

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 2021年10月15日

【発行者名】 ブラックロック・ジャパン株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 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

【電話番号】 03-6703-7940

【届出の対象とした募集(売出)内国投資
信託受益証券に係るファンドの名称】 ブラックロック・スタイル・アドバンテージ・ポートフォリオ（円／年1回
決算コース）

【届出の対象とした募集(売出)内国投資
信託受益証券の金額】 5,000億円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

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

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

ブラックロック・スタイル・アドバンテージ・ポートフォリオ（円／年1回決算コース）

（以下「当ファンド」または「ファンド」という場合があります。）

ファンド名の「円」とは、日本円で投資可能であることを意味しており、為替ヘッジにかかる方針を示唆するものではありません。

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

当初元本は、1口当たり1円です。

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

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

(3)【発行（売出）価額の総額】

5,000億円を上限とします。

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

(4)【発行（売出）価格】

購入受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額につきましては、販売会社または下記にお問い合わせください。

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

ホームページアドレス：www.blackrock.com/jp/

(5)【申込手数料】

購入時の申込手数料（以下「購入時手数料」といいます。）は、購入受付日の翌営業日の基準価額に4.40%（税抜4.00%）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、「(8) 申込取扱場所」に記載の照会先までお問い合わせください。）

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

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。

(6)【申込単位】

分配金の受取方法により、収益の分配時に分配金を受け取る「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の申込単位（以下「購入単位」といいます。）は、各販売会社により異なりますので、詳細は販売会社にお問い合わせください。

(7)【申込期間】

2021年10月16日から2022年4月15日まで

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

(8)【申込取扱場所】

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

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

ホームページアドレス：www.blackrock.com/jp/

(9)【払込期日】

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

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

(10)【払込取扱場所】

上記「(8)申込取扱場所」で払い込みください。

(11)【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構です。

(12)【その他】

購入代金の利息

購入代金には利息をつけません。

日本以外の地域における発行

行ないません。

購入不可日

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

振替受益権について

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

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

(参考)

投資信託振替制度とは、

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

「ブラックロック・スタイル・アドバンテージ・ポートフォリオ(円/年1回決算コース)」(以下「当ファンド」または「ファンド」という場合があります。)は、信託財産の中長期的な成長を目標に運用を行いません。

当ファンドは、追加型証券投資信託であり、追加型投信/内外/資産複合/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	あり (限定ヘッジ) 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

< 各分類および区分の定義 >

・ 商品分類

単位型投信・追加型投信の区分	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
投資対象地域による区分	内外	目論見書又は投資信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に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	資産複合	目論見書又は投資信託約款において、株式、債券、不動産投信（リート）等の資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に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）	目論見書又は投資信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいう。
決算頻度による属性区分	年1回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
投資対象地域による属性区分	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	目論見書又は投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいう。
為替ヘッジによる属性区分	為替ヘッジあり（限定ヘッジ）	目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行なう旨の記載があるものをいう。なお、「為替ヘッジ」とは、対円での為替リスクに対するヘッジの有無をいう。
特殊型による属性区分	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（資産複合）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、5,000億円です。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

1

主として内外の株式、債券、通貨および派生商品等に投資し長期的に市場動向に左右されない絶対収益を追求する投資信託証券に投資します。

絶対収益追求とは

特定の市場(当ファンドにおいては内外の株式および債券に加え通貨市場を指します。)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。

- 当ファンドは、スタイル・アドバンテージ・マザー・ポートフォリオ(円)(以下「マザーファンド」といいます。)への投資を通じて、以下のファンドに実質的に投資を行ないます。投資対象ファンドの運用は、ブラックロック・グループの運用会社が行ないます。

＜主要投資対象ファンド＞…絶対収益を追求するファンド

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・スタイル・アドバンテージ・ファンドクラス投資証券

＜副次的投資対象ファンド＞…短期債券等に投資するファンド

インスティテューショナル・キャッシュ・シリーズplc ブラックロック・ICS・USTレジャーリー・ファンド エージェンシークラス投資証券

※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。

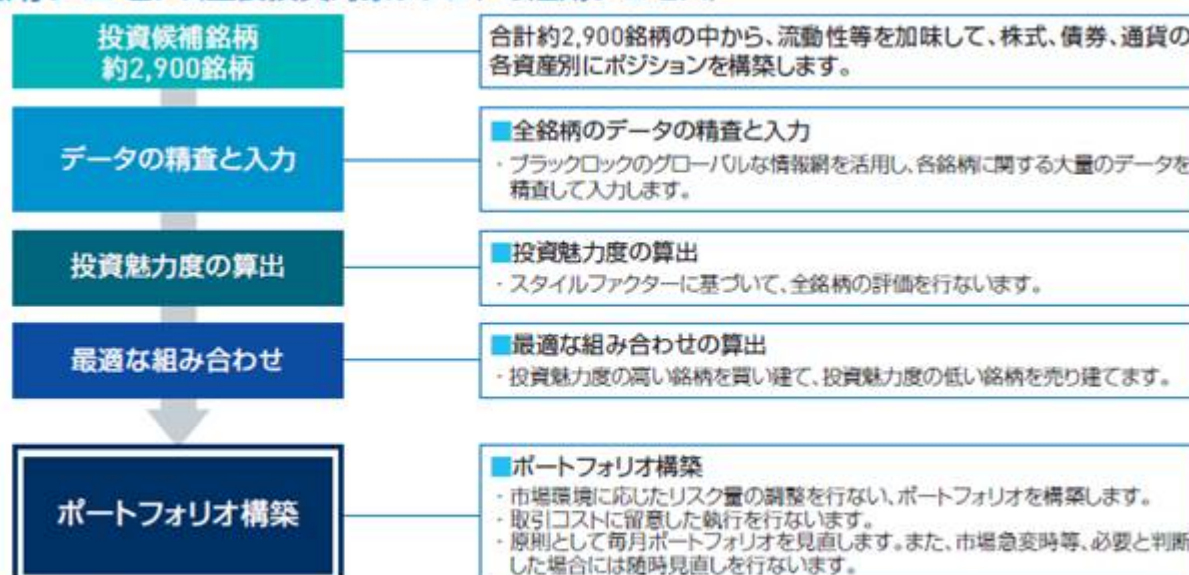
- 主要投資対象ファンドへの投資割合を高位に保ちます。
※投資対象ファンドへの投資割合は、原則として市場動向および投資対象ファンドの収益性等を勘案して委託会社が決定します。
- 主要投資対象ファンドは、世界の株式、債券、通貨等の複数の資産に投資し、市場の変動に関わらない中長期的なリターンを獲得を目指します。
 - ◆主要投資対象ファンドでは、スタイルファクター*戦略を用い、様々な尺度から各銘柄の投資魅力度を測り、銘柄選定を行ないます。運用にあたっては、ブラックロック独自の運用テクノロジーを活用します。
*このファンドでいう「スタイルファクター」とは、ブラックロックの検証により、法則性があり有効であると考えられる投資家の行動特性のことで、各資産および各銘柄の値動きに好影響を与えると考えられる要素をいいます。
 - ◆運用にあたっては、ロングショート戦略*によりポートフォリオの構築をします。
ロングショート戦略においては、値動きに好影響を与える要素をより多く含む銘柄(資産)を買い建て、その逆の銘柄(資産)を売り建てます。
*後述の「ロングショート戦略について」をあわせてご参照ください。

2

米ドルに対する為替ヘッジを行ない、為替リスクの低減を図ります。

- 主要投資対象ファンドにおいては、当該ファンドで保有する資産を米ドル換算し、米ドル換算した額に対して米ドル売り・円買いの為替取引(ヘッジ取引)を行なうことによって、為替変動リスクの低減を図ります(また、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。)。主要投資対象ファンドが運用戦略上保有する米ドル建て以外の資産、および収益追求のために取得した通貨市場における米ドル以外のエクスポージャーについては、米ドルでの為替ヘッジを行っておりません。したがって、米ドル以外の通貨の為替変動の影響を受けます。
- 米ドル建ての副次的投資対象ファンドに対しては、マザーファンドにおいて為替ヘッジを行ないません。

運用プロセス(主要投資対象ファンドの運用プロセス)



※ 上記の投資候補銘柄数は、今後変更になる可能性があります。
 ※ 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。
 ※ 主要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。

(追加的記載事項)

主要投資対象ファンドの概要

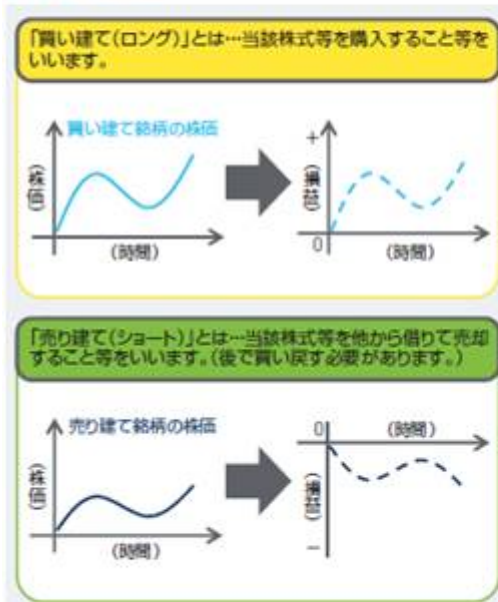
ファンド名	ブラックロック・ストラテジック・ファンズ ブラックロック・スタイル・アドバンテージ・ファンド クラスI投資証券(円建て円ヘッジ)
形態	ルクセンブルグ籍(オープン・エンド型)会社型外国投資証券(円建て円ヘッジ)
投資目的および投資態度	当ファンドは、長期的に市場動向に左右されない絶対収益の追求を目指して運用を行ないます。 当ファンドは機動的にエクスポージャーを調整することで様々なスタイルファクター戦略からプレミアムを獲得することを目指します。 独自の計量化モデルを用いて銘柄の選定を行ない投資目的の達成を目指します。また、バリュー、モメンタム、キャリー、ディフェンシブといったスタイルファクターを活用し、幅広い投資資産に横断的に投資を行ないます。
管理会社	ブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エー
投資顧問会社	ブラックロック・インベストメント・マネジメント・エル・エル・シー

ロングショート戦略とは

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

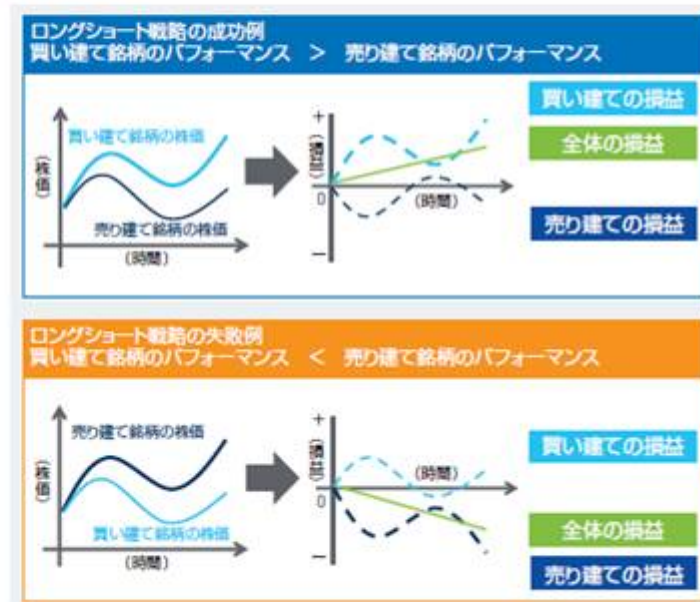
「買い建て」と「売り建て」について

[イメージ図]



ロングショート戦略による損益

[イメージ図]



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

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

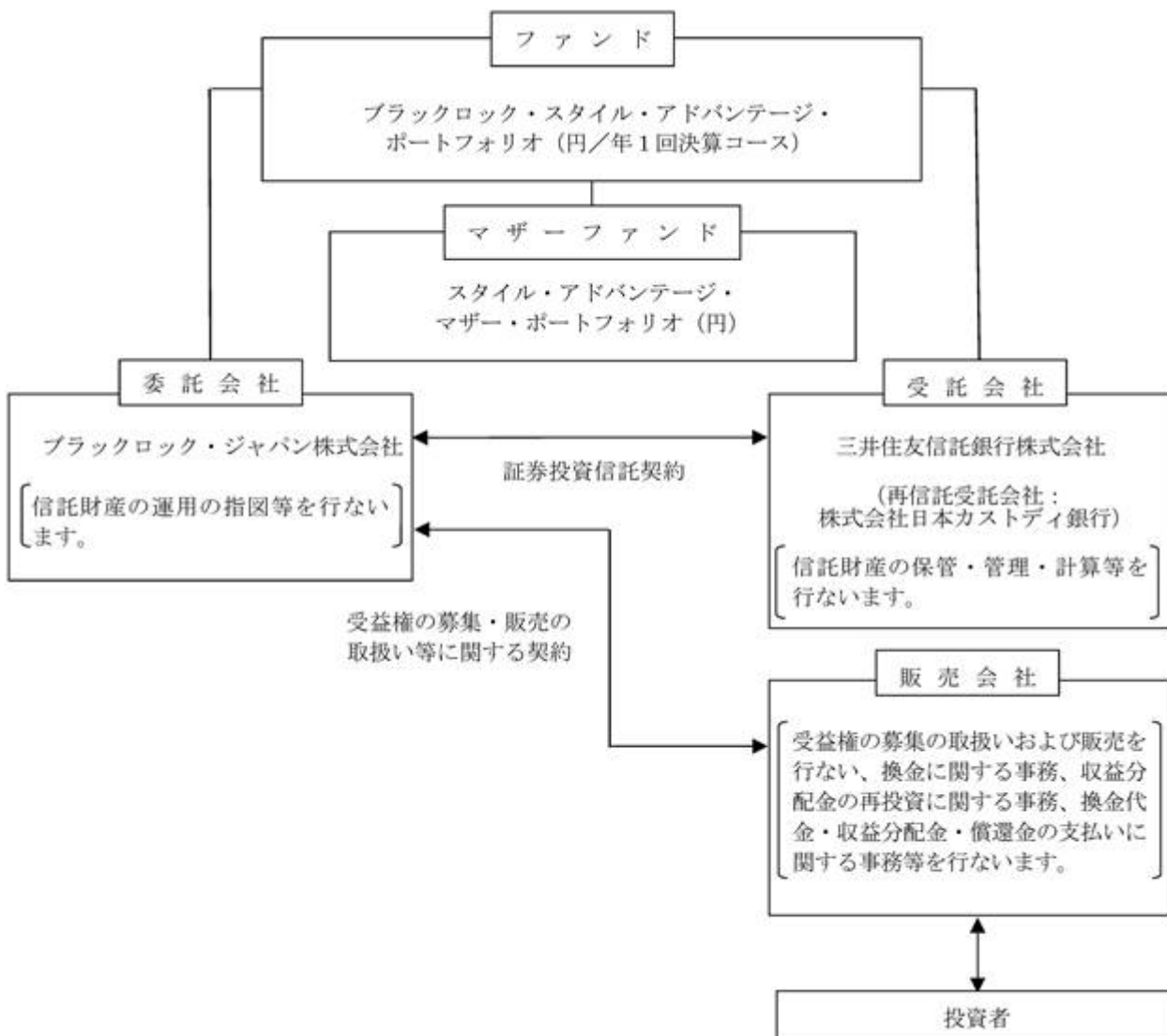
※ロングとショートの双方で損失した場合は、通常想定される以上に当ファンドの運用成果が影響を被る可能性があります。

(2) 【ファンドの沿革】

2017年8月4日

信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



< 契約等の概要 >

a. 「証券投資信託契約」

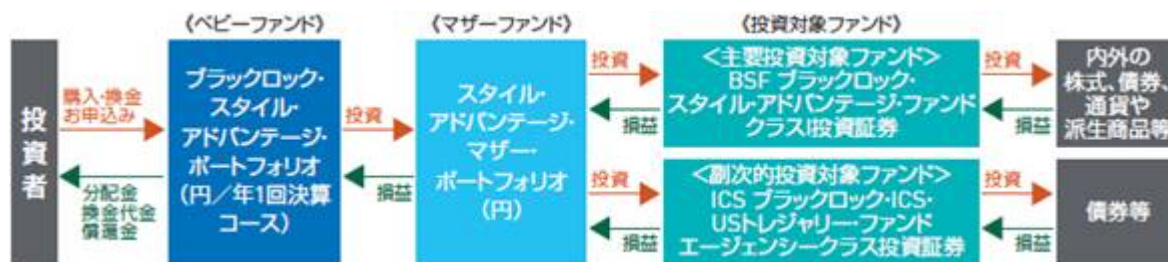
ファンドの設定・運営に関する事項、信託財産の運用・管理に関する事項、委託会社および受託会社の業務に関する事項、投資者に関する事項等について規定しています。

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。

<ファンドの仕組み>

当ファンドは、スタイル・アドバンテージ・マザー・ポートフォリオ（円）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。また、マザーファンドは、投資信託証券を投資対象とするファンド・オブ・ファンズ形式で運用します。



<委託会社の概況>

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

c . 大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

マザーファンドの受益証券を通じて、主として内外の株式、債券、通貨および派生商品等に投資し長期的に市場動向に左右されない絶対収益を追求する投資信託証券（以下「主要投資対象ファンド」といいます。）に投資します。マザーファンドにおいては副次的な投資対象として、短期債券等に投資する投資信託証券にも投資を行いません。

マザーファンドの投資対象ファンドは、ブラックロック・グループの運用会社が運用する投資信託証券とします。投資対象ファンドは、委託会社の判断により、変更することがあります。

マザーファンドの主要投資対象ファンドにおいて、原則として米ドル・日本円について為替ヘッジが行なわれ、米ドル・日本円間での為替リスクの低減が図られます。また、マザーファンドの副次的な投資対象ファンドに対してはマザーファンドにおいて為替ヘッジを行ない、為替リスクの低減を図ります。

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

投資対象ファンドの設定にあたっては、上記の投資方針の他、当ファンドの運営上の効率性等を勘案します。

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。

<参考> マザーファンドの運用の基本方針

スタイル・アドバンテージ・マザー・ポートフォリオ（円）

- 運用の基本方針 -

1. 基本方針

この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を目標に運用を行いません。

2. 運用方法

(1) 投資対象

主として内外の株式、債券、通貨および派生商品等に投資し長期的に市場動向に左右されない絶対収益を追求する投資信託証券を主要投資対象とします。副次的な投資対象として、短期債券等に投資する投資信託証券にも投資を行いません。

(2) 投資態度

主として内外の株式、債券、通貨および派生商品等に投資し長期的に市場動向に左右されない絶対収益を追求する投資信託証券（以下「主要投資対象ファンド」といいます。）に投資します。副次的な投資対象として、短期債券等に投資する投資信託証券にも投資を行いません。

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投資信託証券とします。投資対象ファンドは、委託会社の判断により、変更することがあります。

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

主要投資対象ファンドにおいて、原則として米ドル・日本円について為替ヘッジが行なわれ、米ドル・日本円間での為替リスクの低減が図られます。また、副次的な投資対象ファンドに対しては為替ヘッジを行ない、為替リスクの低減を図ります。

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

(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、主としてスタイル・アドバンテージ・マザー・ポートフォリオ（円）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項に規定する特定短期社債、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

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. 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・スタイル・アドバンテージ・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（円建て円ヘッジ）
投資目的および投資態度	当ファンドは、長期的に市場動向に左右されない絶対収益の追求を目指して運用を行いません。 当ファンドは機動的にエクスポージャーを調整することで様々なスタイルファクター戦略からプレミアムを獲得することを目指します。 独自の定量化モデルを用いて銘柄の選定を行ない投資目的の達成を目指します。またバリュウ、モメンタム、キャリー、ディフェンシブといったファクターを活用し、幅広い投資資産に横断的に投資を行いません。
設定日	2016年9月14日
存続期間	無期限
主な投資対象	世界の株式、株式関連証券、債券、債券関連証券、通貨、デリバティブ、ファンド、短期金融商品等の多様な資産に投資を行いません。商品市場へのエクスポージャーを獲得する為にファンド、パフォーマンス・リンク債、上場投資信託、商品指数を原資産とするデリバティブ等を活用する場合があります。
主な投資制限	・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。 ・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。
管理報酬	年0.55%
その他費用	管理業務会社、保管会社および名義書換事務代行会社への報酬等および事務諸費に要する費用についてはファンドから差し引かれます。
決算日	年1回（原則として5月末日）に決算を行いません。
収益分配方針	原則として、分配を行いません。
申込手数料	ありません。
管理会社	ブラックロック（ルクセンブルグ）エス・エー
投資顧問会社	ブラックロック・インベストメント・マネジメント・エル・エル・シー
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

b. ICS ブラックロック・ICS・USTレジャリー・ファンド

形態	アイルランド籍（オープン・エンド型）会社型外国投資証券（米ドル建て）
投資目的および投資態度	ファンドは、流動性と元本の安定性を確保しつつ、安定的なインカム水準を追求します。 ファンドは、米国短中期国債、米国政府によって発行されるその他債務権および現先取引に投資をします。現先取引の活用により流動性を確保します。
設定日	2008年9月29日
存続期間	無期限
主な投資対象	主としてファンドは、米国短中期国債、米国政府によって発行されるその他債務権および現先取引を主要投資対象とします。
主な投資制限	・同一発行体の譲渡性のある証券もしくは短期金融商品への投資は原則としてファンドの純資産総額の10%以下とします。
管理報酬 その他費用	管理報酬、保管報酬および事務の処理に要する諸費用がファンドから差し引かれます。
決算日	年1回（原則として9月30日）に決算を行いません。
収益分配方針	原則として、分配を行いません。
申込手数料	ありません。
管理会社	ブラックロック・アセット・マネジメント・アイルランド・リミテッド
投資顧問会社	ブラックロック・キャピタル・マネジメント・インク
保管会社	J P モルガン・バンク（アイルランド）ピー・エル・シー

(3)【運用体制】

ファンドの運用・管理の各業務の役割分担を社内規程により定めております。

ファンドの運用については委託会社の運用部門が統括しています。

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

当ファンドの運用は、マルチアセット戦略部と協働してマルチアセット運用部（当ファンド担当：5名）が担当いたします。

投資対象ファンドの選定に当たっては、ベンチマークの構成指数に対応する資産を投資対象とする投資信託証券の中から、定性評価と定量評価の両面から検討のうえ決定します。

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^{*}（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1回の毎決算時（原則として1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（「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「消費税等相当額」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いません。当該売り付けにより増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

b. 時効

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

(5)【投資制限】

以下は当ファンドの約款で定める投資制限です。

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

投資信託証券への投資制限

投資信託証券への実質投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資制限

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

公社債の借入れ

a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行なうにあたり担保の提供が必要と認められた時は、担保の提供の指図を行なうものとします。

b. a. の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

c. 信託財産の換金等の事由により、b. の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

d．a．の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

外国為替予約の指図および範囲

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

資金の借入れ

a．委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、換金に伴う支払資金の手当て（換金に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。

b．換金に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、投資者への換金代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または投資者への換金代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の換金代金入金日までの間もしくは投資者への換金代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却または換金代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

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

d．借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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ないます。

3【投資リスク】

(1) 投資リスク

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

当ファンドにかかる主なリスクは以下の通りです。

基準価額の変動要因

a．ロングショート戦略によるリスク

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

b．株価変動リスク

世界各国の株式および株式関連の派生商品に投資を行ないます。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．債券投資のリスク

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

d．デリバティブ取引のリスク

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

（レバレッジ・リスク）

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

（デリバティブ取引の取引先に関するリスク）

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

e．為替変動リスク

主要投資対象ファンドにおいては、当該ファンドで保有する資産を米ドル換算し、米ドル換算した額に対して米ドル売り・円買いの為替取引（ヘッジ取引）を行なうことによって、為替変動リスクの低減を図りますが、米ドルの対円での為替変動を完全にヘッジすることはできません。また、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。

また、主要投資対象ファンドが運用戦略上で保有する米ドル建て以外の資産、および収益追求のために取得した通貨市場における米ドル以外のエクスポージャーについては、米ドルに対する為替ヘッジを行っておりません。したがって、米ドル以外の通貨の為替レートの変動が、間接的に当ファンドの運用成果に影響を与えます。

f．カントリーリスク

世界各国の有価証券等に投資します。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、有価証券の価格が変動することがあり、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を取り消す場合があります。

b．ファンドの繰上償還

当ファンドは換金により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、または投資者のため有利と認められる場合、その他やむを得ない事情が発生したとき等は、ファンドを償還させる場合があります。

c．法令・税制・会計等の変更

法令・税制・会計方法等は今後変更される可能性があります。

d．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
- ・金利の急激な変動または信用リスク不安が高まる等の影響により、債券価格の変動が大きくなるまたは取引量が著しく少なくなる等、債券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

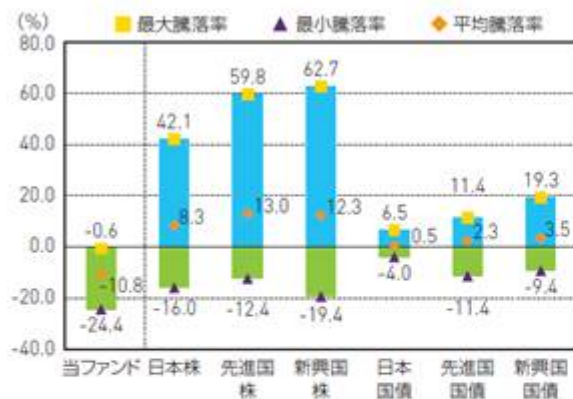
委託会社ではリスク管理を重視しており、独自開発のシステムを用いてリスク管理を行っております。具体的には、運用担当部門から独立したリスク管理担当部門においてファンドの投資リスクおよび流動性リスクの計測・分析、投資・流動性制限のモニタリングなどを行なうことにより、ファンドの投資リスク（流動性リスクを含む）が運用方針に合致していることを確認し、その結果を運用担当部門にフィードバックするほか、社内の関係者で共有しております。また、委託会社の業務に関するリスクについて社内規程を定めて管理を行っております。

リスクの管理体制は、変更となる場合があります。

(参考情報)

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2016年8月～2021年7月)



当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

(2016年8月～2021年7月)



※上記グラフは、過去5年間における年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)の平均・最大・最小を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドについては、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算しており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※上記グラフは、各月末における分配金再投資基準価額の1年間の騰落率および分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算しており、実際の基準価額とは異なる場合があります。

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

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

※各資産クラスの指数

日本株…東証株価指数(配当込み)

先進国株…MSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)

新興国株…MSCIエマージングマーケット・インデックス(配当込み、円ベース)

日本国債…NOMURA-BPI国債

先進国国債…FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

新興国国債…J.P.モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(円ベース)

(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしております。

<各指数について>

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

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

NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が公表している指数で、日本国債の市場全体の動向を表す投資収益指数です。同指数に関する知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI国債を用いて行なわれるブラックロック・ジャパン株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

購入時の申込手数料（以下「購入時手数料」といいます。）は、購入受付日の翌営業日の基準価額に4.40%（税抜4.00%）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/

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。

「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。

(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1.2859%（税抜1.219%）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0.7359%（税抜0.669%）の率を乗じて得た金額とします。信託報酬に係る委託会社、販売会社、受託会社間の配分および当該報酬を対価とする役務の内容は次の通りとします。

	信託報酬の配分	役務の内容
委託会社	年0.0550% (税抜0.050%)	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0.600%)	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0.0209% (税抜0.019%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行等

b．主要投資対象ファンドにかかる運用管理費用

年0.55%が投資対象ファンドから支払われます。

信託報酬の支払時期と支払方法等

信託報酬は日々計上され、ファンドの基準価額に反映されます。なお、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（当該終了日が休業日の場合はその翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支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。）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、ファンドの基準価額に反映されます。なお、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（当該終了日が休業日の場合はその翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支払われるものとします。

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

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

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

換金時および償還時の課税について

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

収益分配金の課税について

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

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

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

個人、法人の課税の取扱いについて

- a．個人の投資者に対する課税
- (a) 収益分配金の課税について
- 支払いを受ける収益分配金のうち、課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含む）、地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれます。原則として、申告は不要です。
- また、確定申告を行なうことにより総合課税（配当控除なし）と申告分離課税（20.315%（所得税15.315%、地方税5%））のいずれかを選択することができます。
- (b) 換金時および償還時の差益の課税について
- 換金時および償還時の差益（換金価額および償還価額から購入費用（購入時手数料および当該購入時手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%（復興特別所得税を含む）、地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。原則として確定申告が必要ですが、特定口座（源泉徴収口座）の利用が可能な場合があります。

換金時および償還時に損失（譲渡損）が生じた場合には、確定申告することで、他の株式等の譲渡益、上場株式等の配当所得および特定公社債等の利子所得の金額（申告分離課税を選択したものに限りません。）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%(復興特別所得税を含む)、地方税の源泉徴収はありません。)の税率による源泉徴収が行なわれます。なお、当ファンドについては、法人税の課税対象となりますが、益金不算入制度の適用はありません。

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・スタイル・アドバンテージ・ポートフォリオ（円／年1回決算コース）」

(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	5,492,237,506	100.03
内 日本	5,492,237,506	100.03
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,908,971	0.03
純資産総額	5,490,328,535	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	スタイル・アドバンテージ・マザー・ポートフォリオ(円)	日本	親投資信託受益証券	7,596,455,749	0.6855	5,207,593,582	0.7230	5,492,237,506	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(2018年1月15日)	26,606,655,103	(同左)	0.9910	(同左)
第2期(2019年1月15日)	21,207,097,954	(同左)	0.8968	(同左)
第3期(2020年1月15日)	12,865,922,909	(同左)	0.8658	(同左)
第4期(2021年1月15日)	5,467,430,556	(同左)	0.6644	(同左)
2020年7月末現在	7,418,249,158		0.7053	
2020年8月末現在	7,130,506,134		0.7028	
2020年9月末現在	6,441,367,332		0.6914	
2020年10月末現在	6,254,960,526		0.6928	
2020年11月末現在	5,887,694,864		0.6642	
2020年12月末現在	5,440,244,190		0.6585	
2021年1月末現在	5,494,275,817		0.6692	
2021年2月末現在	5,199,704,277		0.6637	
2021年3月末現在	5,371,117,871		0.6883	
2021年4月末現在	5,238,550,569		0.6803	
2021年5月末現在	5,382,996,024		0.6992	
2021年6月末現在	5,539,905,004		0.6961	
2021年7月末現在	5,490,328,535		0.7003	

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1期	
第2期	
第3期	
第4期	
2021年1月16日～2021年7月15日	

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1期	0.9
第2期	9.5
第3期	3.5
第4期	23.3
2021年1月16日～2021年7月15日	5.2

(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	26,923,816,773	76,558,715	26,847,258,058
第2期	5,356,776,069	8,556,726,598	23,647,307,529
第3期	546,810,054	9,333,232,291	14,860,885,292
第4期	186,127	6,631,910,102	8,229,161,317
2021年1月16日～ 2021年7月15日	618,193,379	961,371,891	7,885,982,805

(参考情報)

「スタイル・アドバンテージ・マザー・ポートフォリオ(円)」

(1) 投資状況

資産の種類	金額(円)	投資比率(%)
投資証券	5,432,374,181	98.91
内 ルクセンブルグ	5,376,353,415	97.89
内 アイルランド	56,020,766	1.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	60,136,159	1.09
純資産総額	5,492,510,340	100.00

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

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

順位	銘柄	国/地域	種類	投資口数	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	ブラックロック・ストラテジック・ファンズ ブラックロック・スタイル・アドバンテージ・ファンド クラスI投資証券	ルクセンブルグ	投資証券	674,580	7,528.28	5,078,433,659	7,969.91	5,376,353,415	97.89
2	インスティテューショナル・キャッシュ・シリーズplc ブラックロック・ICS・USトレジャリー・ファンド エージェンシークラス投資証券	アイルランド	投資証券	4,822	11,616.01	56,013,112	11,617.60	56,020,766	1.02

(注) 投資比率は、純資産総額に対する評価金額の比率です。

種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.91

(注)投資比率は、純資産総額に対する評価金額の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

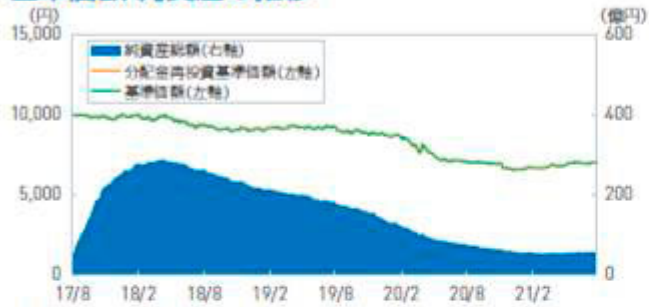
該当事項はありません。

(参考情報)

運用実績

2021年7月末現在

基準価額・純資産の推移



※ 基準価額および分配金再投資基準価額は価額報酬控除後の値です。信託報酬等については、後述の「ファンドの費用」をご覧ください。

※ 分配金再投資基準価額は、税引前分配金を再投資したものとして算出しています。

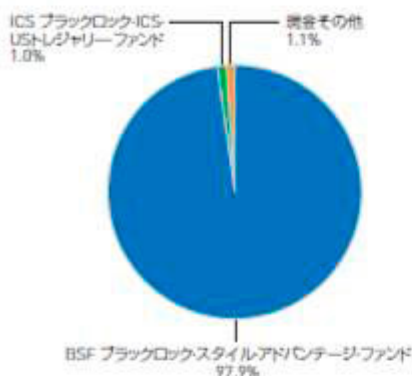
分配の推移

設定来累計		0円
第1期	2018年1月	0円
第2期	2019年1月	0円
第3期	2020年1月	0円
第4期	2021年1月	0円

※ 分配金は税引前、1万口当たり

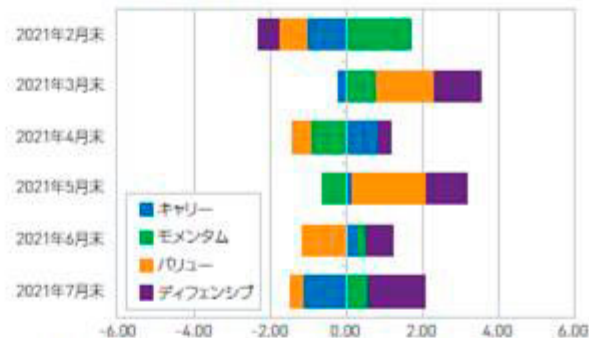
主要な資産の状況

資産構成比率



※ 比率はマザーファンドの純資産総額に対する割合です。四捨五入の関係で合計が100にならない場合があります。

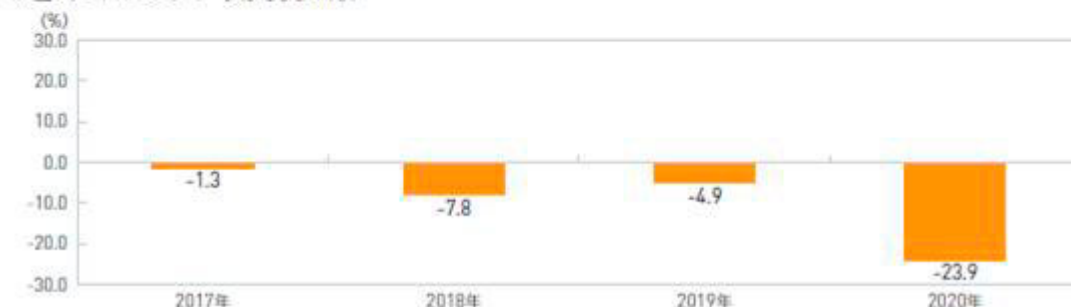
スタイル別寄与度の推移 (%)



※ 実質的な主要投資対象ファンドの運用状況です。比率は実質的な主要投資対象ファンドの米ドル建てのリターンを要因別に分解した数値です。品質料、為替ヘッジコストおよび運用報酬等は、比率には含まれておりません。比率は概算値であり、実際の要因を正確に示すものではありません。

年間収益率の推移

- ※ 2017年は設定日(8月4日)から年末までの収益率を表示しています。
- ※ ファンドの年間収益率は、決算時の分配金を非課税で再投資したものと算出しています。
- ※ 当ファンドにベンチマークはありません。



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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

(1) 申込方法

受益権の投資者は、販売会社と有価証券の取引に関する契約を締結します。このため、販売会社は有価証券の取引にかかわる約款を投資者に交付し、投資者は当該約款に基づく取引口座の設定を申込み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、詳細は販売会社までお問い合わせください。

投資者は販売会社に、購入と同時にまたは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。ただし、受付時間は販売会社によって異なることがあります。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/

(4) 購入不可日

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

(5) 購入単位

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。

(6) 購入価額

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

(7) 購入時手数料

購入受付日の翌営業日の基準価額に4.40%（税抜4.00%）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。

「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。

(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（購入受付日の翌営業日の基準価額に購入口数を乗じた金額に、購入時手数料を加算した金額をいいます。）を販売会社に支払うものとします。

(9) 購入の受付の中止、既に受付けた購入の受付の取消

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

2【換金（解約）手続等】

(1) 換金の申込と受付

投資者は、自己に帰属する受益権について、委託会社に換金を申込することができます。投資者が換金の申込をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。換金の申込の受付は、午後3時までとなっております。ただし、受付時間は販売会社によって異なることがあります。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お取扱いとします。

(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

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

(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を設ける場合があります。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6営業日目から販売会社においてお支払いします。

(7) 換金の申込の受付中止および取消

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従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「スタイル円1」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/

(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、2017年8月4日から2027年8月4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】

計算期間は1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。

(5)【その他】

ファンドの償還条件等

a．委託会社は、信託期間中において、このファンドを償還することが投資者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、このファンドを償還させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、償還しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

b．委託会社は換金により、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、このファンドを償還させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、償還しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- c . a . および b . の場合において、委託会社は、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行いません。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびにファンドの償還の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約に係る知っている投資者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- d . c . の書面決議において、投資者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る投資者としての受託会社を除きます。以下 d . において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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、監督官庁よりこの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、委託会社はこのファンドを償還させます。

信託約款の変更

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

- 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、この信託のすべての投資者に対してその効力を生じます。
- f . b . ~ e . までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての投資者が書面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、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっては、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からあらかじめお申し出いただいた方法に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/

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6営業日目から投資者に支払います。

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

(4) 反対受益者の買取請求の不適用

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

(5) 帳簿書類の閲覧または謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間(2020年1月16日から2021年1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「スタイル・アドバンス・マザー・ポートフォリオ(円)」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。

(4) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57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)に基づき作成しております。

なお、中間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。

(5) 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、当中間計算期間(2021年1月16日から2021年7月15日まで)の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による中間監査を受けております。

(6) 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「スタイル・アドバンス・マザー・ポートフォリオ(円)」の貸借対照表、注記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・スタイル・アドバンテージ・ポートフォリオ(円/年1回決算コース)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第3期 (2020年1月15日現在)	第4期 (2021年1月15日現在)
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	12,926,803,000	5,494,180,747
未収入金	63,292,125	10,434,571
流動資産合計	12,990,095,125	5,504,615,318
資産合計	12,990,095,125	5,504,615,318
負債の部		
流動負債		
未払解約金	63,292,125	10,434,571
未払受託者報酬	1,642,098	672,786
未払委託者報酬	56,178,434	23,018,308
その他未払費用	3,059,559	3,059,097
流動負債合計	124,172,216	37,184,762
負債合計	124,172,216	37,184,762
純資産の部		
元本等		
元本	14,860,885,292	8,229,161,317
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,994,962,383	2,761,730,761
(分配準備積立金)	-	-
元本等合計	12,865,922,909	5,467,430,556
純資産合計	12,865,922,909	5,467,430,556
負債純資産合計	12,990,095,125	5,504,615,318

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第3期 (自 2019年1月16日 至 2020年1月15日)	第4期 (自 2020年1月16日 至 2021年1月15日)
営業収益		
有価証券売買等損益	295,824,339	2,320,519,005
営業収益合計	295,824,339	2,320,519,005
営業費用		
受託者報酬	3,680,078	1,684,254
委託者報酬	125,900,178	57,622,381
その他費用	6,507,591	5,915,929
営業費用合計	136,087,847	65,222,564
営業利益又は営業損失()	431,912,186	2,385,741,569
経常利益又は経常損失()	431,912,186	2,385,741,569
当期純利益又は当期純損失()	431,912,186	2,385,741,569
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()	34,738,218	728,741,422
期首剰余金又は期首欠損金()	2,440,209,575	1,994,962,383
剰余金増加額又は欠損金減少額	960,351,564	890,287,199
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	960,351,564	890,287,199
剰余金減少額又は欠損金増加額	48,453,968	55,430
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	48,453,968	55,430
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金()	1,994,962,383	2,761,730,761

(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。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第3期 (2020年1月15日現在)	第4期 (2021年1月15日現在)
1 当該計算期間の末日における受益権総数	14,860,885,292口	8,229,161,317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 1,994,962,383円	元本の欠損 2,761,730,761円
3 1口当たり純資産額	0.8658円	0.6644円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第3期 (自 2019年1月16日 至 2020年1月15日)	第4期 (自 2020年1月16日 至 2021年1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)(0円)、分配準備積立金(0円)により、分配対象収益は0円となり、当期は分配ができませんでした。	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)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(0円)、分配準備積立金(0円)により、分配対象収益は0円となり、当期は分配ができませんでした。

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

1 金融商品に対する取組方針

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

2 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク

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

当ファンドの主な投資リスクとして、「ロングショート戦略によるリスク」、「株価変動リスク」、「債券投資のリスク」、「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3期 (2020年1月15日現在)	第4期 (2021年1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3期 (2020年1月15日現在)	第4期 (2021年1月15日現在)
期首元本額	23,647,307,529円	14,860,885,292円
期中追加設定元本額	546,810,054円	186,127円
期中一部解約元本額	9,333,232,291円	6,631,910,102円

2 有価証券関係

第3期(2020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	366,796,480
合計	366,796,480

第4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	1,603,433,514
合計	1,603,433,514

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	スタイル・アドバンテージ・マザー・ ポートフォリオ(円)	8,045,366,448	5,494,180,747	
親投資信託受益証券	合計	8,045,366,448	5,494,180,747	
合計		8,045,366,448	5,494,180,747	

