GBP	FTSE 100 Index Futures March 2021	2020年12月	(172)
23	EUR	FTSE MIB Index Futures December 2020	2020年12月	338,153
9	HKD	Hang Seng Index Futures March 2021	2020年12月	(13,229)
(22)	EUR	IBEX 35 Index Futures March 2021	2020年12月	(80,010)
21	EUR	Mini-DAX Futures December 2020	2020年12月	117,778
(30)	SGD	MSCI Singapore Index Futures March 2021	2020年12月	14,315
(175)	SEK	OMX Stockholm 30 Index Futures March 2021	2020年12月	(29,060)
(5)	CAD	S&P/TSX 60 Index Futures December 2020	2020年12月	486
4	AUD	SPI 200 Index Futures March 2021	2020年12月	(6,253)
15	CHF	Swiss Market Index Futures December 2020	2020年12月	8,192
1	JPY	Topix Index Futures December 2020	2020年12月	3,021
合計				713,186

## 金融デリバティブ商品

## 未決済先渡為替予約

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現純評価益 / (損) (米ドル)
AUD	1,959,000	USD	1,427,658	Bank of America Merrill Lynch	14/12/2020	17,970
AUD	2,005,000	USD	1,465,815	BNP Paribas	14/12/2020	13,759
AUD	3,431,000	USD	2,494,746	JP Morgan	14/12/2020	37,134
AUD	125,000	USD	92,342	Morgan Stanley	14/12/2020	(99)
AUD	798,000	USD	580,572	UBS	14/12/2020	8,306
CAD	481,000	USD	370,314	Morgan Stanley	14/12/2020	1,620
CAD	444,000	USD	340,518	UBS	14/12/2020	2,806
CHF	706,000	EUR	653,446	Morgan Stanley	14/12/2020	(2,709)
CHF	519,000	EUR	485,927	UBS	14/12/2020	(8,664)
EUR	61,610	CHF	66,000	Citibank	14/12/2020	881
EUR	1,681,938	NOK	18,254,000	JP Morgan	14/12/2020	(55,776)
EUR	485,154	NOK	5,190,000	Morgan Stanley	14/12/2020	(7,527)
EUR	177,849	SEK	1,827,000	Credit Suisse	14/12/2020	(2,005)
EUR	972,593	SEK	9,904,000	Deutsche Bank	14/12/2020	(684)
EUR	1,125,371	SEK	11,517,000	JP Morgan	14/12/2020	(7,541)
EUR	2,403,000	USD	2,851,215	Bank of America Merrill Lynch	14/12/2020	32,301
EUR	3,771,000	USD	4,492,559	BNP Paribas	14/12/2020	32,509
EUR	1,472,000	USD	1,751,386	JP Morgan	14/12/2020	14,963
EUR	911,000	USD	1,087,550	Morgan Stanley	14/12/2020	5,618
GBP	1,082,000	USD	1,441,127	Credit Suisse	14/12/2020	6,043