(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、「スタイル・アドバンテージ・マザー・ポートフォリオ（円）」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1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。

「スタイル・アドバンテージ・マザー・ポートフォリオ（円）」の状況

(1) 貸借対照表

項目	(2021年1月15日現在)
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	88,548,363
投資証券	5,416,125,282
派生商品評価勘定	226,744
流動資産合計	5,504,900,389
資産合計	5,504,900,389
負債の部	
流動負債	
未払解約金	10,434,571
流動負債合計	10,434,571
負債合計	10,434,571
純資産の部	
元本等	
元本	8,045,366,448
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,550,900,630
元本等合計	5,494,465,818
純資産合計	5,494,465,818
負債純資産合計	5,504,900,389

(注)親投資信託の計算期間は、原則として、毎年1月16日から翌年1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事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

2 デリバティブの評価基準及び評価方法

為替予約取引

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

3 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準

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

4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

外貨建資産等の会計処理

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2021年1月15日現在)
1 当該計算日における受益権総数	8,045,366,448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 2,550,900,630円
3 1口当たり純資産額	0.6829円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

1 金融商品に対する取組方針

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

2 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク

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

当ファンドの主な投資リスクとして、「ロングショート戦略によるリスク」、「株価変動リスク」、「債券投資のリスク」、「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、外貨建資産の時価総額の為替変動リスクの低減を目的としており、投機を目的とする為替予約は行わない方針であります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変化により損失が発生する信用リスクであります。

3 金融商品に係るリスク管理体制

(1) 市場リスクの管理

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

(2) 信用リスクの管理

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

(3) 取引先リスクの管理

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

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

金融商品の時価等に関する事項

(2021年1月15日現在)

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

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

(2021年1月15日現在)	
同計算期間の期首元本額	14,652,916,573円
同計算期間中の追加設定元本額	181,660円
同計算期間中の一部解約元本額	6,607,731,785円
同計算期間末日の元本額	8,045,366,448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・スタイル・アドバンテージ・ポートフォリオ（円/年 1回決算コース）	8,045,366,448円
合計	8,045,366,448円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	(2021年1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	1,582,511,649
合計	1,582,511,649

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

3 デリバティブ取引関係

取引の時価等に関する事項

通貨関連

区分	種類	(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	59,496,544	-	59,269,800	226,744
合計		59,496,544	-	59,269,800	226,744

(注1) 時価の算定方法

為替予約取引

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

(注2) 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	日本円	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・スタイル・アドバンテー ジ・ファンド クラスI投資証券	712,562	5,356,827,589	
	日本円小計		712,562	5,356,827,589	
	アメリカドル	インスティテューショナル・キャッシュ・シ リーズplc ブラックロック・ICS・UST レジャーリー・ファンド エージェンシークラ ス投資証券	5,382.580	571,048.670	
	アメリカドル小計		5,382.580	571,048.670 (59,297,693)	
投資証券 合計				5,416,125,282 (59,297,693)	
合計				5,416,125,282 (59,297,693)	

(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、内数で表示してありま
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 1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

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。

(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・スタイル・アドバンテージ・ファンド クラスI投資証券」及び「インスティテューショナル・キャッシュ・シリーズplc ブラックロック・ICS・USTレジャーリー・ファンド エージェンシークラス投資証券」(以下、両者を併せて「同ファンド」という。)を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された投資証券は、すべて同ファンドの投資証券であります。同ファンドの状況は以下のとおりであります。

なお、以下に記載した情報は監査意見の対象外です。

同ファンドの状況

(1)「ブラックロック・ストラテジック・ファンズ ブラックロック・スタイル・アドバンテージ・ファンド クラスI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5月31日に終了する計算期間(2019年6月1日から2020年5月31日まで)に係る財務書類であります。

当該財務書類は、当該ファンドを含む「ブラックロック・ストラテジック・ファンズ」の2020年5月31日現在の財務書類のうち、当該ファンドにかかる部分を、委託会社において抜粋し、その原文を翻訳したものです。なお、財務書類に含まれる「投資有価証券明細表」の銘柄については原文通り英語表記で行っております。

(2)「インスティテューショナル・キャッシュ・シリーズplc ブラックロック・ICS・USTレジャーリー・ファンド エージェンシークラス投資証券」は、アイルランドにおいて設立されたオープンエンド型投資法人が発行するファンドであり、当該ファンドの現時点で日本語に翻訳された直近の情報は、2020年3月31日に終了する中間計算期間(2019年10月1日から2020年3月31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「インスティテューショナル・キャッシュ・シリーズplc」の2020年3月31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、アイルランドにおける独立監査人の監査を受けておりません。

純資産計算書 2020年5月31日現在

	注記	ブラックロック・スタイル・アドバンテージ・ファンド 米ドル
資産		
投資有価証券 - 取得原価		1,637,024,758
未実現評価益		1,102,305
投資有価証券 - 時価	2 (a)	1,638,127,063
銀行預金	2 (a)	338,233,216
ブローカーに対する債権	15	312,297,224
未収利息および未収配当金	2 (a)、2 (d)	8,233,121
売却投資有価証券未収金	2 (a)、2 (d)	291,182,427
販売投資証券未収金	2 (a)	87,842
以下に係る未実現純評価益：		
未決済先渡為替予約	2 (d)	27,927,959
差金決済契約	2 (d)	4,568,937
その他の資産		8,381
資産合計		2,620,666,170
負債		
未払利息および未払配当金	2 (a)、2 (d)	3,791,749
購入投資有価証券未払金	2 (a)、2 (d)	403,324,819
買戻し投資証券未払金	2 (a)	31,066,510
以下に係る未実現純評価損：		
先物取引	2 (d)	25,367,889
スワップの時価	2 (d)	4,793,293
未払費用およびその他の負債	2 (a)、4、5、6、7、8	2,155,906
負債合計		470,500,166
純資産合計		2,150,166,004

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5月31日現在

ブラックロック・スタイル・アドバンテージ・ファンド

	通貨	2020年	2019年	2018年
		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	2,150,166,004	3,245,426,903	3,328,390,128
以下の1口当たり純資産価額:				
クラスA分配型投資証券	米ドル	86.16	106.29	108.61
クラスAユーロ・ヘッジ分配型投資証券	ユーロ	78.78	99.40	104.64
クラスA無分配投資証券	米ドル	84.79	104.62	106.88
クラスAユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	69.57	87.87	92.47
クラスAスウェーデン・クローネ・ヘッジ 無分配投資証券	スウェーデン・ クローネ	71.25	89.53	94.21
クラスDスイス・フラン・ヘッジ 無分配投資証券	スイス・ フラン	71.55	89.83	94.16
クラスD無分配投資証券(ユーロ)	ユーロ	87.23	106.55	103.48
クラスD無分配英国報告型投資証券	米ドル	87.73	107.43	108.95
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	79.82	100.01	104.46
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	76.20	94.37	97.66
クラスE無分配投資証券(ユーロ)	ユーロ	83.25	102.91	101.13
クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	76.34	96.82	102.41
クラスIスイス・フラン・ヘッジPF 無分配投資証券	スイス・ フラン	73.69	92.11	96.06
クラスIユーロ・ヘッジPF無分配投資証券	ユーロ	81.13	101.38	105.47
クラスIブラジル・リアル・ヘッジ 無分配投資証券	米ドル	50.61	83.34	86.97
クラスIスイス・フラン・ヘッジ 無分配投資証券	スイス・ フラン	71.90	90.29	94.43
クラスI無分配英国報告型投資証券	米ドル	77.97	95.35	96.53
クラスIユーロ・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	ユーロ	80.42	100.61	104.90
クラスI英ポンド・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	英ポンド	76.24	94.73	97.80
クラスI日本円ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	日本円	8,162.20	10,175.36	10,592.54
クラスX無分配投資証券	米ドル	91.12	110.60	111.12
クラスX豪ドル・ヘッジ無分配投資証券 ⁽¹⁾	豪ドル	91.81	111.75	112.90
クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	75.30	93.42	96.68
クラスXニュージーランド・ドル・ヘッジ 無分配投資証券	ニュージーラン ド・ドル	91.00	110.98	112.02
クラスX英ポンド・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	英ポンド	86.47	106.63	109.28
クラスZ無分配投資証券	米ドル	88.28	107.92	109.28
クラスZユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	80.39	100.55	104.87

(1) 終値で評価された1口当たり純資産価額、詳細については注記2(a)を参照のこと。
添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

損益および純資産変動計算書 2020年5月31日に終了した会計年度

	注記	ブラックロック・スタイル・ アドバンテージ・ファンド
		米ドル
期首純資産		3,245,426,903
収益		
預金利息	2 (c)	3,208,302
債券利息	2 (c)	53,882,011
スワップに係る受取利息および受取配当金	2 (c)	4,855,603
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)	140,172,071
収益合計		202,117,987
費用		
差金決済契約に係る支払利息	2 (c)、2 (d)	48,313,263
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)	112,474,667
管理事務代行報酬	5	1,804,809
預託報酬	2 (i)、6	1,560,953
税金	8	357,201
販売報酬	4	5,500
ローン・コミットメント・フィー	14	56,400
投資運用報酬および投資運用再委託報酬	4	9,517,468
払戻前費用合計		174,090,261
費用の払戻し	4	79,542
払戻後費用合計		174,010,719
投資純利益		28,107,268
以下に係る実現純利益 / (損失) :		
投資有価証券	2 (a)、2 (b)	2,518,505
差金決済契約	2 (d)	(674,968,247)
先物取引	2 (d)	(27,900,955)
外貨および先渡為替予約	2 (d)、2 (e)、2 (j)	(66,229,889)
スワップ取引	2 (d)	45,314,071
当期実現純損失		(721,266,515)
以下に係る未実現評価益 / (損) の純変動額 :		
投資有価証券	2 (a)	21,921
差金決済契約	2 (d)	39,393,334
先物取引	2 (d)	(31,272,479)
外貨および先渡為替予約	2 (d)、2 (e)、2 (j)	1,281,921
スワップ取引	2 (d)	1,593,460
当期末実現評価益 / (損) の純変動		11,018,157
運用成績による純資産の減少		(682,141,090)
資本の変動		
投資証券発行による正味受取額		573,405,808
投資証券買戻しによる正味支払額	2 (g)	(986,525,617)
資本の変動による純資産の減少		(413,119,809)
期末純資産		2,150,166,004

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5月31日に終了した会計年度

ブラックロック・スタイル・アドバンテージ・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分配型投資証券	1,585	74	1,507	152
クラスAユーロ・ヘッジ分配型投資証券	2,014	160	317	1,857
クラスA無分配投資証券	13,673	179	5,215	8,637
クラスAユーロ・ヘッジ無分配投資証	64,678	-	64,549	129
クラスAスウェーデン・クローネ・ヘッジ 無分配投資証券	440	-	-	440
クラスDスイス・フラン・ヘッジ 無分配投資証券	5,369	-	-	5,369
クラスD無分配投資証券(ユーロ)	1,106	-	1,060	46
クラスD無分配英国報告型投資証券	139,627	55,986	141,343	54,270
クラスDユーロ・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	1,750,961	249,187	970,714	1,029,434
クラスD英ポンド・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	12,888	3,483	12,653	3,718
クラスE無分配投資証券(ユーロ)	1,307	7,348	1,754	6,901
クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券	9,435	103	6,373	3,165
クラスIスイス・フラン・ヘッジPF 無分配投資証券	288,992	-	12,454	276,538
クラスIユーロ・ヘッジPF無分配投資証券	19,122	774,823	778,816	15,129
クラスIブラジル・リアル・ヘッジ 無分配投資証券	179,141	7,522	136,477	50,186
クラスIスイス・フラン・ヘッジ 無分配投資証券	257,389	29,826	287,167	48
クラスI無分配英国報告型投資証券	786,275	286,308	219,470	853,113
クラスIユーロ・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	3,890,337	150,167	1,936,142	2,104,362
クラスI英ポンド・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	1,716,312	225,584	264,277	1,677,619
クラスI日本円ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	5,634,109	45,898	3,817,481	1,862,526
クラスX無分配投資証券	231,662	751,680	412,156	571,186
クラスX豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	15,934,322	3,358,991	2,151,434	17,141,879
クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券	42	81,126	81,126	42
クラスXニュージーランド・ドル・ヘッジ 無分配投資証券	952,003	-	110,217	841,786
クラスX英ポンド・ヘッジ 無分配英国報告型投資証券	2,800,648	240,893	2,951	3,038,590
クラスZ無分配投資証券	50	-	-	50
クラスZユーロ・ヘッジ無分配投資証券	79,409	-	-	79,409

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・スタイル・アドバンテージ・ファンド

投資有価証券明細表 2020年5月31日現在

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			
ドイツ			
USD 30,000,000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1.875% 30/6/2020	30,032,797	1.40
USD 25,000,000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2.75% 15/7/2020	25,068,718	1.16
USD 87,000,000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2.75% 1/10/2020	87,713,601	4.08
		142,815,116	6.64
国際機関			
USD 40,000,000	African Development Bank 2.625% 22/3/2021	40,705,099	1.89
USD 45,000,000	European Bank for Reconstruction & Development 1.125% 24/8/2020	45,069,598	2.10
USD 32,000,000	European Bank for Reconstruction & Development 2.00% 1/2/2021	32,350,257	1.50
USD 42,000,000	European Bank for Reconstruction & Development 2.75% 26/4/2021	42,817,498	1.99
USD 50,000,000	European Investment Bank 1.375% 15/6/2020	50,015,300	2.33
USD 52,879,000	European Investment Bank 1.625% 14/8/2020	52,994,019	2.47
USD 30,000,000	European Investment Bank 2.875% 15/9/2020	30,202,122	1.41
USD 20,000,000	European Investment Bank 2.00% 15/3/2021	20,254,410	0.94
USD 30,000,000	European Investment Bank 2.50% 15/4/2021	30,545,397	1.42
USD 65,530,000	Inter-American Development Bank 1.875% 16/6/2020	65,562,213	3.05
USD 20,000,000	Inter-American Development Bank 2.625% 19/4/2021	20,408,081	0.95
USD 24,000,000	International Bank for Reconstruction & Development 1.125% 10/8/2020	24,035,251	1.12
USD 80,000,000	International Bank for Reconstruction & Development 1.625% 4/9/2020	80,263,408	3.73
USD 16,000,000	International Bank for Reconstruction & Development 2.125% 1/11/2020	16,101,329	0.75
USD 11,478,000	International Bank for Reconstruction & Development 1.625% 9/3/2021	11,604,956	0.54
USD 30,000,000	International Finance Corp 2.25% 25/1/2021	30,349,862	1.41
		593,278,800	27.60
米国			
USD 50,000,000	United States Treasury Bill 18/6/2020 (Zero Coupon)	49,960,380	2.32
USD 138,000,000	United States Treasury Bill 16/7/2020 (Zero Coupon)	137,670,943	6.40
USD 155,000,000	United States Treasury Bill 10/9/2020 (Zero Coupon)	154,604,795	7.19
USD 157,000,000	United States Treasury Bill 5/11/2020 (Zero Coupon)	155,958,784	7.25
USD 150,000,000	United States Treasury Bill 28/1/2021 (Zero Coupon)	149,136,253	6.94
USD 140,000,000	United States Treasury Bill 25/3/2021 (Zero Coupon)	139,860,882	6.51
USD 115,000,000	United States Treasury Bill 22/4/2021 (Zero Coupon)	114,841,110	5.34
		902,033,147	41.95
債券合計		1,638,127,063	76.19
公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品合計		1,638,127,063	76.19
投資有価証券(時価)合計		1,638,127,063	76.19
その他の純資産		512,038,941	23.81
純資産合計(米ドル)		2,150,166,004	100.00

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

差金決済契約 2020年5月31日現在

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			
(597,919)	Adbri Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(126,988)
(420,570)	Adbri Ltd	Barclays Bank	(78,157)
(493,042)	Adbri Ltd	Credit Suisse	(45,812)
(79,780)	Adbri Ltd	Goldam Sachs	(16,944)
(558,092)	Adbri Ltd	HSBC	(51,857)
(194,748)	Adbri Ltd	JP Morgan	(18,096)
(80,658)	Afterpay Ltd	Barclays Bank	(155,245)
(101,405)	Afterpay Ltd	Goldam Sachs	(417,948)
61,667	AGL Energy Ltd	Bank of America Merrill Lynch	7,776
76,082	AGL Energy Ltd	Barclays Bank	20,198
15,241	AGL Energy Ltd	Credit Suisse	2,731
136,679	AGL Energy Ltd	Goldam Sachs	17,236
85,196	AGL Energy Ltd	HSBC	15,267
156,970	ALS Ltd	Bank of America Merrill Lynch	90,637
71,290	ALS Ltd	Credit Suisse	35,486
72,940	ALS Ltd	Goldam Sachs	42,117
32,960	ALS Ltd	HSBC	19,766
53,100	ALS Ltd	JP Morgan	26,432
(56,660)	Altium Ltd	Barclays Bank	(48,511)
(11,580)	Altium Ltd	Goldam Sachs	(16,985)
(383,359)	Alumina Ltd	Goldam Sachs	(15,266)
(75,550)	AMP Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(9,276)
(322,890)	AMP Ltd	Goldam Sachs	(39,646)
(2,881,822)	AMP Ltd	HSBC	(420,786)
48,210	Ampol Ltd	Bank of America Merrill Lynch	61,434
29,930	Ampol Ltd	Citibank	75,492
10,560	Ampol Ltd	Credit Suisse	18,152
62,890	Ampol Ltd	Goldam Sachs	80,141
22,120	Ampol Ltd	JP Morgan	38,024
2,358	Ansell Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4,022
26,930	Ansell Ltd	Barclays Bank	17,695
278,250	Ansell Ltd	Goldam Sachs	474,613
(40,700)	APA Group (Unit)	Barclays Bank	(10,535)
(99,720)	APA Group (Unit)	Goldam Sachs	(13,899)
(15,280)	APA Group (Unit)	HSBC	(2,847)
(15,380)	APA Group (Unit)	JP Morgan	(4,422)
83,681	Aristocrat Leisure Ltd	Barclays Bank	11,108
42,930	Aristocrat Leisure Ltd	Goldam Sachs	14,246
57,119	ASX Ltd	Bank of America Merrill Lynch	219,877
22,460	ASX Ltd	Barclays Bank	60,670
1,665	ASX Ltd	Credit Suisse	6,498
40,305	ASX Ltd	Goldam Sachs	155,152
185,841	Atlas Arteria Ltd (Unit)	Bank of America Merrill Lynch	86,340
573,850	Atlas Arteria Ltd (Unit)	Goldam Sachs	266,605

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)		
40,136	Aurizon Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	5,061
951,454	Aurizon Holdings Ltd	Barclays Bank	119,981
773,463	Aurizon Holdings Ltd	Credit Suisse	133,470
959,574	Aurizon Holdings Ltd	Goldam Sachs	121,005
11,614	Aurizon Holdings Ltd	HSBC	2,004
683,901	Aurizon Holdings Ltd	JP Morgan	118,015
120,630	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	196,152
89,700	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	Barclays Bank	158,360
65,850	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	Goldam Sachs	107,076
21,370	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	HSBC	34,968
(1,054,697)	Bank of Queensland Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(406,001)
(3,970)	Bank of Queensland Ltd	Goldam Sachs	(1,528)
350,158	Beach Energy Ltd	Goldam Sachs	42,994
(170,520)	Bendigo & Adelaide Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(50,928)
(81,200)	Bendigo & Adelaide Bank Ltd	Barclays Bank	(31,258)
(600,175)	Bendigo & Adelaide Bank Ltd	Goldam Sachs	(179,251)
(123,190)	Bendigo & Adelaide Bank Ltd	JP Morgan	(21,258)
37,496	BHP Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	73,912
10,924	BHP Group Ltd	Credit Suisse	23,491
80,710	BHP Group Ltd	Goldam Sachs	159,095
(104,490)	BlueScope Steel Ltd	Barclays Bank	(49,932)
(43,160)	BlueScope Steel Ltd	Goldam Sachs	(27,499)
(153,090)	Boral Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(60,963)
(42,178)	Boral Ltd	Barclays Bank	(15,117)
(109,694)	Boral Ltd	Credit Suisse	(26,209)
(83,580)	Boral Ltd	Goldam Sachs	(33,283)
(48,360)	Brambles Ltd	Barclays Bank	(18,937)
(35,210)	Brambles Ltd	Goldam Sachs	(13,320)
(200,200)	Challenger Ltd	Barclays Bank	(51,820)
(250,930)	Challenger Ltd	Credit Suisse	(41,636)
(345,306)	Challenger Ltd	Goldam Sachs	(176,468)
(179,130)	Challenger Ltd	HSBC	(88,689)
(15,745)	Challenger Ltd	JP Morgan	(2,612)
61,190	CIMIC Group Ltd	Barclays Bank	45,485
219,053	CIMIC Group Ltd	Goldam Sachs	296,586
12,003	CIMIC Group Ltd	HSBC	15,216
(1,315,921)	Cleanaway Waste Management Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(96,071)
(6,248)	Cleanaway Waste Management Ltd	Credit Suisse	(290)
(1,350,473)	Cleanaway Waste Management Ltd	Goldam Sachs	(98,594)
63,300	Coca-Cola Amatil Ltd	Bank of America Merrill Lynch	7,142
453,040	Coca-Cola Amatil Ltd	Barclays Bank	72,164
35,760	Coca-Cola Amatil Ltd	Credit Suisse	2,373
813,740	Coca-Cola Amatil Ltd	Goldam Sachs	91,813
179,710	Coca-Cola Amatil Ltd	HSBC	11,927
9,820	Cochlear Ltd	Barclays Bank	45,427

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)		
2,170	Cochlear Ltd	Citibank	10,038
1,920	Cochlear Ltd	Goldam Sachs	6,206
1,360	Cochlear Ltd	JP Morgan	10,245
(41,600)	Coles Group Ltd	Barclays Bank	(8,559)
7,710	Commonwealth Bank of Australia	Bank of America Merrill Lynch	21,236
19,140	Commonwealth Bank of Australia	Barclays Bank	64,151
16,920	Commonwealth Bank of Australia	Goldam Sachs	46,604
1,220	Commonwealth Bank of Australia	JP Morgan	3,360
185,330	Computershare Ltd	Goldam Sachs	183,275
(91,090)	Crown Resorts Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(32,646)
(157,500)	Crown Resorts Ltd	Barclays Bank	(30,314)
(62,470)	Crown Resorts Ltd	Goldam Sachs	(22,389)
(115,230)	Crown Resorts Ltd	JP Morgan	(19,120)
8,469	CSL Ltd	Credit Suisse	(140,297)
7,300	CSL Ltd	Goldam Sachs	(124,129)
202,269	CSR Ltd	Bank of America Merrill Lynch	69,808
353,384	CSR Ltd	Barclays Bank	91,471
754,675	CSR Ltd	Goldam Sachs	260,456
(477,789)	Domain Holdings Australia Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(104,646)
(327,811)	Domain Holdings Australia Ltd	Barclays Bank	2,176
(192,651)	Domain Holdings Australia Ltd	Goldam Sachs	(42,195)
(60,274)	Domain Holdings Australia Ltd	JP Morgan	(4,000)
(19,402)	Domino's Pizza Enterprises Ltd	HSBC	(69,279)
(210,450)	Downer EDI Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(76,822)
(248,290)	Downer EDI Ltd	Barclays Bank	(54,381)
(1,569,940)	Downer EDI Ltd	Goldam Sachs	(573,083)
(234,719)	Downer EDI Ltd	HSBC	(70,102)
43,160	Evolution Mining Ltd	Bank of America Merrill Lynch	10,599
216,170	Evolution Mining Ltd	Barclays Bank	30,129
129,570	Evolution Mining Ltd	Goldam Sachs	31,818
(307,326)	Flight Centre Travel Group Ltd	Credit Suisse	(485,090)
(91,236)	Fortescue Metals Group Ltd	Barclays Bank	(19,377)
(1,902,004)	Harvey Norman Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(542,815)
14,450	IDP Education Ltd	Barclays Bank	8,823
19,040	IDP Education Ltd	Goldam Sachs	34,499
9,930	IDP Education Ltd	JP Morgan	10,611
(1)	Iluka Resources Ltd	Bank of America Merrill Lynch	-
374,454	Iluka Resources Ltd	Barclays Bank	27,338
76,663	Iluka Resources Ltd	Credit Suisse	42,304
139,401	Iluka Resources Ltd	Goldam Sachs	53,662
48,774	Iluka Resources Ltd	HSBC	20,526
(284,884)	Incitec Pivot Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(5,672)
(473,510)	Incitec Pivot Ltd	Barclays Bank	(34,570)
(256,010)	Incitec Pivot Ltd	Credit Suisse	(4,587)
(636,463)	Incitec Pivot Ltd	Goldam Sachs	(12,673)

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)			
(885,734)	Insurance Australia Group Ltd	Barclays Bank	(340,960)
(293,692)	IOOF Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(157,888)
(205,841)	IOOF Holdings Ltd	Barclays Bank	(69,674)
(319,551)	IOOF Holdings Ltd	HSBC	(86,955)
1,110	James Hardie Industries Plc - CDI	Barclays Bank	1,768
62,080	James Hardie Industries Plc - CDI	Goldam Sachs	181,703
(15,720)	JB Hi-Fi Ltd	Credit Suisse	(19,239)
(319,499)	Lendlease Group (Unit)	Goldam Sachs	(379,572)
61,520	Macquarie Group Ltd	Barclays Bank	300,107
12,150	Macquarie Group Ltd	Goldam Sachs	39,433
11,890	Macquarie Group Ltd	HSBC	37,721
(17,104)	Magellan Financial Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(45,748)
(69,470)	Magellan Financial Group Ltd	Barclays Bank	(110,657)
(22,273)	Magellan Financial Group Ltd	Goldam Sachs	(59,574)
(648,346)	Medibank Pvt Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4,303
(584,200)	Medibank Pvt Ltd	Barclays Bank	(23,264)
(936,790)	Medibank Pvt Ltd	Goldam Sachs	6,217
(1,160,655)	Metcash Ltd	Barclays Bank	(146,362)
(2,567,547)	Metcash Ltd	Goldam Sachs	(477,143)
(85,420)	National Australia Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(133,229)
(250,832)	National Australia Bank Ltd	Barclays Bank	(411,199)
(43,950)	National Australia Bank Ltd	Citibank	(72,049)
13,080	Newcrest Mining Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3,038
183,110	Newcrest Mining Ltd	Goldam Sachs	42,536
6,210	Newcrest Mining Ltd	HSBC	6,689
29,080	Northern Star Resources Ltd	Bank of America Merrill Lynch	14,668
29,510	Northern Star Resources Ltd	Barclays Bank	6,463
16,240	Northern Star Resources Ltd	Citibank	3,557
18,840	Northern Star Resources Ltd	Credit Suisse	21,861
(1,467,348)	Nufarm Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(301,902)
109,540	Oil Search Ltd	Barclays Bank	18,902
255,660	Oil Search Ltd	Credit Suisse	103,506
208,840	Oil Search Ltd	Goldam Sachs	88,709
127,425	Orica Ltd	Bank of America Merrill Lynch	82,881
17,640	Orica Ltd	Barclays Bank	3,981
138,800	Orica Ltd	Citibank	31,321
104,282	Orica Ltd	Credit Suisse	65,238
342,646	Orica Ltd	Goldam Sachs	222,866
18,230	Orica Ltd	JP Morgan	20,196
842,184	Orora Ltd	Goldam Sachs	44,717
348,140	OZ Minerals Ltd	Bank of America Merrill Lynch	175,606
27,770	OZ Minerals Ltd	Barclays Bank	(369)
68,560	OZ Minerals Ltd	Citibank	(910)
184,500	OZ Minerals Ltd	Goldam Sachs	93,064
37,360	OZ Minerals Ltd	HSBC	18,018

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)		
36,500	OZ Minerals Ltd	JP Morgan	17,684
(24,543)	Perpetual Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(36,976)
(29,584)	Perpetual Ltd	Credit Suisse	(21,795)
(40,068)	Perpetual Ltd	Goldam Sachs	(60,366)
(20,221)	Perpetual Ltd	HSBC	(14,897)
(82,402)	Platinum Asset Management Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(19,142)
(499,197)	Platinum Asset Management Ltd	Barclays Bank	(59,637)
(264,515)	Platinum Asset Management Ltd	Credit Suisse	(66,712)
(82,510)	Platinum Asset Management Ltd	JP Morgan	(20,810)
(89,060)	Qantas Airways Ltd	Citibank	(23,053)
(49,000)	Qantas Airways Ltd	JP Morgan	(15,288)
106,120	QBE Insurance Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	85,223
148,440	QBE Insurance Group Ltd	Barclays Bank	109,357
52,040	QBE Insurance Group Ltd	Citibank	38,338
108,350	QBE Insurance Group Ltd	Credit Suisse	91,328
100,710	QBE Insurance Group Ltd	Goldam Sachs	80,878
302,340	QBE Insurance Group Ltd	HSBC	259,880
(832,930)	Qube Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(121,619)
(429,230)	Qube Holdings Ltd	Barclays Bank	(11,395)
(128,190)	Qube Holdings Ltd	Credit Suisse	(19,798)
(3,700)	Ramsay Health Care Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(14,538)
(55,610)	Ramsay Health Care Ltd	Barclays Bank	(123,643)
8,430	REA Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	56,453
32,900	REA Group Ltd	Barclays Bank	69,001
25,860	REA Group Ltd	Goldam Sachs	173,178
45,630	Rio Tinto Ltd	Bank of America Merrill Lynch	243,488
36,677	Rio Tinto Ltd	Barclays Bank	50,389
4,330	Rio Tinto Ltd	Goldam Sachs	23,106
42,520	Santos Ltd	Bank of America Merrill Lynch	21,448
212,540	Santos Ltd	Barclays Bank	39,498
870,320	Santos Ltd	Goldam Sachs	439,000
71,890	Santos Ltd	HSBC	25,400
85,580	Santos Ltd	JP Morgan	28,968
12,050	SEEK Ltd	Barclays Bank	8,158
13,290	SEEK Ltd	Goldam Sachs	25,139
22,400	SEEK Ltd	JP Morgan	40,438
(163,032)	Seven Group Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(253,198)
(13,440)	Seven Group Holdings Ltd	Credit Suisse	(19,000)
(311,608)	Seven Group Holdings Ltd	Goldam Sachs	(483,945)
(192,249)	Seven Group Holdings Ltd	HSBC	(271,779)
(16,645)	Seven Group Holdings Ltd	JP Morgan	(23,531)
(32,216)	Sims Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(28,652)
(222,297)	Sims Ltd	Goldam Sachs	(197,702)
(33,780)	Sonic Healthcare Ltd	Credit Suisse	(50,893)
(25,780)	Sonic Healthcare Ltd	Goldam Sachs	(17,966)

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)		
(19,900)	Sonic Healthcare Ltd	HSBC	(29,981)
127,710	South32 Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3,814
160,518	South32 Ltd	Credit Suisse	6,392
1,147,940	South32 Ltd	Goldam Sachs	34,285
219,010	South32 Ltd	HSBC	8,721
(111,240)	Star Entertainment Grp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(27,317)
(64,460)	Star Entertainment Grp Ltd	Goldam Sachs	(15,829)
(73,480)	Star Entertainment Grp Ltd	JP Morgan	(17,611)
25,120	Suncorp Group Ltd	Barclays Bank	10,837
(99,500)	Sydney Airport (Unit)	Bank of America Merrill Lynch	(22,453)
(127,830)	Sydney Airport (Unit)	Barclays Bank	(12,726)
(259,580)	Sydney Airport (Unit)	Credit Suisse	(68,913)
(116,000)	Sydney Airport (Unit)	Goldam Sachs	(26,176)
(78,920)	Tabcorp Holdings Ltd	Barclays Bank	(1,048)
(83,320)	Tabcorp Holdings Ltd	Credit Suisse	(4,424)
(54,010)	Tabcorp Holdings Ltd	Goldam Sachs	(3,585)
(322,148)	Tabcorp Holdings Ltd	HSBC	(17,105)
(458,230)	Telstra Corp Ltd	Barclays Bank	(54,743)
(145,624)	Telstra Corp Ltd	Goldam Sachs	(6,766)
116,537	TPG Telecom Ltd	Barclays Bank	54,142
77,530	Transurban Group (Unit)	Barclays Bank	6,689
6,610	Transurban Group (Unit)	Goldam Sachs	3,027
163,740	Vocus Group Ltd	Barclays Bank	29,342
71,000	Vocus Group Ltd	Citibank	12,723
59,160	Vocus Group Ltd	Credit Suisse	5,497
71,450	Vocus Group Ltd	HSBC	6,639
150,380	Wesfarmers Ltd	Goldam Sachs	246,524
(50,449)	Westpac Banking Corp	Barclays Bank	(73,997)
(338,690)	Westpac Banking Corp	Goldam Sachs	(440,586)
(152,682)	WiseTech Global Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(126,669)
(22,383)	WiseTech Global Ltd	JP Morgan	(7,131)
33,280	Woodside Petroleum Ltd	Bank of America Merrill Lynch	31,144
74,550	Woodside Petroleum Ltd	Barclays Bank	25,729
82,138	Woodside Petroleum Ltd	Goldam Sachs	76,866
8,120	Woodside Petroleum Ltd	HSBC	6,904
46,990	Woodside Petroleum Ltd	JP Morgan	24,326
(19,960)	Woolworths Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,385)
(7,680)	Woolworths Group Ltd	Barclays Bank	(6,015)
(8,120)	Woolworths Group Ltd	Goldam Sachs	(970)
(234,700)	Worley Ltd	Barclays Bank	101,251
(12,770)	Worley Ltd	Credit Suisse	1,356
(7,310)	Worley Ltd	Goldam Sachs	(2,426)
4,250	Xero Ltd	Bank of America Merrill Lynch	28,066
19,310	Xero Ltd	Barclays Bank	65,618
2,110	Xero Ltd	Citibank	7,170

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)			
15,410	Xero Ltd	Goldam Sachs	101,765
9,370	Xero Ltd	JP Morgan	18,470
			(1,970,030)
オーストリア			
48,603	ANDRITZ AG	Bank of America Merrill Lynch	152,404
8,261	ANDRITZ AG	Barclays Bank	20,393
6,190	ANDRITZ AG	Citibank	15,280
4,420	ANDRITZ AG	Credit Suisse	10,125
50,116	ANDRITZ AG	Deutsche Bank	157,149
76,309	ANDRITZ AG	Goldam Sachs	239,282
20,890	ANDRITZ AG	HSBC	47,851
5,300	ANDRITZ AG	JP Morgan	12,140
24,620	Erste Group Bank AG	Bank of America Merrill Lynch	55,300
60,748	Erste Group Bank AG	Goldam Sachs	136,448
3,329	OMV AG	Bank of America Merrill Lynch	(2,961)
74,610	OMV AG	Barclays Bank	(31,526)
54,970	OMV AG	Citibank	(23,227)
28,710	OMV AG	Deutsche Bank	(25,539)
14,440	OMV AG	Goldam Sachs	(12,845)
(125,763)	Raiffeisen Bank International AG	Bank of America Merrill Lynch	(68,523)
(54,630)	Raiffeisen Bank International AG	Barclays Bank	(69,250)
(37,503)	Raiffeisen Bank International AG	Deutsche Bank	(20,434)
(77,603)	Raiffeisen Bank International AG	Goldam Sachs	(42,282)
(15,287)	Raiffeisen Bank International AG	HSBC	(9,009)
(11,946)	Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe	Deutsche Bank	(11,424)
(29,390)	voestalpine AG	Barclays Bank	(23,040)
(13,100)	voestalpine AG	Goldam Sachs	(2,185)
			504,127
バルバドス			
1	Brookfield Property Partners LP	JP Morgan	1
			1
ベルギー			
4,517	Ackermans & van Haaren NV	Bank of America Merrill Lynch	45,204
2,519	Ackermans & van Haaren NV	Barclays Bank	19,047
3,298	Ackermans & van Haaren NV	Citibank	24,937
2,752	Ackermans & van Haaren NV	Credit Suisse	16,218
900	Ackermans & van Haaren NV	Deutsche Bank	9,007
1,800	Ackermans & van Haaren NV	Goldam Sachs	18,014
4,919	Ackermans & van Haaren NV	HSBC	28,989
1,780	Ackermans & van Haaren NV	JP Morgan	10,490
(80,970)	Anheuser-Busch InBev SA	Bank of America Merrill Lynch	(452,874)
(3,300)	Anheuser-Busch InBev SA	Barclays Bank	(16,696)
(2,050)	Anheuser-Busch InBev SA	Citibank	(10,372)
(40,520)	Anheuser-Busch InBev SA	Deutsche Bank	(226,633)

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)			
(10,890)	Anheuser-Busch InBev SA	Goldam Sachs	(60,909)
(13,650)	Anheuser-Busch InBev SA	HSBC	(31,343)
(21,830)	Argenx SE	Goldam Sachs	(1,233,113)
(16,050)	Argenx SE	HSBC	(1,013,698)
54,753	Colruyt SA	Deutsche Bank	(155,859)
5,351	Groupe Bruxelles Lambert SA	Bank of America Merrill Lynch	33,439
2,453	Groupe Bruxelles Lambert SA	Barclays Bank	12,602
2,431	Groupe Bruxelles Lambert SA	Citibank	12,489
40,189	Groupe Bruxelles Lambert SA	Goldam Sachs	251,147
27,275	Groupe Bruxelles Lambert SA	HSBC	59,444
(34,780)	Proximus SADP	Barclays Bank	(41,768)
1,620	Sofina SA	Citibank	40,531
1,970	Sofina SA	Deutsche Bank	70,097
2,280	Sofina SA	JP Morgan	54,815
(8,840)	Solvay SA	Barclays Bank	(31,455)
(9,584)	Solvay SA	Deutsche Bank	2,345
32,524	Telenet Group Holding NV	Bank of America Merrill Lynch	97,646
190	Telenet Group Holding NV	Barclays Bank	334
68,190	Telenet Group Holding NV	Goldam Sachs	204,724
16,420	UCB SA	Barclays Bank	161,038
9,940	UCB SA	Deutsche Bank	85,770
2,220	UCB SA	HSBC	12,433
(82,559)	Umicore SA	Bank of America Merrill Lynch	(277,240)
(59,887)	Umicore SA	Deutsche Bank	(201,106)
(64,810)	Umicore SA	Goldam Sachs	(217,638)
(21,215)	Umicore SA	HSBC	(61,806)
			<u>(2,761,750)</u>
カナダ			
9,570	Alimentation Couche-Tard Inc ' B '	Bank of America Merrill Lynch	18,620
13,900	Alimentation Couche-Tard Inc ' B '	Credit Suisse	23,512
2,490	Bank of Montreal	HSBC	10,543
4,900	Bank of Nova Scotia	Citibank	17,751
39,970	Bank of Nova Scotia	Goldam Sachs	177,586
98,210	BCE Inc	Bank of America Merrill Lynch	154,718
19,120	BCE Inc	Goldam Sachs	30,121
3,730	Canadian Imperial Bank of Commerce	Bank of America Merrill Lynch	26,402
3,270	Canadian Imperial Bank of Commerce	Goldam Sachs	23,146
(84,592)	Canadian National Railway Co	Bank of America Merrill Lynch	(518,317)
11,450	Canadian Natural Resources Ltd	Bank of America Merrill Lynch	5,902
10,470	Canadian Natural Resources Ltd	Credit Suisse	14,138
80,850	Canadian Natural Resources Ltd	Goldam Sachs	41,674
7,300	Canadian Natural Resources Ltd	JP Morgan	4,225
12,100	Canadian Pacific Railway Ltd	Bank of America Merrill Lynch	292,870
13,991	Canadian Tire Corp Ltd ' A '	Bank of America Merrill Lynch	226,200
56,130	Canadian Tire Corp Ltd ' A '	Goldam Sachs	907,485

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)		
13,372	Canadian Tire Corp Ltd 'A'	HSBC	162,509
1,780	Canadian Tire Corp Ltd 'A'	JP Morgan	21,632
58,800	Canadian Utilities Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	118,672
31,140	Canadian Utilities Ltd 'A'	Goldam Sachs	62,847
(39,670)	Cenovus Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(19,872)
(34,160)	Cenovus Energy Inc	Credit Suisse	(19,269)
(73,560)	Cenovus Energy Inc	HSBC	(27,770)
(3,370)	CGI Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,025)
(2,650)	CGI Inc	Citibank	(1,866)
(5,600)	CGI Inc	Goldam Sachs	(13,335)
(1,840)	CGI Inc	HSBC	(3,521)
(2,050)	CGI Inc	JP Morgan	3,676
1,320	Constellation Software Inc	Bank of America Merrill Lynch	85,901
810	Constellation Software Inc	Citibank	(15,095)
700	Constellation Software Inc	Credit Suisse	43,150
9,340	Constellation Software Inc	Goldam Sachs	607,817
250	Constellation Software Inc	JP Morgan	15,411
(24,810)	Dollarama Inc	Bank of America Merrill Lynch	(77,450)
(9,260)	Dollarama Inc	Goldam Sachs	(28,907)
(4,090)	Dollarama Inc	JP Morgan	(6,978)
(30,030)	Enbridge Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,142)
800	Fairfax Financial Holdings Ltd	Credit Suisse	20,287
500	Fairfax Financial Holdings Ltd	Goldam Sachs	11,608
1,470	Fairfax Financial Holdings Ltd	HSBC	36,451
1,170	Fairfax Financial Holdings Ltd	JP Morgan	29,293
(3,370)	Fortis Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,288)
(6,760)	Fortis Inc	Credit Suisse	(4,064)
7,870	Franco-Nevada Corp	Credit Suisse	(15,083)
11,250	Franco-Nevada Corp	Goldam Sachs	(126,919)
10,490	George Weston Ltd	Bank of America Merrill Lynch	15,307
7,770	George Weston Ltd	Credit Suisse	6,600
12,350	George Weston Ltd	Goldam Sachs	18,021
44,890	George Weston Ltd	HSBC	38,129
3,950	George Weston Ltd	JP Morgan	3,355
(108,426)	Great-West Lifeco Inc	Bank of America Merrill Lynch	(184,193)
(7,120)	Great-West Lifeco Inc	Goldam Sachs	(12,095)
(152,219)	Great-West Lifeco Inc	HSBC	(71,830)
(316,492)	Husky Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(78,121)
(180,100)	Husky Energy Inc	Citibank	15,690
(67,650)	Husky Energy Inc	HSBC	(16,025)
(222,500)	Husky Energy Inc	JP Morgan	14,538
3,950	Hydro One Ltd	Citibank	2,265
8,330	Hydro One Ltd	Credit Suisse	3,387
182,500	Hydro One Ltd	Goldam Sachs	113,942
106,181	Hydro One Ltd	HSBC	43,168

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)		
26,390	IGM Financial Inc	Goldam Sachs	103,073
163,070	Imperial Oil Ltd	Goldam Sachs	179,946
(31,320)	Intact Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	14,780
(211,020)	Inter Pipeline Ltd	Goldam Sachs	(99,577)
(39,809)	Inter Pipeline Ltd	HSBC	(35,259)
(18,360)	Loblaw Cos Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(13,196)
(430)	Loblaw Cos Ltd	Goldam Sachs	(309)
(19,340)	Loblaw Cos Ltd	HSBC	12,496
(68,010)	Manulife Financial Corp	Goldam Sachs	(61,717)
(28,450)	Manulife Financial Corp	HSBC	3,860
(7,250)	Metro Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,158
(145,740)	Metro Inc	Goldam Sachs	83,585
79,671	National Bank of Canada	Bank of America Merrill Lynch	529,810
66,198	National Bank of Canada	HSBC	242,214
5,650	Pembina Pipeline Corp	Bank of America Merrill Lynch	4,922
6,710	Pembina Pipeline Corp	Citibank	(4,628)
6,300	Pembina Pipeline Corp	Credit Suisse	10,428
8,380	Pembina Pipeline Corp	Goldam Sachs	7,300
8,070	Pembina Pipeline Corp	HSBC	13,358
32,470	Pembina Pipeline Corp	JP Morgan	53,745
(75,550)	Power Corp of Canada	Bank of America Merrill Lynch	(170,576)
(23,530)	Power Corp of Canada	Credit Suisse	(27,161)
(51,230)	Power Corp of Canada	HSBC	(59,135)
(47,420)	Power Corp of Canada	JP Morgan	(66,185)
(23,130)	Rogers Communications Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(39,461)
(10,780)	Rogers Communications Inc 'B'	Citibank	(21,365)
(4,710)	Rogers Communications Inc 'B'	Goldam Sachs	(8,035)
(3,350)	Rogers Communications Inc 'B'	HSBC	(6,186)
86,120	Royal Bank of Canada	Bank of America Merrill Lynch	482,665
32,940	Royal Bank of Canada	Goldam Sachs	184,614
(71,580)	Saputo Inc	Goldam Sachs	7,275
(62,850)	Shaw Communications Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(31,483)
(2,330)	Shaw Communications Inc 'B'	Citibank	(1,184)
(2,830)	Shaw Communications Inc 'B'	Credit Suisse	(185)
(75,310)	Shaw Communications Inc 'B'	Goldam Sachs	(37,725)
(1,100)	Shopify Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	26,744
(2,500)	Shopify Inc 'A'	Citibank	190,352
37,000	Sun Life Financial Inc	Goldam Sachs	54,528
59,610	Suncor Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	29,427
119,090	Suncor Energy Inc	Goldam Sachs	58,791
15,990	TC Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	(6,617)
8,120	TC Energy Corp	Citibank	19,100
(137,900)	Teck Resources Ltd 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(65,073)
(27,880)	TELUS Corp	Bank of America Merrill Lynch	(23,884)
(59,370)	TELUS Corp	Citibank	(45,687)

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)			
6,060	Toronto-Dominion Bank	Goldam Sachs	20,809
22,470	Toronto-Dominion Bank	HSBC	42,413
(13,450)	Wheaton Precious Metals Corp	Bank of America Merrill Lynch	40,620
			3,805,769
デンマーク			
(97,361)	Ambu A/S 'B'	Citibank	(162,668)
(8,893)	Ambu A/S 'B'	Credit Suisse	(26,002)
(22,910)	Ambu A/S 'B'	Goldam Sachs	(86,808)
(20,030)	Ambu A/S 'B'	HSBC	(58,565)
635	AP Moller - Maersk A/S 'A'	Barclays Bank	(33,154)
588	AP Moller - Maersk A/S 'A'	Deutsche Bank	11,403
483	AP Moller - Maersk A/S 'A'	Goldam Sachs	9,367
240	AP Moller - Maersk A/S 'A'	JP Morgan	13,212
17,940	Carlsberg A/S 'B'	Citibank	82,963
4,040	Carlsberg A/S 'B'	Credit Suisse	21,335
20,850	Carlsberg A/S 'B'	HSBC	110,105
19,669	Carlsberg A/S 'B'	JP Morgan	103,868
(21,611)	Chr Hansen Holding A/S	Bank of America Merrill Lynch	(61,253)
(14,118)	Chr Hansen Holding A/S	Barclays Bank	(421)
(14,395)	Chr Hansen Holding A/S	Credit Suisse	(49,390)
1,550	Coloplast A/S 'B'	Bank of America Merrill Lynch	21,966
840	Coloplast A/S 'B'	Barclays Bank	(627)
2,530	Coloplast A/S 'B'	Credit Suisse	33,779
35,230	Coloplast A/S 'B'	Deutsche Bank	499,269
(55,990)	Danske Bank A/S	Bank of America Merrill Lynch	(96,219)
(76,140)	Danske Bank A/S	Barclays Bank	(85,641)
(21,350)	Danske Bank A/S	Citibank	(21,275)
(285,160)	Danske Bank A/S	Deutsche Bank	(490,049)
(36,090)	Danske Bank A/S	HSBC	(41,132)
(69,989)	Demant A/S	Deutsche Bank	(272,501)
(54,760)	DSV PANALPINA A/S	Bank of America Merrill Lynch	(249,967)
(3,663)	DSV PANALPINA A/S	Deutsche Bank	(16,721)
9,640	Genmab A/S	Deutsche Bank	153,872
2,040	Genmab A/S	Goldam Sachs	32,562
34,755	GN Store Nord A/S	Bank of America Merrill Lynch	240,047
8	GN Store Nord A/S	Barclays Bank	11
15,450	GN Store Nord A/S	Deutsche Bank	106,711
(65,520)	H Lundbeck A/S	Deutsche Bank	(138,791)
(15,830)	ISS A/S	Bank of America Merrill Lynch	(37,287)
(40,800)	ISS A/S	Barclays Bank	(14,607)
(102,510)	ISS A/S	Deutsche Bank	(241,461)
(14,700)	ISS A/S	JP Morgan	(32,433)
8,733	Novo Nordisk A/S 'B'	Citibank	(11,139)
30,830	Novo Nordisk A/S 'B'	Deutsche Bank	(2,530)
54,440	Novo Nordisk A/S 'B'	Goldam Sachs	(4,467)

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)			
15,065	Novo Nordisk A/S 'B'	JP Morgan	(112)
7,130	Novozymes A/S 'B'	Credit Suisse	17,337
20,288	Novozymes A/S 'B'	Deutsche Bank	55,990
13,060	Novozymes A/S 'B'	HSBC	31,756
(10,080)	Orsted A/S	Barclays Bank	(28,570)
(5,146)	Orsted A/S	Credit Suisse	(65,251)
(34,770)	Orsted A/S	Deutsche Bank	(405,611)
(13,690)	Orsted A/S	HSBC	(173,588)
75,920	Pandora A/S	Barclays Bank	362,414
6,947	ROCKWOOL International A/S 'B'	Bank of America Merrill Lynch	411,421
810	ROCKWOOL International A/S 'B'	Credit Suisse	55,372
7,684	ROCKWOOL International A/S 'B'	Deutsche Bank	455,068
3,843	ROCKWOOL International A/S 'B'	Goldam Sachs	227,593
33,098	Tryg A/S	Barclays Bank	10,862
62,910	Tryg A/S	Deutsche Bank	113,554
1,750	Vestas Wind Systems A/S	Deutsche Bank	20,937
			<u>294,534</u>
フィンランド			
(1,860)	Elisa Oyj	Citibank	(2,399)
20,200	Fortum Oyj	Bank of America Merrill Lynch	51,212
64,480	Fortum Oyj	Barclays Bank	101,453
2,090	Fortum Oyj	Citibank	3,288
6,770	Fortum Oyj	Credit Suisse	12,120
29,550	Fortum Oyj	Deutsche Bank	74,917
58,875	Fortum Oyj	Goldam Sachs	149,263
23,100	Fortum Oyj	HSBC	41,355
33,900	Fortum Oyj	JP Morgan	55,435
12,880	Huhtamaki Oyj	Deutsche Bank	60,152
18,560	Huhtamaki Oyj	HSBC	57,373
6,150	Huhtamaki Oyj	JP Morgan	19,011
9,112	Kesko Oyj 'B'	Bank of America Merrill Lynch	7,903
14,200	Kesko Oyj 'B'	Barclays Bank	11,053
120,725	Kesko Oyj 'B'	Deutsche Bank	104,707
52,608	Kesko Oyj 'B'	Goldam Sachs	45,628
22,483	Kone Oyj 'B'	Bank of America Merrill Lynch	95,500
103	Metsa Board Oyj	Bank of America Merrill Lynch	61
1	Metsa Board Oyj	Citibank	-
1	Metsa Board Oyj	Credit Suisse	-
50	Metsa Board Oyj	HSBC	-
1	Metsa Board Oyj	JP Morgan	-
(150,966)	Metso Oyj	Deutsche Bank	(768,829)
(1,530)	Neste Oyj	Bank of America Merrill Lynch	(9,119)
(3,950)	Neste Oyj	Citibank	(5,622)
(9,520)	Neste Oyj	Deutsche Bank	(56,740)
(3,920)	Neste Oyj	Goldam Sachs	(23,363)

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)			
(397,595)	Nokia Oyj	Bank of America Merrill Lynch	(162,032)
(763,732)	Nokia Oyj	Deutsche Bank	(311,243)
(139,950)	Nokian Renkaat Oyj	Bank of America Merrill Lynch	(577,341)
(237,447)	Nokian Renkaat Oyj	Barclays Bank	(768,325)
(45,531)	Nokian Renkaat Oyj	Goldam Sachs	(187,831)
(20,305)	Nokian Renkaat Oyj	HSBC	(37,028)
(759,551)	Nordea Bank Abp	Bank of America Merrill Lynch	(784,617)
(733,622)	Nordea Bank Abp	Barclays Bank	(496,792)
(103,303)	Nordea Bank Abp	Deutsche Bank	(106,712)
(216,872)	Nordea Bank Abp	Goldam Sachs	(224,029)
(17,221)	Nordea Bank Abp	HSBC	(9,613)
(14,766)	Nordea Bank Abp	JP Morgan	(8,242)
8,490	Orion Oyj ' B '	Barclays Bank	29,926
36,570	Orion Oyj ' B '	Goldam Sachs	100,033
1,005	Orion Oyj ' B '	HSBC	2,973
6,560	Orion Oyj ' B '	JP Morgan	19,403
(6,780)	Sampo Oyj ' A '	Barclays Bank	(24,728)
(77,920)	Sampo Oyj ' A '	Goldam Sachs	(512,927)
(40,860)	Stora Enso Oyj ' R '	Bank of America Merrill Lynch	(52,886)
(15,130)	Stora Enso Oyj ' R '	Barclays Bank	(6,393)
(11,880)	Stora Enso Oyj ' R '	Citibank	(5,020)
(55,520)	Stora Enso Oyj ' R '	Deutsche Bank	(71,860)
(115,170)	Stora Enso Oyj ' R '	Goldam Sachs	(149,066)
13,170	UPM-Kymmene Oyj	Bank of America Merrill Lynch	32,364
7,640	UPM-Kymmene Oyj	JP Morgan	9,055
(45,070)	Wartsila Oyj Abp	Bank of America Merrill Lynch	(29,067)
(153,964)	Wartsila Oyj Abp	Barclays Bank	(54,784)
(62,958)	Wartsila Oyj Abp	Citibank	(22,402)
(274,580)	Wartsila Oyj Abp	Deutsche Bank	(177,085)
(439,440)	Wartsila Oyj Abp	Goldam Sachs	(283,408)
(86,394)	Wartsila Oyj Abp	HSBC	(29,973)
			<u>(4,875,291)</u>
フランス			
(7,575)	Aeroports de Paris	Bank of America Merrill Lynch	(178,989)
(84,950)	Air France-KLM	Barclays Bank	(46,097)
(392,970)	Air France-KLM	Deutsche Bank	(74,284)
(121,810)	Air France-KLM	Goldam Sachs	(23,026)
(2,892)	Air France-KLM	JP Morgan	389
(79,283)	ALD SA	Bank of America Merrill Lynch	(66,119)
(19,563)	ALD SA	Citibank	(4,351)
(282,055)	ALD SA	Credit Suisse	37,636
(24,671)	ALD SA	JP Morgan	3,292
31,646	Alstom SA	Goldam Sachs	7,038
(15,640)	Amundi SA	Goldam Sachs	(130,432)
(60,299)	Amundi SA	HSBC	(405,649)

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)		
3,708	Arkema SA	Credit Suisse	11,627
(27,018)	BioMerieux	Barclays Bank	177,252
10,200	BNP Paribas SA	Bank of America Merrill Lynch	70,150
15,290	BNP Paribas SA	Barclays Bank	73,957
6,060	BNP Paribas SA	Deutsche Bank	41,677
(519)	Bollore SA	Bank of America Merrill Lynch	(37)
(1,203)	Bollore SA	Bank of America Merrill Lynch	(243)
73,806	Bollore SA	Barclays Bank	4,268
(5)	Bollore SA	Citibank	-
(6,033)	Bollore SA	Citibank	(926)
(377)	Bollore SA	JP Morgan	(77)
42,690	Carrefour SA	Barclays Bank	16,852
(114,766)	Casino Guichard Perrachon SA	Barclays Bank	(193,973)
13,860	Cie de Saint-Gobain	Bank of America Merrill Lynch	92,162
198,682	Cie de Saint-Gobain	Barclays Bank	505,917
6,630	Cie de Saint-Gobain	Citibank	16,882
9,140	Cie de Saint-Gobain	Deutsche Bank	60,776
(57,736)	Cie Plastic Omnium SA	Bank of America Merrill Lynch	(90,521)
(20,735)	Cie Plastic Omnium SA	Deutsche Bank	(32,509)
(13,730)	Cie Plastic Omnium SA	Goldam Sachs	(21,527)
(81,360)	CNP Assurances	Barclays Bank	(41,163)
(17,510)	CNP Assurances	Credit Suisse	(4,381)
960	Dassault Systemes SE	Credit Suisse	12,863
13,280	Dassault Systemes SE	Deutsche Bank	222,977
(90,098)	Edenred	Deutsche Bank	(216,398)
18,560	Eiffage SA	Bank of America Merrill Lynch	222,888
2,110	Eiffage SA	Citibank	16,330
7,958	Eiffage SA	Credit Suisse	47,961
31,256	Eiffage SA	Goldam Sachs	375,355
19,090	Electricite de France SA	Bank of America Merrill Lynch	18,001
35,390	Electricite de France SA	Deutsche Bank	33,370
61,000	Electricite de France SA	Goldam Sachs	57,519
23,920	Electricite de France SA	HSBC	22,555
334,450	Engie SA	Deutsche Bank	479,368
13,940	Engie SA	JP Morgan	23,765
14,702	Eurazeo SE	Bank of America Merrill Lynch	96,453
30,788	Eurazeo SE	Barclays Bank	57,514
31,960	Eurazeo SE	Deutsche Bank	209,674
20,401	Eurazeo SE	Goldam Sachs	133,841
4,600	Eurazeo SE	HSBC	(2,046)
(8,442)	Eurofins Scientific SE	HSBC	(439,315)
24,455	Euronext NV	Barclays Bank	(8,158)
9,540	Euronext NV	HSBC	15,697
(124,310)	Eutelsat Communications SA	Deutsche Bank	79,066
(9,750)	Faurecia SE	Bank of America Merrill Lynch	(54,316)

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)		
(58,200)	Faurecia SE	Barclays Bank	(89,955)
(48,797)	Faurecia SE	Deutsche Bank	(271,842)
(7,780)	Faurecia SE	Goldam Sachs	(43,341)
441	Hermes International	Bank of America Merrill Lynch	40,701
750	Hermes International	Barclays Bank	42,032
430	Hermes International	Citibank	24,098
660	Hermes International	Deutsche Bank	60,913
420	Hermes International	JP Morgan	31,944
(5,089)	Iliad SA	Bank of America Merrill Lynch	(81,768)
(1,945)	Iliad SA	Barclays Bank	(13,842)
(447)	Iliad SA	Credit Suisse	(7,754)
(36,958)	Imerys SA	Bank of America Merrill Lynch	(133,971)
(6,970)	Imerys SA	Barclays Bank	(23,406)
(5,169)	Imerys SA	Credit Suisse	(20,692)
(72,350)	Imerys SA	Deutsche Bank	(262,266)
(13,020)	Imerys SA	Goldam Sachs	(47,197)
(29,549)	Ingenico Group SA	Bank of America Merrill Lynch	(248,070)
45,110	Ipsen SA	Deutsche Bank	250,800
(65,302)	JCDecaux SA	Bank of America Merrill Lynch	62,447
(1,684)	JCDecaux SA	Barclays Bank	(2,004)
(60,787)	JCDecaux SA	Goldam Sachs	58,129
43,037	Legrand SA	Credit Suisse	99,538
6,420	Legrand SA	Goldam Sachs	29,983
83,842	Legrand SA	HSBC	193,914
853	Legrand SA	JP Morgan	1,973
(8)	Natixis SA	HSBC	1
30,560	Orange SA	Barclays Bank	21,578
205,660	Orange SA	Deutsche Bank	182,947
40,150	Orange SA	Goldam Sachs	35,716
9,980	Orange SA	JP Morgan	7,406
(3,990)	Orpea	Citibank	(18,190)
(4,030)	Orpea	Credit Suisse	(27,559)
(20,003)	Orpea	Deutsche Bank	(181,275)
(4,015)	Orpea	Goldam Sachs	(36,385)
(3,617)	Orpea	HSBC	(24,735)
39,160	Peugeot SA	Bank of America Merrill Lynch	56,389
305,828	Peugeot SA	Barclays Bank	436,984
28,740	Peugeot SA	Goldam Sachs	41,385
61,990	Publicis Groupe SA	Deutsche Bank	35,844
9,090	Publicis Groupe SA	Goldam Sachs	5,256
(12,411)	Remy Cointreau SA	Citibank	(77,282)
(6,043)	Remy Cointreau SA	Credit Suisse	(47,709)
(12,760)	Remy Cointreau SA	Deutsche Bank	(38,309)
(1,910)	Remy Cointreau SA	Goldam Sachs	(5,734)
(13,629)	Remy Cointreau SA	HSBC	(107,599)

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)			
(54,630)	Rexel SA	Bank of America Merrill Lynch	(86,867)
(37,940)	Rexel SA	Barclays Bank	(24,806)
(40,030)	Rexel SA	Credit Suisse	(25,550)
(25,582)	Rexel SA	Goldam Sachs	(40,678)
(13,300)	Rexel SA	HSBC	(8,489)
(54,860)	Rubis SCA	Bank of America Merrill Lynch	(200,085)
(39,692)	Rubis SCA	Goldam Sachs	(144,764)
3,450	Sartorius Stedim Biotech	Bank of America Merrill Lynch	14,578
7,260	Sartorius Stedim Biotech	Barclays Bank	(19,375)
830	Sartorius Stedim Biotech	JP Morgan	1,108
21,739	Schneider Electric SE	Citibank	136,334
17,630	Schneider Electric SE	Deutsche Bank	231,323
11,080	SCOR SE	Deutsche Bank	(1,478)
6,660	SCOR SE	Goldam Sachs	(889)
(11,462)	SEB SA	Bank of America Merrill Lynch	(151,668)
(12,627)	SEB SA	Barclays Bank	(148,830)
(231)	SEB SA	Citibank	(2,723)
(7,280)	SEB SA	Goldam Sachs	(96,330)
(1,342)	SEB SA	JP Morgan	(11,938)
(91,890)	SES SA	Bank of America Merrill Lynch	(34,536)
(20,085)	SES SA	Deutsche Bank	(7,549)
8,340	Sodexo SA	Barclays Bank	51,005
17,670	STMicroelectronics NV	Goldam Sachs	9,824
92,420	Suez SA	Bank of America Merrill Lynch	(31,858)
101,011	Suez SA	Barclays Bank	101,424
81,210	Suez SA	Goldam Sachs	(27,993)
(8,034)	Teleperformance	Bank of America Merrill Lynch	(76,827)
(4,641)	Teleperformance	Goldam Sachs	(44,381)
2,210	Thales SA	Barclays Bank	18,381
1,510	Thales SA	Citibank	12,559
22,010	Thales SA	Deutsche Bank	146,355
2,200	Thales SA	Goldam Sachs	14,629
5,490	Thales SA	HSBC	(2,686)
44,570	TOTAL SA	Deutsche Bank	138,767
(10,590)	Ubisoft Entertainment SA	Bank of America Merrill Lynch	(14,837)
(620)	Ubisoft Entertainment SA	Barclays Bank	(28)
(17,790)	Ubisoft Entertainment SA	Deutsche Bank	(24,925)
(1,490)	Ubisoft Entertainment SA	Goldam Sachs	(2,088)
(39,490)	Valeo SA	Barclays Bank	(144,686)
(22,162)	Valeo SA	JP Morgan	(27,354)
19,340	Veolia Environnement SA	Deutsche Bank	35,376
30,020	Veolia Environnement SA	Goldam Sachs	54,911
89,276	Veolia Environnement SA	HSBC	19,854
40,982	Vivendi SA	Bank of America Merrill Lynch	59,013
105,380	Vivendi SA	Barclays Bank	107,803

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)			
33,050	Vivendi SA	Deutsche Bank	47,591
129,630	Vivendi SA	Goldam Sachs	186,664
8,597	Wendel SE	Bank of America Merrill Lynch	73,608
21,453	Wendel SE	Barclays Bank	118,081
2,980	Wendel SE	Citibank	16,402
1,580	Wendel SE	Credit Suisse	14,670
15,886	Wendel SE	Deutsche Bank	136,016
14,060	Wendel SE	Goldam Sachs	120,382
4,156	Wendel SE	HSBC	38,588
107	Wendel SE	JP Morgan	993
			1,621,649
ドイツ			
(98,949)	1&1 Drillisch AG	Barclays Bank	(16,504)
(161,032)	1&1 Drillisch AG	JP Morgan	(372,444)
3,720	Allianz SE RegS	Deutsche Bank	70,072
16,615	Allianz SE RegS	HSBC	112,698
22,060	Aroundtown SA	Bank of America Merrill Lynch	9,542
106,500	Aroundtown SA	Deutsche Bank	46,066
48,560	Aroundtown SA	Goldam Sachs	21,005
26,350	Aroundtown SA	HSBC	2,368
52,950	Aroundtown SA	JP Morgan	(5,593)
10,940	BASF SE	Deutsche Bank	73,779
(13,578)	Bayer AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	(73,829)
(3,620)	Bayer AG RegS	Barclays Bank	(16,061)
(22,720)	Bayer AG RegS	Deutsche Bank	(123,539)
(8,910)	Bayer AG RegS	Goldam Sachs	(48,448)
(21,903)	Bayer AG RegS	JP Morgan	(88,896)
(49,888)	Bayerische Motoren Werke AG (Pref)	Bank of America Merrill Lynch	(194,155)
(3,532)	Bayerische Motoren Werke AG (Pref)	Barclays Bank	(7,933)
(1,137)	Bayerische Motoren Werke AG (Pref)	Deutsche Bank	(4,425)
(38,726)	Bayerische Motoren Werke AG (Pref)	Goldam Sachs	(150,715)
(466)	Bayerische Motoren Werke AG (Pref)	JP Morgan	497
(5,990)	Bechtle AG	Bank of America Merrill Lynch	(80,593)
(3,450)	Bechtle AG	Barclays Bank	(15,729)
(1,390)	Bechtle AG	Credit Suisse	(7,126)
(3,260)	Bechtle AG	Goldam Sachs	(43,862)
2,640	Beiersdorf AG	Bank of America Merrill Lynch	6,928
23,790	Beiersdorf AG	Deutsche Bank	62,430
3,237	Beiersdorf AG	Goldam Sachs	8,495
24,060	Brenntag AG	Bank of America Merrill Lynch	132,965
11,640	Brenntag AG	Goldam Sachs	64,327
5,798	Carl Zeiss Meditec AG	Barclays Bank	32,235
8,980	Carl Zeiss Meditec AG	Deutsche Bank	88,370
1,770	Carl Zeiss Meditec AG	Goldam Sachs	17,418
(100,350)	Commerzbank AG	Barclays Bank	(28,900)

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)		
(1,292,770)	Commerzbank AG	Deutsche Bank	(977,497)
(361,280)	Commerzbank AG	Goldam Sachs	(273,173)
(155,946)	Commerzbank AG	HSBC	(55,316)
(13,530)	Continental AG	Deutsche Bank	(222,962)
(15,430)	Covestro AG	Barclays Bank	(39,634)
(2,108)	Covestro AG	Deutsche Bank	(10,595)
3,390	CTS Eventim AG & Co KGaA	JP Morgan	14,444
(130,800)	Daimler AG	Barclays Bank	(346,882)
(3,850)	Daimler AG	Goldam Sachs	(24,487)
(18,391)	Delivery Hero SE	Barclays Bank	79,755
(26,270)	Delivery Hero SE	Deutsche Bank	(97,564)
(2,650)	Delivery Hero SE	Goldam Sachs	(9,842)
(41,360)	Deutsche Bank AG	Bank of America Merrill Lynch	(77,770)
(238,779)	Deutsche Bank AG	Citibank	(249,845)
(60,220)	Deutsche Bank AG	Credit Suisse	(107,863)
(688,041)	Deutsche Bank AG	HSBC	(837,749)
3,200	Deutsche Boerse AG	Bank of America Merrill Lynch	6,049
15,880	Deutsche Boerse AG	Deutsche Bank	30,018
6,660	Deutsche Boerse AG	Goldam Sachs	12,590
6	Deutsche EuroShop AG	HSBC	-
(336,622)	Deutsche Lufthansa AG RegS	Deutsche Bank	(639,316)
193,474	Deutsche Post AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	342,062
52,040	Deutsche Post AG RegS	Barclays Bank	54,394
59,460	Deutsche Post AG RegS	Deutsche Bank	105,125
37,380	Deutsche Post AG RegS	HSBC	71,076
195,040	Deutsche Telekom AG RegS	Credit Suisse	119,281
282,370	Deutsche Telekom AG RegS	Deutsche Bank	178,969
21,240	Deutsche Telekom AG RegS	Goldam Sachs	13,462
(12,280)	Deutsche Wohnen SE	Barclays Bank	(8,876)
(9,870)	Deutsche Wohnen SE	Goldam Sachs	(27,767)
3,591	DWS Group GmbH & Co KGaA	Credit Suisse	17,960
5,870	DWS Group GmbH & Co KGaA	Goldam Sachs	25,554
4,760	DWS Group GmbH & Co KGaA	JP Morgan	20,434
(96,210)	E.ON SE	Barclays Bank	8,345
51,300	Evonik Industries AG	Bank of America Merrill Lynch	90,128
65,565	Evonik Industries AG	HSBC	1,458
11,380	Fielmann AG	Bank of America Merrill Lynch	37,962
6,970	Fielmann AG	Barclays Bank	18,601
1,857	Fielmann AG	Credit Suisse	5,885
8,777	Fielmann AG	Goldam Sachs	29,279
55	Fielmann AG	HSBC	174
25,624	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	Bank of America Merrill Lynch	237,628
47,354	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	Barclays Bank	284,339

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)		
12,320	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	Citibank	73,976
16,691	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	Credit Suisse	120,682
10,140	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	Deutsche Bank	94,035
23,828	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	Goldam Sachs	220,973
(8,230)	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	Bank of America Merrill Lynch	(30,932)
(3,440)	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	Barclays Bank	(2,678)
(49,706)	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	Deutsche Bank	(186,815)
(7,840)	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	Goldam Sachs	(29,466)
(16,340)	Fresenius SE & Co KGaA	Bank of America Merrill Lynch	(86,122)
(11,980)	Fresenius SE & Co KGaA	Barclays Bank	(1,465)
(6,940)	Fresenius SE & Co KGaA	Goldam Sachs	(36,578)
(9,200)	Fresenius SE & Co KGaA	JP Morgan	(30,792)
9,087	FUCHS PETROLUB SE	Goldam Sachs	17,683
5,094	FUCHS PETROLUB SE	HSBC	-
4,240	FUCHS PETROLUB SE (Pref)	Citibank	5,752
14,995	FUCHS PETROLUB SE (Pref)	Deutsche Bank	53,689
8,010	FUCHS PETROLUB SE (Pref)	HSBC	6,769
16,680	FUCHS PETROLUB SE (Pref)	JP Morgan	14,096
55,880	GEA Group AG	Bank of America Merrill Lynch	218,097
43,360	GEA Group AG	Barclays Bank	103,660
14,092	GEA Group AG	Credit Suisse	75,214
97,030	GEA Group AG	Deutsche Bank	378,703
112,810	GEA Group AG	Goldam Sachs	440,291
5,020	GEA Group AG	HSBC	26,794
11,370	GEA Group AG	JP Morgan	60,686
(16,043)	GRENKE AG	HSBC	(107,034)
(79)	GRENKE AG	JP Morgan	(527)
(35,148)	Hapag-Lloyd AG	Bank of America Merrill Lynch	3,943,456
(151)	Hapag-Lloyd AG	Barclays Bank	10,494
(6,180)	Hapag-Lloyd AG	JP Morgan	489,963
6,410	HeidelbergCement AG	Bank of America Merrill Lynch	39,843
65,635	HeidelbergCement AG	Barclays Bank	286,093
1,170	HeidelbergCement AG	Deutsche Bank	7,273
30,930	HeidelbergCement AG	Goldam Sachs	192,255
524	Hella GmbH & Co KGaA	Bank of America Merrill Lynch	2,133
21,496	Hella GmbH & Co KGaA	Barclays Bank	38,722
4,030	Hella GmbH & Co KGaA	Goldam Sachs	16,401
8	Hella GmbH & Co KGaA	HSBC	12
32,650	Henkel AG & Co KGaA (Pref)	Barclays Bank	113,998
5,306	HOCHTIEF AG	Bank of America Merrill Lynch	79,060
67,839	HOCHTIEF AG	Barclays Bank	441,286
22,348	HOCHTIEF AG	Citibank	145,372
4,130	HOCHTIEF AG	Credit Suisse	37,657

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)		
18,350	HOCHTIEF AG	Goldam Sachs	273,417
15,068	HOCHTIEF AG	HSBC	137,390
5,210	HUGO BOSS AG	Bank of America Merrill Lynch	10,833
58,410	HUGO BOSS AG	Barclays Bank	96,774
8,350	HUGO BOSS AG	Credit Suisse	325
140,200	HUGO BOSS AG	Deutsche Bank	291,524
23,070	HUGO BOSS AG	Goldam Sachs	47,971
62,210	HUGO BOSS AG	HSBC	86,468
7,010	HUGO BOSS AG	JP Morgan	9,743
(83,140)	Infineon Technologies AG	Barclays Bank	(22,372)
(65,750)	Infineon Technologies AG	Deutsche Bank	(179,852)
(61,140)	Infineon Technologies AG	Goldam Sachs	(167,242)
(16,440)	KION Group AG	Barclays Bank	(103,285)
(15,022)	KION Group AG	Citibank	(94,376)
(17,148)	KION Group AG	Credit Suisse	(90,000)
(15,870)	KION Group AG	Deutsche Bank	(120,350)
(9,020)	KION Group AG	Goldam Sachs	(68,403)
(22,123)	KION Group AG	HSBC	(116,110)
(8)	Knorr-Bremse AG	Bank of America Merrill Lynch	(102)
(1,215)	Knorr-Bremse AG	Barclays Bank	(5,836)
(16,124)	LANXESS AG	Barclays Bank	(22,770)
(10,210)	LANXESS AG	Citibank	(14,418)
(14,480)	LANXESS AG	Deutsche Bank	(57,642)
(5,790)	LANXESS AG	Goldam Sachs	(23,049)
(2,830)	LANXESS AG	HSBC	(7,718)
25,383	Merck KGaA	Bank of America Merrill Lynch	25,402
6,700	Merck KGaA	Barclays Bank	745
14,900	Merck KGaA	Goldam Sachs	14,911
(104,770)	METRO AG	Bank of America Merrill Lynch	(52,658)
(57,100)	METRO AG	Deutsche Bank	(28,699)
(14,930)	METRO AG	Goldam Sachs	(7,504)
(67,900)	METRO AG	JP Morgan	(54,059)
(5,870)	MTU Aero Engines AG	Bank of America Merrill Lynch	(193,530)
(3,130)	MTU Aero Engines AG	Barclays Bank	(51,162)
(180)	MTU Aero Engines AG	Credit Suisse	(4,403)
(623)	MTU Aero Engines AG	Deutsche Bank	(20,540)
3,230	Muenchener Rueckversicherungs- Gesellschaft AG in Muenchen RegS	Bank of America Merrill Lynch	91,406
2,240	Muenchener Rueckversicherungs- Gesellschaft AG in Muenchen RegS	Barclays Bank	29,391
3,030	Muenchener Rueckversicherungs- Gesellschaft AG in Muenchen RegS	Citibank	39,757
1,060	Muenchener Rueckversicherungs- Gesellschaft AG in Muenchen RegS	Credit Suisse	30,022
7,200	Muenchener Rueckversicherungs- Gesellschaft AG in Muenchen RegS	Deutsche Bank	203,754
11,170	Muenchener Rueckversicherungs- Gesellschaft AG in Muenchen RegS	Goldam Sachs	316,101

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)		
11,855	Muenchener Rueckversicherungs- Gesellschaft AG in Muenchen RegS	HSBC	181,255
2,379	Muenchener Rueckversicherungs- Gesellschaft AG in Muenchen RegS	JP Morgan	36,373
2,510	Nemetschek SE	Bank of America Merrill Lynch	27,910
(11,472)	OSRAM Licht AG	JP Morgan	2,551
(9,670)	Porsche Automobil Holding SE (Pref)	Bank of America Merrill Lynch	(70,644)
(48,880)	Porsche Automobil Holding SE (Pref)	Barclays Bank	(134,793)
(124,779)	ProSiebenSat.1 Media SE	Bank of America Merrill Lynch	(177,597)
(1,662)	ProSiebenSat.1 Media SE	Credit Suisse	(3,546)
(128,370)	ProSiebenSat.1 Media SE	Deutsche Bank	(182,708)
30,350	Puma SE	Deutsche Bank	178,863
(7,760)	QIAGEN NV	Barclays Bank	(1,208)
(2,860)	QIAGEN NV	Deutsche Bank	(1,145)
(31,070)	QIAGEN NV	Goldam Sachs	(12,437)
1,727	Rational AG	Bank of America Merrill Lynch	115,220
310	Rational AG	Barclays Bank	13,443
4,960	Rational AG	Deutsche Bank	330,916
710	Rational AG	Goldam Sachs	47,369
960	Rational AG	HSBC	36,721
1,018	Rational AG	JP Morgan	38,940
35,660	Rheinmetall AG	Barclays Bank	203,812
170	Rheinmetall AG	Citibank	972
19,280	Rheinmetall AG	Deutsche Bank	185,228
9,630	Rheinmetall AG	Goldam Sachs	92,518
46	RTL Group SA	Barclays Bank	93
1,655	RTL Group SA	Deutsche Bank	5,300
54,103	RTL Group SA	Goldam Sachs	173,260
5,218	RTL Group SA	HSBC	5,338
(8,680)	SAP SE	Goldam Sachs	(98,448)
(670)	Sartorius AG (Pref)	Bank of America Merrill Lynch	(23,393)
(1,150)	Sartorius AG (Pref)	Barclays Bank	(7,928)
(1,747)	Sartorius AG (Pref)	Credit Suisse	(80,423)
(4,986)	Sartorius AG (Pref)	Deutsche Bank	(174,087)
(820)	Sartorius AG (Pref)	Goldam Sachs	(28,630)
7,700	Scout24 AG	Bank of America Merrill Lynch	32,536
11,190	Scout24 AG	Goldam Sachs	47,282
16,100	Siemens AG RegS	Deutsche Bank	227,360
4,870	Siemens Healthineers AG	Bank of America Merrill Lynch	28,619
9,190	Siemens Healthineers AG	Credit Suisse	62,590
6,560	Siemens Healthineers AG	Deutsche Bank	38,551
4,600	Siemens Healthineers AG	Goldam Sachs	27,033
(95,080)	Suedzucker AG	Barclays Bank	1,057
(1,943)	Suedzucker AG	HSBC	(1,167)
(46,362)	Suedzucker AG	JP Morgan	(27,838)
4,620	Symrise AG	Barclays Bank	10,788

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)		
1,870	Symrise AG	Credit Suisse	7,902
11,820	Symrise AG	Deutsche Bank	55,727
4,060	Symrise AG	Goldam Sachs	19,142
4,330	Symrise AG	JP Morgan	18,296
(15)	Talanx AG	Bank of America Merrill Lynch	(46)
(908)	Talanx AG	Barclays Bank	(949)
(1)	Talanx AG	Goldam Sachs	(3)
(45,570)	TeamViewer AG	Bank of America Merrill Lynch	(144,667)
(1,110)	TeamViewer AG	Credit Suisse	(3,234)
584,616	Telefonica Deutschland Holding AG	Barclays Bank	94,259
(76,314)	thyssenkrupp AG	Bank of America Merrill Lynch	(140,269)
(19,500)	thyssenkrupp AG	Barclays Bank	(15,525)
(54,174)	thyssenkrupp AG	Goldam Sachs	(99,575)
(284,124)	thyssenkrupp AG	JP Morgan	(244,531)
(1,007)	Traton SE	Credit Suisse	(1,299)
(46,623)	Traton SE	Goldam Sachs	(108,040)
(28,040)	Uniper SE	Bank of America Merrill Lynch	(110,997)
(51,004)	Uniper SE	Barclays Bank	(165,605)
(12,630)	Uniper SE	Deutsche Bank	(49,996)
(49,232)	Uniper SE	Goldam Sachs	(194,887)
(5,195)	United Internet AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	(13,633)
(6,555)	United Internet AG RegS	Citibank	(5,977)
(11,126)	United Internet AG RegS	Deutsche Bank	(29,197)
(6,700)	United Internet AG RegS	Goldam Sachs	(17,582)
(35,736)	United Internet AG RegS	HSBC	(214,975)
(34,014)	United Internet AG RegS	JP Morgan	(204,616)
(470)	Volkswagen AG	Barclays Bank	(1,463)
(4,933)	Volkswagen AG	Credit Suisse	(20,295)
(26,216)	Volkswagen AG	Deutsche Bank	(358,556)
(13,658)	Volkswagen AG	HSBC	(56,192)
(4,500)	Vonovia SE	Bank of America Merrill Lynch	(22,417)
(6,430)	Vonovia SE	Citibank	(16,159)
(2,870)	Vonovia SE	Deutsche Bank	(14,297)
3,400	Wacker Chemie AG	Barclays Bank	1,512
4,920	Wacker Chemie AG	Citibank	2,188
6,660	Wacker Chemie AG	Credit Suisse	19,551
26,448	Wacker Chemie AG	Deutsche Bank	169,395
15,510	Wacker Chemie AG	HSBC	45,530
3,360	Wacker Chemie AG	JP Morgan	14,962
(5,710)	Wirecard AG	HSBC	(49,524)
(10,330)	Wirecard AG	JP Morgan	(89,594)
(2,840)	Zalando SE	Barclays Bank	(14,400)
(34,899)	Zalando SE	Goldam Sachs	(352,358)
			<u>3,524,352</u>