## 金融デリバティブ商品

## 未決済先渡為替予約(続き)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現純評価益/ (損)(米ドル)
GBP	802,000	USD	1,065,311	JP Morgan	14/12/2020	7,359
JPY	253,233,000	USD	2,442,156	Bank of America Merrill Lynch	14/12/2020	(12,649)
JPY	34,312,000	USD	329,667	Morgan Stanley	14/12/2020	(480)
NOK	21,236,203	EUR	1,965,175	Deutsche Bank	14/12/2020	54,743
NOK	1,445,797	EUR	134,651	Goldman Sachs	14/12/2020	2,697
NOK	8,152,000	EUR	761,217	JP Morgan	14/12/2020	12,807
NOK	1,280,000	EUR	121,340	Morgan Stanley	14/12/2020	(169)
NZD	827,000	USD	572,392	Goldman Sachs	14/12/2020	10,284
NZD	66,000	USD	46,208	Morgan Stanley	14/12/2020	293
SEK	34,202,000	EUR	3,323,778	Goldman Sachs	14/12/2020	44,274
SEK	1,378,000	EUR	135,695	Morgan Stanley	14/12/2020	(352)
USD	2,005,120	AUD	2,759,000	Bank of America Merrill Lynch	14/12/2020	(30,863)
USD	857,908	CAD	1,123,000	BNP Paribas	14/12/2020	(10,454)
USD	109,686	CAD	143,000	Deutsche Bank	14/12/2020	(889)
USD	2,307,359	EUR	1,941,000	Bank of America Merrill Lynch	14/12/2020	(21,773)
USD	1,740,375	EUR	1,472,000	BNP Paribas	14/12/2020	(25,973)
USD	2,202,811	EUR	1,854,355	JP Morgan	14/12/2020	(22,350)
USD	1,050,885	GBP	802,043	BNP Paribas	14/12/2020	(21,843)
USD	2,885,867	GBP	2,164,000	Citibank	14/12/2020	(8,471)
USD	520,954	JPY	53,832,000	Bank of America Merrill Lynch	14/12/2020	4,492
USD	1,444,305	JPY	150,550,000	Citibank	14/12/2020	(66)
USD	1,665,162	JPY	173,523,000	Deutsche Bank	14/12/2020	389
USD	1,748,636	NZD	2,585,000	JP Morgan	14/12/2020	(72,665)
USD	383,310	NZD	565,000	UBS	14/12/2020	(14,770)
USD	176,127	SGD	238,000	HSBC	14/12/2020	(1,823)
						<u>(19,347)</u>
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	37,431,279	USD	44,531,079	State Street Bank & Trust Company	15/12/2020	386,818
USD	1,199,085	EUR	1,011,840	State Street Bank & Trust Company	15/12/2020	(15,131)
						<u>371,687</u>
ヘッジを使用した英ポンド建投資証券クラス						
GBP	341,000	USD	449,192	State Street Bank & Trust Company	15/12/2020	6,904
USD	8,757	GBP	6,615	State Street Bank & Trust Company	15/12/2020	(91)
						<u>6,813</u>
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	793,661	USD	92,358	State Street Bank & Trust Company	15/12/2020	1,224
USD	30,447	SEK	259,998	State Street Bank & Trust Company	15/12/2020	(211)
						<u>1,013</u>
合計						<u>360,166</u>

業種別内訳 2020年11月30日現在

	純資産比率(%)
政府	90.67
投資有価証券 - 時価	90.67
その他の純資産	9.33
	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。

## 2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】(2021年7月末現在)

「ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド(為替ヘッジあり)」

資産総額	50,816,979円
負債総額	17,342円
純資産総額( - )	50,799,637円
発行済数量	55,258,627口
1単位当たり純資産額( / )	0.9193円

「ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド(為替ヘッジなし)」

資産総額	720,357,952円
負債総額	1,073,305円
純資産総額( - )	719,284,647円
発行済数量	745,728,420口
1単位当たり純資産額( / )	0.9645円

(参考情報)

「世界株式絶対収益追求マザーファンド」

資産総額	770,692,091円
負債総額	826,271円
純資産総額( - )	769,865,820円
発行済数量	659,101,832口
1単位当たり純資産額( / )	1.1681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

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た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したがって取り扱われます。

## 第二部【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、利益処分の承認、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ないます。

###### <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ないます。

###### 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ないます。

###### 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。

## 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2021年7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(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	173	10,450,376
単位型株式投資信託	46	400,147
合計	219	10,850,523

### 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34期事業年度(自2020年1月1日 至2020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33期 (2019年12月31日現在)	第34期 (2020年12月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	20,388	17,786
立替金	26	29
前払費用	175	190
未収入金	2 9	3
未収委託者報酬	1,696	1,756
未収運用受託報酬	2,268	2,166
未収収益	2 1,327	872
その他流動資産	0	0
流動資産計	25,892	22,805
固定資産		
有形固定資産		
建物附属設備	1 1,240	1,002
器具備品	1 475	480
有形固定資産計	1,716	1,482
無形固定資産		
ソフトウェア	5	6
無形固定資産計	5	6
投資その他の資産		
投資有価証券	49	142
長期差入保証金	1,120	1,122
前払年金費用	800	899
長期前払費用	45	34
繰延税金資産	824	888
投資その他の資産計	2,839	3,088
固定資産計	4,561	4,577
資産合計	30,454	27,383