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	香港		
70,400	AIA Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(49,023)
40,400	AIA Group Ltd	Barclays Bank	(5,991)
25,200	AIA Group Ltd	Citibank	(3,737)
6,400	AIA Group Ltd	HSBC	(5,612)
(34,863)	Bank of East Asia Ltd	Bank of America Merrill Lynch	8,272
(658,600)	Bank of East Asia Ltd	Barclays Bank	103,613
(653,000)	Bank of East Asia Ltd	Citibank	102,732
(468,425)	Bank of East Asia Ltd	Goldam Sachs	111,145
(235,600)	Bank of East Asia Ltd	HSBC	66,231
(92,199)	Bank of East Asia Ltd	JP Morgan	25,919
191,500	BOC Hong Kong Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(58,032)
241,500	BOC Hong Kong Holdings Ltd	Barclays Bank	(26,471)
357,000	BOC Hong Kong Holdings Ltd	Credit Suisse	(112,789)
16,000	BOC Hong Kong Holdings Ltd	Goldam Sachs	(4,849)
322,500	BOC Hong Kong Holdings Ltd	HSBC	(101,889)
(86,000)	Cafe de Coral Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	19,740
(76,000)	Cafe de Coral Holdings Ltd	Barclays Bank	2,352
(66,000)	Cafe de Coral Holdings Ltd	HSBC	15,875
(66,000)	Cafe de Coral Holdings Ltd	JP Morgan	18,894
(132,000)	Cathay Pacific Airways Ltd	Barclays Bank	4,255
(163,000)	Cathay Pacific Airways Ltd	Citibank	5,255
(745,000)	Cathay Pacific Airways Ltd	Goldam Sachs	95,109
816	Cathay Pacific Airways Ltd	JP Morgan	(133)
(866)	China Everbright Bank Co Ltd 'H'	Citibank	(10)
171,500	CK Asset Holdings Ltd	HSBC	(144,856)
189,000	CK Hutchison Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(197,414)
253,500	CK Hutchison Holdings Ltd	Barclays Bank	(76,821)
22,000	CK Hutchison Holdings Ltd	Credit Suisse	(26,668)
728,500	CK Hutchison Holdings Ltd	Goldam Sachs	(760,934)
230,500	CK Hutchison Holdings Ltd	HSBC	(279,403)
80,000	CK Hutchison Holdings Ltd	JP Morgan	(96,973)
113,500	CK Infrastructure Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(122,212)
61,000	CK Infrastructure Holdings Ltd	Credit Suisse	(52,703)
110,000	CLP Holdings Ltd	Barclays Bank	(15,603)
21,500	CLP Holdings Ltd	Citibank	(3,050)
11,500	CLP Holdings Ltd	Credit Suisse	(5,225)
74,500	CLP Holdings Ltd	Goldam Sachs	(27,860)
28,800	Dah Sing Financial Holdings Ltd	Goldam Sachs	(8,542)
(1,578,000)	FIH Mobile Ltd	Barclays Bank	2,035
(7,287,000)	FIH Mobile Ltd	Citibank	9,397
(687,000)	FIH Mobile Ltd	Credit Suisse	(886)
(17,640,000)	FIH Mobile Ltd	Goldam Sachs	(45,495)
(2,370,000)	FIH Mobile Ltd	HSBC	(3,056)
(3,173)	FIH Mobile Ltd	JP Morgan	(4)
(157,000)	Galaxy Entertainment Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(5,061)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
香港(続き)			
(188,000)	Galaxy Entertainment Group Ltd	Barclays Bank	(55,759)
(7,000)	Galaxy Entertainment Group Ltd	Citibank	(2,076)
(497)	GOME Retail Holdings Ltd	JP Morgan	(3)
(457,000)	Guotai Junan International Holdings Ltd	Citibank	1,768
(2,726,000)	Guotai Junan International Holdings Ltd	Credit Suisse	31,637
70,000	Hang Lung Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(11,554)
181,000	Hang Lung Group Ltd	Barclays Bank	(2,801)
149,000	Hang Lung Group Ltd	Credit Suisse	(34,201)
184,000	Hang Lung Group Ltd	Goldam Sachs	(30,371)
66,000	Hang Lung Group Ltd	JP Morgan	(15,149)
(287,000)	Hang Lung Properties Ltd	Bank of America Merrill Lynch	13,323
(68,000)	Hang Lung Properties Ltd	Barclays Bank	(4,735)
(114,000)	Hang Lung Properties Ltd	Citibank	(7,938)
(431,000)	Hang Lung Properties Ltd	Goldam Sachs	20,008
(148,000)	Hang Lung Properties Ltd	JP Morgan	6,107
193,500	Hang Seng Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(336,858)
344,800	Hang Seng Bank Ltd	Barclays Bank	(271,225)
59,400	Hang Seng Bank Ltd	Credit Suisse	(132,515)
(45,500)	Health & Happiness H&H International Holdings Ltd	Barclays Bank	(14,082)
(490,000)	Health & Happiness H&H International Holdings Ltd	Citibank	(151,649)
(181,500)	Health & Happiness H&H International Holdings Ltd	Credit Suisse	(4,681)
(7,000)	Health & Happiness H&H International Holdings Ltd	HSBC	(181)
(44,000)	Health & Happiness H&H International Holdings Ltd	JP Morgan	(1,135)
(64,000)	Henderson Land Development Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	18,157
(9,000)	Henderson Land Development Co Ltd	Barclays Bank	58
(77,000)	Henderson Land Development Co Ltd	Goldam Sachs	21,845
38,300	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	Bank of America Merrill Lynch	87,913
51,500	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	Barclays Bank	74,380
181,000	Hysan Development Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(49,015)
290,000	Hysan Development Co Ltd	Barclays Bank	(18,698)
278,000	Hysan Development Co Ltd	Goldam Sachs	(75,283)
110,500	Johnson Electric Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	16,244
75,000	Johnson Electric Holdings Ltd	Barclays Bank	3,869
87,000	Johnson Electric Holdings Ltd	Citibank	4,488
(89,000)	Kerry Logistics Network Ltd	Goldam Sachs	9,870
87,000	Kerry Properties Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(28,047)
330,000	Kerry Properties Ltd	Barclays Bank	(69,789)
59,000	Kerry Properties Ltd	Credit Suisse	(26,629)
270,500	Kerry Properties Ltd	Goldam Sachs	(87,205)
368,500	Lifestyle International Holdings Ltd	Citibank	(9,979)
380,000	Lifestyle International Holdings Ltd	Goldam Sachs	(29,401)
109,000	Lifestyle International Holdings Ltd	HSBC	(14,759)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	香港(続き)		
64,000	Lifestyle International Holdings Ltd	JP Morgan	(8,666)
(310,800)	MGM China Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(5,210)
(2,643,329)	MGM China Holdings Ltd	Citibank	(88,625)
(24,400)	MGM China Holdings Ltd	Credit Suisse	1,227
(668,000)	MGM China Holdings Ltd	Goldam Sachs	(11,198)
(303,200)	MGM China Holdings Ltd	JP Morgan	15,248
(216,000)	Minth Group Ltd	Barclays Bank	(29,247)
(685,750)	Minth Group Ltd	Citibank	(92,851)
(142,000)	Minth Group Ltd	Credit Suisse	(28,016)
(94,000)	Minth Group Ltd	Goldam Sachs	(18,304)
(322,000)	Minth Group Ltd	HSBC	(63,530)
(1,000,786)	Minth Group Ltd	JP Morgan	(197,453)
(36,500)	MTR Corp Ltd	Barclays Bank	4,236
(470,000)	New World Development Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	62,426
(1,038,000)	New World Development Co Ltd	Barclays Bank	26,771
(216,000)	New World Development Co Ltd	JP Morgan	36,210
(475,000)	NWS Holdings Ltd	Citibank	34,914
(2,360,000)	NWS Holdings Ltd	Goldam Sachs	349,979
(290,000)	NWS Holdings Ltd	HSBC	62,826
(50,000)	NWS Holdings Ltd	JP Morgan	10,832
1,110,000	PCCW Ltd	Barclays Bank	2,863
286,000	PCCW Ltd	Credit Suisse	(18,809)
948,000	PCCW Ltd	Goldam Sachs	(22,005)
749,000	PCCW Ltd	HSBC	(49,259)
(1,000)	PICC Property & Casualty Co Ltd 'H'	JP Morgan	68
27,000	Power Assets Holdings Ltd	Credit Suisse	(25,243)
552,500	Power Assets Holdings Ltd	Goldam Sachs	(520,101)
37,000	Power Assets Holdings Ltd	HSBC	(34,592)
48,000	Power Assets Holdings Ltd	JP Morgan	(44,876)
(94,400)	PRADA SpA	Bank of America Merrill Lynch	(52,345)
(827,500)	PRADA SpA	Barclays Bank	(320,126)
(162,700)	PRADA SpA	Citibank	(62,942)
(777,900)	PRADA SpA	Goldam Sachs	(431,345)
(521,500)	PRADA SpA	HSBC	(208,472)
(110,000)	PRADA SpA	JP Morgan	(43,973)
(11)	Semiconductor Manufacturing International Corp	JP Morgan	-
(632,000)	Shangri-La Asia Ltd	Goldam Sachs	(29,339)
(294,000)	Shangri-La Asia Ltd	JP Morgan	(12,890)
(145)	Shenzhen International Holdings Ltd	JP Morgan	41
528,000	Shun Tak Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	5,447
608,000	Shun Tak Holdings Ltd	Goldam Sachs	6,272
512,000	Sino Land Co Ltd	JP Morgan	(123,465)
(1)	Sisram Medical Ltd	JP Morgan	-
(167,000)	SJM Holdings Ltd	Barclays Bank	(12,060)
(1,620,000)	SJM Holdings Ltd	Citibank	(116,986)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
香港(続き)			
(1,507,000)	SJM Holdings Ltd	Goldam Sachs	(108,826)
(10,500)	Sun Hung Kai Properties Ltd	Bank of America Merrill Lynch	10,290
(18,500)	Sun Hung Kai Properties Ltd	HSBC	31,968
160,000	Swire Pacific Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(141,333)
198,000	Swire Pacific Ltd 'A'	Barclays Bank	(97,024)
307,500	Swire Pacific Ltd 'A'	Citibank	(150,682)
96,000	Swire Pacific Ltd 'A'	Credit Suisse	(116,214)
17,500	Swire Pacific Ltd 'A'	Goldam Sachs	(15,458)
250,000	Swire Pacific Ltd 'A'	HSBC	(302,889)
110,500	Swire Pacific Ltd 'A'	JP Morgan	(137,506)
50,000	Swire Pacific Ltd 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(5,029)
97,500	Swire Pacific Ltd 'B'	Credit Suisse	(15,465)
92,500	Swire Pacific Ltd 'B'	Goldam Sachs	(9,304)
(529,800)	Swire Properties Ltd	Bank of America Merrill Lynch	231,603
(600,800)	Swire Properties Ltd	Barclays Bank	71,277
(185,800)	Swire Properties Ltd	Citibank	22,043
(121,800)	Swire Properties Ltd	HSBC	62,523
(148,000)	Techtronic Industries Co Ltd	Barclays Bank	(23,856)
(326,000)	Vitasoy International Holdings Ltd	Barclays Bank	319,495
(64,000)	Vitasoy International Holdings Ltd	Goldam Sachs	30,124
25,700	VTech Holdings Ltd	Citibank	1,160
9,300	VTech Holdings Ltd	Credit Suisse	(11,693)
3,400	VTech Holdings Ltd	Goldam Sachs	(3,617)
55,400	VTech Holdings Ltd	JP Morgan	(69,654)
(1,214,000)	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	Citibank	(187,859)
42,000	Wheelock & Co Ltd	Barclays Bank	-
67,000	Wheelock & Co Ltd	Credit Suisse	(46,655)
21,000	Wheelock & Co Ltd	HSBC	(14,623)
(206,400)	Wynn Macau Ltd	Bank of America Merrill Lynch	15,437
(873,200)	Wynn Macau Ltd	Barclays Bank	22,520
(281,600)	Wynn Macau Ltd	Citibank	7,263
(1,600)	Xinyi Energy Holdings Ltd	Citibank	23
(170,000)	Xinyi Glass Holdings Ltd	Barclays Bank	1,315
(1,878,000)	Xinyi Glass Holdings Ltd	Citibank	14,530
(1,760,000)	Xinyi Glass Holdings Ltd	Goldam Sachs	65,818
99,500	Yue Yuen Industrial Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(18,476)
799,500	Yue Yuen Industrial Holdings Ltd	Barclays Bank	(78,355)
172,500	Yue Yuen Industrial Holdings Ltd	Credit Suisse	(49,540)
			<u>(5,575,766)</u>
イタリア			
369,763	A2A SpA	Bank of America Merrill Lynch	(3,289)
31,171	A2A SpA	JP Morgan	1,109
(39)	ASTM SpA	Bank of America Merrill Lynch	(75)
6	Autogrill SpA	Citibank	5
3	Autogrill SpA	JP Morgan	3

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)			
126,019	Buzzi Unicem SpA	Bank of America Merrill Lynch	324,394
10,742	Buzzi Unicem SpA	Citibank	12,781
67,011	Buzzi Unicem SpA	Goldam Sachs	172,497
2,506	Buzzi Unicem SpA - RSP	Credit Suisse	1,616
591	EXOR NV	Barclays Bank	1,827
187	EXOR NV	Citibank	578
614	EXOR NV	Deutsche Bank	3,933
206	EXOR NV	Goldam Sachs	1,319
28,790	Fiat Chrysler Automobiles NV	HSBC	18,046
41,620	Fiat Chrysler Automobiles NV	JP Morgan	20,511
83,922	Hera SpA	HSBC	23,329
(94,198)	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	Bank of America Merrill Lynch	36,137
(151,119)	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	Barclays Bank	15,963
(45,565)	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	Deutsche Bank	17,480
(11,981)	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	Goldam Sachs	4,596
321,207	Mediaset SpA	Bank of America Merrill Lynch	(50,003)
42,720	Mediaset SpA	Barclays Bank	4,275
892,218	Mediaset SpA	Citibank	89,289
409,663	Mediaset SpA	Credit Suisse	(105,226)
588,561	Mediaset SpA	HSBC	(151,178)
14,843	Mediaset SpA	JP Morgan	(3,813)
10,310	Moncler SpA	Deutsche Bank	31,183
640,390	Saipem SpA	Bank of America Merrill Lynch	(56,967)
1,744,004	Saipem SpA	Barclays Bank	40,724
82,172	Saipem SpA	Credit Suisse	(15,807)
233,650	Saipem SpA	Deutsche Bank	(20,785)
94,720	Saipem SpA	HSBC	(18,221)
106,177	Saipem SpA	JP Morgan	(20,425)
(7)	Tod ' s SpA	Citibank	(5)
(107,520)	UnipolSai Assicurazioni SpA	Goldam Sachs	22,955
			398,756
日本			
(24,600)	77 Bank Ltd	HSBC	(34,762)
7,500	ABC-Mart Inc	Credit Suisse	57,175
3,200	ABC-Mart Inc	JP Morgan	24,395
(206,400)	Acom Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(46,052)
(448,800)	Acom Co Ltd	Barclays Bank	(87,620)
(69,700)	Acom Co Ltd	Goldam Sachs	(15,552)
(40,400)	Acom Co Ltd	HSBC	(1,502)
(37,900)	Acom Co Ltd	JP Morgan	4,338
3,400	Advantest Corp	Bank of America Merrill Lynch	(316)
12,500	Advantest Corp	Goldam Sachs	(1,162)
78,700	Aeon Co Ltd	Barclays Bank	73,165
24,300	AEON Financial Service Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	40,890
87,700	AEON Financial Service Co Ltd	Barclays Bank	110,884

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
7,400	AEON Financial Service Co Ltd	Credit Suisse	9,563
126,700	AEON Financial Service Co Ltd	Goldam Sachs	213,199
15,400	AEON Financial Service Co Ltd	HSBC	19,901
800	AEON Financial Service Co Ltd	JP Morgan	1,034
(22,500)	Aeon Mall Co Ltd	Barclays Bank	(7,530)
(10,000)	Aeon Mall Co Ltd	Credit Suisse	(8,367)
(13,500)	Aeon Mall Co Ltd	Goldam Sachs	(3,640)
(13,400)	Aeon Mall Co Ltd	JP Morgan	(11,212)
66,500	AGC Inc	Bank of America Merrill Lynch	233,691
15,400	AGC Inc	Credit Suisse	54,834
5,800	AGC Inc	Goldam Sachs	20,382
22,300	AGC Inc	HSBC	79,402
(13,100)	Aica Kogyo Co Ltd	Barclays Bank	(18,268)
(30,200)	Ain Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(137,573)
(29,300)	Ain Holdings Inc	Goldam Sachs	(133,473)
(113,600)	Air Water Inc	Goldam Sachs	(49,637)
(36,900)	Aisin Seiki Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(108,060)
(16,100)	Aisin Seiki Co Ltd	Barclays Bank	(27,690)
(2,700)	Aisin Seiki Co Ltd	Citibank	(4,644)
(6,100)	Aisin Seiki Co Ltd	Credit Suisse	(18,998)
(4,900)	Aisin Seiki Co Ltd	Deutsche Bank	(14,349)
(4,600)	Aisin Seiki Co Ltd	Goldam Sachs	(13,471)
(35,200)	Aisin Seiki Co Ltd	HSBC	(109,627)
(9,000)	Aisin Seiki Co Ltd	JP Morgan	(28,030)
10,000	Ajinomoto Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,460)
91,300	Ajinomoto Co Inc	Goldam Sachs	(77,240)
12,900	Alfresa Holdings Corp	Barclays Bank	14,631
96,600	Alps Alpine Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	137,403
47,500	Alps Alpine Co Ltd	Citibank	53,874
16,400	Alps Alpine Co Ltd	Goldam Sachs	23,327
48,200	Alps Alpine Co Ltd	HSBC	80,658
43,900	Alps Alpine Co Ltd	JP Morgan	73,463
39,200	Amada Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(364)
164,000	Amada Co Ltd	Barclays Bank	118,923
34,400	Amada Co Ltd	Citibank	24,945
120,700	Amada Co Ltd	Credit Suisse	(14,587)
225,100	Amada Co Ltd	Goldam Sachs	(2,093)
3,700	Amada Co Ltd	HSBC	(447)
390,500	Amada Co Ltd	JP Morgan	(47,195)
81,400	Amano Corp	Bank of America Merrill Lynch	110,486
16,100	Amano Corp	Barclays Bank	12,274
12,000	Amano Corp	Credit Suisse	13,053
56,600	Amano Corp	Goldam Sachs	76,824
33,600	Amano Corp	HSBC	32,010
18,800	Amano Corp	JP Morgan	21,836

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(14,900)	ANA Holdings Inc	Barclays Bank	(28,050)
(6,400)	ANA Holdings Inc	Citibank	(12,049)
(267,900)	ANA Holdings Inc	Goldam Sachs	(709,817)
(52,600)	ANA Holdings Inc	JP Morgan	(201,960)
41,900	Anritsu Corp	Goldam Sachs	(23,761)
22,300	Anritsu Corp	HSBC	(18,120)
100,900	Aozora Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	208,244
7,000	Aozora Bank Ltd	Barclays Bank	12,365
7,400	Aozora Bank Ltd	Citibank	13,071
21,200	Aozora Bank Ltd	Credit Suisse	21,089
11,700	Aozora Bank Ltd	HSBC	8,772
14,900	Aozora Bank Ltd	JP Morgan	20,739
(4,500)	Ariake Japan Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(19,244)
(5,100)	Ariake Japan Co Ltd	Barclays Bank	(4,741)
(8,000)	Ariake Japan Co Ltd	Credit Suisse	(93,711)
(14,700)	Ariake Japan Co Ltd	Goldam Sachs	(62,864)
(33,600)	Ariake Japan Co Ltd	HSBC	(393,585)
(7,800)	Ariake Japan Co Ltd	JP Morgan	(91,368)
5,100	Asahi Group Holdings Ltd	Barclays Bank	18,254
37,600	Asahi Group Holdings Ltd	Goldam Sachs	144,367
(19,400)	Asahi Intecc Co Ltd	HSBC	(94,146)
(46,100)	Asahi Kasei Corp	Bank of America Merrill Lynch	(42,901)
(3,000)	Asahi Kasei Corp	Barclays Bank	(2,284)
(89,900)	Asahi Kasei Corp	Goldam Sachs	(83,661)
(16,800)	Asahi Kasei Corp	HSBC	(16,977)
(16,300)	Asahi Kasei Corp	JP Morgan	(16,472)
(58,900)	Asics Corp	Bank of America Merrill Lynch	(78,851)
(60,400)	Asics Corp	Barclays Bank	(41,553)
(18,700)	Asics Corp	Goldam Sachs	(25,034)
8,700	ASKUL Corp	Credit Suisse	(404)
13,600	ASKUL Corp	Goldam Sachs	(27,184)
96,200	Astellas Pharma Inc	Bank of America Merrill Lynch	166,795
9,900	Astellas Pharma Inc	Citibank	18,039
415,300	Astellas Pharma Inc	Credit Suisse	306,943
25,900	Astellas Pharma Inc	Goldam Sachs	44,906
30,900	Astellas Pharma Inc	HSBC	22,838
150,000	Astellas Pharma Inc	JP Morgan	110,863
226,900	Autobacs Seven Co Ltd	JP Morgan	40,079
127,600	Azbil Corp	Bank of America Merrill Lynch	24,911
9,000	Azbil Corp	Barclays Bank	4,686
45,700	Azbil Corp	Credit Suisse	(42,061)
68,100	Azbil Corp	Goldam Sachs	13,295
11,700	Azbil Corp	HSBC	(10,768)
(1,100)	Bank of Kyoto Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3,681)
(6,600)	Bank of Kyoto Ltd	Citibank	(11,351)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(7,700)	Bank of Kyoto Ltd	Credit Suisse	(15,391)
(15,900)	Bank of Kyoto Ltd	JP Morgan	(31,781)
(30,800)	Benefit One Inc	Barclays Bank	(35,506)
(72,600)	Benefit One Inc	Goldam Sachs	(154,561)
(28,600)	Benefit One Inc	HSBC	(103,402)
(49,400)	Benefit One Inc	JP Morgan	(192,429)
96,100	Benesse Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(123,291)
140,800	Benesse Holdings Inc	Barclays Bank	(304,991)
58,800	Benesse Holdings Inc	Goldam Sachs	(75,437)
(14,400)	Bic Camera Inc	Bank of America Merrill Lynch	(15,797)
(17,000)	Bic Camera Inc	Barclays Bank	(9,641)
(28,700)	Bic Camera Inc	HSBC	(30,603)
145,200	Bridgestone Corp	Barclays Bank	431,962
54,100	Bridgestone Corp	Citibank	160,945
88,800	Bridgestone Corp	Credit Suisse	226,200
47,700	Bridgestone Corp	Goldam Sachs	172,503
125,900	Brother Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	196,636
114,200	Brother Industries Ltd	Barclays Bank	146,512
75,500	Brother Industries Ltd	Citibank	96,862
129,600	Brother Industries Ltd	Credit Suisse	265,068
49,900	Brother Industries Ltd	Goldam Sachs	77,936
50,400	Brother Industries Ltd	HSBC	103,082
57,700	Brother Industries Ltd	JP Morgan	118,012
33,000	Calbee Inc	Bank of America Merrill Lynch	52,768
28,900	Calbee Inc	Barclays Bank	33,853
93,700	Calbee Inc	Goldam Sachs	149,829
(5,600)	Canon Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,566)
53,900	Canon Marketing Japan Inc	Bank of America Merrill Lynch	59,129
36,300	Canon Marketing Japan Inc	Citibank	47,583
43,000	Canon Marketing Japan Inc	Credit Suisse	23,985
6,200	Canon Marketing Japan Inc	HSBC	3,458
27,100	Canon Marketing Japan Inc	JP Morgan	15,116
(3,900)	Capcom Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(10,515)
(15,500)	Capcom Co Ltd	Goldam Sachs	(41,789)
(4,700)	Capcom Co Ltd	HSBC	(18,352)
(23,500)	Casio Computer Co Ltd	Barclays Bank	(55,492)
(7,500)	Casio Computer Co Ltd	Goldam Sachs	(19,802)
(41,000)	Casio Computer Co Ltd	JP Morgan	(85,244)
(400)	Central Japan Railway Co	Barclays Bank	(3,812)
(4,800)	Central Japan Railway Co	Goldam Sachs	(39,492)
61,200	Chiba Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	38,689
24,500	Chiba Bank Ltd	Credit Suisse	4,783
129,000	Chiba Bank Ltd	Goldam Sachs	81,551
13,100	Chiba Bank Ltd	JP Morgan	2,558
(175,600)	Chubu Electric Power Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(13,060)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
日本(続き)			
(95,200)	Chubu Electric Power Co Inc	Barclays Bank	(25,224)
600	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	15,535
18,200	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	Goldam Sachs	471,222
(78,100)	Chugoku Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(39,208)
(52,100)	Chugoku Bank Ltd	Barclays Bank	(18,406)
(103,500)	Chugoku Bank Ltd	Credit Suisse	25,017
(38,100)	Chugoku Bank Ltd	Goldam Sachs	(19,127)
(25,600)	Chugoku Electric Power Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(952)
(50,300)	Chugoku Electric Power Co Inc	Barclays Bank	3,273
100,900	Citizen Watch Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	40,336
264,800	Citizen Watch Co Ltd	Barclays Bank	71,391
155,600	Citizen Watch Co Ltd	Citibank	41,950
137,000	Citizen Watch Co Ltd	Credit Suisse	17,831
37,400	Citizen Watch Co Ltd	Goldam Sachs	14,951
161,600	Citizen Watch Co Ltd	JP Morgan	21,033
(44,400)	Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(113,513)
(36,900)	Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc	Citibank	(89,879)
(8,500)	Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc	HSBC	(13,908)
13,000	COMSYS Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,417)
13,000	COMSYS Holdings Corp	Goldam Sachs	(2,417)
(160,100)	Concordia Financial Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(59,536)
(22,100)	Concordia Financial Group Ltd	Barclays Bank	(8,013)
(49,600)	Concordia Financial Group Ltd	Credit Suisse	(12,911)
(117,000)	Concordia Financial Group Ltd	Goldam Sachs	(43,509)
3,800	Cosmos Pharmaceutical Corp	Bank of America Merrill Lynch	41,333
15,800	Cosmos Pharmaceutical Corp	Barclays Bank	69,037
1,000	Cosmos Pharmaceutical Corp	Citibank	4,369
4,800	Cosmos Pharmaceutical Corp	Goldam Sachs	52,210
(138,300)	Credit Saison Co Ltd	Barclays Bank	(191,574)
(13,500)	Credit Saison Co Ltd	JP Morgan	(10,500)
(27,100)	CyberAgent Inc	Bank of America Merrill Lynch	(137,308)
(67,300)	CyberAgent Inc	Barclays Bank	(100,107)
(15,200)	CyberAgent Inc	Goldam Sachs	(77,014)
21,200	Dai Nippon Printing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	72,923
44,200	Dai Nippon Printing Co Ltd	Goldam Sachs	152,038
32,100	Daicel Corp	Bank of America Merrill Lynch	15,518
53,500	Daicel Corp	Credit Suisse	23,377
23,700	Daicel Corp	Goldam Sachs	11,457
(12,800)	Daido Steel Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(25,585)
(13,600)	Daido Steel Co Ltd	Barclays Bank	(54,999)
(8,900)	Daido Steel Co Ltd	Citibank	(35,992)
(20,300)	Daido Steel Co Ltd	Credit Suisse	(28,308)
(8,600)	Daido Steel Co Ltd	Deutsche Bank	(17,190)
(5,200)	Daido Steel Co Ltd	JP Morgan	(7,251)
(16,600)	Daifuku Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(72,533)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(35,400)	Daifuku Co Ltd	Citibank	(36,201)
(48,400)	Daifuku Co Ltd	Credit Suisse	(409,464)
(2,100)	Daifuku Co Ltd	HSBC	(17,766)
(377,200)	Dai-ichi Life Holdings Inc	Goldam Sachs	(398,012)
(36,200)	Dai-ichi Life Holdings Inc	HSBC	(35,842)
(3,300)	Daiichi Sankyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(50,713)
(9,500)	Daiichi Sankyo Co Ltd	Barclays Bank	(133,626)
(3,700)	Daiichi Sankyo Co Ltd	Goldam Sachs	(56,860)
45,700	Daiichikosh Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	165,695
6,400	Daiichikosh Co Ltd	Barclays Bank	10,412
34,100	Daiichikosh Co Ltd	Credit Suisse	131,562
8,900	Daiichikosh Co Ltd	Goldam Sachs	32,269
21,500	Daiichikosh Co Ltd	HSBC	82,950
29,200	Daiichikosh Co Ltd	JP Morgan	108,278
1,600	Daikin Industries Ltd	Citibank	15,618
(3,300)	Daishi Hokuetsu Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,945)
(20,600)	Daishi Hokuetsu Financial Group Inc	Barclays Bank	(30,450)
(12,900)	Daishi Hokuetsu Financial Group Inc	Goldam Sachs	(11,513)
(11,800)	Daishi Hokuetsu Financial Group Inc	HSBC	(2,848)
(2,600)	Daito Trust Construction Co Ltd	Barclays Bank	(18,612)
(5,000)	Daito Trust Construction Co Ltd	Credit Suisse	(37,884)
(2,200)	Daito Trust Construction Co Ltd	Goldam Sachs	(20,044)
(41,100)	Daiwa House Industry Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(108,706)
(63,700)	Daiwa House Industry Co Ltd	Barclays Bank	(91,199)
(11,300)	Daiwa House Industry Co Ltd	Citibank	(16,178)
(5,800)	Daiwa House Industry Co Ltd	Credit Suisse	2,642
(34,600)	Daiwa House Industry Co Ltd	Goldam Sachs	(91,514)
(12,300)	Daiwa House Industry Co Ltd	HSBC	5,603
(4,800)	Daiwa House Industry Co Ltd	JP Morgan	2,187
(101,800)	Daiwa Securities Group Inc	Barclays Bank	(29,812)
(28,600)	Daiwa Securities Group Inc	Credit Suisse	(7,745)
(99,600)	Daiwa Securities Group Inc	JP Morgan	(13,611)
129,700	DeNA Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	94,051
53,300	DeNA Co Ltd	Barclays Bank	21,803
9,400	DeNA Co Ltd	Citibank	3,845
120,100	DeNA Co Ltd	Credit Suisse	193,160
79,500	DeNA Co Ltd	Goldam Sachs	57,649
32,100	DeNA Co Ltd	HSBC	51,627
27,400	Denka Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(9,934)
10,400	Denka Co Ltd	Barclays Bank	5,511
33,600	Denka Co Ltd	Citibank	17,805
18,100	Denka Co Ltd	Credit Suisse	(978)
17,700	Denka Co Ltd	JP Morgan	(471)
33,300	Denso Corp	Bank of America Merrill Lynch	125,380
100,200	Denso Corp	Barclays Bank	299,021

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
45,100	Denso Corp	Goldam Sachs	169,809
23,300	Dentsu Group Inc	Barclays Bank	137,549
32,800	Dentsu Group Inc	Citibank	193,632
22,100	Dentsu Group Inc	HSBC	131,698
7,000	Dentsu Group Inc	JP Morgan	38,849
2,500	DIC Corp	HSBC	9,554
(5,800)	Disco Corp	Bank of America Merrill Lynch	54,460
(4,300)	Disco Corp	Goldam Sachs	40,376
88,700	DMG Mori Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	124,517
119,000	DMG Mori Co Ltd	Barclays Bank	140,501
13,900	DMG Mori Co Ltd	Citibank	16,411
86,300	DMG Mori Co Ltd	Credit Suisse	143,613
445,000	DMG Mori Co Ltd	Goldam Sachs	624,692
50,100	DMG Mori Co Ltd	HSBC	83,372
76,300	DMG Mori Co Ltd	JP Morgan	126,972
32,100	East Japan Railway Co	Barclays Bank	182,039
4,100	East Japan Railway Co	Citibank	23,251
29,300	East Japan Railway Co	Goldam Sachs	161,529
7,900	East Japan Railway Co	HSBC	38,569
7,800	Ebara Corp	Bank of America Merrill Lynch	21,609
19,100	Ebara Corp	Barclays Bank	43,326
73,600	Ebara Corp	Goldam Sachs	203,903
5,300	Ebara Corp	HSBC	14,743
(9,400)	Eisai Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(85,991)
(5,200)	Eisai Co Ltd	Goldam Sachs	(47,569)
(87,500)	Electric Power Development Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(95,988)
(22,300)	Electric Power Development Co Ltd	Barclays Bank	(28,402)
(22,500)	Electric Power Development Co Ltd	Credit Suisse	(11,714)
(47,500)	Electric Power Development Co Ltd	Goldam Sachs	(52,108)
21,600	Ezaki Glico Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	22,089
10,700	Ezaki Glico Co Ltd	Barclays Bank	20,890
23,800	Ezaki Glico Co Ltd	Credit Suisse	89,611
23,100	Ezaki Glico Co Ltd	Goldam Sachs	23,623
1,000	Ezaki Glico Co Ltd	HSBC	3,765
(33,600)	FamilyMart Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(69,971)
(21,100)	FamilyMart Co Ltd	Barclays Bank	(40,409)
(44,000)	FamilyMart Co Ltd	Goldam Sachs	(91,628)
13,200	Fancl Corp	Barclays Bank	(1,841)
10,100	Fancl Corp	JP Morgan	2,112
(11,000)	FANUC Corp	Bank of America Merrill Lynch	(183,563)
(6,700)	FANUC Corp	Credit Suisse	(81,286)
(1,300)	FANUC Corp	HSBC	(15,772)
(700)	FANUC Corp	JP Morgan	(9,515)
(900)	Fast Retailing Co Ltd	Barclays Bank	(63,004)
(4,400)	Fast Retailing Co Ltd	Citibank	(308,018)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
日本(続き)			
(1,600)	Fast Retailing Co Ltd	Credit Suisse	(127,923)
(1,800)	Fast Retailing Co Ltd	Goldam Sachs	(158,639)
3,800	FP Corp	Goldam Sachs	4,946
2,700	FP Corp	HSBC	(6,526)
(7,300)	Fuji Electric Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(12,759)
(800)	Fuji Electric Co Ltd	Barclays Bank	(1,130)
(3,000)	Fuji Electric Co Ltd	Credit Suisse	(5,773)
(35,000)	Fuji Electric Co Ltd	Goldam Sachs	(61,172)
310,800	Fuji Media Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	288,942
218,900	Fuji Media Holdings Inc	Barclays Bank	122,103
131,300	Fuji Media Holdings Inc	Credit Suisse	(1,221)
105,300	Fuji Media Holdings Inc	Goldam Sachs	97,894
68,600	Fuji Media Holdings Inc	HSBC	(638)
28,600	Fuji Media Holdings Inc	JP Morgan	(266)
(48,500)	Fuji Oil Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(85,669)
(10,000)	Fuji Oil Holdings Inc	Barclays Bank	(17,292)
(18,300)	Fuji Oil Holdings Inc	Citibank	(31,644)
(51,100)	Fuji Oil Holdings Inc	Credit Suisse	(176,248)
(7,000)	Fuji Oil Holdings Inc	HSBC	(24,144)
(36,100)	Fuji Oil Holdings Inc	JP Morgan	(124,512)
8,800	Fuji Seal International Inc	Barclays Bank	20,371
9,500	Fuji Seal International Inc	Credit Suisse	32,678
43,700	Fuji Seal International Inc	Goldam Sachs	58,502
(6,300)	FUJIFILM Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	8,610
(5,200)	FUJIFILM Holdings Corp	Barclays Bank	(1,740)
(10,600)	FUJIFILM Holdings Corp	Goldam Sachs	14,486
258,400	Fujikura Ltd	Bank of America Merrill Lynch	36,034
178,100	Fujikura Ltd	Barclays Bank	(3,311)
487,300	Fujikura Ltd	Credit Suisse	49,833
198,100	Fujikura Ltd	Goldam Sachs	27,625
(98,900)	Fujitsu General Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(163,661)
(26,500)	Fujitsu General Ltd	Credit Suisse	(77,112)
(164,700)	Fujitsu General Ltd	Goldam Sachs	(272,548)
(80,200)	Fujitsu General Ltd	HSBC	(233,371)
(4,100)	Fujitsu General Ltd	JP Morgan	(11,930)
13,700	Fujitsu Ltd	Bank of America Merrill Lynch	86,608
300	Fujitsu Ltd	Barclays Bank	1,604
45,700	Fujitsu Ltd	Goldam Sachs	288,904
(59,500)	Fukuoka Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(114,503)
(78,500)	Fukuoka Financial Group Inc	Barclays Bank	(102,901)
(17,500)	Fukuoka Financial Group Inc	Credit Suisse	(29,122)
(43,100)	Fukuoka Financial Group Inc	Goldam Sachs	(82,942)
(17,100)	Fukuoka Financial Group Inc	HSBC	(28,456)
(27,800)	Fukuyama Transporting Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(71,073)
(3,800)	Fukuyama Transporting Co Ltd	Citibank	(8,832)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(17,900)	Fukuyama Transporting Co Ltd	Credit Suisse	26,626
53,700	Furukawa Electric Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	310,523
2,900	Furukawa Electric Co Ltd	Barclays Bank	4,637
34,100	Furukawa Electric Co Ltd	Goldam Sachs	197,185
7,300	Fuyo General Lease Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	37,326
300	Fuyo General Lease Co Ltd	Barclays Bank	1,116
9,800	Fuyo General Lease Co Ltd	Goldam Sachs	50,109
83,700	Glory Ltd	Bank of America Merrill Lynch	139,286
10,700	Glory Ltd	Barclays Bank	15,021
52,900	Glory Ltd	Citibank	74,261
53,700	Glory Ltd	Credit Suisse	54,916
15,700	Glory Ltd	HSBC	16,055
40,300	Glory Ltd	JP Morgan	41,212
(25,300)	GMO internet Inc	Bank of America Merrill Lynch	(46,336)
(5,100)	GMO internet Inc	JP Morgan	(4,898)
(20,200)	GMO Payment Gateway Inc	Bank of America Merrill Lynch	(200,939)
(23,300)	GMO Payment Gateway Inc	Barclays Bank	(60,652)
(5,900)	GMO Payment Gateway Inc	Goldam Sachs	(58,690)
(9,400)	GMO Payment Gateway Inc	JP Morgan	(203,616)
(4,600)	Goldwin Inc	Credit Suisse	(52,057)
(2,200)	Goldwin Inc	JP Morgan	(24,952)
33,300	GS Yuasa Corp	Bank of America Merrill Lynch	89,469
310,000	GS Yuasa Corp	Credit Suisse	1,083,624
38,500	GS Yuasa Corp	Goldam Sachs	103,440
10,600	GungHo Online Entertainment Inc	Bank of America Merrill Lynch	5,026
29,900	GungHo Online Entertainment Inc	Barclays Bank	2,502
8,900	GungHo Online Entertainment Inc	Citibank	745
33,600	GungHo Online Entertainment Inc	Goldam Sachs	15,931
(130,200)	Gunma Bank Ltd	Barclays Bank	(48,417)
(68,400)	Gunma Bank Ltd	Credit Suisse	(2,544)
47,700	H2O Retailing Corp	Goldam Sachs	19,955
20,300	H2O Retailing Corp	JP Morgan	8,681
(53,100)	Hachijuni Bank Ltd	Credit Suisse	(17,278)
(76,100)	Hachijuni Bank Ltd	Deutsche Bank	(36,081)
(59,300)	Hachijuni Bank Ltd	JP Morgan	(19,295)
48,900	Hakuhodo DY Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	103,196
54,100	Hakuhodo DY Holdings Inc	Barclays Bank	99,081
31,300	Hakuhodo DY Holdings Inc	Citibank	57,324
14,900	Hakuhodo DY Holdings Inc	Credit Suisse	24,657
25,600	Hakuhodo DY Holdings Inc	Goldam Sachs	54,025
14,300	Hakuhodo DY Holdings Inc	HSBC	23,664
12,700	Hakuhodo DY Holdings Inc	JP Morgan	21,016
(3,300)	Hamamatsu Photonics KK	Barclays Bank	(9,357)
(2,600)	Hamamatsu Photonics KK	HSBC	(2,319)
62,100	Hankyu Hanshin Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	158,764

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
80,200	Hankyu Hanshin Holdings Inc	Barclays Bank	130,479
24,200	Hankyu Hanshin Holdings Inc	Credit Suisse	50,621
39,400	Hankyu Hanshin Holdings Inc	Goldam Sachs	100,730
1,400	Hankyu Hanshin Holdings Inc	JP Morgan	2,928
(27,200)	Haseko Corp	Bank of America Merrill Lynch	(41,218)
(340,300)	Haseko Corp	Barclays Bank	(221,457)
(42,200)	Haseko Corp	Citibank	(27,462)
(26,400)	Haseko Corp	Credit Suisse	(32,888)
(29,200)	Haseko Corp	Goldam Sachs	(44,249)
(52,500)	Haseko Corp	HSBC	(65,402)
(40,900)	Heiwa Corp	Bank of America Merrill Lynch	4,183
(15,100)	Heiwa Corp	Barclays Bank	(702)
(17,900)	Heiwa Corp	Credit Suisse	6,490
(78,900)	Heiwa Corp	Goldam Sachs	8,069
(19,100)	Heiwa Corp	JP Morgan	6,925
(1,800)	Hikari Tsushin Inc	Bank of America Merrill Lynch	(31,962)
(5,900)	Hikari Tsushin Inc	Goldam Sachs	(104,765)
(1,400)	Hikari Tsushin Inc	HSBC	(18,612)
99,100	Hino Motors Ltd	Bank of America Merrill Lynch	105,029
60,500	Hino Motors Ltd	Barclays Bank	38,809
2,700	Hino Motors Ltd	Credit Suisse	1,933
162,100	Hino Motors Ltd	Goldam Sachs	171,798
57,600	Hino Motors Ltd	HSBC	41,233
55,200	Hino Motors Ltd	JP Morgan	39,515
(51,300)	Hiroshima Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(28,138)
(47,400)	Hiroshima Bank Ltd	Barclays Bank	(24,237)
(117,100)	Hiroshima Bank Ltd	Citibank	(59,875)
(45,300)	Hiroshima Bank Ltd	Credit Suisse	(26,532)
(51,700)	Hiroshima Bank Ltd	Deutsche Bank	(28,358)
(223,600)	Hiroshima Bank Ltd	Goldam Sachs	(122,646)
(44,500)	Hiroshima Bank Ltd	JP Morgan	(26,063)
28,400	HIS Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	93,993
113,700	HIS Co Ltd	Barclays Bank	88,791
17,500	HIS Co Ltd	Citibank	13,666
13,700	HIS Co Ltd	Credit Suisse	63,682
5,900	HIS Co Ltd	Goldam Sachs	19,527
16,400	HIS Co Ltd	HSBC	76,233
4,900	Hisamitsu Pharmaceutical Co Inc	Barclays Bank	22,549
3,500	Hisamitsu Pharmaceutical Co Inc	Goldam Sachs	16,920
14,100	Hitachi Capital Corp	Bank of America Merrill Lynch	42,340
13,200	Hitachi Capital Corp	Barclays Bank	29,575
17,600	Hitachi Chemical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	-
(61,300)	Hitachi Construction Machinery Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(185,214)
(81,100)	Hitachi Construction Machinery Co Ltd	Goldam Sachs	(245,038)
(100,200)	Hitachi Construction Machinery Co Ltd	HSBC	(272,007)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
19,700	Hitachi Ltd	Bank of America Merrill Lynch	67,031
3,800	Hitachi Ltd	Barclays Bank	9,009
12,600	Hitachi Ltd	Credit Suisse	29,285
18,400	Hitachi Ltd	Goldam Sachs	62,608
8,500	Hitachi Ltd	HSBC	19,755
(31,000)	Hitachi Metals Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(64,845)
(14,900)	Hitachi Metals Ltd	Barclays Bank	(24,380)
10,400	Hitachi Transport System Ltd	Barclays Bank	20,497
29,400	Hitachi Transport System Ltd	Citibank	57,944
14,800	Hitachi Transport System Ltd	Credit Suisse	50,083
15,200	Hitachi Transport System Ltd	HSBC	51,437
12,800	Hitachi Transport System Ltd	JP Morgan	43,315
(36,800)	Hokuriku Electric Power Co	Bank of America Merrill Lynch	-
(41,900)	Hokuriku Electric Power Co	Barclays Bank	(7,012)
(19,200)	Hokuriku Electric Power Co	Goldam Sachs	-
(6,200)	Honda Motor Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(19,079)
(31,200)	Honda Motor Co Ltd	Goldam Sachs	(96,009)
(3,300)	Honda Motor Co Ltd	JP Morgan	(7,547)
5,200	Horiba Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(8,702)
5,000	Horiba Ltd	Barclays Bank	7,902
4,400	Horiba Ltd	Citibank	6,954
7,100	Horiba Ltd	Credit Suisse	(9,026)
6,800	Horiba Ltd	Goldam Sachs	(11,379)
18,100	Horiba Ltd	HSBC	(22,738)
11,600	Horiba Ltd	JP Morgan	(12,941)
(2,500)	Hoshizaki Corp	Bank of America Merrill Lynch	(14,642)
(11,400)	Hoshizaki Corp	Barclays Bank	(20,137)
(3,600)	Hoshizaki Corp	Goldam Sachs	(21,085)
55,700	House Foods Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	36,248
58,100	House Foods Group Inc	Barclays Bank	86,422
32,300	House Foods Group Inc	Credit Suisse	60,057
41,900	House Foods Group Inc	Goldam Sachs	27,267
19,900	House Foods Group Inc	HSBC	11,220
13,600	Hoya Corp	Bank of America Merrill Lynch	54,620
15,300	Hoya Corp	Credit Suisse	33,853
5,600	Hoya Corp	Goldam Sachs	22,491
2,600	Hoya Corp	HSBC	5,753
(35,200)	Hulic Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(31,415)
(69,800)	Hulic Co Ltd	Barclays Bank	(45,424)
(31,200)	Hulic Co Ltd	HSBC	(20,014)
(9,800)	Ibiden Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	11,115
(132,600)	Ibiden Co Ltd	HSBC	72,732
(287,200)	Ichigo Inc	Bank of America Merrill Lynch	(80,100)
(495,100)	Ichigo Inc	Barclays Bank	(73,645)
(38,200)	Ichigo Inc	Citibank	(5,682)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(155,200)	Ichigo Inc	Credit Suisse	(47,614)
(53,000)	Ichigo Inc	HSBC	(16,260)
(65,500)	Idemitsu Kosan Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	34,100
(45,300)	Idemitsu Kosan Co Ltd	Barclays Bank	45,483
(21,200)	Idemitsu Kosan Co Ltd	Credit Suisse	10,446
(35,500)	Idemitsu Kosan Co Ltd	Goldam Sachs	18,482
(38,500)	Idemitsu Kosan Co Ltd	HSBC	18,970
(38,000)	IHI Corp	Bank of America Merrill Lynch	(103,510)
(40,400)	IHI Corp	Barclays Bank	(78,498)
(175,400)	Iida Group Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(344,065)
(82,800)	Iida Group Holdings Co Ltd	Barclays Bank	(126,242)
(30,800)	Iida Group Holdings Co Ltd	Citibank	(46,960)
(210,200)	Iida Group Holdings Co Ltd	Credit Suisse	(328,300)
(174,900)	Iida Group Holdings Co Ltd	Goldam Sachs	(343,085)
(71,100)	Iida Group Holdings Co Ltd	JP Morgan	(111,047)
83,900	Inpex Corp	Bank of America Merrill Lynch	53,742
114,600	Inpex Corp	Barclays Bank	31,003
36,300	Inpex Corp	Citibank	9,820
23,000	Inpex Corp	Credit Suisse	17,946
76,400	Inpex Corp	Goldam Sachs	48,937
69,000	Inpex Corp	HSBC	37,654
(31,400)	Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(21,018)
(357,500)	Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd	Barclays Bank	(169,502)
(73,100)	Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd	Credit Suisse	(62,594)
(89,100)	Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd	Goldam Sachs	(59,640)
(277,900)	Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd	JP Morgan	(222,186)
(179,900)	Isuzu Motors Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(252,042)
(136,200)	Isuzu Motors Ltd	Barclays Bank	(162,835)
(98,000)	Isuzu Motors Ltd	Goldam Sachs	(137,299)
53,700	Ito En Ltd	Bank of America Merrill Lynch	59,908
300	Ito En Ltd	Barclays Bank	446
45,500	Ito En Ltd	Citibank	67,680
26,000	Ito En Ltd	Credit Suisse	36,257
5,800	Ito En Ltd	JP Morgan	8,088
(15,700)	ITOCHU Corp	Bank of America Merrill Lynch	(18,975)
(70,700)	ITOCHU Corp	Citibank	(69,014)
(20,500)	ITOCHU Corp	Goldam Sachs	(24,776)
(24,600)	Itochu Techno-Solutions Corp	Barclays Bank	(19,439)
(12,100)	Itoham Yonekyu Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,387)
(54,600)	Itoham Yonekyu Holdings Inc	JP Morgan	(22,334)
(203,500)	Iyo Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(75,675)
(72,500)	Iyo Bank Ltd	Barclays Bank	(20,220)
(1,400)	Iyo Bank Ltd	Citibank	(390)
(106,200)	Iyo Bank Ltd	Credit Suisse	(23,695)
(120,400)	Iyo Bank Ltd	Goldam Sachs	(44,773)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(27,000)	Iyo Bank Ltd	JP Morgan	(6,024)
10,200	Izumi Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	18,017
52,600	Izumi Co Ltd	Barclays Bank	90,466
9,400	Izumi Co Ltd	Citibank	16,167
14,500	Izumi Co Ltd	Credit Suisse	25,612
51,000	Izumi Co Ltd	Goldam Sachs	90,085
5,700	Izumi Co Ltd	HSBC	10,068
(80,800)	J Front Retailing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(41,315)
(40,500)	J Front Retailing Co Ltd	Barclays Bank	(25,227)
(156,400)	Japan Airlines Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(451,468)
(79,500)	Japan Airlines Co Ltd	Barclays Bank	(170,360)
(39,800)	Japan Airlines Co Ltd	Citibank	(85,287)
(312,000)	Japan Airlines Co Ltd	Credit Suisse	(942,686)
(56,800)	Japan Airlines Co Ltd	Goldam Sachs	(163,960)
(13,900)	Japan Airport Terminal Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(93,041)
(30,800)	Japan Airport Terminal Co Ltd	Barclays Bank	(171,803)
(32,600)	Japan Airport Terminal Co Ltd	Goldam Sachs	(218,212)
(23,600)	Japan Airport Terminal Co Ltd	HSBC	(174,425)
(26,400)	Japan Airport Terminal Co Ltd	JP Morgan	(189,904)
10,800	Japan Aviation Electronics Industry Ltd	Bank of America Merrill Lynch	11,848
48,200	Japan Aviation Electronics Industry Ltd	Barclays Bank	44,810
12,900	Japan Aviation Electronics Industry Ltd	Citibank	11,993
23,000	Japan Aviation Electronics Industry Ltd	Credit Suisse	13,360
26,400	Japan Aviation Electronics Industry Ltd	HSBC	15,953
29,200	Japan Exchange Group Inc	Credit Suisse	53,478
12,200	Japan Exchange Group Inc	JP Morgan	22,344
99,300	Japan Petroleum Exploration Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	89,547
42,400	Japan Petroleum Exploration Co Ltd	Credit Suisse	55,579
148,600	Japan Petroleum Exploration Co Ltd	Goldam Sachs	134,005
5,100	Japan Petroleum Exploration Co Ltd	HSBC	6,685
(180,800)	Japan Post Bank Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	258,850
(34,400)	Japan Post Bank Co Ltd	Barclays Bank	(5,437)
(31,800)	Japan Post Bank Co Ltd	Citibank	(5,026)
(52,900)	Japan Post Bank Co Ltd	Credit Suisse	59,015
(93,100)	Japan Post Bank Co Ltd	Goldam Sachs	133,291
(71,600)	Japan Post Bank Co Ltd	HSBC	79,877
(72,900)	Japan Post Holdings Co Ltd	Barclays Bank	(26,499)
(315,100)	Japan Post Holdings Co Ltd	Goldam Sachs	154,379
(47,600)	Japan Post Holdings Co Ltd	HSBC	13,276
(15,300)	Japan Post Insurance Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(12,090)
(58,400)	Japan Post Insurance Co Ltd	Barclays Bank	(39,634)
(23,300)	Japan Post Insurance Co Ltd	JP Morgan	(13,931)
(31,800)	Japan Steel Works Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(80,117)
(32,700)	Japan Steel Works Ltd	Barclays Bank	(78,433)
(11,800)	Japan Steel Works Ltd	Citibank	(28,303)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(54,200)	Japan Steel Works Ltd	Credit Suisse	(125,970)
(41,600)	Japan Steel Works Ltd	Goldam Sachs	(104,807)
(45,000)	Japan Steel Works Ltd	HSBC	(104,588)
(67,000)	Japan Tobacco Inc	Bank of America Merrill Lynch	(79,729)
(36,700)	Japan Tobacco Inc	Barclays Bank	(44,866)
(6,100)	JCR Pharmaceuticals Co Ltd	Barclays Bank	(28,922)
(41,600)	JCR Pharmaceuticals Co Ltd	Goldam Sachs	(324,864)
(249,700)	JFE Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(222,853)
(207,500)	JFE Holdings Inc	Barclays Bank	(171,687)
(26,400)	JFE Holdings Inc	Credit Suisse	(20,862)
(19,200)	JFE Holdings Inc	Goldam Sachs	(17,136)
(33,300)	JFE Holdings Inc	HSBC	(26,314)
(12,600)	JFE Holdings Inc	JP Morgan	(9,957)
15,700	JGC Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	21,456
105,800	JGC Holdings Corp	Goldam Sachs	144,588
8,100	JSR Corp	HSBC	10,911
121,600	JTEKT Corp	Bank of America Merrill Lynch	123,222
17,900	JTEKT Corp	Barclays Bank	17,140
73,000	JTEKT Corp	Citibank	69,902
52,000	JTEKT Corp	Credit Suisse	53,177
21,300	JTEKT Corp	Deutsche Bank	21,584
14,100	JTEKT Corp	Goldam Sachs	14,288
16,400	JTEKT Corp	HSBC	16,771
48,500	JTEKT Corp	JP Morgan	49,598
(1,200)	Justsystems Corp	Barclays Bank	(2,789)
(9,000)	Justsystems Corp	HSBC	(27,611)
658,000	JXTG Holdings Inc	Barclays Bank	87,476
48,400	JXTG Holdings Inc	Citibank	6,434
252,900	JXTG Holdings Inc	Goldam Sachs	86,287
79,900	JXTG Holdings Inc	JP Morgan	21,118
7,800	Kagome Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	18,201
700	Kagome Co Ltd	Barclays Bank	1,028
39,900	Kagome Co Ltd	Goldam Sachs	93,106
(49,800)	Kajima Corp	Bank of America Merrill Lynch	(17,130)
(203,900)	Kajima Corp	Barclays Bank	(100,467)
(436,300)	Kajima Corp	Credit Suisse	(287,987)
(400,000)	Kajima Corp	Goldam Sachs	(137,591)
9,700	Kakaku.com Inc	Credit Suisse	10,587
7,200	Kakaku.com Inc	Goldam Sachs	12,718
40,100	Kaken Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	123,023
23,200	Kaken Pharmaceutical Co Ltd	Citibank	38,823
7,400	Kaken Pharmaceutical Co Ltd	Credit Suisse	12,383
12,400	Kaken Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	20,750
83,200	Kamigumi Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	123,758
21,000	Kamigumi Co Ltd	Barclays Bank	38,070

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
5,400	Kamigumi Co Ltd	Citibank	9,789
9,100	Kamigumi Co Ltd	Credit Suisse	15,989
147,600	Kamigumi Co Ltd	Goldam Sachs	219,551
34,700	Kamigumi Co Ltd	HSBC	60,971
24,200	Kamigumi Co Ltd	JP Morgan	42,521
208,600	Kandenko Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	151,265
92,000	Kandenko Co Ltd	Barclays Bank	23,948
147,000	Kandenko Co Ltd	Goldam Sachs	106,596
169,800	Kaneka Corp	Citibank	228,894
(105,400)	Kansai Electric Power Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(68,591)
(305,200)	Kansai Electric Power Co Inc	Barclays Bank	(103,563)
(9,200)	Kansai Electric Power Co Inc	Credit Suisse	(1,711)
(57,500)	Kansai Electric Power Co Inc	Goldam Sachs	(37,419)
(19,600)	Kansai Electric Power Co Inc	HSBC	(3,644)
(68,200)	Kansai Mirai Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(34,872)
(92,500)	Kansai Mirai Financial Group Inc	Barclays Bank	(41,277)
(39,700)	Kansai Mirai Financial Group Inc	HSBC	(16,978)
(79,800)	Kansai Mirai Financial Group Inc	JP Morgan	(34,126)
(33,000)	Kansai Paint Co Ltd	Credit Suisse	(56,756)
(21,800)	Kansai Paint Co Ltd	JP Morgan	(37,494)
4,900	Kao Corp	Barclays Bank	3,462
13,600	Kao Corp	Goldam Sachs	(11,632)
(111,500)	Kawasaki Heavy Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(204,207)
(159,500)	Kawasaki Heavy Industries Ltd	Barclays Bank	(209,078)
(10,400)	Kawasaki Heavy Industries Ltd	Credit Suisse	(10,345)
(89,800)	Kawasaki Heavy Industries Ltd	Goldam Sachs	(164,464)
(7,700)	Kawasaki Heavy Industries Ltd	HSBC	(11,394)
(321,201)	Kawasaki Kisen Kaisha Ltd	Credit Suisse	(262,778)
(112,200)	Kawasaki Kisen Kaisha Ltd	JP Morgan	(91,792)
10,100	KDDI Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,723)
13,500	KDDI Corp	Barclays Bank	7,656
8,400	KDDI Corp	Credit Suisse	(2,263)
6,700	KDDI Corp	HSBC	(2,429)
8,400	KDDI Corp	JP Morgan	(3,046)
(5,500)	Keihan Holdings Co Ltd	Citibank	(6,903)
(32,900)	Keihan Holdings Co Ltd	Credit Suisse	(103,993)
51,700	Keikyu Corp	Bank of America Merrill Lynch	56,715
10,200	Keikyu Corp	Barclays Bank	5,784
40,200	Keikyu Corp	Goldam Sachs	44,100
(3,900)	Keio Corp	Bank of America Merrill Lynch	(17,766)
(3,200)	Keio Corp	Barclays Bank	(10,115)
(8,300)	Keio Corp	Citibank	(26,235)
(23,500)	Keio Corp	Credit Suisse	(172,593)
(3,000)	Keio Corp	Goldam Sachs	(13,666)
(31,000)	Keio Corp	JP Morgan	(227,676)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(26,700)	Keisei Electric Railway Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(84,395)
85,200	Kewpie Corp	Bank of America Merrill Lynch	30,891
34,100	Kewpie Corp	Barclays Bank	14,583
23,600	Kewpie Corp	Citibank	10,093
21,700	Kewpie Corp	Credit Suisse	5,043
100,100	Kewpie Corp	Goldam Sachs	36,293
39,000	Kewpie Corp	HSBC	9,064
(1,600)	Keyence Corp	Bank of America Merrill Lynch	(81,514)
(2,300)	Keyence Corp	Citibank	(90,875)
(7,900)	Keyence Corp	HSBC	(356,938)
(400)	Keyence Corp	JP Morgan	(18,073)
(15,700)	Kikkoman Corp	Bank of America Merrill Lynch	(80,277)
(23,600)	Kikkoman Corp	Barclays Bank	(78,985)
(12,100)	Kikkoman Corp	Goldam Sachs	(61,870)
73,500	Kinden Corp	Bank of America Merrill Lynch	57,398
37,100	Kinden Corp	Barclays Bank	10,002
11,100	Kinden Corp	Citibank	2,993
76,000	Kinden Corp	Credit Suisse	16,957
53,600	Kinden Corp	Goldam Sachs	41,857
109,200	Kinden Corp	JP Morgan	24,365
(27,600)	Kirin Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(53,755)
(1,400)	Kirin Holdings Co Ltd	Barclays Bank	(2,252)
(122,800)	Kirin Holdings Co Ltd	Goldam Sachs	(239,173)
9,600	Kissei Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	24,365
5,700	Kissei Pharmaceutical Co Ltd	Barclays Bank	12,294
9,600	Kissei Pharmaceutical Co Ltd	Citibank	20,706
4,400	Kissei Pharmaceutical Co Ltd	Credit Suisse	3,681
1,800	Kissei Pharmaceutical Co Ltd	Deutsche Bank	4,568
19,100	Kissei Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	15,981
(3,900)	Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	7,251
(5,000)	Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd	Barclays Bank	(930)
(1,100)	Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd	Citibank	(205)
(22,400)	Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd	Goldam Sachs	41,649
(2,600)	Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd	HSBC	9,185
(5,900)	Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	20,843
(92,000)	Kobe Bussan Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(517,455)
(4,100)	Kobe Bussan Co Ltd	Barclays Bank	(16,771)
(9,500)	Kobe Bussan Co Ltd	HSBC	(29,145)
29,100	Kobe Steel Ltd	Barclays Bank	7,034
31,300	Kobe Steel Ltd	Goldam Sachs	7,566
75,600	Kobe Steel Ltd	JP Morgan	35,142
(55,000)	Koei Tecmo Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(15,340)
(98,100)	Koei Tecmo Holdings Co Ltd	Barclays Bank	(4,560)
(500)	Koei Tecmo Holdings Co Ltd	Goldam Sachs	(139)
(16,000)	Koei Tecmo Holdings Co Ltd	HSBC	(18,147)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(6,100)	Koei Tecmo Holdings Co Ltd	JP Morgan	(6,919)
(3,100)	Koito Manufacturing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(14,842)
(12,900)	Koito Manufacturing Co Ltd	Barclays Bank	(34,779)
84,700	Kokuyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	97,641
23,500	Kokuyo Co Ltd	Barclays Bank	13,764
1,500	Kokuyo Co Ltd	Citibank	879
255,600	Kokuyo Co Ltd	Goldam Sachs	294,653
3,500	Kokuyo Co Ltd	JP Morgan	3,156
(18,900)	Komatsu Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(24,599)
(69,500)	Komatsu Ltd	Barclays Bank	(66,874)
(6,900)	Komatsu Ltd	Citibank	(6,639)
(107,200)	Komatsu Ltd	Credit Suisse	(145,006)
(10,800)	Komatsu Ltd	Goldam Sachs	(14,057)
(61,600)	Komatsu Ltd	HSBC	(83,325)
(89,600)	Komatsu Ltd	JP Morgan	(121,199)
(13,000)	Konami Holdings Corp	Barclays Bank	(29,610)
(56,400)	Konami Holdings Corp	Goldam Sachs	(207,112)
(37,500)	Konica Minolta Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10,807)
(165,100)	Konica Minolta Inc	Barclays Bank	(41,442)
(60,900)	Konica Minolta Inc	Citibank	(15,287)
(66,200)	Konica Minolta Inc	Credit Suisse	(6,154)
(69,300)	Konica Minolta Inc	Goldam Sachs	(19,972)
(8,800)	Kose Corp	Bank of America Merrill Lynch	(17,180)
(7,800)	Kose Corp	Barclays Bank	(44,959)
(3,600)	Kose Corp	Credit Suisse	(13,053)
(7,100)	Kose Corp	Goldam Sachs	(13,861)
(6,500)	Kotobuki Spirits Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(28,401)
(2,800)	Kotobuki Spirits Co Ltd	Barclays Bank	(6,898)
(4,700)	Kotobuki Spirits Co Ltd	Goldam Sachs	(20,536)
31,400	K's Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	36,490
12,500	K's Holdings Corp	Barclays Bank	6,973
28,300	K's Holdings Corp	Credit Suisse	49,725
100,000	K's Holdings Corp	Goldam Sachs	116,209
12,600	K's Holdings Corp	HSBC	22,139
30,700	K's Holdings Corp	JP Morgan	53,942
(265,800)	Kubota Corp	Bank of America Merrill Lynch	(144,557)
(42,700)	Kubota Corp	Barclays Bank	(22,230)
22,400	Kuraray Co Ltd	Barclays Bank	12,911
13,000	Kuraray Co Ltd	Credit Suisse	6,043
15,200	Kuraray Co Ltd	HSBC	3,268
(29,900)	Kusuri no Aoki Holdings Co Ltd	Goldam Sachs	(127,867)
13,800	Kyocera Corp	Bank of America Merrill Lynch	16,807
42,400	Kyocera Corp	Barclays Bank	109,976
2,700	Kyocera Corp	Citibank	7,003
13,400	Kyocera Corp	Goldam Sachs	16,319

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
10,500	Kyocera Corp	HSBC	2,733
3,700	Kyocera Corp	JP Morgan	963
(25,800)	Kyoritsu Maintenance Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(128,802)
(6,800)	Kyoritsu Maintenance Co Ltd	Barclays Bank	(7,902)
(3,300)	Kyoritsu Maintenance Co Ltd	Citibank	(3,835)
(68,600)	Kyoritsu Maintenance Co Ltd	Credit Suisse	(358,418)
(41,900)	Kyoritsu Maintenance Co Ltd	JP Morgan	(218,917)
(41,700)	Kyowa Exeo Corp	Bank of America Merrill Lynch	15,507
(45,600)	Kyowa Exeo Corp	Barclays Bank	(27,555)
(54,900)	Kyowa Exeo Corp	Goldam Sachs	20,416
(30,200)	Kyowa Exeo Corp	HSBC	59,802
(7,400)	Kyowa Exeo Corp	JP Morgan	14,653
29,700	Kyowa Kirin Co Ltd	Barclays Bank	55,775
300	Kyowa Kirin Co Ltd	Citibank	563
118,100	Kyowa Kirin Co Ltd	Goldam Sachs	372,202
17,000	Kyowa Kirin Co Ltd	JP Morgan	48,678
(11,600)	Kyudenko Corp	Bank of America Merrill Lynch	(8,412)
(7,200)	Kyudenko Corp	Barclays Bank	(6,158)
(17,600)	Kyudenko Corp	Goldam Sachs	(12,763)
(4,100)	Kyudenko Corp	JP Morgan	(1,279)
(214,000)	Kyushu Electric Power Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(71,622)
(187,000)	Kyushu Electric Power Co Inc	Barclays Bank	(88,663)
(121,100)	Kyushu Electric Power Co Inc	Credit Suisse	(31,523)
(399,800)	Kyushu Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(141,239)
(271,700)	Kyushu Financial Group Inc	Barclays Bank	(53,044)
(150,700)	Kyushu Financial Group Inc	Credit Suisse	(25,218)
(363,400)	Kyushu Financial Group Inc	Goldam Sachs	(128,380)
(100,100)	Kyushu Financial Group Inc	HSBC	(16,751)
(60,000)	Kyushu Financial Group Inc	JP Morgan	(10,040)
(54,600)	Kyushu Railway Co	Bank of America Merrill Lynch	(72,079)
(14,900)	Kyushu Railway Co	Credit Suisse	(25,211)
(49,400)	Kyushu Railway Co	HSBC	(83,585)
(61,200)	Lasertec Corp	Barclays Bank	(278,790)
51,600	Lawson Inc	Bank of America Merrill Lynch	239,855
73,500	Lawson Inc	Barclays Bank	239,158
30,600	Lawson Inc	Goldam Sachs	142,240
(55)	LINE Corp	Bank of America Merrill Lynch	(31)
(3,900)	LINE Corp	Credit Suisse	(3,263)
(20,848)	LINE Corp	JP Morgan	(17,444)
68,200	Lintec Corp	Bank of America Merrill Lynch	98,909
23,300	Lintec Corp	Credit Suisse	40,073
82,200	Lintec Corp	HSBC	141,375
24,300	Lintec Corp	JP Morgan	41,793
5,300	Lion Corp	Credit Suisse	5,415
163,900	LIXIL Group Corp	Bank of America Merrill Lynch	281,890

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
8,800	LIXIL Group Corp	Barclays Bank	8,508
20,000	LIXIL Group Corp	Credit Suisse	22,684
68,000	LIXIL Group Corp	Goldam Sachs	116,953
26,600	LIXIL Group Corp	HSBC	30,170
9,000	LIXIL Group Corp	JP Morgan	10,208
(26,500)	M3 Inc	Barclays Bank	(56,663)
(100)	M3 Inc	Goldam Sachs	(535)
(66,100)	M3 Inc	HSBC	(251,950)
34,400	Mabuchi Motor Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	121,527
15,000	Mabuchi Motor Co Ltd	Barclays Bank	50,202
20,900	Mabuchi Motor Co Ltd	Citibank	69,948
5,400	Mabuchi Motor Co Ltd	Credit Suisse	14,057
2,400	Mabuchi Motor Co Ltd	Deutsche Bank	8,479
25,300	Mabuchi Motor Co Ltd	Goldam Sachs	89,379
13,000	Mabuchi Motor Co Ltd	HSBC	33,840
20,100	Mabuchi Motor Co Ltd	JP Morgan	52,322
(398,600)	Maeda Corp	Bank of America Merrill Lynch	(70,408)
(181,900)	Maeda Corp	Barclays Bank	(89,627)
(49,000)	Maeda Corp	Citibank	(24,144)
(72,800)	Maeda Corp	Credit Suisse	17,597
(295,800)	Maeda Corp	Goldam Sachs	(52,249)
(57,500)	Maeda Corp	HSBC	13,899
(150,000)	Maeda Corp	JP Morgan	36,257
(26,700)	Maeda Road Construction Co Ltd	Credit Suisse	2,531
(60,900)	Maeda Road Construction Co Ltd	Goldam Sachs	(105,874)
(45,600)	Makita Corp	Goldam Sachs	(116,581)
(42,800)	Mani Inc	Bank of America Merrill Lynch	(132,500)
(110,400)	Mani Inc	Barclays Bank	(246,325)
(11,600)	Mani Inc	Credit Suisse	(43,892)
(9,100)	Mani Inc	Goldam Sachs	(28,172)
51,100	Marubeni Corp	Barclays Bank	22,898
69,400	Marubeni Corp	Credit Suisse	37,321
8,600	Maruha Nichiro Corp	Bank of America Merrill Lynch	12,792
19,000	Maruha Nichiro Corp	Barclays Bank	25,083
4,400	Maruha Nichiro Corp	Credit Suisse	3,313
5,600	Maruha Nichiro Corp	Goldam Sachs	8,330
12,000	Maruha Nichiro Corp	JP Morgan	9,036
(229,400)	Marui Group Co Ltd	Barclays Bank	(481,982)
(60,500)	Marui Group Co Ltd	Credit Suisse	(132,972)
(29,200)	Marui Group Co Ltd	Goldam Sachs	(74,110)
(86,700)	Marui Group Co Ltd	JP Morgan	(174,101)
(20,100)	Maruichi Steel Tube Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(6,353)
(15,900)	Maruichi Steel Tube Ltd	Barclays Bank	(5,469)
(24,900)	Maruichi Steel Tube Ltd	Credit Suisse	(72,687)
(26,800)	Maruichi Steel Tube Ltd	Goldam Sachs	(8,471)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(75,300)	Matsui Securities Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(68,604)
(174,400)	Matsui Securities Co Ltd	Barclays Bank	(113,494)
(16,400)	Matsui Securities Co Ltd	Goldam Sachs	(14,942)
(49,500)	Matsumotokiyoshi Holdings Co Ltd	Goldam Sachs	(96,639)
(248,200)	Mazda Motor Corp	Bank of America Merrill Lynch	(166,136)
(165,100)	Mazda Motor Corp	Barclays Bank	(116,651)
(70,200)	Mazda Motor Corp	Credit Suisse	(67,873)
(86,300)	Mazda Motor Corp	Goldam Sachs	(57,766)
(148,100)	Mebuki Financial Group Inc	Citibank	(22,029)
(316,600)	Mebuki Financial Group Inc	Credit Suisse	(38,263)
(747,000)	Mebuki Financial Group Inc	JP Morgan	(90,280)
49,600	Medipal Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	77,006
112,300	Medipal Holdings Corp	Goldam Sachs	174,351
56,100	Megmilk Snow Brand Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	27,642
4,600	Megmilk Snow Brand Co Ltd	Barclays Bank	2,908
75,300	Megmilk Snow Brand Co Ltd	Goldam Sachs	37,102
4,200	MEIJI Holdings Co Ltd	Barclays Bank	24,990
51,200	MEIJI Holdings Co Ltd	Goldam Sachs	214,196
(38,400)	MINEBEA MITSUMI Inc	Barclays Bank	(36,056)
(51,700)	MINEBEA MITSUMI Inc	HSBC	(59,119)
(12,200)	Miraca Holdings Inc	Barclays Bank	(5,784)
(9,200)	Miraca Holdings Inc	Credit Suisse	32,905
(1,300)	MISUMI Group Inc	Credit Suisse	(2,804)
(45,700)	MISUMI Group Inc	Goldam Sachs	(107,489)
(23,400)	MISUMI Group Inc	JP Morgan	(50,470)
100	Mitsubishi Chemical Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	45
22,600	Mitsubishi Chemical Holdings Corp	Barclays Bank	9,203
143,100	Mitsubishi Chemical Holdings Corp	Goldam Sachs	65,055
(14,400)	Mitsubishi Corp	Bank of America Merrill Lynch	(25,837)
(111,400)	Mitsubishi Corp	Barclays Bank	(141,884)
(39,800)	Mitsubishi Corp	Citibank	(50,691)
(11,000)	Mitsubishi Corp	Goldam Sachs	(19,737)
161,900	Mitsubishi Electric Corp	Bank of America Merrill Lynch	178,359
64,400	Mitsubishi Electric Corp	Barclays Bank	58,673
64,400	Mitsubishi Electric Corp	Credit Suisse	49,992
125,000	Mitsubishi Electric Corp	Goldam Sachs	137,707
(600)	Mitsubishi Estate Co Ltd	Credit Suisse	(410)
(13,800)	Mitsubishi Estate Co Ltd	Goldam Sachs	(17,063)
(8,700)	Mitsubishi Estate Co Ltd	HSBC	3,186
35,200	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	53,995
13,500	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	Credit Suisse	34,514
9,300	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	Goldam Sachs	14,266
51,100	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	HSBC	130,642
15,300	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Barclays Bank	28,448
63,900	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Goldam Sachs	141,683

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
37,500	Mitsubishi Logistics Corp	Barclays Bank	97,964
17,600	Mitsubishi Logistics Corp	Credit Suisse	63,485
31,700	Mitsubishi Logistics Corp	HSBC	114,346
2,200	Mitsubishi Logistics Corp	JP Morgan	7,936
70,200	Mitsubishi Materials Corp	Bank of America Merrill Lynch	146,189
86,600	Mitsubishi Materials Corp	Barclays Bank	128,815
11,800	Mitsubishi Materials Corp	Citibank	17,552
32,500	Mitsubishi Materials Corp	Credit Suisse	73,421
20,400	Mitsubishi Materials Corp	Goldam Sachs	42,482
17,600	Mitsubishi Materials Corp	JP Morgan	39,760
(498,800)	Mitsubishi Motors Corp	Bank of America Merrill Lynch	(51,009)
(637,400)	Mitsubishi Motors Corp	Barclays Bank	(94,812)
(184,300)	Mitsubishi Motors Corp	Credit Suisse	(19,511)
(333,900)	Mitsubishi Motors Corp	Goldam Sachs	(34,146)
(468,400)	Mitsubishi Motors Corp	JP Morgan	(65,319)
(63,200)	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	Barclays Bank	(18,860)
(52,500)	Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(17,083)
(156,500)	Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co Ltd	Credit Suisse	(32,009)
(310,800)	Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co Ltd	HSBC	(63,567)
74,500	Mitsui Chemicals Inc	Bank of America Merrill Lynch	244,489
13,500	Mitsui Chemicals Inc	Citibank	37,275
28,800	Mitsui Chemicals Inc	Credit Suisse	55,691
28,700	Mitsui Chemicals Inc	Goldam Sachs	94,186
13,000	Mitsui Chemicals Inc	HSBC	25,138
(19,000)	Mitsui Fudosan Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(29,498)
(36,300)	Mitsui Fudosan Co Ltd	HSBC	(59,901)
(8,200)	Mitsui Fudosan Co Ltd	JP Morgan	(13,531)
(7,100)	Mitsui Mining & Smelting Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(19,538)
(96,200)	Mitsui Mining & Smelting Co Ltd	Barclays Bank	(171,714)
(16,300)	Mitsui Mining & Smelting Co Ltd	Goldam Sachs	(44,855)
(7,100)	Mitsui Mining & Smelting Co Ltd	HSBC	(16,568)
41,200	Mitsui OSK Lines Ltd	Bank of America Merrill Lynch	62,433
9,900	Mitsui OSK Lines Ltd	Barclays Bank	11,044
47,100	Mitsui OSK Lines Ltd	Goldam Sachs	71,374
3,800	Mitsui OSK Lines Ltd	HSBC	4,027
(1,400)	Miura Co Ltd	Goldam Sachs	(3,644)
(23,700)	Miura Co Ltd	HSBC	(17,627)
344,900	Mizuho Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	45,852
564,500	Mizuho Financial Group Inc	Goldam Sachs	75,046
359,100	Mizuho Financial Group Inc	HSBC	39,728
131,400	Mizuho Financial Group Inc	JP Morgan	16,497
6,600	Mochida Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	9,511
8,400	Mochida Pharmaceutical Co Ltd	Barclays Bank	25,380
6,400	Mochida Pharmaceutical Co Ltd	Credit Suisse	4,760
3,300	Mochida Pharmaceutical Co Ltd	Goldam Sachs	4,755

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
19,400	Mochida Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	14,428
(125,400)	MonotaRO Co Ltd	Barclays Bank	163,213
(47,500)	MonotaRO Co Ltd	Citibank	61,823
32,900	Morinaga & Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	105,522
5,800	Morinaga & Co Ltd	Barclays Bank	14,828
33,700	Morinaga & Co Ltd	Credit Suisse	65,793
102,200	Morinaga & Co Ltd	Goldam Sachs	327,792
23,100	Morinaga & Co Ltd	HSBC	45,098
4,800	Morinaga Milk Industry Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	446
4,100	Morinaga Milk Industry Co Ltd	Barclays Bank	6,861
7,500	Morinaga Milk Industry Co Ltd	Citibank	12,551
5,300	Morinaga Milk Industry Co Ltd	Goldam Sachs	493
18,600	Morinaga Milk Industry Co Ltd	HSBC	64,845
13,200	Morinaga Milk Industry Co Ltd	JP Morgan	46,019
11,600	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	Citibank	25,882
119,500	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	HSBC	224,413
(14,500)	Murata Manufacturing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	14,424
(1,600)	Murata Manufacturing Co Ltd	Barclays Bank	(744)
(23,500)	Murata Manufacturing Co Ltd	JP Morgan	8,520
29,300	Nagase & Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	12,530
19,000	Nagase & Co Ltd	Citibank	8,832
10,200	Nagase & Co Ltd	Credit Suisse	7,491
8,500	Nagase & Co Ltd	Goldam Sachs	3,635
20,600	Nagase & Co Ltd	JP Morgan	15,129
43,500	Nankai Electric Railway Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	44,485
14,700	Nankai Electric Railway Co Ltd	Barclays Bank	12,573
14,800	Nankai Electric Railway Co Ltd	Credit Suisse	26,274
16,000	Nankai Electric Railway Co Ltd	Goldam Sachs	16,362
17,100	Nankai Electric Railway Co Ltd	JP Morgan	32,908
151,800	NEC Corp	Bank of America Merrill Lynch	49,393
22,300	NEC Corp	HSBC	152,378
37,700	NET One Systems Co Ltd	Goldam Sachs	29,791
(11,800)	Nexon Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(10,312)
(213,500)	Nexon Co Ltd	Barclays Bank	79,394
(6,200)	Nexon Co Ltd	Credit Suisse	(26,168)
(6,600)	Nexon Co Ltd	Goldam Sachs	(5,768)
8,600	NGK Insulators Ltd	Bank of America Merrill Lynch	16,710
28,300	NGK Insulators Ltd	Barclays Bank	43,148
34,300	NGK Insulators Ltd	Credit Suisse	64,194
29,400	NGK Insulators Ltd	HSBC	56,031
(73,400)	NGK Spark Plug Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(109,181)
(8,700)	NGK Spark Plug Co Ltd	Barclays Bank	(9,140)
(3,300)	NGK Spark Plug Co Ltd	Citibank	(3,467)
(49,700)	NGK Spark Plug Co Ltd	Credit Suisse	(74,389)
(66,700)	NGK Spark Plug Co Ltd	Goldam Sachs	(99,214)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(30,200)	NGK Spark Plug Co Ltd	HSBC	(45,202)
(3,000)	NGK Spark Plug Co Ltd	JP Morgan	(4,490)
2,500	NH Foods Ltd	Barclays Bank	4,765
23,600	NH Foods Ltd	Goldam Sachs	69,112
(22,200)	NHK Spring Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(10,319)
(2,000)	Nichirei Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,283)
(10,300)	Nichirei Corp	Barclays Bank	(14,555)
(23,600)	Nichirei Corp	Goldam Sachs	(15,139)
(1,800)	Nichirei Corp	HSBC	(5,171)
(55,500)	Nidec Corp	Bank of America Merrill Lynch	(305,453)
(600)	Nidec Corp	Barclays Bank	(1,467)
(24,500)	Nidec Corp	JP Morgan	(103,179)
24,000	Nifco Inc	Bank of America Merrill Lynch	56,673
19,000	Nifco Inc	Barclays Bank	21,903
20,000	Nifco Inc	Citibank	23,056
43,000	Nifco Inc	Credit Suisse	125,924
12,900	Nifco Inc	Goldam Sachs	30,462
30,600	Nifco Inc	HSBC	89,611
18,600	Nifco Inc	JP Morgan	54,469
20,500	Nihon Kohden Corp	Barclays Bank	64,798
8,100	Nihon Kohden Corp	Credit Suisse	(20,211)
3,900	Nihon Kohden Corp	Goldam Sachs	8,339
3,700	Nihon Kohden Corp	HSBC	1,734
(5,400)	Nihon M&A Center Inc	Barclays Bank	(13,806)
(39,900)	Nihon M&A Center Inc	HSBC	(250,383)
1,800	Nihon Unisys Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,008
2,700	Nihon Unisys Ltd	Goldam Sachs	3,012
63,900	Nihon Unisys Ltd	HSBC	121,782
(300,500)	Nikon Corp	Barclays Bank	(78,222)
(63,200)	Nikon Corp	Goldam Sachs	(34,666)
(25,700)	Nikon Corp	HSBC	(1,434)
(43,200)	Nikon Corp	JP Morgan	(2,410)
(24,600)	Nippo Corp	Bank of America Merrill Lynch	(47,798)
(34,000)	Nippo Corp	Barclays Bank	(25,287)
(6,200)	Nippo Corp	Credit Suisse	(9,683)
(5,800)	Nippo Corp	JP Morgan	(13,426)
59,200	Nippon Electric Glass Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	82,004
1,300	Nippon Electric Glass Co Ltd	Credit Suisse	1,511
29,700	Nippon Electric Glass Co Ltd	Goldam Sachs	41,141
(10,900)	Nippon Express Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(67,894)
(9,100)	Nippon Express Co Ltd	Barclays Bank	(51,606)
(13,800)	Nippon Express Co Ltd	Credit Suisse	(57,733)
(12,100)	Nippon Express Co Ltd	Goldam Sachs	(75,368)
154,800	Nippon Kayaku Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	96,422
74,700	Nippon Kayaku Co Ltd	Citibank	35,418

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
45,400	Nippon Kayaku Co Ltd	Credit Suisse	24,480
67,100	Nippon Kayaku Co Ltd	Goldam Sachs	41,795
39,200	Nippon Kayaku Co Ltd	JP Morgan	21,137
(88,300)	Nippon Paint Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(591,047)
(24,600)	Nippon Paint Holdings Co Ltd	Goldam Sachs	(164,663)
17,600	Nippon Paper Industries Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	19,635
12,800	Nippon Paper Industries Co Ltd	Barclays Bank	6,664
140,400	Nippon Paper Industries Co Ltd	Goldam Sachs	156,631
(5,800)	Nippon Shinyaku Co Ltd	Barclays Bank	(47,990)
(3,600)	Nippon Shinyaku Co Ltd	Credit Suisse	(62,914)
(1,900)	Nippon Shinyaku Co Ltd	JP Morgan	(29,293)
18,000	Nippon Shokubai Co Ltd	Barclays Bank	48,529
146,800	Nippon Steel Corp	Bank of America Merrill Lynch	142,481
139,700	Nippon Steel Corp	Barclays Bank	101,692
85,000	Nippon Steel Corp	Goldam Sachs	82,499
22,500	Nippon Steel Corp	HSBC	20,081
(53,500)	Nippon Telegraph & Telephone Corp	Bank of America Merrill Lynch	(43,520)
(88,100)	Nippon Telegraph & Telephone Corp	Barclays Bank	(19,657)
70,700	Nippon Television Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	88,075
259,300	Nippon Television Holdings Inc	Goldam Sachs	323,025
165,600	Nippon Yusen KK	Bank of America Merrill Lynch	249,405
31,700	Nippon Yusen KK	Credit Suisse	53,931
157,400	Nippon Yusen KK	Goldam Sachs	237,055
38,800	Nipro Corp	Bank of America Merrill Lynch	12,986
93,600	Nipro Corp	Barclays Bank	22,624
34,800	Nipro Corp	Citibank	8,412
44,700	Nipro Corp	Credit Suisse	23,995
82,500	Nipro Corp	Goldam Sachs	27,611
35,700	Nipro Corp	HSBC	20,577
80,800	Nipro Corp	JP Morgan	46,573
1,200	Nishi-Nippon Financial Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,339
(15,800)	Nishi-Nippon Railroad Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(32,462)
(30,100)	Nishi-Nippon Railroad Co Ltd	Barclays Bank	(50,649)
(12,700)	Nishi-Nippon Railroad Co Ltd	Citibank	(21,370)
(55,700)	Nishi-Nippon Railroad Co Ltd	Credit Suisse	(163,633)
(16,600)	Nishi-Nippon Railroad Co Ltd	Deutsche Bank	(34,106)
(7,900)	Nishi-Nippon Railroad Co Ltd	HSBC	(23,208)
(24,900)	Nishi-Nippon Railroad Co Ltd	JP Morgan	(73,150)
(21,200)	Nissan Chemical Corp	Bank of America Merrill Lynch	(131,065)
(8,400)	Nissan Chemical Corp	Barclays Bank	(23,428)
(22,300)	Nissan Chemical Corp	Goldam Sachs	(137,865)
(37,400)	Nissan Chemical Corp	HSBC	(234,695)
(14,600)	Nissan Motor Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4,262)
(82,800)	Nissan Motor Co Ltd	Barclays Bank	(21,477)
(103,500)	Nissan Motor Co Ltd	Citibank	(26,846)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(728,100)	Nissan Motor Co Ltd	Goldam Sachs	(212,544)
(24,000)	Nisshin Seifun Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(26,998)
(15,600)	Nisshin Seifun Group Inc	Barclays Bank	(8,557)
(22,700)	Nisshin Seifun Group Inc	Goldam Sachs	(25,535)
47,100	Nisshinbo Holdings Inc	Barclays Bank	35,030
25,900	Nisshinbo Holdings Inc	JP Morgan	22,815
2,300	Nissin Foods Holdings Co Ltd	Citibank	(1,069)
6,700	Nissin Foods Holdings Co Ltd	Credit Suisse	(1,246)
3,800	Nissin Foods Holdings Co Ltd	JP Morgan	(835)
4,100	Nitori Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	85,572
4,200	Nitori Holdings Co Ltd	Barclays Bank	70,478
10,600	Nitori Holdings Co Ltd	Citibank	177,874
2,600	Nitori Holdings Co Ltd	Credit Suisse	66,230
9,800	Nitori Holdings Co Ltd	Goldam Sachs	204,537
56,700	Nitto Denko Corp	Bank of America Merrill Lynch	258,290
16,900	Nitto Denko Corp	Barclays Bank	67,559
13,200	Nitto Denko Corp	Credit Suisse	51,541
41,500	Nitto Denko Corp	Goldam Sachs	189,048
4,100	Nitto Denko Corp	HSBC	16,009
19,100	Nitto Denko Corp	JP Morgan	76,247
(10,500)	Noevir Holdings Co Ltd	Barclays Bank	(16,107)
(5,500)	Noevir Holdings Co Ltd	Credit Suisse	7,414
(5,000)	NOF Corp	Citibank	(2,324)
(3,700)	NOF Corp	Credit Suisse	(8,457)
(4,100)	NOF Corp	Goldam Sachs	(2,859)
55,500	NOK Corp	Bank of America Merrill Lynch	81,523
9,900	NOK Corp	Citibank	7,823
12,200	NOK Corp	Credit Suisse	14,817
47,300	NOK Corp	Goldam Sachs	69,478
10,700	NOK Corp	HSBC	14,996
13,100	NOK Corp	JP Morgan	21,069
(46,700)	Nomura Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(24,921)
(94,000)	Nomura Holdings Inc	Barclays Bank	(41,073)
(114,300)	Nomura Holdings Inc	Citibank	(49,943)
(136,400)	Nomura Holdings Inc	Goldam Sachs	(72,787)
(49,900)	Nomura Holdings Inc	HSBC	(10,113)
(27,000)	Nomura Real Estate Holdings Inc	Barclays Bank	(40,915)
(17,000)	Nomura Real Estate Holdings Inc	Goldam Sachs	(40,143)
(4,700)	Nomura Research Institute Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(12,890)
(10,600)	Nomura Research Institute Ltd	Barclays Bank	(29,465)
(6,300)	Nomura Research Institute Ltd	HSBC	(17,486)
(5,600)	NS Solutions Corp	Goldam Sachs	(13,848)
(49,200)	NSK Ltd	Barclays Bank	(25,157)
(28,200)	NSK Ltd	Goldam Sachs	(14,944)
379,000	NTN Corp	Bank of America Merrill Lynch	88,086