	第33期 (2019年12月31日現在)	第34期 (2020年12月31日現在)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	94	121
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	487	444
その他未払金	908	1,508
未払費用	2	859
未払消費税等	117	210
未払法人税等	363	343
前受金	97	84
賞与引当金	2,017	1,987
役員賞与引当金	139	195
早期退職慰労引当金	10	-
流動負債計	4,967	5,835
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	67	69
資産除去債務	782	783
固定負債計	850	853
負債合計	5,818	6,688
<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	14,330	10,386
利益剰余金合計	14,666	10,723
株主資本合計	24,634	20,691
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	1	3
評価・換算差額等合計	1	3
純資産合計	24,636	20,694
負債・純資産合計	30,454	27,383

## (2)【損益計算書】

(単位：百万円)

		第33期 (自 2019年1月1日 至 2019年12月31日)	第34期 (自 2020年1月1日 至 2020年12月31日)
営業収益			
委託者報酬		5,643	5,605
運用受託報酬	1	7,545	7,342
その他営業収益	1	13,290	12,092
営業収益計		26,480	25,041
営業費用			
支払手数料		1,632	1,405
広告宣伝費		167	127
調査費			
調査費		381	352
委託調査費	1	3,587	3,346
調査費計		3,968	3,698
委託計算費		82	85
営業雑経費			
通信費		53	64
印刷費		82	82
諸会費		43	49
営業雑経費計		178	195
営業費用計		6,029	5,512
一般管理費			
給料			
役員報酬		482	601
給料・手当		4,441	4,691
賞与		2,343	2,384
給料計		7,268	7,678
退職給付費用		308	331
福利厚生費		977	1,028
事務委託費	1	2,339	2,701
交際費		57	16
寄付金		2	1
旅費交通費		233	60
租税公課		257	246
不動産賃借料		875	905
水道光熱費		76	60
固定資産減価償却費		404	428
資産除去債務利息費用		0	0
諸経費		312	390
一般管理費計		13,114	13,851
営業利益		7,335	5,677

	第33期 (自 2019年1月1日 至 2019年12月31日)	第34期 (自 2020年1月1日 至 2020年12月31日)
営業外収益		
その他	1	5
営業外収益計	1	5
営業外費用		
為替差損	32	20
固定資産除却損	3	0
その他	0	-
営業外費用計	36	20
経常利益	7,300	5,662
特別利益		
特別利益計	-	-
特別損失		
特別退職金	36	-
特別損失計	36	-
税引前当期純利益	7,263	5,662
法人税、住民税及び事業税	2,338	1,970
法人税等調整額	22	64
当期純利益	4,902	3,756

## (3)【株主資本等変動計算書】

第33期 (自 2019年1月1日 至 2019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				
2019年1月1日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	17,127	17,464	27,432	0	0	27,431
当期変動額											
剰余金の配当						7,700	7,700	7,700			7,700
当期純利益						4,902	4,902	4,902			4,902
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)									1	1	1
当期変動額合計	-	-	-	-	-	2,797	2,797	2,797	1	1	2,795
2019年12月31日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	14,330	14,666	24,634	1	1	24,636

第34期 (自 2020年1月1日 至 2020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				
2020年1月1日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	14,330	14,666	24,634	1	1	24,636
当期変動額											
剰余金の配当						7,700	7,700	7,700			7,700
当期純利益						3,756	3,756	3,756			3,756
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)									1	1	1
当期変動額合計	-	-	-	-	-	3,943	3,943	3,943	1	1	3,942
2020年12月31日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	10,386	10,723	20,691	3	3	20,694

## 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。

## 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。

## (3) 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」(令和2年法律第8号)において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」(実務対応報告第39号 2020年3月31日)第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日)第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

**(会計方針の変更)****(金銭債権と金銭債務の相殺表示に関わる会計方針の変更)**

当社は、当社グループ会社間の債権債務を含む金銭債権及び金銭債務を従来総額で表示しておりましたが、グループ会社間でのマスター・ネットリング契約締結を契機に見直しを行った結果、「金融商品会計に関する実務指針」(日本公認会計士協会 会計制度委員会報告第14号)第140項に基づき、金銭債権と金銭債務を相殺表示の方が当社の財政状態をより適切に表示できると判断し、当事業年度から相殺表示する方法へ変更しております。

前事業年度末の財務諸表等については、当該変更に伴う組替えを行っております。この結果、遡及修正を行う前と比べて、前事業年度末の未収入金、金銭債権である未収収益、その他未払金及び金銭債務である未払費用が、それぞれ20百万円、505百万円、77百万円及び449百万円減少しています。

**(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 2020年3月31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 2020年3月31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。

「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準30号 2019年7月4日)

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日)

「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 2019年7月4日)

「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 2020年3月31日)

## (1) 概要

国際的な会計基準の定めとの比較可能性を向上させるため、「時価の算定に関する会計基準」及び「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(以下「時価算定会計基準等」という。)が開発され、時価の算定方法に関するガイダンス等が定められました。時価算定会計基準等は次の項目の時価に適用されます。

- ・「金融商品に関する会計基準」における金融商品

また「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」が改訂され、金融商品の時価のレベルごとの内訳等の注記事項が定められました。

## (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。

## (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 (2019年12月31日)	当事業年度 (2020年12月31日)
建物附属設備	1,769 百万円	2,010 百万円
器具備品	1,104 百万円	1,290 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 (2019年12月31日)	当事業年度 (2020年12月31日)
未収入金	3 百万円	- 百万円
未収収益	579 百万円	185 百万円
その他未払金	894 百万円	1,496 百万円
未払費用	182 百万円	89 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 (2019年12月31日)	当事業年度 (2020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 2019年1月1日 至 2019年12月31日)	当事業年度 (自 2020年1月1日 至 2020年12月31日)
運用受託報酬	225 百万円	247 百万円
その他営業収益	5,554 百万円	5,052 百万円
委託調査費	698 百万円	763 百万円
事務委託費	954 百万円	851 百万円

**(株主資本等変動計算書関係)**

前事業年度 (自 2019年1月1日 至 2019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)	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

## (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2019年3月28日 株主総会決議	普通株式	7,700	513,333	2018年12月31日	2019年3月29日

当事業年度 (自 2020年1月1日 至 2020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

## (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2020年3月30日 株主総会決議	普通株式	7,700	513,333	2019年12月31日	2020年3月30日

## (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、未収運用受託報酬及び未収収益は、顧客及び関係会社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及び未払費用はその全てが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（2019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	20,388	20,388	-
(2) 未収委託者報酬	1,696	1,696	-
(3) 未収運用受託報酬	2,268	2,268	-
(4) 未収収益	1,327	1,327	-
(5) 長期差入保証金	1,120	1,116	4
資産計	26,801	26,797	4
(1) 未払手数料	487	487	-
(2) 未払費用	653	653	-
負債計	1,141	1,141	-

当事業年度(2020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	17,786	17,786	-
(2) 未収委託者報酬	1,756	1,756	-
(3) 未収運用受託報酬	2,166	2,166	-
(4) 未収収益	872	872	-
(5) 長期差入保証金	1,122	1,123	1
資産計	23,704	23,705	1
(1) 未払手数料	444	444	-
(2) 未払費用	859	859	-
負債計	1,304	1,304	-

(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、事務所の敷金を合理的に見積もった返済期日までの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(2019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	20,388	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	1,696	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	2,268	-	-	-
(4) 未収収益	1,327	-	-	-
(5) 長期差入保証金	-	1,051	57	11
合計	25,680	1,051	57	11

当事業年度(2020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	17,786	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	1,756	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	2,166	-	-	-
(4) 未収収益	872	-	-	-
合計	22,581	-	-	-

**(有価証券関係)**

前事業年度 (2019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	49	47	1
合計		49	47	1

当事業年度 (2020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	142	138	4
合計		142	138	4

**(退職給付関係)**

前事業年度 (自 2019年1月1日 至 2019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、2009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、2011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、2011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 2019年1月1日 至 2019年12月31日)
退職給付債務の期首残高	1,934
勤務費用	290
利息費用	11
数理計算上の差異の発生額	14
退職給付の支払額	204
過去勤務費用の発生額	-
退職給付債務の期末残高	2,047

## (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 2019年1月 1日 至 2019年12月31日)
年金資産の期首残高	2,696
期待運用収益	26
数理計算上の差異の発生額	132
事業主からの拠出額	328
退職給付の支払額	204
年金資産の期末残高	2,979