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
29,200	NTN Corp	Barclays Bank	7,058
421,900	NTN Corp	Goldam Sachs	98,057
136,900	NTT Data Corp	Bank of America Merrill Lynch	162,908
39,300	NTT Data Corp	Barclays Bank	13,518
59,800	NTT DOCOMO Inc	Bank of America Merrill Lynch	(56,428)
8,000	NTT DOCOMO Inc	Barclays Bank	(1,450)
26,100	NTT DOCOMO Inc	Citibank	(4,732)
18,400	NTT DOCOMO Inc	HSBC	(31,389)
14,600	NTT DOCOMO Inc	JP Morgan	(24,907)
(31,000)	Obayashi Corp	JP Morgan	(24,934)
(9,300)	OBIC Business Consultants Co Ltd	Barclays Bank	(25,938)
(20,300)	OBIC Business Consultants Co Ltd	Goldam Sachs	(116,065)
(13,900)	OBIC Business Consultants Co Ltd	HSBC	(74,950)
(4,000)	OBIC Business Consultants Co Ltd	JP Morgan	(21,568)
(16,600)	Obic Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(226,858)
(12,900)	Obic Co Ltd	HSBC	(188,286)
(33,000)	Odakyu Electric Railway Co Ltd	Barclays Bank	(50,621)
(11,900)	Odakyu Electric Railway Co Ltd	Citibank	(18,254)
(19,600)	Odakyu Electric Railway Co Ltd	Credit Suisse	(65,233)
(16,300)	Odakyu Electric Railway Co Ltd	Goldam Sachs	(39,096)
(5,100)	Odakyu Electric Railway Co Ltd	JP Morgan	(16,974)
(104,600)	Oji Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(12,642)
(234,300)	Oji Holdings Corp	Barclays Bank	17,426
(247,700)	Oji Holdings Corp	Goldam Sachs	(29,936)
(53,500)	OKUMA Corp	Bank of America Merrill Lynch	(126,830)
(3,100)	OKUMA Corp	Credit Suisse	(5,764)
(62,400)	OKUMA Corp	Goldam Sachs	(147,929)
(10,100)	OKUMA Corp	HSBC	(18,779)
42,300	Olympus Corp	Bank of America Merrill Lynch	95,757
60,900	Olympus Corp	Barclays Bank	102,760
8,200	Olympus Corp	Citibank	13,836
48,200	Olympus Corp	Goldam Sachs	109,113
11,400	Omron Corp	Goldam Sachs	49,812
30,600	Ono Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	102,555
137,000	Ono Pharmaceutical Co Ltd	Barclays Bank	291,029
(14,400)	Open House Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(78,851)
(76,000)	Open House Co Ltd	Barclays Bank	(207,019)
(55,800)	Open House Co Ltd	HSBC	(300,879)
(3,700)	Open House Co Ltd	JP Morgan	(19,951)
(10,900)	Oracle Corp Japan	Goldam Sachs	17,227
(185,300)	Orient Corp	Bank of America Merrill Lynch	(18,949)
(133,500)	Orient Corp	Barclays Bank	(13,652)
(216,800)	Orient Corp	Citibank	(22,171)
(928,200)	Orient Corp	Credit Suisse	(53,972)
(102,300)	Orient Corp	Goldam Sachs	(10,462)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(22,400)	Oriental Land Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(283,215)
(900)	Oriental Land Co Ltd	Barclays Bank	(3,472)
(9,300)	Oriental Land Co Ltd	Credit Suisse	(162,976)
(13,500)	Oriental Land Co Ltd	HSBC	(236,578)
98,000	ORIX Corp	HSBC	164,905
14,600	Osaka Gas Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	8,415
12,600	Osaka Gas Co Ltd	Barclays Bank	12,768
13,500	OSG Corp	Bank of America Merrill Lynch	12,927
9,700	OSG Corp	Citibank	9,739
46,700	OSG Corp	Credit Suisse	48,625
88,600	OSG Corp	HSBC	92,253
25,000	OSG Corp	JP Morgan	26,031
(25,400)	Otsuka Corp	Bank of America Merrill Lynch	(88,551)
(3,200)	Otsuka Corp	Citibank	(15,023)
(13,200)	Otsuka Corp	Credit Suisse	(27,935)
(12,200)	Otsuka Corp	Goldam Sachs	(42,532)
46,400	Otsuka Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	263,997
63,700	Otsuka Holdings Co Ltd	Barclays Bank	393,221
(24,400)	PALTAC Corp	Barclays Bank	(38,563)
(5,000)	PALTAC Corp	Citibank	(7,902)
(18,000)	PALTAC Corp	Credit Suisse	26,775
(13,100)	PALTAC Corp	Goldam Sachs	(13,397)
(3,400)	PALTAC Corp	HSBC	5,057
(60,100)	Pan Pacific International Holdings Corp	Barclays Bank	(38,553)
(40,000)	Pan Pacific International Holdings Corp	Goldam Sachs	(56,152)
191,300	Panasonic Corp	Barclays Bank	149,213
(24,700)	Park24 Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(45,237)
(47,700)	Park24 Co Ltd	Citibank	(33,702)
(165,000)	Penta-Ocean Construction Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(35,281)
(153,500)	Penta-Ocean Construction Co Ltd	Barclays Bank	(22,833)
(228,200)	Penta-Ocean Construction Co Ltd	Citibank	(33,944)
(287,200)	Penta-Ocean Construction Co Ltd	Credit Suisse	(16,020)
(987,100)	Penta-Ocean Construction Co Ltd	Goldam Sachs	(211,066)
(29,100)	Penta-Ocean Construction Co Ltd	JP Morgan	(1,623)
(59,000)	PeptiDream Inc	Bank of America Merrill Lynch	(257,798)
(49,200)	PeptiDream Inc	Barclays Bank	(130,358)
(29,600)	PeptiDream Inc	Credit Suisse	(158,230)
(9,800)	PeptiDream Inc	Goldam Sachs	(42,821)
(11,000)	Persol Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(17,589)
(10,200)	Persol Holdings Co Ltd	HSBC	(20,388)
(23,300)	Pigeon Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3,249)
(13,700)	Pigeon Corp	Barclays Bank	(15,284)
(19,600)	Pigeon Corp	Credit Suisse	(29,154)
(35,800)	Pigeon Corp	Goldam Sachs	(4,992)
(29,300)	Pigeon Corp	HSBC	(43,583)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
17,900	Pilot Corp	Bank of America Merrill Lynch	26,626
17,300	Pilot Corp	Barclays Bank	49,858
10,800	Pilot Corp	Goldam Sachs	16,065
2,300	Pilot Corp	HSBC	3,314
900	Pilot Corp	JP Morgan	1,297
34,800	Pola Orbis Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	38,823
57,800	Pola Orbis Holdings Inc	Barclays Bank	66,094
9,000	Pola Orbis Holdings Inc	Goldam Sachs	10,040
345,100	Rakuten Inc	Barclays Bank	(44,916)
70,100	Rakuten Inc	Goldam Sachs	(13,686)
32,500	Rakuten Inc	HSBC	(5,874)
23,900	Recruit Holdings Co Ltd	Barclays Bank	84,433
28,200	Recruit Holdings Co Ltd	Goldam Sachs	105,391
16,300	Recruit Holdings Co Ltd	JP Morgan	85,012
(25,100)	Relo Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,700)
(97,800)	Relo Group Inc	Barclays Bank	(13,638)
(14,000)	Relo Group Inc	Goldam Sachs	(4,295)
(49,600)	Relo Group Inc	HSBC	(88,995)
(53,400)	Renesas Electronics Corp	Bank of America Merrill Lynch	(496)
(59,800)	Renesas Electronics Corp	Barclays Bank	(7,227)
(52,500)	Renesas Electronics Corp	Goldam Sachs	(488)
(20,000)	Rengo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	5,764
(45,000)	Rengo Co Ltd	Goldam Sachs	12,969
(341,800)	Resona Holdings Inc	Barclays Bank	(156,021)
(224,800)	Resona Holdings Inc	Goldam Sachs	(112,019)
(528,000)	Resona Holdings Inc	HSBC	(310,718)
27,200	Resorttrust Inc	Barclays Bank	29,333
4,200	Resorttrust Inc	Credit Suisse	8,785
55,100	Resorttrust Inc	Goldam Sachs	107,572
53,600	Ricoh Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	38,868
366,700	Ricoh Co Ltd	Barclays Bank	190,910
2,000	Ricoh Co Ltd	Credit Suisse	614
101,700	Ricoh Co Ltd	Goldam Sachs	73,747
67,600	Ricoh Co Ltd	HSBC	20,739
11,100	Rohm Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	15,479
8,600	Rohm Co Ltd	Barclays Bank	6,396
10,200	Rohm Co Ltd	Credit Suisse	36,034
19,800	Rohm Co Ltd	Goldam Sachs	27,611
7,800	Rohm Co Ltd	HSBC	27,555
500	Rohm Co Ltd	JP Morgan	1,766
(5,400)	Rohto Pharmaceutical Co Ltd	Barclays Bank	(3,012)
(6,300)	Rohto Pharmaceutical Co Ltd	Citibank	(3,514)
(57,600)	Ryohin Keikaku Co Ltd	Barclays Bank	(72,827)
(52,300)	Ryohin Keikaku Co Ltd	Goldam Sachs	(91,895)
180,500	Sankyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	58,732

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	Sankyo Co Ltd	Credit Suisse	(3,239)
22,100	Sankyo Co Ltd	Goldam Sachs	7,191
20,200	Sankyo Co Ltd	HSBC	(25,164)
9,100	Sankyu Inc	Bank of America Merrill Lynch	37,647
11,900	Sankyu Inc	HSBC	40,933
(13,500)	Sanrio Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(17,947)
(24,900)	Sanrio Co Ltd	Citibank	(29,399)
(62,400)	Sanrio Co Ltd	Credit Suisse	(98,619)
(36,100)	Sanrio Co Ltd	Goldam Sachs	(47,992)
17,800	Santen Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	14,893
74,000	Santen Pharmaceutical Co Ltd	Barclays Bank	94,938
26,500	Santen Pharmaceutical Co Ltd	Goldam Sachs	22,173
139,000	Sanwa Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	63,320
196,400	Sanwa Holdings Corp	Citibank	96,771
127,500	Sanwa Holdings Corp	Credit Suisse	106,680
137,900	Sanwa Holdings Corp	Goldam Sachs	62,819
44,500	Sapporo Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	96,393
84,300	Sapporo Holdings Ltd	Barclays Bank	126,178
112,000	Sapporo Holdings Ltd	Goldam Sachs	242,607
8,600	Sawai Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	47,971
32,800	Sawai Pharmaceutical Co Ltd	Barclays Bank	112,825
26,100	Sawai Pharmaceutical Co Ltd	Goldam Sachs	145,586
(32,200)	SBI Holdings Inc	Credit Suisse	(58,973)
(35,000)	SBI Holdings Inc	Goldam Sachs	(54,665)
(52,000)	SBI Holdings Inc	HSBC	(95,235)
(13,300)	SBI Holdings Inc	JP Morgan	(24,358)
(3,300)	SCREEN Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	21,936
(5,500)	SCREEN Holdings Co Ltd	Barclays Bank	12,527
(16,500)	SCREEN Holdings Co Ltd	Goldam Sachs	109,678
(33,800)	SCREEN Holdings Co Ltd	HSBC	111,551
(3,100)	SCSK Corp	Citibank	(10,519)
6,300	Secom Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	22,256
7,400	Secom Co Ltd	Barclays Bank	18,850
4,000	Secom Co Ltd	Credit Suisse	11,342
40,100	Secom Co Ltd	Goldam Sachs	141,663
18,400	Sega Sammy Holdings Inc	Barclays Bank	171
23,300	Sega Sammy Holdings Inc	Credit Suisse	(719)
14,900	Sega Sammy Holdings Inc	HSBC	1,656
103,200	Seibu Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	138,156
41,000	Seibu Holdings Inc	Barclays Bank	9,910
84,500	Seibu Holdings Inc	Credit Suisse	115,620
113,400	Seibu Holdings Inc	Goldam Sachs	151,811
38,000	Seibu Holdings Inc	HSBC	44,753
25,300	Seibu Holdings Inc	JP Morgan	35,227
53,700	Seiko Epson Corp	Barclays Bank	35,945

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
31,000	Seiko Epson Corp	Citibank	20,750
16,000	Seiko Epson Corp	Goldam Sachs	17,552
192,800	Seino Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	299,332
154,300	Seino Holdings Co Ltd	Barclays Bank	193,655
114,200	Seino Holdings Co Ltd	Goldam Sachs	177,301
154,400	Sekisui Chemical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	256,939
46,500	Sekisui Chemical Co Ltd	Citibank	43,662
139,800	Sekisui Chemical Co Ltd	Credit Suisse	189,753
109,300	Sekisui Chemical Co Ltd	JP Morgan	148,355
218,400	Sekisui House Ltd	Bank of America Merrill Lynch	506,585
134,500	Sekisui House Ltd	Barclays Bank	158,176
12,500	Sekisui House Ltd	Citibank	14,700
3,300	Sekisui House Ltd	Credit Suisse	5,906
214,800	Sekisui House Ltd	Goldam Sachs	498,235
202,300	Sekisui House Ltd	HSBC	362,039
45,300	Seven & i Holdings Co Ltd	Barclays Bank	90,966
(52,400)	Seven Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(10,717)
(102,000)	Seven Bank Ltd	Barclays Bank	(4,741)
(43,000)	Seven Bank Ltd	Credit Suisse	(9,774)
(146,700)	Seven Bank Ltd	Goldam Sachs	(30,004)
(33,200)	SG Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(132,720)
(38,600)	SG Holdings Co Ltd	Credit Suisse	(174,044)
(119,800)	SG Holdings Co Ltd	HSBC	(540,166)
(133,200)	Sharp Corp	Barclays Bank	(61,916)
(24,100)	Sharp Corp	Citibank	(11,203)
(34,400)	Sharp Corp	Credit Suisse	(14,892)
(175,500)	Sharp Corp	Goldam Sachs	(76,684)
(13,000)	Sharp Corp	JP Morgan	(7,464)
7,500	Shiga Bank Ltd	Credit Suisse	(3,626)
7,500	Shiga Bank Ltd	Goldam Sachs	18,477
2,300	Shiga Bank Ltd	HSBC	(1,112)
(143,300)	Shikoku Electric Power Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,329)
(235,900)	Shikoku Electric Power Co Inc	Barclays Bank	(19,738)
(163,100)	Shikoku Electric Power Co Inc	Goldam Sachs	(6,065)
(131,100)	Shikoku Electric Power Co Inc	HSBC	(10,969)
(2,300)	Shimadzu Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3,592)
(28,200)	Shimadzu Corp	Goldam Sachs	(44,044)
(6,900)	Shimamura Co Ltd	Barclays Bank	(41,054)
(2,300)	Shimamura Co Ltd	Goldam Sachs	(16,464)
(2,800)	Shimamura Co Ltd	JP Morgan	(16,640)
(7,400)	Shimano Inc	Bank of America Merrill Lynch	(63,980)
(12,400)	Shimano Inc	Barclays Bank	69,167
(4,300)	Shimano Inc	JP Morgan	(106,336)
(239,200)	Shimizu Corp	Bank of America Merrill Lynch	(148,993)
(210,700)	Shimizu Corp	Goldam Sachs	(131,241)

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	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	6,852
2,100	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	JP Morgan	13,369
(41,100)	Shinsei Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(33,242)
(32,700)	Shinsei Bank Ltd	Barclays Bank	(20,064)
(1,000)	Shinsei Bank Ltd	Credit Suisse	(502)
(9,200)	Shinsei Bank Ltd	Goldam Sachs	(7,441)
(16,100)	Shinsei Bank Ltd	HSBC	(8,083)
28,900	Shionogi & Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	173,833
(2,500)	Ship Healthcare Holdings Inc	HSBC	3,486
(22,000)	Shiseido Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(19,430)
(3,300)	Shiseido Co Ltd	Barclays Bank	(5,093)
(23,300)	Shiseido Co Ltd	Goldam Sachs	(20,578)
147,200	Shizuoka Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	88,951
125,400	Shizuoka Bank Ltd	Citibank	74,612
50,000	Shizuoka Bank Ltd	Credit Suisse	18,593
20,600	Shizuoka Bank Ltd	Goldam Sachs	12,448
(33,600)	SHO-BOND Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(131,195)
(18,400)	SHO-BOND Holdings Co Ltd	Barclays Bank	(44,475)
(5,300)	SHO-BOND Holdings Co Ltd	Citibank	(12,811)
(26,600)	SHO-BOND Holdings Co Ltd	Credit Suisse	(145,902)
(58,100)	SHO-BOND Holdings Co Ltd	Goldam Sachs	(226,858)
(34,400)	SHO-BOND Holdings Co Ltd	HSBC	(179,616)
(200)	Shochiku Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,989)
(3,000)	Shochiku Co Ltd	Citibank	(21,196)
(9,100)	Shochiku Co Ltd	Credit Suisse	(148,896)
(23,100)	Shochiku Co Ltd	Goldam Sachs	(229,787)
(2,700)	Shochiku Co Ltd	JP Morgan	(44,178)
(22,600)	Showa Denko KK	Barclays Bank	(57,989)
(13,300)	Showa Denko KK	Citibank	(34,126)
(7,800)	Showa Denko KK	Credit Suisse	(21,972)
(76,400)	Showa Denko KK	Goldam Sachs	(166,203)
62,500	Skylark Holdings Co Ltd	Credit Suisse	27,309
97,000	Skylark Holdings Co Ltd	JP Morgan	42,384
(2,000)	SMC Corp	Bank of America Merrill Lynch	(38,488)
(1,800)	SMC Corp	Barclays Bank	(17,571)
(1,000)	SMC Corp	Citibank	(9,762)
(600)	SMC Corp	Credit Suisse	(21,252)
(2,000)	SMC Corp	Goldam Sachs	(38,488)
(1,500)	SMC Corp	HSBC	(53,131)
(2,900)	SMC Corp	JP Morgan	(102,719)
(38,800)	SMS Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(54,107)
(51,300)	SMS Co Ltd	Barclays Bank	(24,800)
(6,500)	SMS Co Ltd	Citibank	(3,142)
(7,400)	SMS Co Ltd	Credit Suisse	(12,616)
(19,200)	SMS Co Ltd	Goldam Sachs	(26,775)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(5,900)	SoftBank Group Corp	Bank of America Merrill Lynch	(14,151)
(21,700)	SoftBank Group Corp	Goldam Sachs	(52,049)
(64,400)	SoftBank Group Corp	HSBC	(98,188)
1,500	Sohgo Security Services Co Ltd	Credit Suisse	2,650
1,800	Sohgo Security Services Co Ltd	Goldam Sachs	(1,841)
36,900	Sohgo Security Services Co Ltd	HSBC	65,179
407,900	Sojitz Corp	Bank of America Merrill Lynch	68,258
714,200	Sojitz Corp	Goldam Sachs	119,515
(13,900)	Sony Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,163)
(25,200)	Sony Corp	Goldam Sachs	(2,108)
(36,300)	Sony Financial Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(199,782)
(27,900)	Sony Financial Holdings Inc	Barclays Bank	(259)
(6,800)	Sony Financial Holdings Inc	Goldam Sachs	(37,425)
(7,900)	Sony Financial Holdings Inc	HSBC	(42,302)
32,500	Sotetsu Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	62,241
8,200	Sotetsu Holdings Inc	Barclays Bank	14,256
1,400	Sotetsu Holdings Inc	Citibank	2,434
3,400	Sotetsu Holdings Inc	Credit Suisse	10,621
12,100	Sotetsu Holdings Inc	Deutsche Bank	23,173
5,800	Sotetsu Holdings Inc	Goldam Sachs	11,108
14,000	Sotetsu Holdings Inc	JP Morgan	43,732
(3,000)	Square Enix Holdings Co Ltd	Goldam Sachs	(12,829)
(117,700)	Subaru Corp	Bank of America Merrill Lynch	(281,215)
(5,500)	Subaru Corp	Credit Suisse	(13,473)
(85,200)	Subaru Corp	Goldam Sachs	(203,564)
36,800	Sugi Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	88,951
21,700	Sugi Holdings Co Ltd	Barclays Bank	2,017
15,800	Sugi Holdings Co Ltd	Credit Suisse	86,664
28,300	Sugi Holdings Co Ltd	Goldam Sachs	68,405
12,500	Sugi Holdings Co Ltd	HSBC	68,563
6,500	Sugi Holdings Co Ltd	JP Morgan	35,653
(58,700)	SUMCO Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,091)
(1,000)	SUMCO Corp	Barclays Bank	(214)
(8,300)	SUMCO Corp	Citibank	(1,775)
(15,400)	SUMCO Corp	Goldam Sachs	(286)
(32,200)	SUMCO Corp	HSBC	(30,534)
51,200	Sumitomo Bakelite Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	89,486
37,700	Sumitomo Bakelite Co Ltd	Barclays Bank	16,122
14,900	Sumitomo Bakelite Co Ltd	Credit Suisse	33,384
29,600	Sumitomo Bakelite Co Ltd	Goldam Sachs	51,734
22,400	Sumitomo Bakelite Co Ltd	HSBC	50,187
9,000	Sumitomo Bakelite Co Ltd	JP Morgan	20,165
400,400	Sumitomo Chemical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	48,391
115,500	Sumitomo Chemical Co Ltd	Goldam Sachs	13,959
(14,100)	Sumitomo Corp	Barclays Bank	(12,453)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(19,100)	Sumitomo Corp	Citibank	(16,869)
(45,300)	Sumitomo Corp	Goldam Sachs	(28,427)
(18,100)	Sumitomo Corp	HSBC	(249)
37,400	Sumitomo Dainippon Pharma Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	62,238
56,500	Sumitomo Dainippon Pharma Co Ltd	Barclays Bank	73,012
45,800	Sumitomo Dainippon Pharma Co Ltd	Goldam Sachs	76,216
159,300	Sumitomo Electric Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	251,764
69,400	Sumitomo Electric Industries Ltd	Barclays Bank	70,971
12,200	Sumitomo Electric Industries Ltd	Citibank	12,476
26,500	Sumitomo Electric Industries Ltd	Credit Suisse	41,758
69,200	Sumitomo Electric Industries Ltd	Goldam Sachs	109,366
83,800	Sumitomo Electric Industries Ltd	HSBC	132,051
10,800	Sumitomo Forestry Co Ltd	Citibank	10,040
18,300	Sumitomo Forestry Co Ltd	Goldam Sachs	28,752
9,800	Sumitomo Forestry Co Ltd	HSBC	7,744
8,000	Sumitomo Heavy Industries Ltd	Credit Suisse	15,197
(69,900)	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(144,589)
(70,000)	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	Barclays Bank	(133,733)
(63,800)	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	Credit Suisse	(169,635)
(49,200)	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	Goldam Sachs	(101,771)
(9,000)	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	HSBC	(15,610)
32,000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	121,824
145,000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	Barclays Bank	379,468
(18,100)	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	Barclays Bank	(53,258)
(37,500)	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	Goldam Sachs	(77,918)
32,500	Sumitomo Osaka Cement Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	66,471
10,700	Sumitomo Osaka Cement Co Ltd	Citibank	1,492
4,800	Sumitomo Osaka Cement Co Ltd	Credit Suisse	7,363
5,200	Sumitomo Osaka Cement Co Ltd	Goldam Sachs	10,635
(4,400)	Sumitomo Realty & Development Co Ltd	Goldam Sachs	(8,733)
98,300	Sumitomo Rubber Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	69,454
16,900	Sumitomo Rubber Industries Ltd	Barclays Bank	6,285
4,900	Sumitomo Rubber Industries Ltd	Credit Suisse	3,918
68,100	Sumitomo Rubber Industries Ltd	Goldam Sachs	48,116
6,600	Sumitomo Rubber Industries Ltd	HSBC	5,277
29,800	Sumitomo Rubber Industries Ltd	JP Morgan	23,826
41,300	Sundrug Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(28,797)
5,100	Sundrug Co Ltd	Barclays Bank	12,802
8,600	Sundrug Co Ltd	Citibank	21,587
13,200	Sundrug Co Ltd	Credit Suisse	(1,227)
8,300	Sundrug Co Ltd	Goldam Sachs	(5,787)
4,300	Sundrug Co Ltd	HSBC	(400)
103,300	Suntory Beverage & Food Ltd	Bank of America Merrill Lynch	307,312
80,700	Suntory Beverage & Food Ltd	Barclays Bank	210,068
7,900	Sushiro Global Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	21,446

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
20,600	Sushiro Global Holdings Ltd	Goldam Sachs	55,922
6,600	Sushiro Global Holdings Ltd	HSBC	21,026
200	Sushiro Global Holdings Ltd	JP Morgan	563
(9,800)	Suzuken Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(22,321)
(3,400)	Suzuken Co Ltd	Barclays Bank	(8,850)
(8,600)	Suzuken Co Ltd	Citibank	(22,386)
(21,300)	Suzuken Co Ltd	Goldam Sachs	(48,515)
25,000	Systemex Corp	Barclays Bank	92,735
2,500	Systemex Corp	Credit Suisse	18,634
1,600	Systemex Corp	Goldam Sachs	9,416
(130,500)	T&D Holdings Inc	Barclays Bank	(152,866)
(34,300)	T&D Holdings Inc	Credit Suisse	(35,471)
(95,500)	T&D Holdings Inc	Goldam Sachs	(126,960)
(125,500)	T&D Holdings Inc	JP Morgan	(113,173)
(269,400)	Tadano Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(177,822)
(69,100)	Tadano Ltd	Barclays Bank	(14,775)
(97,800)	Tadano Ltd	Credit Suisse	(50,007)
(137,000)	Tadano Ltd	Goldam Sachs	(90,429)
(79,200)	Tadano Ltd	HSBC	(40,496)
(2,000)	Tadano Ltd	JP Morgan	(1,023)
39,100	Taiheiyo Cement Corp	Bank of America Merrill Lynch	158,850
7,400	Taiheiyo Cement Corp	Barclays Bank	5,435
800	Taiheiyo Cement Corp	Citibank	588
6,100	Taiheiyo Cement Corp	Credit Suisse	20,586
89,700	Taiheiyo Cement Corp	Goldam Sachs	364,421
24,700	Taiheiyo Cement Corp	HSBC	83,355
32,000	Taiheiyo Cement Corp	JP Morgan	107,991
(135,300)	Taisei Corp	Bank of America Merrill Lynch	(264,147)
(43,900)	Taisei Corp	Barclays Bank	(40,813)
(117,500)	Taisei Corp	Goldam Sachs	(229,396)
18,100	Taisho Pharmaceutical Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	122,837
13,400	Taisho Pharmaceutical Holdings Co Ltd	Barclays Bank	58,551
17,600	Taisho Pharmaceutical Holdings Co Ltd	Goldam Sachs	119,444
(111,400)	Taiyo Nippon Sanso Corp	JP Morgan	(151,205)
(38,100)	Taiyo Yuden Co Ltd	Citibank	(23,732)
(89,600)	Taiyo Yuden Co Ltd	Credit Suisse	41,649
(14,800)	Taiyo Yuden Co Ltd	JP Morgan	6,880
(13,600)	Takara Bio Inc	Bank of America Merrill Lynch	(62,459)
(17,400)	Takara Bio Inc	Barclays Bank	(39,955)
(8,200)	Takara Bio Inc	Credit Suisse	(29,573)
(22,600)	Takara Bio Inc	Goldam Sachs	(103,792)
(9,300)	Takara Bio Inc	JP Morgan	(35,016)
(22,200)	Takara Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(21,877)
(83,000)	Takara Holdings Inc	Goldam Sachs	(81,792)
(52,000)	Takashimaya Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(42,058)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(107,700)	Takashimaya Co Ltd	Barclays Bank	(72,090)
(27,500)	Takashimaya Co Ltd	Credit Suisse	(23,191)
(97,300)	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	Goldam Sachs	(161,918)
4,100	TDK Corp	Barclays Bank	25,157
2,800	TDK Corp	Goldam Sachs	16,660
1,500	TDK Corp	JP Morgan	9,122
(19,800)	TechnoPro Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(57,063)
(9,000)	TechnoPro Holdings Inc	Goldam Sachs	(25,938)
82,300	Teijin Ltd	Bank of America Merrill Lynch	85,693
63,700	Teijin Ltd	Citibank	53,298
124,400	Teijin Ltd	Credit Suisse	95,990
270,000	Teijin Ltd	Goldam Sachs	281,132
50,800	Teijin Ltd	HSBC	39,199
96,400	Teijin Ltd	JP Morgan	74,385
5,000	Terumo Corp	Barclays Bank	16,409
5,200	Terumo Corp	Goldam Sachs	27,942
2,100	Terumo Corp	HSBC	11,683
(49,000)	THK Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(104,774)
(29,300)	THK Co Ltd	Citibank	(56,385)
(47,300)	THK Co Ltd	Credit Suisse	(86,188)
(32,200)	THK Co Ltd	Goldam Sachs	(68,851)
(8,900)	THK Co Ltd	HSBC	(16,217)
(16,900)	THK Co Ltd	JP Morgan	(30,794)
(7,600)	TIS Inc	Barclays Bank	(6,430)
(5,600)	TIS Inc	Goldam Sachs	(5,050)
(12,900)	TIS Inc	JP Morgan	(16,717)
36,900	Tobu Railway Co Ltd	Goldam Sachs	61,749
(396,200)	Toda Corp	Bank of America Merrill Lynch	(128,917)
(245,000)	Toda Corp	Barclays Bank	(77,442)
(48,200)	Toda Corp	Citibank	(15,235)
(328,000)	Toda Corp	Goldam Sachs	(106,726)
(30,700)	Toda Corp	HSBC	(7,421)
(48,700)	Toda Corp	JP Morgan	(11,771)
(900)	Toho Co Ltd	Citibank	(1,464)
(12,000)	Toho Co Ltd	Credit Suisse	(44,066)
(32,400)	Toho Co Ltd	HSBC	(118,979)
(10,600)	Toho Co Ltd	JP Morgan	(38,925)
(39,000)	Toho Gas Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	184,911
(900)	Toho Gas Co Ltd	Credit Suisse	3,012
(126,300)	Tohoku Electric Power Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(91,586)
(276,300)	Tohoku Electric Power Co Inc	Barclays Bank	(164,395)
(53,700)	Tohoku Electric Power Co Inc	HSBC	(45,929)
(261,700)	Tokai Carbon Co Ltd	Barclays Bank	(192,203)
(144,200)	Tokai Carbon Co Ltd	Citibank	(105,906)
(426,700)	Tokai Carbon Co Ltd	Goldam Sachs	(357,021)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(138,500)	Tokai Carbon Co Ltd	JP Morgan	(190,564)
192,100	Tokai Rika Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	325,033
11,100	Tokai Rika Co Ltd	Barclays Bank	11,558
9,500	Tokai Rika Co Ltd	Credit Suisse	17,286
25,000	Tokai Rika Co Ltd	Goldam Sachs	42,300
10,400	Tokai Rika Co Ltd	JP Morgan	16,428
20,800	Tokio Marine Holdings Inc	Credit Suisse	42,735
56,400	Tokuyama Corp	Bank of America Merrill Lynch	116,402
33,600	Tokuyama Corp	Barclays Bank	51,229
25,700	Tokuyama Corp	Credit Suisse	70,005
130,000	Tokuyama Corp	Goldam Sachs	268,303
7,300	Tokuyama Corp	HSBC	19,885
(71,100)	Tokyo Broadcasting System Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(114,352)
(135,700)	Tokyo Broadcasting System Holdings Inc	Barclays Bank	(82,002)
(179,300)	Tokyo Broadcasting System Holdings Inc	Goldam Sachs	(288,374)
(29,000)	Tokyo Broadcasting System Holdings Inc	HSBC	(19,033)
(21,300)	Tokyo Century Corp	Bank of America Merrill Lynch	(167,327)
(14,500)	Tokyo Century Corp	Barclays Bank	(76,163)
(10,800)	Tokyo Century Corp	Citibank	(56,728)
(26,400)	Tokyo Century Corp	Credit Suisse	(269,976)
(300)	Tokyo Century Corp	Deutsche Bank	(2,357)
(54,700)	Tokyo Century Corp	Goldam Sachs	(429,708)
(15,400)	Tokyo Century Corp	HSBC	(157,486)
(3,100)	Tokyo Century Corp	JP Morgan	(31,702)
(275,200)	Tokyo Electric Power Co Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(35,818)
(759,100)	Tokyo Electric Power Co Holdings Inc	Barclays Bank	(112,914)
4,700	Tokyo Electron Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(44,787)
4,100	Tokyo Electron Ltd	Barclays Bank	(23,823)
11,100	Tokyo Electron Ltd	Goldam Sachs	(105,773)
16,900	Tokyo Gas Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	15,554
101,000	Tokyo Gas Co Ltd	Barclays Bank	149,296
6,600	Tokyo Gas Co Ltd	Goldam Sachs	6,074
5,500	Tokyo Gas Co Ltd	HSBC	4,039
30,300	Tokyo Gas Co Ltd	JP Morgan	20,267
(15,800)	Tokyo Tatemono Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(30,553)
(29,300)	Tokyo Tatemono Co Ltd	Barclays Bank	(36,773)
(17,700)	Tokyo Tatemono Co Ltd	Credit Suisse	(30,278)
(21,100)	Tokyo Tatemono Co Ltd	Goldam Sachs	(40,801)
(31,100)	Tokyo Tatemono Co Ltd	HSBC	(53,199)
(36,800)	Tokyu Fudosan Holdings Corp	Credit Suisse	(5,816)
(691,600)	Tokyu Fudosan Holdings Corp	HSBC	(109,303)
83,400	Topcon Corp	Bank of America Merrill Lynch	103,121
28,400	Topcon Corp	Barclays Bank	26,139
17,000	Topcon Corp	Citibank	15,646
36,600	Topcon Corp	Credit Suisse	35,047

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
66,200	Topcon Corp	Goldam Sachs	81,854
19,700	Topcon Corp	HSBC	18,864
47,700	Topcon Corp	JP Morgan	31,592
266,300	Toppan Printing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	960,576
2,300	Toppan Printing Co Ltd	Credit Suisse	6,094
25,400	Toppan Printing Co Ltd	Goldam Sachs	91,621
64,000	Toray Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	28,202
63,800	Toray Industries Inc	Barclays Bank	20,997
180,000	Toray Industries Inc	Credit Suisse	74,299
143,800	Toray Industries Inc	Goldam Sachs	63,367
39,900	Toray Industries Inc	HSBC	16,470
53,400	Toray Industries Inc	JP Morgan	22,042
(12,700)	Toshiba Corp	Barclays Bank	(18,773)
(4,400)	Toshiba Corp	Credit Suisse	(10,478)
3,900	Toshiba TEC Corp	Bank of America Merrill Lynch	13,778
19,500	Toshiba TEC Corp	Barclays Bank	(9,064)
4,100	Toshiba TEC Corp	Citibank	(1,906)
11,900	Toshiba TEC Corp	Credit Suisse	24,892
3,500	Toshiba TEC Corp	HSBC	6,964
5,800	Toshiba TEC Corp	JP Morgan	7,523
32,200	Tosoh Corp	Barclays Bank	20,955
24,600	Tosoh Corp	Citibank	16,009
14,000	Tosoh Corp	Goldam Sachs	13,536
22,800	Tosoh Corp	JP Morgan	38,366
54,700	TOTO Ltd	Barclays Bank	218,668
10,900	TOTO Ltd	Citibank	43,574
32,400	TOTO Ltd	Credit Suisse	91,870
14,800	TOTO Ltd	Goldam Sachs	68,108
19,200	TOTO Ltd	HSBC	54,441
8,600	TOTO Ltd	JP Morgan	24,385
72,400	Toyo Seikan Group Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	86,827
48,200	Toyo Seikan Group Holdings Ltd	Barclays Bank	31,367
27,600	Toyo Seikan Group Holdings Ltd	Citibank	17,961
35,100	Toyo Seikan Group Holdings Ltd	Credit Suisse	25,094
28,300	Toyo Seikan Group Holdings Ltd	Goldam Sachs	33,939
2,500	Toyo Seikan Group Holdings Ltd	JP Morgan	1,883
39,500	Toyo Suisan Kaisha Ltd	Bank of America Merrill Lynch	135,871
28,800	Toyo Suisan Kaisha Ltd	Barclays Bank	16,065
36,800	Toyo Suisan Kaisha Ltd	HSBC	130,005
(226,900)	Toyo Tire Corp	Bank of America Merrill Lynch	(251,021)
(60,900)	Toyo Tire Corp	Barclays Bank	(37,367)
(4,300)	Toyo Tire Corp	Citibank	(2,638)
(210,800)	Toyo Tire Corp	Goldam Sachs	(233,210)
(16,100)	Toyo Tire Corp	HSBC	(39,066)
(100)	Toyo Tire Corp	JP Morgan	(243)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
8,100	Toyobo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,108
19,100	Toyobo Co Ltd	Citibank	9,056
12,400	Toyobo Co Ltd	Credit Suisse	28,243
7,400	Toyobo Co Ltd	HSBC	5,454
100,200	Toyoda Gosei Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	299,021
2,900	Toyoda Gosei Co Ltd	Barclays Bank	2,804
7,300	Toyoda Gosei Co Ltd	Citibank	7,058
9,000	Toyoda Gosei Co Ltd	Credit Suisse	24,348
100,000	Toyoda Gosei Co Ltd	Goldam Sachs	298,424
11,200	Toyoda Gosei Co Ltd	HSBC	30,300
5,700	Toyoda Gosei Co Ltd	JP Morgan	15,420
50,800	Toyota Boshoku Corp	Bank of America Merrill Lynch	108,623
135,800	Toyota Boshoku Corp	Citibank	164,124
33,400	Toyota Boshoku Corp	Credit Suisse	61,481
3,300	Toyota Boshoku Corp	JP Morgan	6,074
(17,000)	Toyota Industries Corp	Bank of America Merrill Lynch	(56,896)
(24,700)	Toyota Industries Corp	Credit Suisse	(36,741)
(3,900)	Toyota Industries Corp	HSBC	(5,801)
(3,300)	Toyota Motor Corp	Barclays Bank	(14,296)
(1,900)	Toyota Motor Corp	JP Morgan	(8,745)
(6,200)	Toyota Tsusho Corp	Credit Suisse	(11,413)
26,300	Trend Micro Inc	Bank of America Merrill Lynch	85,576
7,000	Trend Micro Inc	Barclays Bank	14,317
1,800	Trend Micro Inc	Citibank	3,681
54,700	TS Tech Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	97,638
41,700	TS Tech Co Ltd	Credit Suisse	62,415
12,700	TS Tech Co Ltd	Goldam Sachs	22,669
12,100	TS Tech Co Ltd	HSBC	18,111
30,400	TS Tech Co Ltd	JP Morgan	45,502
(4,300)	Tsumura & Co	Barclays Bank	(8,315)
(4,300)	Tsumura & Co	Citibank	(8,315)
(5,600)	Tsumura & Co	Goldam Sachs	(11,193)
2,600	Tsuruha Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	39,641
2,400	Tsuruha Holdings Inc	Barclays Bank	17,850
900	Tsuruha Holdings Inc	Citibank	6,694
900	Tsuruha Holdings Inc	Goldam Sachs	13,722
(8,400)	TV Asahi Holdings Corp	Barclays Bank	(8,981)
(8,300)	TV Asahi Holdings Corp	HSBC	(6,327)
50,300	Ube Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	101,007
20,200	Ube Industries Ltd	Barclays Bank	31,174
12,600	Ube Industries Ltd	Citibank	19,445
63,900	Ube Industries Ltd	Credit Suisse	86,139
7,400	Ube Industries Ltd	Deutsche Bank	14,860
85,300	Ube Industries Ltd	Goldam Sachs	171,290
40,700	Ube Industries Ltd	HSBC	54,864