## (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 (2019年12月31日)
積立型制度の退職給付債務	1,979
年金資産	2,979
	999
非積立型制度の退職給付債務	67
未積立退職給付債務	931
未認識数理計算上の差異	157
未認識過去勤務費用	41
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	732
退職給付引当金	67
前払年金費用	800
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	732

## (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 2019年1月 1日 至 2019年12月31日)
勤務費用	290
利息費用	11
期待運用収益	26
数理計算上の差異の費用処理額	33
過去勤務費用の処理額	10
確定給付制度に係る退職給付費用合計	231
特別退職金	36
合計	267

## (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 (2019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76%、株式21%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 2019年1月 1日 至 2019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。

当事業年度（自 2020年1月1日 至 2020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、2009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、2011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、2011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 2020年1月 1日 至 2020年12月31日)
退職給付債務の期首残高	2,047
勤務費用	297
利息費用	11
数理計算上の差異の発生額	82
退職給付の支払額	123
過去勤務費用の発生額	-
退職給付債務の期末残高	2,149

## (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 2020年1月 1日 至 2020年12月31日)
年金資産の期首残高	2,979
期待運用収益	14
数理計算上の差異の発生額	92
事業主からの拠出額	350
退職給付の支払額	123
年金資産の期末残高	3,313

## (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 (2020年12月31日)
積立型制度の退職給付債務	2,080
年金資産	3,313
	1,233
非積立型制度の退職給付債務	69
未積立退職給付債務	1,163
未認識数理計算上の差異	296
未認識過去勤務費用	37
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	829
退職給付引当金	69
前払年金費用	899
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	829

## (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 2020年1月 1日 至 2020年12月31日)
勤務費用	297
利息費用	11
期待運用収益	14
数理計算上の差異の費用処理額	36
過去勤務費用の処理額	4
確定給付制度に係る退職給付費用合計	252
特別退職金	-
合計	252

## (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 (2020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74%、株式24%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 2020年1月 1日 至 2020年12月31日)
割引率	1.0%
長期期待運用収益率	0.5%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、78百万円 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 (2019年12月31日)	当事業年度 (2020年12月31日)
繰延税金資産		
未払費用	191	215
賞与引当金	617	608
資産除去債務	239	239
未払事業税	72	72
早期退職慰労引当金	3	-
退職給付引当金	20	21
有形固定資産	1	2
その他	45	94
繰延税金資産合計	1,191	1,256
繰延税金負債		
退職給付引当金	245	275
資産除去債務に対応する除去費用	121	90
その他	0	1
繰延税金負債合計	366	367
繰延税金資産の純額	824	888

（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 (2019年12月31日)	当事業年度 (2020年12月31日)
固定資産 - 繰延税金資産	824	888

## 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 (2019年12月31日)	当事業年度 (2020年12月31日)
法定実効税率	30.6%	30.6%
（調整）		
交際費等永久に損金に算入されない項目	1.9	2.9
その他	0.0	0.2
税効果会計適用後の法人税等の負担率	32.5%	33.7%

**（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

使用見込期間を合理的に見積り、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。

## 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 2019年1月 1日 至 2019年12月31日)	当事業年度 (自 2020年1月 1日 至 2020年12月31日)
期首残高	781	782
時の経過による調整額	0	0
期末残高	782	783

## (デリバティブ取引関係)

前事業年度 (2019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	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の 取引	為替予約取引 売建	79	-	0	0
	米ドル				
	買建	0	-	0	0
英ポンド					
合計		79	-	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 (2020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	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の 取引	為替予約取引 買建	99	-	0	0
	米ドル				
合計		99	-	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。

## (セグメント情報等)

前事業年度 (自 2019年1月1日 至 2019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	5,643	7,545	13,290	26,480

## (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
12,538	11,197	2,744	26,480

(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	5,779	投資運用業
ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	3,314	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 2020年1月1日 至 2020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	5,605	7,342	12,092	25,041

## (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
12,247	10,417	2,375	25,041

(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	5,299	投資運用業
ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	2,874	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 2019年1月1日 至 2019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	225	未収収益	579
							受入 手数料	5,554		
							委託 調査費	698	未払費用	182
							事務 委託費	954		
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	-	未収入金	3
									その他未払金	894

当事業年度（自 2020年1月1日 至 2020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	247	未収収益	185
							受入 手数料	5,052		
							委託 調査費	763	未払費用	89
							事務 委託費	851		
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	連結法人税 の個別帰属額	1,496	未収入金	-
									その他未払金	1,496

## (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 2019年1月1日 至 2019年12月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2020年1月1日 至 2020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 2019年1月1日 至 2019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	3,314	未収収益	351
							委託調査費	145	未払費用	-
							事務委託費	28		

当事業年度（自 2020年1月1日 至 2020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	2,874	未収収益	314
							委託調査費	220	未払費用	-
							事務委託費	16		

## (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 2019年1月 1日 至 2019年12月31日)	当事業年度 (自 2020年1月 1日 至 2020年12月31日)
1株当たり純資産額	1,642,418 円 94 銭	1,379,616 円 18 銭
1株当たり当期純利益金額	326,833 円 15 銭	250,430 円 96 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 2019年1月 1日 至 2019年12月31日)	当事業年度 (自 2020年1月 1日 至 2020年12月31日)
当期純利益 (百万円)	4,902	3,756
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)	4,902	3,756
普通株式の期中平均株式数 (株)	15,000	15,000

独立監査人の監査報告書は、当事業年度(自 2020年1月1日 至2020年12月31日)を対象としております。

**【中間財務諸表】**

## 1．中間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。）の中間財務諸表すなわち中間貸借対照表、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（1977年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定により「金融商品取引業等に関する内閣府令」（2007年内閣府令第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、中間会計期間（自2021年1月1日 至2021年6月30日）の中間財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる中間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) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

中間会計期間末  
(2021年6月30日)

資産の部	
流動資産	
現金・預金	2 12,619
立替金	30
前払費用	200
未収入金	7
未収委託者報酬	1,879
未収運用受託報酬	1,708
未収収益	1,166
為替予約	0
流動資産計	17,612
固定資産	
有形固定資産	
建物附属設備	1 885
器具備品	1 464
有形固定資産計	1,349
無形固定資産	
ソフトウェア	10
無形固定資産計	10
投資その他の資産	
投資有価証券	40
長期差入保証金	1,121
前払年金費用	927
長期前払費用	14
繰延税金資産	550
投資その他の資産計	2,654
固定資産計	4,013
資産合計	21,626

(単位：百万円)

中間会計期間末  
(2021年6月30日)

負債の部	
流動負債	
預り金	146
未払金	
未払収益分配金	4
未払償還金	74
未払手数料	446
その他未払金	670
未払費用	571
未払消費税等	241
未払法人税等	265
前受金	166
賞与引当金	1,025
役員賞与引当金	86
流動負債計	3,699
固定負債	
退職給付引当金	79
資産除去債務	783
固定負債計	863
負債合計	4,563
純資産の部	
株主資本	
資本金	3,120
資本剰余金	
資本準備金	3,001
その他資本剰余金	3,846
資本剰余金合計	6,847
利益剰余金	
利益準備金	336
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	6,755
利益剰余金合計	7,092
株主資本合計	17,059
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	3
評価・換算差額等合計	3
純資産合計	17,063
負債・純資産合計	21,626

## (2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

	中間会計期間 (自 2021年1月1日 至 2021年6月30日)
営業収益	
委託者報酬	3,152
運用受託報酬	4,542
その他営業収益	6,993
営業収益計	14,688
営業費用	
支払手数料	729
広告宣伝費	50
調査費	
調査費	140
委託調査費	2,647
調査費計	2,788
委託計算費	49
営業雑経費	
通信費	25
印刷費	48
諸会費	17
営業雑経費計	92
営業費用計	3,710
一般管理費	
給料	
役員報酬	400
給料・手当	2,443
賞与	1,484
給料計	4,329
退職給付費用	183
福利厚生費	534
事務委託費	1,588
交際費	4
旅費交通費	13
租税公課	123
不動産賃借料	451
水道光熱費	24
固定資産減価償却費	1
資産除去債務利息費用	0
諸経費	183
一般管理費計	7,647
営業利益	3,330

(単位：百万円)