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
45,300	Ube Industries Ltd	JP Morgan	61,065
22,300	Ulvac Inc	Bank of America Merrill Lynch	74,634
7,200	Ulvac Inc	Citibank	6,694
5,200	Ulvac Inc	Credit Suisse	14,890
49,500	Ulvac Inc	Goldam Sachs	165,667
7,200	Ulvac Inc	JP Morgan	20,616
(37,800)	Unicharm Corp	Barclays Bank	4,920
(9,400)	Unicharm Corp	Credit Suisse	87
(9,000)	Unicharm Corp	Goldam Sachs	3,347
(10,000)	Unicharm Corp	HSBC	93
(79,200)	Ushio Inc	Goldam Sachs	(164,931)
(44,000)	USS Co Ltd	Barclays Bank	(55,631)
(76,000)	USS Co Ltd	Citibank	(96,091)
(30,300)	USS Co Ltd	Credit Suisse	(38,873)
(61,600)	USS Co Ltd	Goldam Sachs	(97,928)
69,800	Wacoal Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	49,966
36,800	Wacoal Holdings Corp	Barclays Bank	11,974
17,400	Wacoal Holdings Corp	Credit Suisse	14,397
92,700	Wacoal Holdings Corp	Goldam Sachs	66,359
7,800	Welcia Holdings Co Ltd	Barclays Bank	43,509
8,800	Welcia Holdings Co Ltd	Goldam Sachs	105,536
18,000	Welcia Holdings Co Ltd	HSBC	201,755
38,300	West Japan Railway Co	Bank of America Merrill Lynch	207,229
7,700	West Japan Railway Co	Credit Suisse	48,463
7,200	West Japan Railway Co	Goldam Sachs	38,957
(30,500)	Yamada Denki Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(16,162)
(67,200)	Yamada Denki Co Ltd	Barclays Bank	(17,493)
(133,600)	Yamada Denki Co Ltd	Citibank	(34,777)
(23,500)	Yamada Denki Co Ltd	Credit Suisse	(2,960)
(25,400)	Yamaguchi Financial Group Inc	Barclays Bank	(14,404)
(23,200)	Yamaguchi Financial Group Inc	Citibank	(13,157)
(25,700)	Yamaguchi Financial Group Inc	Credit Suisse	(18,877)
(54,900)	Yamaguchi Financial Group Inc	Goldam Sachs	(40,831)
(39,800)	Yamaguchi Financial Group Inc	HSBC	(27,381)
29,100	Yamaha Corp	Bank of America Merrill Lynch	155,557
8,300	Yamaha Corp	Citibank	35,495
15,300	Yamaha Corp	Goldam Sachs	81,788
2,700	Yamaha Corp	HSBC	18,622
30,000	Yamaha Corp	JP Morgan	238,460
21,500	Yamaha Motor Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	37,377
26,500	Yamaha Motor Co Ltd	Barclays Bank	38,186
23,500	Yamaha Motor Co Ltd	Credit Suisse	41,510
14,600	Yamaha Motor Co Ltd	Goldam Sachs	25,382
16,300	Yamaha Motor Co Ltd	HSBC	28,792
9,200	Yamaha Motor Co Ltd	JP Morgan	15,905

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
日本(続き)			
(34,300)	Yamato Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(157,525)
(27,200)	Yamato Holdings Co Ltd	Barclays Bank	(70,045)
(171,800)	Yamato Holdings Co Ltd	Goldam Sachs	(789,004)
25,200	Yamazaki Baking Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	8,903
126,900	Yamazaki Baking Co Ltd	Barclays Bank	104,998
19,600	Yamazaki Baking Co Ltd	Credit Suisse	6,195
10,900	Yaoko Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	34,454
4,700	Yaoko Co Ltd	Barclays Bank	7,865
2,900	Yaoko Co Ltd	Citibank	4,853
7,300	Yaoko Co Ltd	Goldam Sachs	23,074
3,300	Yaoko Co Ltd	HSBC	10,124
10,500	Yaoko Co Ltd	JP Morgan	32,213
(50,500)	Yaskawa Electric Corp	Bank of America Merrill Lynch	(169,014)
(76,500)	Yaskawa Electric Corp	Barclays Bank	(145,796)
(58,600)	Yaskawa Electric Corp	Goldam Sachs	(196,123)
60,500	Yokogawa Electric Corp	Bank of America Merrill Lynch	78,181
9,300	Yokogawa Electric Corp	Barclays Bank	12,364
12,000	Yokogawa Electric Corp	Citibank	15,953
13,600	Yokogawa Electric Corp	HSBC	6,954
33,700	Yokogawa Electric Corp	JP Morgan	17,231
111,800	Yokohama Rubber Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	245,292
64,500	Yokohama Rubber Co Ltd	Barclays Bank	112,132
2,700	Yokohama Rubber Co Ltd	Citibank	4,694
34,500	Yokohama Rubber Co Ltd	Credit Suisse	93,014
19,200	Yokohama Rubber Co Ltd	Goldam Sachs	42,125
40,500	Yokohama Rubber Co Ltd	HSBC	109,190
(215,800)	Z Holdings Corp	Citibank	(2,006)
(85,100)	Z Holdings Corp	Credit Suisse	(3,956)
(299,800)	Z Holdings Corp	HSBC	(13,936)
(412,682)	Z Holdings Corp	JP Morgan	(19,183)
6,000	Zenkoku Hosho Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	38,767
10,700	Zenkoku Hosho Co Ltd	Goldam Sachs	69,135
3,900	Zenkoku Hosho Co Ltd	HSBC	25,341
26,000	Zensho Holdings Co Ltd	Barclays Bank	22,479
7,500	Zensho Holdings Co Ltd	Goldam Sachs	6,206
117,200	Zeon Corp	Bank of America Merrill Lynch	116,584
68,300	Zeon Corp	Citibank	43,813
290,000	Zeon Corp	Goldam Sachs	288,477
			<u>753,386</u>
オランダ			
(23,820)	Aalberts NV	Bank of America Merrill Lynch	(89,260)
(12,970)	Aalberts NV	Barclays Bank	(32,161)
(44,661)	Aalberts NV	Goldam Sachs	(167,357)
(481,341)	Aegon NV	Bank of America Merrill Lynch	(193,752)
(727,890)	Aegon NV	Barclays Bank	(174,826)

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)		
(109,670)	Aegon NV	Credit Suisse	(29,511)
42,916	Akzo Nobel NV	Barclays Bank	54,401
3,900	Akzo Nobel NV	Credit Suisse	13,357
(167,100)	Altice Europe NV	Bank of America Merrill Lynch	(33,074)
(130,420)	Altice Europe NV	Barclays Bank	(13,922)
(518,340)	Altice Europe NV	Deutsche Bank	(102,594)
(28,920)	Altice Europe NV	Goldam Sachs	(5,724)
17,570	ArcelorMittal SA	Barclays Bank	8,870
20,540	ArcelorMittal SA	Credit Suisse	30,817
65,600	ArcelorMittal SA	Deutsche Bank	55,146
58,400	ArcelorMittal SA	HSBC	(32,413)
2,500	ASM International NV	Bank of America Merrill Lynch	17,763
30,800	ASM International NV	Deutsche Bank	218,845
1,260	ASML Holding NV	Deutsche Bank	35,797
34,220	ASR Nederland NV	Bank of America Merrill Lynch	101,596
12,110	ASR Nederland NV	Barclays Bank	15,620
8,790	ASR Nederland NV	Goldam Sachs	26,097
89,336	ASR Nederland NV	HSBC	113,244
(6,190)	Boskalis Westminster	Bank of America Merrill Lynch	(13,766)
(52,525)	Boskalis Westminster	Barclays Bank	(9,929)
(37,522)	Boskalis Westminster	Credit Suisse	(37,968)
(79,182)	Boskalis Westminster	Goldam Sachs	(176,093)
(26,065)	Boskalis Westminster	HSBC	(37,461)
(106,150)	Boskalis Westminster	JP Morgan	(107,411)
(1,930)	Galapagos NV	Deutsche Bank	33,479
80,810	ING Groep NV	Bank of America Merrill Lynch	87,341
103,870	ING Groep NV	Deutsche Bank	112,264
85,460	ING Groep NV	Goldam Sachs	92,366
46,890	ING Groep NV	HSBC	41,570
(1,800)	Just Eat Takeaway.com NV	Credit Suisse	(400)
(27,225)	Just Eat Takeaway.com NV	Deutsche Bank	(38,749)
(15,260)	Just Eat Takeaway.com NV	Goldam Sachs	(21,720)
(52,470)	Just Eat Takeaway.com NV	HSBC	(11,669)
46,620	Koninklijke Ahold Delhaize NV	Barclays Bank	10,368
185,970	Koninklijke Ahold Delhaize NV	Deutsche Bank	82,716
8,290	Koninklijke Ahold Delhaize NV	Goldam Sachs	3,687
12,732	Koninklijke DSM NV	Bank of America Merrill Lynch	69,371
3,796	Koninklijke DSM NV	Barclays Bank	2,744
2,000	Koninklijke DSM NV	Citibank	1,446
300	Koninklijke DSM NV	Credit Suisse	300
1,410	Koninklijke DSM NV	HSBC	1,411
992,730	Koninklijke KPN NV	Deutsche Bank	115,906
16,341	Koninklijke Philips NV	Credit Suisse	27,165
89,120	Koninklijke Philips NV	Deutsche Bank	314,633
6,490	Koninklijke Philips NV	Goldam Sachs	22,913

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)			
35,199	Koninklijke Philips NV	HSBC	58,514
(19,380)	Koninklijke Vopak NV	Bank of America Merrill Lynch	(14,007)
(19,417)	Koninklijke Vopak NV	Barclays Bank	(31,523)
(12,210)	Koninklijke Vopak NV	Goldam Sachs	(8,825)
(24,040)	NN Group NV	HSBC	(58,007)
(158,084)	OCI NV	Bank of America Merrill Lynch	(247,852)
(30,440)	OCI NV	Barclays Bank	(19,124)
(18,020)	OCI NV	Credit Suisse	(28,115)
(143,720)	OCI NV	Goldam Sachs	(225,331)
(37,950)	Prosus NV	Bank of America Merrill Lynch	194,957
(15,955)	Prosus NV	Barclays Bank	75,222
(41,800)	Prosus NV	Deutsche Bank	214,735
(170)	Prosus NV	HSBC	(53)
41,290	Randstad NV	Barclays Bank	72,542
17,360	Randstad NV	Deutsche Bank	75,863
2,835	Randstad NV	HSBC	6,084
8,070	Randstad NV	JP Morgan	18,267
184,327	Signify NV	Bank of America Merrill Lynch	472,438
50,730	Signify NV	Barclays Bank	111,408
14,314	Signify NV	Citibank	31,435
4,420	Signify NV	Deutsche Bank	11,329
77,550	Signify NV	Goldam Sachs	198,764
36,740	Signify NV	JP Morgan	70,880
120,840	Unilever NV	Deutsche Bank	278,142
20,163	Wolters Kluwer NV	Bank of America Merrill Lynch	122,415
3,307	Wolters Kluwer NV	Barclays Bank	10,737
132	Wolters Kluwer NV	Citibank	429
73,790	Wolters Kluwer NV	Deutsche Bank	447,997
140	Wolters Kluwer NV	Goldam Sachs	850
50,883	Wolters Kluwer NV	HSBC	170,870
544	Wolters Kluwer NV	JP Morgan	1,827
			2,394,341
ニュージーランド			
(389,086)	Air New Zealand Ltd	JP Morgan	(33,792)
(151,836)	Auckland International Airport Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(75,353)
(31,560)	Auckland International Airport Ltd	Goldam Sachs	(15,663)
(489,257)	Auckland International Airport Ltd	HSBC	(248,879)
(146,640)	Auckland International Airport Ltd	JP Morgan	(74,431)
233,596	Contact Energy Ltd	Bank of America Merrill Lynch	14,491
23,835	Contact Energy Ltd	Barclays Bank	296
455,474	Contact Energy Ltd	Goldam Sachs	28,255
16,320	Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd	Barclays Bank	7,897
194,280	Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd	Goldam Sachs	(62,671)
(500,558)	Fletcher Building Ltd	HSBC	(34,157)
(825,066)	Fletcher Building Ltd	JP Morgan	(56,301)

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)			
(52,352)	Mercury NZ Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,273
(219,911)	Mercury NZ Ltd	Barclays Bank	12,278
(128,580)	Mercury NZ Ltd	HSBC	11,965
(99,990)	Mercury NZ Ltd	JP Morgan	9,304
(564,683)	Meridian Energy Ltd	HSBC	(17,515)
(305,393)	Meridian Energy Ltd	JP Morgan	(9,472)
(18,487)	Ryman Healthcare Ltd	Barclays Bank	3,211
(230,076)	Ryman Healthcare Ltd	HSBC	5,709
(162,520)	Ryman Healthcare Ltd	JP Morgan	4,033
(834,116)	SKYCITY Entertainment Group Ltd	HSBC	26,410
(627,037)	SKYCITY Entertainment Group Ltd	JP Morgan	19,449
			(482,663)
ノルウェー			
(17,070)	Adevinta ASA	Barclays Bank	(4,391)
(89,763)	Adevinta ASA	Goldam Sachs	(76,667)
(29,411)	Adevinta ASA	JP Morgan	(15,889)
9,750	Aker ASA 'A'	Bank of America Merrill Lynch	24,280
24,814	Aker ASA 'A'	Deutsche Bank	61,794
13,524	Aker ASA 'A'	Goldam Sachs	33,679
6,560	Aker ASA 'A'	JP Morgan	270
(92,236)	Aker BP ASA	Deutsche Bank	6,169
(111,650)	Aker BP ASA	Goldam Sachs	7,468
(9,660)	DNB ASA	Deutsche Bank	(17,595)
(20,970)	DNB ASA	Goldam Sachs	(38,195)
(28,390)	Equinor ASA	Bank of America Merrill Lynch	(4,820)
(10,760)	Equinor ASA	Barclays Bank	5,758
(330,170)	Equinor ASA	Deutsche Bank	(56,060)
(59,700)	Equinor ASA	Goldam Sachs	(10,137)
(30,520)	Gjensidige Forsikring ASA	Barclays Bank	(2,827)
(29,550)	Gjensidige Forsikring ASA	Deutsche Bank	(6,690)
(14,000)	Gjensidige Forsikring ASA	Goldam Sachs	(3,169)
(11,990)	Gjensidige Forsikring ASA	HSBC	953
(98,950)	Gjensidige Forsikring ASA	JP Morgan	19,346
(311,888)	Leroy Seafood Group ASA	Bank of America Merrill Lynch	(23,750)
(139,674)	Leroy Seafood Group ASA	Barclays Bank	19,260
(78,230)	Leroy Seafood Group ASA	Credit Suisse	19,803
(388,095)	Leroy Seafood Group ASA	Goldam Sachs	(29,553)
(40,360)	Leroy Seafood Group ASA	HSBC	10,217
(196,351)	Mowi ASA	Bank of America Merrill Lynch	(35,359)
(77,320)	Mowi ASA	Barclays Bank	(3,978)
(126,756)	Mowi ASA	Credit Suisse	(54,783)
(15,930)	Mowi ASA	Goldam Sachs	(2,869)
(236,900)	Norsk Hydro ASA	Bank of America Merrill Lynch	(43,393)
(325,830)	Norsk Hydro ASA	Barclays Bank	(39,564)
(55,420)	Norsk Hydro ASA	Deutsche Bank	(10,151)

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)			
31,360	Orkla ASA	Deutsche Bank	6,390
513,564	Orkla ASA	HSBC	122,607
(47,670)	Salmar ASA	Bank of America Merrill Lynch	(97,127)
(40,380)	Salmar ASA	Barclays Bank	(2,909)
(14,823)	Salmar ASA	Deutsche Bank	(30,202)
(2,110)	Salmar ASA	Goldam Sachs	(4,299)
37,320	Schibsted ASA 'A'	Bank of America Merrill Lynch	89,865
48	Schibsted ASA 'A'	Barclays Bank	50
22,495	Schibsted ASA 'A'	Citibank	23,380
18,137	Schibsted ASA 'A'	Credit Suisse	40,023
63,180	Schibsted ASA 'A'	Deutsche Bank	152,134
15,748	Schibsted ASA 'A'	Goldam Sachs	37,920
6,630	Schibsted ASA 'A'	HSBC	14,054
5,930	Schibsted ASA 'A'	JP Morgan	12,571
37,976	Schibsted ASA 'B'	Bank of America Merrill Lynch	110,202
68,210	Schibsted ASA 'B'	Barclays Bank	77,210
7,889	Schibsted ASA 'B'	Deutsche Bank	22,893
61,707	Schibsted ASA 'B'	Goldam Sachs	179,067
13,420	Schibsted ASA 'B'	HSBC	29,000
(76,750)	Subsea 7 SA	Bank of America Merrill Lynch	(31,434)
(215,530)	Subsea 7 SA	Barclays Bank	(55,891)
(99,769)	Subsea 7 SA	Deutsche Bank	(40,861)
(84,320)	Subsea 7 SA	Goldam Sachs	(34,534)
(25,481)	Subsea 7 SA	HSBC	(11,438)
128,490	Telenor ASA	Bank of America Merrill Lynch	7,933
140,830	Telenor ASA	Barclays Bank	78,981
96,236	Telenor ASA	Citibank	53,972
21,380	Telenor ASA	Deutsche Bank	1,320
20,170	Telenor ASA	Goldam Sachs	1,245
6,809	Telenor ASA	HSBC	(2,277)
7	TOMRA Systems ASA	Bank of America Merrill Lynch	6
24,210	Yara International ASA	Barclays Bank	13,453
35,040	Yara International ASA	Deutsche Bank	63,822
			556,283
ポルトガル			
(92,210)	EDP - Energias de Portugal SA	Bank of America Merrill Lynch	(33,528)
(745,230)	EDP - Energias de Portugal SA	Barclays Bank	(829)
(115,360)	EDP - Energias de Portugal SA	Deutsche Bank	(41,946)
(1,255)	EDP Renovaveis SA	Bank of America Merrill Lynch	(1,144)
(41,264)	EDP Renovaveis SA	Deutsche Bank	(37,625)
170,470	Galp Energia SGPS SA	Barclays Bank	28,433
26,000	Galp Energia SGPS SA	Deutsche Bank	19,197
8,890	Jeronimo Martins SGPS SA	Bank of America Merrill Lynch	15,767
3,280	Jeronimo Martins SGPS SA	Barclays Bank	55
42,850	Jeronimo Martins SGPS SA	Citibank	715

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)			
4,273	Jeronimo Martins SGPS SA	Deutsche Bank	7,578
47,250	Jeronimo Martins SGPS SA	Goldam Sachs	83,801
19,470	Jeronimo Martins SGPS SA	HSBC	(3,139)
			37,335
シンガポール			
255,300	CapitaLand Ltd	Bank of America Merrill Lynch	10,835
234,400	CapitaLand Ltd	Barclays Bank	3,316
369,300	CapitaLand Ltd	Credit Suisse	(6,184)
192,400	CapitaLand Ltd	Goldam Sachs	8,166
60,600	CapitaLand Ltd	HSBC	(1,715)
36,900	City Developments Ltd	Barclays Bank	8,092
26,700	City Developments Ltd	Citibank	5,855
24,400	City Developments Ltd	Credit Suisse	(808)
(117,900)	ComfortDelGro Corp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,668
(173,200)	ComfortDelGro Corp Ltd	Barclays Bank	12,252
26,300	Dairy Farm International Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(14,991)
39,600	Dairy Farm International Holdings Ltd	Barclays Bank	(12,672)
22,200	Dairy Farm International Holdings Ltd	Citibank	(7,104)
16,100	Dairy Farm International Holdings Ltd	Credit Suisse	(9,338)
55,900	Dairy Farm International Holdings Ltd	Goldam Sachs	(31,863)
323,100	Hongkong Land Holdings Ltd	Barclays Bank	77,544
72,900	Hongkong Land Holdings Ltd	Credit Suisse	(25,515)
38,200	Hongkong Land Holdings Ltd	Goldam Sachs	(3,438)
(18,800)	Jardine Cycle & Carriage Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(28,725)
(205,700)	Jardine Cycle & Carriage Ltd	Goldam Sachs	(314,290)
(30,900)	Jardine Cycle & Carriage Ltd	HSBC	(33,223)
(37,000)	Jardine Cycle & Carriage Ltd	JP Morgan	(39,782)
2,900	Jardine Matheson Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(11,629)
1,400	Jardine Matheson Holdings Ltd	Barclays Bank	(1,036)
5,200	Jardine Matheson Holdings Ltd	Goldam Sachs	(20,852)
32,500	Jardine Strategic Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(27,950)
24,800	Jardine Strategic Holdings Ltd	Barclays Bank	-
27,900	Jardine Strategic Holdings Ltd	Citibank	-
20,000	Jardine Strategic Holdings Ltd	Credit Suisse	(34,927)
60,600	Jardine Strategic Holdings Ltd	Goldam Sachs	(52,116)
16,800	Jardine Strategic Holdings Ltd	JP Morgan	(30,240)
(423,700)	Keppel Corp Ltd	Citibank	(2,997)
(914,600)	Keppel Corp Ltd	Goldam Sachs	51,756
146,300	SATS Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4,140
26,000	SATS Ltd	Barclays Bank	(2,391)
1,069,800	SATS Ltd	Credit Suisse	(234,589)
436,100	SATS Ltd	Goldam Sachs	12,339
49,900	SATS Ltd	JP Morgan	(10,942)
(574,700)	Sembcorp Industries Ltd	Barclays Bank	69,109
(293,000)	Sembcorp Industries Ltd	Goldam Sachs	29,016

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)			
(2,723,400)	Sembcorp Marine Ltd	Barclays Bank	38,529
(1,358,439)	Sembcorp Marine Ltd	Citibank	19,218
(1,586,800)	Sembcorp Marine Ltd	Credit Suisse	56,122
(499,200)	Sembcorp Marine Ltd	HSBC	17,656
(292,543)	Sembcorp Marine Ltd	JP Morgan	10,347
(127,900)	Singapore Airlines Ltd	Barclays Bank	(17,190)
(295,400)	Singapore Airlines Ltd	Goldam Sachs	16,716
352,800	Singapore Exchange Ltd	Citibank	(386,815)
41,400	Singapore Exchange Ltd	Credit Suisse	(44,806)
397,800	Singapore Technologies Engineering Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(22,511)
807,100	Singapore Technologies Engineering Ltd	Barclays Bank	57,091
155,900	Singapore Technologies Engineering Ltd	Credit Suisse	(13,233)
98,600	Singapore Technologies Engineering Ltd	Goldam Sachs	(5,580)
141,300	Singapore Technologies Engineering Ltd	JP Morgan	(11,994)
176,900	StarHub Ltd	Barclays Bank	(3,754)
154,900	StarHub Ltd	Citibank	(3,287)
120,200	StarHub Ltd	Credit Suisse	(5,952)
1,018,800	StarHub Ltd	Goldam Sachs	(21,620)
162,000	StarHub Ltd	HSBC	(8,021)
70,800	StarHub Ltd	JP Morgan	(3,506)
71,000	United Overseas Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	5,022
167,000	United Overseas Bank Ltd	Barclays Bank	4,725
57,100	United Overseas Bank Ltd	Goldam Sachs	4,039
(325,700)	UOL Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(41,470)
(33,600)	UOL Group Ltd	Barclays Bank	(8,319)
(214,300)	UOL Group Ltd	Goldam Sachs	(27,286)
(69,200)	Venture Corp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	6,364
(136,700)	Venture Corp Ltd	Barclays Bank	-
(143,000)	Venture Corp Ltd	Goldam Sachs	13,150
(18,000)	Venture Corp Ltd	JP Morgan	3,998
(95,000)	Wilmar International Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(10,080)
(88,200)	Wilmar International Ltd	Barclays Bank	(12,478)
(43,800)	Wilmar International Ltd	Goldam Sachs	(4,647)
(65,500)	Wilmar International Ltd	HSBC	(23,629)
181,800	Yanlord Land Group Ltd	Citibank	6,430
1,231,600	Yanlord Land Group Ltd	Credit Suisse	43,560
363,300	Yanlord Land Group Ltd	JP Morgan	12,849
			(1,025,591)
韓国			
2,230	Amorepacific Corp	Barclays Bank	(12,976)
15,730	AMOREPACIFIC Group	Barclays Bank	29,630
5,529	AMOREPACIFIC Group	Citibank	10,415
4,850	AMOREPACIFIC Group	Goldam Sachs	9,662
10,910	AMOREPACIFIC Group	JP Morgan	(6,870)
(1,310)	AMOREPACIFIC Group (Pref)	Barclays Bank	891

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
韓国(続き)			
(47)	AMOREPACIFIC Group (Pref)	Credit Suisse	166
(252)	AMOREPACIFIC Group (Pref)	JP Morgan	892
(4,879)	BGF retail Co Ltd	JP Morgan	(55,963)
77,100	BNK Financial Group Inc	Barclays Bank	24,549
78,470	BNK Financial Group Inc	Citibank	24,985
393,922	BNK Financial Group Inc	Credit Suisse	44,792
241,025	BNK Financial Group Inc	Goldam Sachs	104,641
61,882	BNK Financial Group Inc	HSBC	7,036
50,676	BNK Financial Group Inc	JP Morgan	5,762
(6,474)	Celltrion Healthcare Co Ltd	Barclays Bank	576
(64,996)	Celltrion Healthcare Co Ltd	Citibank	5,779
(66,936)	Celltrion Healthcare Co Ltd	Credit Suisse	(78,813)
(7,224)	Celltrion Healthcare Co Ltd	HSBC	(8,506)
(13,795)	Celltrion Inc	Credit Suisse	2,335
72,120	Cheil Worldwide Inc	Barclays Bank	(24,494)
106,182	Cheil Worldwide Inc	Credit Suisse	(117,451)
117,070	Cheil Worldwide Inc	Goldam Sachs	(42,782)
7,882	Cheil Worldwide Inc	HSBC	(8,719)
8,571	CJ CheilJedang Corp	Barclays Bank	(33,674)
490	CJ CheilJedang Corp	Goldam Sachs	(5,289)
1,680	CJ CheilJedang Corp	HSBC	21,401
2,349	CJ Corp	Bank of America Merrill Lynch	21,653
16,100	CJ Corp	Barclays Bank	41,504
3,388	CJ Corp	Citibank	8,734
4,979	CJ Corp	Credit Suisse	42,938
7,007	CJ Corp	Goldam Sachs	64,589
32,630	CJ Corp	JP Morgan	281,395
16,296	CJ ENM Co Ltd	Barclays Bank	37,592
(4,344)	CJ Logistics Corp	Citibank	(18,630)
(14,210)	CJ Logistics Corp	JP Morgan	(169,865)
6,100	Coway Co Ltd	Barclays Bank	11,438
4,930	Coway Co Ltd	Credit Suisse	15,357
13,100	Coway Co Ltd	Goldam Sachs	46,817
20,036	Coway Co Ltd	JP Morgan	62,411
39,882	Daelim Industrial Co Ltd	Credit Suisse	314,314
29,055	Daelim Industrial Co Ltd	HSBC	228,986
(37,767)	Daewoo Engineering & Construction Co Ltd	Barclays Bank	(10,392)
(667)	Daewoo Engineering & Construction Co Ltd	Goldam Sachs	(177)
(136,542)	Daewoo Engineering & Construction Co Ltd	JP Morgan	(22,664)
83,694	Daewoo Shipbuilding & Marine Engineering Co Ltd	Barclays Bank	322,989
7,533	Daewoo Shipbuilding & Marine Engineering Co Ltd	Citibank	29,071
6,282	Daewoo Shipbuilding & Marine Engineering Co Ltd	Credit Suisse	21,746
71,094	Daewoo Shipbuilding & Marine Engineering Co Ltd	Goldam Sachs	298,517

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
韓国(続き)			
57,630	Daewoo Shipbuilding & Marine Engineering Co Ltd	HSBC	199,490
37,176	Daewoo Shipbuilding & Marine Engineering Co Ltd	JP Morgan	128,687
(14,770)	DB Insurance Co Ltd	Barclays Bank	31,076
(33,144)	DB Insurance Co Ltd	Goldam Sachs	208,963
(2,873)	DB Insurance Co Ltd	HSBC	5,657
86,970	DGB Financial Group Inc	Barclays Bank	19,590
115,587	DGB Financial Group Inc	Credit Suisse	4,833
290,340	DGB Financial Group Inc	Goldam Sachs	99,852
155,620	DGB Financial Group Inc	HSBC	6,506
10,769	DGB Financial Group Inc	JP Morgan	450
(3,406)	Dongsuh Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,523
(42,249)	Dongsuh Cos Inc	Citibank	17,769
(26,801)	Dongsuh Cos Inc	Credit Suisse	19,792
(10,792)	Dongsuh Cos Inc	JP Morgan	7,969
164,305	Doosan Bobcat Inc	HSBC	12,669
11,980	Doosan Bobcat Inc	JP Morgan	924
6,490	Doosan Co Ltd	Barclays Bank	5,533
1	Doosan Co Ltd	Citibank	1
11,929	Doosan Co Ltd	Credit Suisse	(25,687)
17,317	Doosan Co Ltd	Goldam Sachs	22,843
(40,327)	Doosan Heavy Industries & Construction Co Ltd	Citibank	(10,590)
194,470	Doosan Infracore Co Ltd	Barclays Bank	(45,011)
336,974	Doosan Infracore Co Ltd	Goldam Sachs	(66,048)
(39,881)	Doosan Solus Co Ltd	Citibank	(162,816)
(8,110)	Doosan Solus Co Ltd	JP Morgan	(52,382)
(7,770)	E-MART Inc	Barclays Bank	(24,263)
(15,806)	E-MART Inc	Citibank	(49,356)
(18,456)	E-MART Inc	Credit Suisse	40,920
(6,574)	E-MART Inc	JP Morgan	14,576
81,670	GS Engineering & Construction Corp	Barclays Bank	291,529
4,216	GS Engineering & Construction Corp	Credit Suisse	10,615
84,743	GS Engineering & Construction Corp	Goldam Sachs	315,171
280	GS Engineering & Construction Corp	HSBC	705
5,040	GS Holdings Corp	Barclays Bank	(797)
8,352	GS Holdings Corp	Citibank	(1,321)
30,143	GS Holdings Corp	Credit Suisse	(20,154)
74,992	GS Holdings Corp	Goldam Sachs	31,874
66,625	GS Holdings Corp	HSBC	(69,157)
41,801	GS Holdings Corp	JP Morgan	(43,390)
11,671	GS Retail Co Ltd	Barclays Bank	16,497
18,690	GS Retail Co Ltd	Goldam Sachs	(2,373)
18,203	GS Retail Co Ltd	HSBC	51,669
11,740	GS Retail Co Ltd	JP Morgan	38,930

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
韓国(続き)			
6,817	Hana Financial Group Inc	Citibank	24,602
33,860	Hana Financial Group Inc	Credit Suisse	68,094
101,160	Hana Financial Group Inc	Goldam Sachs	346,872
88,057	Hana Financial Group Inc	HSBC	177,088
70,241	Hana Financial Group Inc	JP Morgan	141,259
29,113	Hankook Tire & Technology Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	67,613
18,610	Hankook Tire & Technology Co Ltd	Barclays Bank	13,113
56,186	Hankook Tire & Technology Co Ltd	Citibank	39,591
38,807	Hankook Tire & Technology Co Ltd	Credit Suisse	22,199
73,763	Hankook Tire & Technology Co Ltd	Goldam Sachs	171,311
13,030	Hankook Tire & Technology Co Ltd	HSBC	7,454
38,362	Hankook Tire & Technology Co Ltd	JP Morgan	21,945
(7,759)	Hanmi Pharm Co Ltd	Barclays Bank	39,437
(8,507)	Hanmi Pharm Co Ltd	Citibank	43,239
(2,136)	Hanmi Pharm Co Ltd	Goldam Sachs	16,355
(60,166)	Hanmi Science Co Ltd	Citibank	18,641
(37,048)	Hanmi Science Co Ltd	Goldam Sachs	(2,554)
(7,645)	Hanmi Science Co Ltd	JP Morgan	17,625
(143,344)	Hanon Systems	Barclays Bank	(94,818)
(34,158)	Hanon Systems	Citibank	(22,594)
(245,060)	Hanon Systems	Credit Suisse	(145,390)
(88,336)	Hanon Systems	JP Morgan	(52,408)
(8,667)	Hanssem Co Ltd	Barclays Bank	718
(7,275)	Hanssem Co Ltd	Credit Suisse	(45,501)
(49,500)	Hanssem Co Ltd	Goldam Sachs	116,971
189,083	Hanwha Aerospace Co Ltd	Barclays Bank	163,649
8,950	Hanwha Aerospace Co Ltd	Citibank	7,746
29,031	Hanwha Aerospace Co Ltd	Credit Suisse	(25,345)
120,269	Hanwha Aerospace Co Ltd	Goldam Sachs	68,764
14,350	Hanwha Aerospace Co Ltd	HSBC	(6,354)
46,430	Hanwha Aerospace Co Ltd	JP Morgan	(40,534)
32,151	Hanwha Solutions Corp	Credit Suisse	42,367
6,062	Hanwha Solutions Corp	JP Morgan	7,988
1	HDC Holdings Co Ltd	Goldam Sachs	-
1	HDC Holdings Co Ltd	JP Morgan	-
(119,932)	Helixmith Co Ltd	Barclays Bank	(50,823)
(50,566)	HLB Inc	Credit Suisse	(447,870)
1,720	Hotel Shilla Co Ltd	HSBC	(1,930)
9	Hyundai Department Store Co Ltd	Barclays Bank	(18)
4,288	Hyundai Department Store Co Ltd	Citibank	(8,589)
2,682	Hyundai Department Store Co Ltd	Credit Suisse	(17,064)
37,793	Hyundai Department Store Co Ltd	Goldam Sachs	(45,591)
8,180	Hyundai Glovis Co Ltd	Barclays Bank	35,467
2,890	Hyundai Glovis Co Ltd	Citibank	12,530
8,260	Hyundai Glovis Co Ltd	Credit Suisse	62,993

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
韓国(続き)			
6,626	Hyundai Glovis Co Ltd	Goldam Sachs	72,774
6,680	Hyundai Glovis Co Ltd	HSBC	50,943
1,750	Hyundai Glovis Co Ltd	JP Morgan	13,346
(10,993)	Hyundai Heavy Industries Holdings Co Ltd	Barclays Bank	(228,155)
(12,313)	Hyundai Heavy Industries Holdings Co Ltd	Credit Suisse	(165,917)
(6,739)	Hyundai Heavy Industries Holdings Co Ltd	Goldam Sachs	(169,010)
(42,000)	Hyundai Marine & Fire Insurance Co Ltd	Barclays Bank	11,184
(139,980)	Hyundai Marine & Fire Insurance Co Ltd	Goldam Sachs	295,184
(27,749)	Hyundai Mipo Dockyard Co Ltd	Citibank	(106,757)
(20,508)	Hyundai Mipo Dockyard Co Ltd	Goldam Sachs	(90,720)
26,284	Hyundai Mobis Co Ltd	Barclays Bank	292,391
3,810	Hyundai Mobis Co Ltd	Credit Suisse	59,425
25,010	Hyundai Mobis Co Ltd	Goldam Sachs	493,880
320	Hyundai Mobis Co Ltd	HSBC	4,991
1,800	Hyundai Mobis Co Ltd	JP Morgan	28,075
(19,682)	Hyundai Motor Co (Pref)	Barclays Bank	(6,796)
(2,850)	Hyundai Motor Co (Pref)	Barclays Bank	(534)
(9,950)	Hyundai Motor Co (Pref)	Citibank	(3,435)
(27,867)	Hyundai Motor Co (Pref)	Credit Suisse	(25,035)
(6,548)	Hyundai Motor Co (Pref)	Credit Suisse	2,392
(15,128)	Hyundai Motor Co (Pref)	Goldam Sachs	(42,249)
(7,015)	Hyundai Motor Co (Pref)	Goldam Sachs	(9,467)
(7,333)	Hyundai Motor Co (Pref)	HSBC	(6,588)
(5,634)	Hyundai Motor Co (Pref)	HSBC	2,058
(2,545)	Hyundai Motor Co (Pref)	JP Morgan	(2,286)
(241,787)	Hyundai Steel Co	Barclays Bank	(375,994)
(2,944)	Hyundai Steel Co	Citibank	(4,578)
(58,178)	Hyundai Steel Co	Credit Suisse	(12,965)
(37,607)	Hyundai Steel Co	Goldam Sachs	(72,359)
6,040	Hyundai Wia Corp	Barclays Bank	10,521
10,100	Hyundai Wia Corp	Credit Suisse	22,672
10,510	Hyundai Wia Corp	JP Morgan	23,593
1,450	Kakao Corp	Barclays Bank	18,968
670	Kakao Corp	Credit Suisse	29,408
1,850	Kakao Corp	HSBC	81,202
(46,826)	Kangwon Land Inc	Citibank	23,823
(59,485)	Kangwon Land Inc	Goldam Sachs	(50,952)
41,251	KB Financial Group Inc	Credit Suisse	23,312
37,741	KB Financial Group Inc	HSBC	21,328
122,510	Kia Motors Corp	Barclays Bank	406,916
39,530	Kia Motors Corp	Citibank	131,298
89,070	Kia Motors Corp	Credit Suisse	236,255
137,260	Kia Motors Corp	Goldam Sachs	551,266
72,934	Kia Motors Corp	HSBC	193,455
4,760	Kia Motors Corp	JP Morgan	12,626

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	韓国(続き)		
29,360	Korea Aerospace Industries Ltd	Barclays Bank	37,249
14,610	Korea Aerospace Industries Ltd	Citibank	18,535
15,440	Korea Aerospace Industries Ltd	Goldam Sachs	23,173
14,000	Korea Aerospace Industries Ltd	HSBC	10,550
24,650	Korea Investment Holdings Co Ltd	Barclays Bank	76,447
55,842	Korea Investment Holdings Co Ltd	Goldam Sachs	316,770
(14,159)	Korea Shipbuilding & Offshore Engineering Co Ltd	Barclays Bank	(123,510)
(37,538)	Korea Shipbuilding & Offshore Engineering Co Ltd	Citibank	(327,447)
(40,178)	Korea Shipbuilding & Offshore Engineering Co Ltd	Credit Suisse	(254,809)
(5,048)	Korea Shipbuilding & Offshore Engineering Co Ltd	Goldam Sachs	(48,609)
(27,548)	Korea Shipbuilding & Offshore Engineering Co Ltd	HSBC	(174,710)
(1,530)	Korea Zinc Co Ltd	Goldam Sachs	(8,981)
3,464	KT&G Corp	Bank of America Merrill Lynch	15,464
10,370	KT&G Corp	Barclays Bank	13,400
48,280	KT&G Corp	Goldam Sachs	215,526
1,650	KT&G Corp	HSBC	5,329
(15,580)	LG Chem Ltd	Barclays Bank	(164,082)
(11,699)	LG Chem Ltd	Goldam Sachs	(395,836)
(4,125)	LG Chem Ltd (Pref)	Barclays Bank	(37,635)
(2,846)	LG Chem Ltd (Pref)	Citibank	(25,966)
(1,100)	LG Chem Ltd (Pref)	Credit Suisse	(12,933)
(1,440)	LG Chem Ltd (Pref)	Goldam Sachs	(24,490)
(475)	LG Chem Ltd (Pref)	HSBC	(5,585)
22,735	LG Corp	Credit Suisse	10,294
28,066	LG Corp	HSBC	12,708
13,240	LG Display Co Ltd	Citibank	(667)
25,100	LG Display Co Ltd	Credit Suisse	(4,892)
32,850	LG Display Co Ltd	HSBC	(11,507)
40,380	LG Electronics Inc	Barclays Bank	95,590
37,227	LG Electronics Inc	Citibank	88,126
90,630	LG Electronics Inc	Goldam Sachs	334,490
230	LG Electronics Inc	HSBC	605
340	LG Household & Health Care Ltd	Goldam Sachs	(31,277)
71,450	LG Uplus Corp	Barclays Bank	(920)
25,450	LG Uplus Corp	HSBC	(3,077)
38,020	LG Uplus Corp	JP Morgan	(4,597)
(7,100)	Lotte Chemical Corp	Barclays Bank	(27,393)
2,430	Lotte Chilsung Beverage Co Ltd	Barclays Bank	(9,087)
3,653	Lotte Chilsung Beverage Co Ltd	Citibank	(13,660)
6,015	Lotte Chilsung Beverage Co Ltd	Credit Suisse	(47,112)
2,255	Lotte Chilsung Beverage Co Ltd	Goldam Sachs	(5,720)
1,594	Lotte Chilsung Beverage Co Ltd	HSBC	(12,485)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
韓国(続き)			
1,664	Lotte Chilsung Beverage Co Ltd	JP Morgan	(13,033)
(57,560)	Lotte Corp	Barclays Bank	67,081
(74,395)	Lotte Corp	Citibank	86,700
(49,800)	Lotte Corp	Credit Suisse	202,700
(8,382)	Lotte Corp	HSBC	34,117
11,168	LOTTE Fine Chemical Co Ltd	Barclays Bank	10,872
49,710	LOTTE Fine Chemical Co Ltd	Credit Suisse	15,548
13,018	LOTTE Fine Chemical Co Ltd	Goldam Sachs	27,731
22,044	LOTTE Fine Chemical Co Ltd	HSBC	6,895
(1)	Lotte Shopping Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1)
18,690	Mando Corp	Barclays Bank	19,155
24,780	Mando Corp	Goldam Sachs	61,189
(13,291)	Medy-Tox Inc	Barclays Bank	151,555
883,894	Mirae Asset Daewoo Co Ltd	Barclays Bank	394,822
103,100	Mirae Asset Daewoo Co Ltd	Goldam Sachs	66,406
2,370	NAVER Corp	Barclays Bank	(9,146)
2,910	NAVER Corp	Citibank	(11,230)
182	NCSOFT Corp	Barclays Bank	(141)
2,260	NCSOFT Corp	Goldam Sachs	73,891
1,400	Netmarble Corp	Barclays Bank	(2,390)
132,853	NH Investment & Securities Co Ltd	Barclays Bank	4,104
9,885	NH Investment & Securities Co Ltd	Credit Suisse	274
160,658	NH Investment & Securities Co Ltd	Goldam Sachs	85,023
47,900	NH Investment & Securities Co Ltd	HSBC	1,330
3,005	NH Investment & Securities Co Ltd	JP Morgan	83
14,790	NHN Corp	Barclays Bank	(27,569)
8,200	NHN Corp	Citibank	(15,285)
2,190	NHN Corp	Goldam Sachs	(10,185)
6,640	NHN Corp	HSBC	16,269
3,520	NHN Corp	JP Morgan	8,625
1,120	NongShim Co Ltd	Citibank	(5,779)
(56,830)	OCI Co Ltd	Barclays Bank	80,297
(1,335)	OCI Co Ltd	Citibank	1,886
(26,802)	OCI Co Ltd	Goldam Sachs	(29,676)
(11,510)	OCI Co Ltd	HSBC	20,680
(928)	OCI Co Ltd	JP Morgan	1,667
5,880	Orion Corp	Barclays Bank	(3,137)
1,060	Orion Corp	Credit Suisse	5,229
5,520	Orion Corp	Goldam Sachs	(39,434)
530	Orion Corp	HSBC	2,614
(647)	Ottogi Corp	Citibank	10,810
(1,222)	Ottogi Corp	Credit Suisse	(5,735)
(998)	Ottogi Corp	HSBC	(4,684)
(57,545)	Paradise Co Ltd	Goldam Sachs	(14,621)
1,803	POSCO	Citibank	12,799