	中間会計期間 (自 2021年1月1日 至 2021年6月30日)
営業外収益	
受取利息	0
有価証券売却益	4
為替差益	91
雑益	0
営業外収益計	96
営業外費用	
固定資産除却損	0
営業外費用計	0
経常利益	3,426
税引前中間純利益	3,426
法人税、住民税及び事業税	819
法人税等調整額	338
中間純利益	2,268

## (3) 中間株主資本等変動計算書

中間会計期間 (自 2021年1月1日 至 2021年6月30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	利益 剰余金 合計				
当期首残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	10,386	10,723	20,691	3	3	20,694
当中間期変動額											
剰余金の配当						5,900	5,900	5,900	0	0	5,900
中間純利益						2,268	2,268	2,268			2,268
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)									0	0	0
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	3,631	3,631	3,631	0	0	3,630
当中間期末残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	6,755	7,092	17,059	3	3	17,063

## 注 記 事 項

## (重要な会計方針)

項 目	中間会計期間 自 2021年1月 1日 至 2021年6月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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。</p>
2. デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	<p>時価法を採用しております。</p>
3. 固定資産の減価償却方法	<p>(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5～18年、器具備品3～15年であります。</p> <p>(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。</p>
4. 引当金の計上基準	<p>(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。</p> <p>(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、中間会計期間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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>

項 目	中間会計期間 自 2021年1月 1日 至 2021年6月30日
5. 外貨建の資産又は負債の本邦通貨への換算基準	<p>(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中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(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中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(5) 早期退職慰労引当金の計上方法 早期退職慰労金の支払に備えて、早期退職慰労金支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>外貨建金銭債権債務は、中間会計期間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。</p>
6. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 消費税等の会計処理 税抜方式によっております。</p> <p>(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。</p> <p>(3) 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用 当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」(令和2年法律第8号)において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」(実務対応報告第39号 2020年3月31日)第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日)第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。</p>

## (中間貸借対照表関係)

中間会計期間 2021年6月30日	
1 有形固定資産の減価償却累計額	
建物附属設備	2,125百万円
器具備品	1,377百万円
2 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。これら契約に基づき当中間会計期間末の借入未実行残高は次のとおりであります。	
当座貸越極度額	1,000百万円
借入実行残高	-
差引額	1,000百万円

## (中間損益計算書関係)

中間会計期間 自 2021年1月 1日 至 2021年6月30日	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	209百万円
無形固定資産	1百万円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

中間会計期間  
自 2021年1月 1日  
至 2021年6月30日

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	前事業年度末 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計 期間末株式数
発行済株式				
普通株式	15,000	-	-	15,000
合計	15,000	-	-	15,000

## 2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

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

## (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2021年3月30日 株主総会決議	普通株式	5,900	393,333	2020年12月31日	2021年3月30日

## (2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの

該当事項はありません。

## (リース取引関係)

中間会計期間	
自 2021年1月 1日	
至 2021年6月30日	
オペレーティング・リース取引	
オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料	
1年以内	835百万円
1年超	-
合計	835百万円
(注) 上記未経過リース料には、解約損害金を含めております。	

## (金融商品関係)

中間会計期間	
自 2021年1月 1日	
至 2021年6月30日	
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	
<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	
(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	
<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2021年6月30日(中間期の決算日)における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりです。

(単位:百万円)

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
現金・預金	12,619	12,619	-
未収委託者報酬	1,879	1,879	-
未収運用受託報酬	1,708	1,708	-
未収収益	1,166	1,166	-
投資有価証券			
その他有価証券	40	40	-
長期差入保証金	1,121	1,119	1
資産計	18,534	18,532	1
未払手数料	446	446	-
未払費用	571	571	-
負債計	1,018	1,018	-
デリバティブ取引			
ヘッジ会計が適用されていないもの	0	0	-
デリバティブ計	0	0	-

## (注)

## 金融商品の時価の算定方法に関する事項

現金・預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬及び未収収益

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。

投資有価証券

投資有価証券は、投資信託であり、決算日の基準価格によっております。

長期差入保証金

事務所敷金の時価については、事務所の敷金を合理的に見積もった返済期日までの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。

但し、上記レートがマイナスとなる場合は、割引率はゼロを使用しております。

未払手数料、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。

デリバティブ取引

デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、( )で示しております。

## (有価証券関係)

中間会計期間 自 2021年1月 1日 至 2021年6月30日				
その他有価証券				
(単位：百万円)				
	種類	中間貸借対照表 計上額	取得原価	差額
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	40	35	5
合計		40	35	5

## (資産除去債務関係)

中間会計期間 自 2021年1月 1日 至 2021年6月30日	
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	使用見込期間を合理的に見積り、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。
3. 当中間会計期間における当該資産除去債務の総額の増減	
期首残高	783 百万円
有形固定資産の取得に伴う増加額	0 百万円
時の経過による調整額	0 百万円
中間会計期間末残高	<u>783 百万円</u>

## (セグメント情報等)

中間会計期間  
自 2021年1月 1日  
至 2021年6月30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) 製品及びサービスに関する情報

(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	3,152	4,542	6,993	14,688

## (2) 地域に関する情報

売上高

(単位：百万円)

日本	北米	その他	合計
7,363	6,247	1,076	14,688

(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中間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) 主要な顧客に関する情報

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	3,011	投資運用業
ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	1,987	投資運用業

## (デリバティブ取引関係)

中間会計期間					
自 2021年1月 1日					
至 2021年6月30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	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建 米ドル	6	-	0	0
合計		6	-	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。

## (1株当たり情報)

中間会計期間	
自 2021年1月 1日	
至 2021年6月30日	
1株当たり純資産額	1,137,549円80銭
1株当たり中間純利益	151,242円29銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間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。	
1株当たり中間純利益の算定上の基礎	
損益計算書上の中間純利益	2,268百万円
1株当たり中間純利益の算定に用いられた普通株式に係る中間純利益	2,268百万円
期中平均株式数	15,000株

## (重要な後発事象)

該当事項はありません。

#### 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) 自己また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、また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、また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) 通常の見積り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。)または子法人等(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また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また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、また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	事業を営むことの目的を変更するため、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(2021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。

#### <参考:再信託受託会社の概要>

- ・名称 : 株式会社日本カストディ銀行
- ・資本金の額 : 51,000百万円(2021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(株式会社日本カストディ銀行)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) (2021年3月末現在)	事業の内容
みずほ証券株式会社	125,167	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【参考情報】

当計算期間において、ファンドに係る金融商品取引法第25条第1項各号に掲げる書類は、以下のとおり提出されております。

2021年4月9日

有価証券報告書

独立監査人の監査報告書

2021年2月26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  
東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山	田	信	之
--------------------	-------	---	---	---	---

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	中	島	紀	子
--------------------	-------	---	---	---	---

## 監査意見

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2020年1月1日から2020年12月31日までの第34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。

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2020年12月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全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。

## 監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

## 財務諸表に対する経営者及び監査役の責任

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

## 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

## 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

2021年9月8日

ブラックロック・ジャパン株式会社  
取締役会御中

P w C あらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 和田 渉

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 榊原 康太

## 監査意見

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世界株式絶対収益追求ファンド（為替ヘッジあり）の2021年1月16日から2021年7月15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。

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、ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド（為替ヘッジあり）の2021年7月15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、全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。

## 監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、ブラックロック・ジャパン株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

## 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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

## 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。

# 独立監査人の監査報告書

2021年9月8日

ブラックロック・ジャパン株式会社  
取締役会御中

P w C あらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 和田 渉

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

## 監査意見

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世界株式絶対収益追求ファンド（為替ヘッジなし）の2021年1月16日から2021年7月15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。

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、ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド（為替ヘッジなし）の2021年7月15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、全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。

## 監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、ブラックロック・ジャパン株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

## 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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

## 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。

独立監査人の中間監査報告書

2021年9月6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

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山田 信之
--------------------	-------	-------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	中島 紀子
--------------------	-------	-------

## 中間監査意見

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2021年1月1日から2021年12月31日までの第35期事業年度の中間会計期間（2021年1月1日から2021年6月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ブラックロック・ジャパン株式会社の2021年6月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2021年1月1日から2021年6月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

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中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の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。

## 中間財務諸表に対する経営者及び監査役の責任

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中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を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中間財務諸表を作成し有用な情報を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。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間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、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 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会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

## 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、中間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 データは中間監査の対象には含まれていません。