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
韓国(続き)			
1,213	POSCO	Credit Suisse	(1,709)
15,973	POSCO	JP Morgan	(22,501)
(145,057)	POSCO Chemical Co Ltd	Barclays Bank	347,966
(55,795)	POSCO Chemical Co Ltd	Citibank	133,842
(35,331)	POSCO Chemical Co Ltd	Credit Suisse	(77,230)
(47)	POSCO Chemical Co Ltd	HSBC	(103)
(4,204)	POSCO Chemical Co Ltd	JP Morgan	(9,189)
64,831	Posco International Corp	Credit Suisse	88,208
203,556	Posco International Corp	Goldam Sachs	331,337
71,600	Posco International Corp	HSBC	97,417
3,198	Posco International Corp	JP Morgan	4,351
(4,061)	S-1 Corp	Goldam Sachs	(4,089)
(4,897)	Samsung Biologics Co Ltd	Credit Suisse	(98,989)
(7,873)	Samsung Biologics Co Ltd	Goldam Sachs	(84,795)
(8,070)	Samsung C&T Corp	Barclays Bank	(1,174)
(390)	Samsung C&T Corp	Citibank	(57)
(6,890)	Samsung C&T Corp	Credit Suisse	44,555
(11,890)	Samsung C&T Corp	Goldam Sachs	3,826
(851)	Samsung C&T Corp	HSBC	5,503
24,820	Samsung Card Co Ltd	Barclays Bank	4,298
881	Samsung Card Co Ltd	Citibank	153
13,101	Samsung Card Co Ltd	Credit Suisse	(11,210)
30,052	Samsung Card Co Ltd	Goldam Sachs	(1,898)
12,720	Samsung Card Co Ltd	JP Morgan	(10,884)
(18,919)	Samsung Electro-Mechanics Co Ltd	Barclays Bank	(89,454)
(10,740)	Samsung Electro-Mechanics Co Ltd	Citibank	(50,781)
134,760	Samsung Electronics Co Ltd (Pref)	Goldam Sachs	179,778
147,240	Samsung Engineering Co Ltd	Barclays Bank	99,435
10,572	Samsung Engineering Co Ltd	Credit Suisse	2,325
376,650	Samsung Engineering Co Ltd	Goldam Sachs	360,192
68,920	Samsung Engineering Co Ltd	HSBC	15,157
(442,761)	Samsung Heavy Industries Co Ltd	Barclays Bank	(241,315)
(434,924)	Samsung Heavy Industries Co Ltd	Citibank	(237,044)
(584,384)	Samsung Heavy Industries Co Ltd	Credit Suisse	(231,236)
(20,211)	Samsung Heavy Industries Co Ltd	Goldam Sachs	(11,099)
(127,357)	Samsung Heavy Industries Co Ltd	HSBC	(50,394)
(10,820)	Samsung Heavy Industries Co Ltd	JP Morgan	(4,281)
(12,946)	Samsung Life Insurance Co Ltd	Credit Suisse	27,979
(8,467)	Samsung Life Insurance Co Ltd	HSBC	18,299
(17,575)	Samsung SDI Co Ltd	Barclays Bank	(320,614)
(1,752)	Samsung SDI Co Ltd	Citibank	(31,961)
(146)	Samsung SDI Co Ltd	Goldam Sachs	(6,445)
5,200	Samsung SDS Co Ltd	Barclays Bank	66,292
2,897	Samsung SDS Co Ltd	Citibank	36,932
8,411	Samsung SDS Co Ltd	Credit Suisse	80,252

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
韓国(続き)			
1,670	Samsung SDS Co Ltd	Goldam Sachs	19,473
7,719	Samsung SDS Co Ltd	HSBC	73,649
14,205	Samsung SDS Co Ltd	JP Morgan	135,534
8,222	Samsung Securities Co Ltd	Credit Suisse	(9,570)
32,150	Samsung Securities Co Ltd	Goldam Sachs	13,891
10,550	Samsung Securities Co Ltd	HSBC	(12,279)
6,377	Shinhan Financial Group Co Ltd	Citibank	5,483
48,857	Shinhan Financial Group Co Ltd	Credit Suisse	(14,131)
73,842	Shinhan Financial Group Co Ltd	HSBC	(21,357)
35,265	Shinhan Financial Group Co Ltd	JP Morgan	(10,200)
(2,509)	SK Holdings Co Ltd	Barclays Bank	(20,711)
(1,660)	SK Holdings Co Ltd	Goldam Sachs	(74,926)
(54,667)	SK Hynix Inc	Barclays Bank	(4,476)
(11,427)	SK Hynix Inc	Goldam Sachs	8,264
(20,747)	SK Innovation Co Ltd	Barclays Bank	(249,183)
(8,013)	SK Innovation Co Ltd	Goldam Sachs	(152,235)
(108,047)	SK Networks Co Ltd	Citibank	(13,427)
(295,133)	SK Networks Co Ltd	Goldam Sachs	(66,837)
12,300	SK Telecom Co Ltd	Barclays Bank	71,977
9,339	SK Telecom Co Ltd	Credit Suisse	44,067
5,460	SK Telecom Co Ltd	Goldam Sachs	47,462
232	SK Telecom Co Ltd	HSBC	1,095
1,730	SK Telecom Co Ltd	JP Morgan	8,163
(18,160)	SKC Co Ltd	Barclays Bank	(63,582)
(9,845)	SKC Co Ltd	Citibank	(34,470)
(85,979)	SKC Co Ltd	Goldam Sachs	(402,063)
(3,000)	SKC Co Ltd	HSBC	(13,877)
(40,074)	SKC Co Ltd	JP Morgan	(185,363)
(25,830)	S-Oil Corp	Barclays Bank	(33,711)
(53,236)	S-Oil Corp	Citibank	(69,479)
(29,676)	S-Oil Corp	Credit Suisse	(15,525)
(8,510)	S-Oil Corp	HSBC	(4,452)
(21,908)	Ssangyong Cement Industrial Co Ltd	Citibank	(777)
(142,874)	Ssangyong Cement Industrial Co Ltd	Credit Suisse	25,316
(211,856)	Ssangyong Cement Industrial Co Ltd	Goldam Sachs	10,412
(121,597)	Ssangyong Cement Industrial Co Ltd	JP Morgan	21,546
(6,840)	Yuhan Corp	Citibank	901
(12,395)	Yuhan Corp	Credit Suisse	(20,023)
(97,155)	Yuhan Corp	Goldam Sachs	964
(13,775)	Yuhan Corp	HSBC	(22,252)
			<u>5,145,814</u>
スペイン			
34,921	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	Barclays Bank	94,358
92,230	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	Deutsche Bank	104,606

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)			
88,021	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	Goldam Sachs	99,833
341	Aena SME SA	Bank of America Merrill Lynch	9,593
8,782	Aena SME SA	Credit Suisse	210,927
12,347	Aena SME SA	Goldam Sachs	347,350
6,254	Aena SME SA	HSBC	150,209
1,867	Industria de Diseno Textil SA	Barclays Bank	3,965
32,613	Industria de Diseno Textil SA	Goldam Sachs	95,012
56,279	Repsol SA	Bank of America Merrill Lynch	18,398
48,640	Repsol SA	Citibank	5,733
212,600	Repsol SA	Deutsche Bank	69,502
150,659	Repsol SA	JP Morgan	(39,536)
			<u>1,169,950</u>
スウェーデン			
21,259	Assa Abloy AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	37,460
3,560	Assa Abloy AB 'B'	Barclays Bank	2,882
20,780	Assa Abloy AB 'B'	Deutsche Bank	36,616
44,560	Assa Abloy AB 'B'	Goldam Sachs	78,518
8,540	Atlas Copco AB 'A'	Barclays Bank	12,472
31,730	Atlas Copco AB 'A'	Goldam Sachs	113,835
2	Axfood AB	Credit Suisse	1
1	Axfood AB	Deutsche Bank	1
(89,215)	Boliden AB	Bank of America Merrill Lynch	(123,213)
(266,030)	Boliden AB	Barclays Bank	67,569
(7,500)	Boliden AB	Credit Suisse	(4,445)
(43,516)	Boliden AB	Deutsche Bank	(60,099)
19,040	Castellum AB	Bank of America Merrill Lynch	16,120
20,250	Castellum AB	Deutsche Bank	17,144
19,800	Castellum AB	Goldam Sachs	16,763
8,890	Castellum AB	JP Morgan	8,027
11,320	Electrolux AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	20,845
39,010	Electrolux AB 'B'	Barclays Bank	40,871
39,600	Electrolux AB 'B'	Citibank	41,489
30,570	Electrolux AB 'B'	Deutsche Bank	56,293
95,790	Electrolux AB 'B'	Goldam Sachs	176,391
(93,484)	Electrolux Professional AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(50,456)
(59,568)	Electrolux Professional AB 'B'	Barclays Bank	(2,900)
(144,900)	Electrolux Professional AB 'B'	Goldam Sachs	(78,207)
(3,236)	Electrolux Professional AB 'B'	JP Morgan	(1,589)
(59,500)	Elekta AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(64,606)
(181,028)	Elekta AB 'B'	Barclays Bank	21,840
(117,691)	Epiroc AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(83,574)
(35,120)	Epiroc AB 'B'	Goldam Sachs	(24,939)
(57,433)	Epiroc AB 'B'	HSBC	(22,185)
(5,690)	EQT AB	Barclays Bank	602
(91,060)	EQT AB	Credit Suisse	18,310

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)		
(169,817)	EQT AB	Goldam Sachs	(124,903)
222,477	Essity AB 'B'	Barclays Bank	113,014
51,045	Essity AB 'B'	Goldam Sachs	41,056
215,710	Hennes & Mauritz AB 'B'	Deutsche Bank	546,743
(17,362)	Hexagon AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(113,552)
(62,090)	Hexagon AB 'B'	Goldam Sachs	(406,085)
32,199	Hufvudstaden AB	Bank of America Merrill Lynch	28,283
88,447	Hufvudstaden AB	Barclays Bank	58,970
48,691	Hufvudstaden AB	Citibank	32,464
109,410	Hufvudstaden AB	Deutsche Bank	96,104
19,403	Hufvudstaden AB	HSBC	(13,142)
(30,040)	Husqvarna AB 'B'	Citibank	(11,699)
(3,890)	ICA Gruppen AB	Bank of America Merrill Lynch	(5,969)
(50,398)	ICA Gruppen AB	Barclays Bank	(87,471)
(9,008)	ICA Gruppen AB	Goldam Sachs	(13,823)
266,497	Industrivarden AB 'A'	Barclays Bank	358,182
33,894	Industrivarden AB 'A'	Goldam Sachs	82,859
85,910	Industrivarden AB 'C'	Bank of America Merrill Lynch	201,838
248,394	Industrivarden AB 'C'	Barclays Bank	337,794
(3)	Intrum AB	JP Morgan	(7)
(23,790)	Investment AB Latour 'B'	Credit Suisse	(47,836)
(389,288)	Investment AB Latour 'B'	Goldam Sachs	(255,429)
(84,683)	Investment AB Latour 'B'	HSBC	(170,277)
(90,240)	Investment AB Latour 'B'	JP Morgan	(181,451)
8,469	Investor AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	41,497
39,099	Investor AB 'B'	Citibank	107,997
54,172	Investor AB 'B'	HSBC	122,686
42,402	Investor AB 'B'	JP Morgan	96,030
(38,480)	Kinnevik AB 'B'	Deutsche Bank	(95,700)
(10,340)	L E Lundbergforetagen AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(59,091)
(5,430)	L E Lundbergforetagen AB 'B'	Barclays Bank	(21,147)
82,310	Lundin Energy AB	Barclays Bank	(49,652)
9,530	Lundin Energy AB	Citibank	(5,749)
75,230	Lundin Energy AB	Deutsche Bank	55,731
22,440	Lundin Energy AB	JP Morgan	1,662
(5)	Modern Times Group MTG AB 'B'	Citibank	(1)
(2)	NCC AB 'B'	Credit Suisse	-
(710)	Nibe Industrier AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(1,631)
(38,695)	Nibe Industrier AB 'B'	Credit Suisse	(111,591)
(101,009)	Nibe Industrier AB 'B'	Goldam Sachs	(231,967)
(57,555)	Saab AB 'B'	Goldam Sachs	(163,239)
(96,474)	Saab AB 'B'	JP Morgan	(160,294)
154,669	Sandvik AB	Credit Suisse	107,214
14,150	Sandvik AB	Goldam Sachs	23,810
59,646	Sandvik AB	HSBC	41,346

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)			
54,198	Securitas AB 'B'	Barclays Bank	46,460
117,430	Securitas AB 'B'	Goldam Sachs	192,627
(50,060)	Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A'	Barclays Bank	(39,098)
(47,050)	Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A'	Deutsche Bank	(53,378)
43,060	Skanska AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	86,356
9,580	Skanska AB 'B'	Barclays Bank	13,890
8,950	Skanska AB 'B'	Deutsche Bank	17,949
31,710	Skanska AB 'B'	Goldam Sachs	63,594
(9,840)	SKF AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(26,294)
(9,810)	SKF AB 'B'	Credit Suisse	(16,611)
(79,960)	SKF AB 'B'	Goldam Sachs	(213,669)
(13,410)	Svenska Cellulosa AB SCA 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(25,190)
(67,660)	Svenska Cellulosa AB SCA 'B'	Deutsche Bank	(127,098)
(436,861)	Svenska Handelsbanken AB 'A'	Deutsche Bank	(254,281)
(44,370)	Swedbank AB 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(86,588)
(149,230)	Swedbank AB 'A'	Barclays Bank	(215,732)
(48,000)	Swedbank AB 'A'	Deutsche Bank	(93,672)
(79,670)	Swedbank AB 'A'	Goldam Sachs	(155,476)
83,259	Swedish Match AB	Bank of America Merrill Lynch	287,247
11,410	Swedish Match AB	Citibank	19,320
24,894	Swedish Match AB	Goldam Sachs	85,885
35,310	Swedish Match AB	JP Morgan	152,463
(43,320)	Swedish Orphan Biovitrum AB	Deutsche Bank	(50,888)
16,900	Tele2 AB 'B'	Credit Suisse	(1,699)
190,630	Tele2 AB 'B'	Deutsche Bank	87,758
12,830	Tele2 AB 'B'	HSBC	618
25,570	Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B'	Barclays Bank	1,894
37,440	Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B'	Citibank	2,774
28,590	Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B'	Credit Suisse	3,872
(123,200)	Telia Co AB	HSBC	3,651
19,490	Trelleborg AB 'B'	Citibank	16,192
56,470	Trelleborg AB 'B'	Deutsche Bank	84,264
28,160	Trelleborg AB 'B'	Goldam Sachs	42,020
29,490	Trelleborg AB 'B'	JP Morgan	16,697
182,520	Volvo AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	268,493
185,190	Volvo AB 'B'	Barclays Bank	151,889
44,706	Volvo AB 'B'	Citibank	36,667
			<u>754,316</u>
スイス			
(245,680)	ABB Ltd RegS	Barclays Bank	(215,531)
(203,310)	ABB Ltd RegS	Goldam Sachs	(422,155)
5	Allreal Holding AG RegS	Credit Suisse	17
1	Allreal Holding AG RegS	HSBC	3
(3,720)	Baloise Holding AG RegS	Barclays Bank	(15,062)
27,370	Banque Cantonale Vaudoise RegS	Bank of America Merrill Lynch	241,533

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)		
9,500	Banque Cantonale Vaudoise RegS	Barclays Bank	57,205
3,800	Banque Cantonale Vaudoise RegS	Citibank	22,882
1,730	Banque Cantonale Vaudoise RegS	Credit Suisse	11,675
230	Banque Cantonale Vaudoise RegS	Deutsche Bank	2,030
2,890	Banque Cantonale Vaudoise RegS	HSBC	19,503
8,530	Banque Cantonale Vaudoise RegS	JP Morgan	57,009
(70)	Barry Callebaut AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	(6,541)
(770)	Barry Callebaut AG RegS	Barclays Bank	(64,753)
(770)	Barry Callebaut AG RegS	Goldam Sachs	(71,948)
1	Cembra Money Bank AG	JP Morgan	6
(242)	Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	Goldam Sachs	(62,811)
(70)	Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	JP Morgan	(11,628)
(140,130)	Cie Financiere Richemont SA RegS	Bank of America Merrill Lynch	(657,587)
(10,740)	Cie Financiere Richemont SA RegS	Credit Suisse	(669)
(78,600)	Cie Financiere Richemont SA RegS	Goldam Sachs	(368,845)
(185,318)	Clariant AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	(228,954)
(4,490)	Clariant AG RegS	Barclays Bank	(3,100)
(20,415)	Clariant AG RegS	Goldam Sachs	(25,222)
(327,129)	Credit Suisse Group AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	(453,063)
(51,232)	Credit Suisse Group AG RegS	Citibank	(40,318)
(244,832)	Credit Suisse Group AG RegS	Goldam Sachs	(339,084)
(185,744)	Credit Suisse Group AG RegS	HSBC	(112,619)
(68,413)	Credit Suisse Group AG RegS	JP Morgan	(41,480)
11,007	DKSH Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	38,739
2,150	DKSH Holding AG	Barclays Bank	3,348
2,190	DKSH Holding AG	Citibank	3,411
7,860	DKSH Holding AG	Goldam Sachs	27,663
2,520	DKSH Holding AG	JP Morgan	(3,009)
11,190	Dufry AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	55,648
6,550	Dufry AG RegS	Citibank	20,469
12,420	Dufry AG RegS	Credit Suisse	35,482
15,490	Dufry AG RegS	HSBC	9,167
240	EMS-Chemie Holding AG RegS	Citibank	9,718
360	EMS-Chemie Holding AG RegS	Credit Suisse	27,173
920	EMS-Chemie Holding AG RegS	Goldam Sachs	76,412
1,180	EMS-Chemie Holding AG RegS	HSBC	100,457
250	EMS-Chemie Holding AG RegS	JP Morgan	21,283
(5,540)	Flughafen Zurich AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	(159,896)
(18,380)	Flughafen Zurich AG RegS	Barclays Bank	(290,050)
(1,400)	Flughafen Zurich AG RegS	Goldam Sachs	(40,407)
(1,446)	Flughafen Zurich AG RegS	JP Morgan	(28,374)
5,360	Geberit AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	223,704
1,321	Geberit AG RegS	Barclays Bank	17,555
3,640	Geberit AG RegS	Goldam Sachs	151,919
682	Georg Fischer AG Reg	JP Morgan	62,309

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)		
480	Georg Fischer AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	75,498
1,290	Georg Fischer AG RegS	Barclays Bank	103,125
1,595	Georg Fischer AG RegS	Credit Suisse	145,723
330	Georg Fischer AG RegS	Goldam Sachs	51,905
20	Georg Fischer AG RegS	HSBC	1,827
170	Givaudan SA RegS	Bank of America Merrill Lynch	30,710
580	Givaudan SA RegS	Barclays Bank	28,302
950	Givaudan SA RegS	Citibank	46,356
107	Givaudan SA RegS	HSBC	17,552
3,010	Helvetia Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	20,938
4,040	Helvetia Holding AG	Citibank	19,504
5,650	Helvetia Holding AG	Goldam Sachs	39,301
(31,422)	Julius Baer Group Ltd	HSBC	(110,917)
5,360	Kuehne + Nagel International AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	28,380
7,120	Kuehne + Nagel International AG RegS	Barclays Bank	8,870
8,070	Kuehne + Nagel International AG RegS	Citibank	10,054
1,740	Kuehne + Nagel International AG RegS	Credit Suisse	2,800
24,090	Kuehne + Nagel International AG RegS	Goldam Sachs	127,553
5,860	Kuehne + Nagel International AG RegS	HSBC	9,116
1,060	Kuehne + Nagel International AG RegS	JP Morgan	1,706
14,070	LafargeHolcim Ltd RegS	Bank of America Merrill Lynch	65,880
14,310	LafargeHolcim Ltd RegS	Barclays Bank	45,610
17,270	LafargeHolcim Ltd RegS	Credit Suisse	5,738
12,330	LafargeHolcim Ltd RegS	Goldam Sachs	57,733
(3,550)	Logitech International SA RegS	Barclays Bank	(9,877)
(3,250)	Logitech International SA RegS	Citibank	(9,043)
(7,602)	Lonza Group AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	(239,141)
(540)	Lonza Group AG RegS	Barclays Bank	1,906
(1,439)	Lonza Group AG RegS	Citibank	5,080
(383)	Lonza Group AG RegS	Goldam Sachs	(12,048)
3,388	Nestle SA RegS	Credit Suisse	(5,417)
9,670	Novartis AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	24,797
16,930	Novartis AG RegS	Barclays Bank	25,486
1,380	Novartis AG RegS	Credit Suisse	1,347
11,200	Novartis AG RegS	Goldam Sachs	28,721
4,649	Novartis AG RegS	HSBC	4,537
8,784	Novartis AG RegS	JP Morgan	8,572
(93,094)	OC Oerlikon Corp AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	(110,665)
(417,906)	OC Oerlikon Corp AG RegS	Barclays Bank	(208,259)
(31,990)	OC Oerlikon Corp AG RegS	Citibank	(15,942)
(107,090)	OC Oerlikon Corp AG RegS	Credit Suisse	(100,619)
(226,001)	OC Oerlikon Corp AG RegS	Goldam Sachs	(268,658)
(74,938)	OC Oerlikon Corp AG RegS	HSBC	(70,410)
89	Pargesa Holding SA	Bank of America Merrill Lynch	725
21,396	Pargesa Holding SA	HSBC	82,190

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)		
330	Partners Group Holding AG	Barclays Bank	8,154
350	Partners Group Holding AG	Citibank	8,648
200	Partners Group Holding AG	Credit Suisse	14,204
610	Partners Group Holding AG	Goldam Sachs	41,165
590	Partners Group Holding AG	JP Morgan	3,798
10,740	PSP Swiss Property AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	71,362
17,650	PSP Swiss Property AG RegS	Barclays Bank	53,141
1,220	PSP Swiss Property AG RegS	Citibank	3,673
3,607	PSP Swiss Property AG RegS	Credit Suisse	(3,488)
56,316	PSP Swiss Property AG RegS	Goldam Sachs	374,193
36,881	PSP Swiss Property AG RegS	HSBC	(153,160)
10,599	Roche Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	(181,565)
2,650	Roche Holding AG	Citibank	(25,724)
17,798	Roche Holding AG	Credit Suisse	(68,369)
2,780	Roche Holding AG	Goldam Sachs	(47,623)
3,961	Roche Holding AG	HSBC	(15,216)
12,440	Schindler Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	165,316
140	SGS SA RegS	Bank of America Merrill Lynch	26,744
450	SGS SA RegS	Barclays Bank	28,032
1,310	SGS SA RegS	Goldam Sachs	250,249
(7,510)	Sika AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	(36,256)
(6,820)	Sika AG RegS	Barclays Bank	72,222
(780)	Sika AG RegS	Credit Suisse	(1,812)
(1,810)	Sika AG RegS	Goldam Sachs	(8,738)
(2,890)	Sika AG RegS	HSBC	(150)
(5,370)	Sika AG RegS	JP Morgan	(279)
14,280	Sonova Holding AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	391,395
750	Sonova Holding AG RegS	Credit Suisse	18,999
3,860	Sonova Holding AG RegS	Goldam Sachs	105,797
750	Sonova Holding AG RegS	JP Morgan	21,043
220	Straumann Holding AG RegS	Barclays Bank	3,563
1,940	Straumann Holding AG RegS	Citibank	31,420
1,320	Straumann Holding AG RegS	Goldam Sachs	146,362
250	Straumann Holding AG RegS	HSBC	10,615
15,113	Sulzer AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	175,733
29,999	Sulzer AG RegS	Barclays Bank	241,375
6,090	Sulzer AG RegS	Citibank	49,001
11,419	Sulzer AG RegS	Credit Suisse	114,403
24,126	Sulzer AG RegS	Goldam Sachs	280,535
4,710	Sulzer AG RegS	HSBC	49,716
1,940	Sulzer AG RegS	JP Morgan	19,436
1,671	Swiss Life Holding AG RegS	Barclays Bank	33,656
1,470	Swiss Life Holding AG RegS	Goldam Sachs	43,343
3,750	Swiss Prime Site AG	Barclays Bank	(1,557)
2,040	Swiss Prime Site AG	Citibank	(847)

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)			
5,690	Swiss Prime Site AG	Goldam Sachs	14,473
4,180	Swiss Prime Site AG	HSBC	(20,614)
(1,671)	Swiss Re AG	Bank of America Merrill Lynch	(9,958)
(26,380)	Swiss Re AG	Barclays Bank	(90,380)
(8,050)	Swiss Re AG	Goldam Sachs	(47,972)
(2,191)	Swisscom AG RegS	Goldam Sachs	(22,065)
(15,800)	Temenos AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	(335,455)
(16,390)	Temenos AG RegS	Credit Suisse	(261,199)
(28,840)	UBS Group AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	(41,320)
(387,030)	UBS Group AG RegS	Barclays Bank	(339,133)
(48,370)	UBS Group AG RegS	Credit Suisse	(42,477)
(59,890)	UBS Group AG RegS	Goldam Sachs	(85,806)
(1,919)	Vifor Pharma AG	Bank of America Merrill Lynch	(5,877)
(4,030)	Vifor Pharma AG	Barclays Bank	(14,644)
(1,050)	Vifor Pharma AG	Credit Suisse	3,052
(969)	Vifor Pharma AG	Goldam Sachs	(2,968)
(2,600)	Zurich Insurance Group AG	Barclays Bank	(63,434)
(3,740)	Zurich Insurance Group AG	Citibank	(91,248)
(12,540)	Zurich Insurance Group AG	Goldam Sachs	(432,234)
(850)	Zurich Insurance Group AG	JP Morgan	(25,463)
			<u>(2,002,453)</u>
台湾			
(47,000)	Advantech Co Ltd	Citibank	(30,765)
452,000	ASE Technology Holding Co Ltd	Barclays Bank	6,373
298,000	ASE Technology Holding Co Ltd	Goldam Sachs	(48,742)
331,000	ASE Technology Holding Co Ltd	HSBC	(68,083)
509,000	ASE Technology Holding Co Ltd	JP Morgan	(103,797)
1,563,000	Asia Cement Corp	Barclays Bank	(21,078)
322,000	Asia Cement Corp	Citibank	(4,342)
3,014,000	Asia Cement Corp	Goldam Sachs	(60,820)
401,000	Asia Cement Corp	JP Morgan	(8,723)
211,000	Asustek Computer Inc	Barclays Bank	40,368
103,000	Asustek Computer Inc	Goldam Sachs	8,680
(124,000)	AU Optronics Corp	Barclays Bank	(44)
(4,405,969)	AU Optronics Corp	JP Morgan	(22,873)
130,000	Capital Securities Corp	Goldam Sachs	(159)
266,000	Capital Securities Corp	HSBC	667
(58,000)	Catcher Technology Co Ltd	Citibank	(24,617)
(375,000)	Catcher Technology Co Ltd	Goldam Sachs	194,703
(18,619)	Cathay Financial Holding Co Ltd	Citibank	(466)
(1,989,272)	Cathay Financial Holding Co Ltd	HSBC	(38,544)
(142,000)	Chailease Holding Co Ltd	Barclays Bank	(22,988)
(1,119,000)	Chailease Holding Co Ltd	Goldam Sachs	(129,435)
(2,430,000)	Cheng Shin Rubber Industry Co Ltd	Citibank	(16,939)
466,000	Chicony Electronics Co Ltd	Barclays Bank	99,340

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	台湾(続き)		
362,000	Chicony Electronics Co Ltd	Goldam Sachs	60,554
8,373,000	China Development Financial Holding Corp	Citibank	41,507
(1,328,000)	China Life Insurance Co Ltd	Citibank	(40,923)
(1,258,000)	China Life Insurance Co Ltd	Goldam Sachs	(38,022)
1,639,000	China Steel Corp	Barclays Bank	9,579
2,080,000	China Steel Corp	Goldam Sachs	10,974
998,000	Chunghwa Telecom Co Ltd	Barclays Bank	(21,234)
386,000	Chunghwa Telecom Co Ltd	Goldam Sachs	6,261
91,000	Chunghwa Telecom Co Ltd	JP Morgan	(24)
697,000	Compal Electronics Inc	Barclays Bank	15,716
483,000	Compal Electronics Inc	HSBC	3,145
294,000	CTBC Financial Holding Co Ltd	Barclays Bank	3,677
1,437,000	CTBC Financial Holding Co Ltd	Citibank	17,974
2,986,000	CTBC Financial Holding Co Ltd	HSBC	3,968
585,000	CTBC Financial Holding Co Ltd	JP Morgan	1,141
(468,000)	Delta Electronics Inc	Citibank	2,690
(18,000)	Eclat Textile Co Ltd	Barclays Bank	(8,472)
(67,275)	Eclat Textile Co Ltd	Citibank	(31,664)
(168,000)	Eclat Textile Co Ltd	Goldam Sachs	(213,952)
(14,000)	Eclat Textile Co Ltd	HSBC	(15,844)
(86,000)	Eclat Textile Co Ltd	JP Morgan	(98,065)
(1,602,157)	Epistar Corp	Citibank	37,130
(226,000)	Epistar Corp	Goldam Sachs	(999)
(765,942)	Epistar Corp	JP Morgan	96,501
374,000	Far EasTone Telecommunications Co Ltd	Barclays Bank	(7,244)
193,000	Far EasTone Telecommunications Co Ltd	Citibank	(3,738)
847,000	Far EasTone Telecommunications Co Ltd	Goldam Sachs	(39,726)
217,000	Far EasTone Telecommunications Co Ltd	HSBC	(19,315)
96,000	Far EasTone Telecommunications Co Ltd	JP Morgan	(8,343)
(245,000)	Feng TAY Enterprise Co Ltd	Citibank	34,527
(355,000)	Feng TAY Enterprise Co Ltd	Goldam Sachs	(304,765)
(165,100)	Feng TAY Enterprise Co Ltd	HSBC	(91,230)
(55,354)	Feng TAY Enterprise Co Ltd	JP Morgan	(30,871)
1,757,000	First Financial Holding Co Ltd	Barclays Bank	51,059
1,842,170	First Financial Holding Co Ltd	Citibank	53,534
1,872,000	First Financial Holding Co Ltd	Goldam Sachs	59,097
2,870,430	First Financial Holding Co Ltd	HSBC	93,599
1,243,310	First Financial Holding Co Ltd	JP Morgan	41,391
(102,000)	Formosa Petrochemical Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3,041)
(686,000)	Formosa Petrochemical Corp	Barclays Bank	55,121
(482,000)	Formosa Petrochemical Corp	Citibank	38,729
(823,000)	Formosa Petrochemical Corp	Goldam Sachs	(24,539)
(243,000)	Formosa Petrochemical Corp	HSBC	8,829
(34,000)	Formosa Petrochemical Corp	JP Morgan	1,141
117,000	Foxconn Technology Co Ltd	Barclays Bank	908

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
台湾(続き)			
176,000	Foxconn Technology Co Ltd	Goldam Sachs	(6,780)
1,094,000	Foxconn Technology Co Ltd	HSBC	(95,188)
(705,000)	Fubon Financial Holding Co Ltd	Citibank	(15,212)
(29,000)	Giant Manufacturing Co Ltd	Citibank	1,251
(232,000)	Giant Manufacturing Co Ltd	Goldam Sachs	(270,965)
(217,000)	Giant Manufacturing Co Ltd	HSBC	(332,130)
(641,791)	Giant Manufacturing Co Ltd	JP Morgan	(986,080)
(200,000)	Hon Hai Precision Industry Co Ltd	Goldam Sachs	11,065
(29,000)	Hotai Motor Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(23,775)
(119,000)	Hotai Motor Co Ltd	Citibank	(92,583)
(179,000)	Hotai Motor Co Ltd	HSBC	(90,142)
(163,510)	Hotai Motor Co Ltd	JP Morgan	(84,999)
3,791,375	Hua Nan Financial Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	45,586
590,520	Hua Nan Financial Holdings Co Ltd	Goldam Sachs	7,100
2,241,055	Hua Nan Financial Holdings Co Ltd	JP Morgan	23,292
(1,332,000)	Inventec Corp	Barclays Bank	(29,739)
(4,069,000)	Inventec Corp	Goldam Sachs	(93,432)
(372,000)	Inventec Corp	HSBC	(10,155)
(92,000)	Inventec Corp	JP Morgan	(2,579)
(3,000)	Largan Precision Co Ltd	Barclays Bank	979
(14,000)	Largan Precision Co Ltd	Citibank	4,570
(27,000)	Largan Precision Co Ltd	Goldam Sachs	223,952
(3,000)	Largan Precision Co Ltd	HSBC	41,314
648,000	Lite-On Technology Corp	Barclays Bank	27,874
378,000	Lite-On Technology Corp	Goldam Sachs	22,460
192,000	MediaTek Inc	Goldam Sachs	320,211
23,000	MediaTek Inc	HSBC	37,698
(2,422,000)	Mega Financial Holding Co Ltd	Goldam Sachs	(28,904)
(333,000)	Mega Financial Holding Co Ltd	HSBC	(6,469)
(698,000)	Nan Ya Plastics Corp	Goldam Sachs	2,178
(51,000)	Nanya Technology Corp	Barclays Bank	(553)
(1,047,000)	Nanya Technology Corp	Goldam Sachs	20,278
(332,000)	Nanya Technology Corp	JP Morgan	47,487
618,000	Pegatron Corp	Barclays Bank	76,653
1,045,000	Pegatron Corp	Goldam Sachs	55,922
45,000	Pegatron Corp	HSBC	(3,250)
2,656,000	Pou Chen Corp	Citibank	178,301
1,350,000	Pou Chen Corp	JP Morgan	75,172
46,000	President Chain Store Corp	Barclays Bank	(6,702)
31,000	President Chain Store Corp	HSBC	(11,559)
(1,011,000)	Quanta Computer Inc	Citibank	(40,881)
(526,687)	Quanta Computer Inc	JP Morgan	(84,206)
462,000	Realtek Semiconductor Corp	Barclays Bank	179,903
258,000	Realtek Semiconductor Corp	Goldam Sachs	101,825
(513,000)	Shanghai Commercial & Savings Bank Ltd	Barclays Bank	(3,362)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
台湾(続き)			
(390,000)	Shanghai Commercial & Savings Bank Ltd	Citibank	(2,556)
(2,236,000)	Shanghai Commercial & Savings Bank Ltd	Goldam Sachs	(26,219)
(887,000)	Shanghai Commercial & Savings Bank Ltd	HSBC	30,794
(635,000)	Shanghai Commercial & Savings Bank Ltd	JP Morgan	21,177
(9,462,136)	Shin Kong Financial Holding Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(44,683)
(2,103,133)	Shin Kong Financial Holding Co Ltd	Barclays Bank	(16,103)
(7,027,888)	Shin Kong Financial Holding Co Ltd	Citibank	(53,809)
(3,927,223)	Shin Kong Financial Holding Co Ltd	Goldam Sachs	(19,712)
(355,483)	Shin Kong Financial Holding Co Ltd	JP Morgan	(5,528)
(415)	Shin Kong Financial Holding Co Ltd (Pref)	Bank of America Merrill Lynch	3
1,298,000	SinoPac Financial Holdings Co Ltd	Barclays Bank	10,183
2,143,700	SinoPac Financial Holdings Co Ltd	Citibank	16,818
4,133,000	SinoPac Financial Holdings Co Ltd	Goldam Sachs	13,135
2,986,740	SinoPac Financial Holdings Co Ltd	JP Morgan	19,564
1,423,000	Synnex Technology International Corp	Barclays Bank	(16,867)
704,000	Synnex Technology International Corp	Goldam Sachs	42,237
40,000	Synnex Technology International Corp	JP Morgan	6,486
3,420,000	Taishin Financial Holding Co Ltd	Barclays Bank	55,174
8,580,812	Taishin Financial Holding Co Ltd	Goldam Sachs	169,231
438,249	Taishin Financial Holding Co Ltd	HSBC	8,485
(262,000)	Taiwan Cement Corp	Barclays Bank	1,338
(193,000)	Taiwan Cement Corp	HSBC	4,429
161,000	Taiwan Cooperative Financial Holding Co Ltd	Barclays Bank	2,011
6,000	Taiwan Cooperative Financial Holding Co Ltd	Citibank	75
2,555,120	Taiwan Cooperative Financial Holding Co Ltd	Goldam Sachs	30,342
6,657,077	Taiwan Cooperative Financial Holding Co Ltd	JP Morgan	101,624
464,000	Taiwan Fertilizer Co Ltd	Barclays Bank	(945)
366,000	Taiwan Fertilizer Co Ltd	Citibank	(745)
160,000	Taiwan Fertilizer Co Ltd	Goldam Sachs	(1,488)
331,000	Taiwan Fertilizer Co Ltd	HSBC	(3,103)
240,000	Taiwan Fertilizer Co Ltd	JP Morgan	13,051
21,000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	Barclays Bank	(255)
630,000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	Goldam Sachs	(155,187)
423,000	Teco Electric and Machinery Co Ltd	Barclays Bank	208
257,000	Teco Electric and Machinery Co Ltd	Goldam Sachs	9,619
(204,000)	Unimicron Technology Corp	Citibank	(6,122)
(842,000)	Unimicron Technology Corp	Goldam Sachs	112,331
(273,000)	Unimicron Technology Corp	JP Morgan	43,702
971,000	Uni-President Enterprises Corp	Barclays Bank	26,198
910,000	Uni-President Enterprises Corp	Citibank	24,552
762,000	Uni-President Enterprises Corp	Goldam Sachs	85,686
145,000	Uni-President Enterprises Corp	HSBC	7,272
1,277,000	United Microelectronics Corp	Barclays Bank	14,083
2,481,000	United Microelectronics Corp	Citibank	27,360
8,742,000	United Microelectronics Corp	Goldam Sachs	(6,452)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
台湾(続き)			
(1,018,000)	Vanguard International Semiconductor Corp	Citibank	(132,674)
(863,000)	Vanguard International Semiconductor Corp	HSBC	(77,853)
(208,506)	Vanguard International Semiconductor Corp	JP Morgan	(19,270)
(1,619,000)	Walsin Lihwa Corp	Citibank	(74,648)
(1,432,000)	Walsin Lihwa Corp	Goldam Sachs	(66,375)
(55,000)	Walsin Lihwa Corp	HSBC	(2,161)
(52,884)	Walsin Lihwa Corp	JP Morgan	(2,099)
522,000	Wan Hai Lines Ltd	Barclays Bank	5,738
113,000	Wan Hai Lines Ltd	Citibank	1,242
473,000	Wan Hai Lines Ltd	JP Morgan	(8,307)
2,971,000	Wistron Corp	Barclays Bank	16,277
1,530,000	Wistron Corp	Goldam Sachs	18,772
(70,000)	Yageo Corp	Barclays Bank	3,414
(26,000)	Yageo Corp	JP Morgan	30,190
2,505,000	Yuanta Financial Holding Co Ltd	Citibank	6,659
2,362,000	Yuanta Financial Holding Co Ltd	HSBC	(18,972)
(605,000)	Yulon Motor Co Ltd	Citibank	5,543
(14,161)	Yulon Motor Co Ltd	JP Morgan	(1,592)
			<u>(1,098,839)</u>
英国			
133,440	3i Group Plc	Barclays Bank	6,922
26,540	3i Group Plc	JP Morgan	23,227
(25,620)	Admiral Group Plc	Barclays Bank	(13,290)
(10,210)	Admiral Group Plc	Goldam Sachs	(5,170)
21,760	Anglo American Plc	Barclays Bank	33,217
15,800	Anglo American Plc	Credit Suisse	51,868
160,780	Anglo American Plc	Deutsche Bank	515,094
57,000	Anglo American Plc	Goldam Sachs	182,612
13,180	Anglo American Plc	HSBC	43,267
6,630	Anglo American Plc	JP Morgan	21,765
(80,870)	Antofagasta Plc	Bank of America Merrill Lynch	(76,906)
(58,700)	Antofagasta Plc	Barclays Bank	(44,803)
(11,500)	Antofagasta Plc	Credit Suisse	(11,594)
(37,520)	Antofagasta Plc	Deutsche Bank	(35,681)
(200,690)	Antofagasta Plc	Goldam Sachs	(190,854)
(1,154)	Ashmore Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(981)
(414,346)	Ashmore Group Plc	Barclays Bank	(205,719)
(123,165)	Ashmore Group Plc	Goldam Sachs	(104,655)
(6,520)	Ashtead Group Plc	Barclays Bank	(10,629)
(5,750)	Ashtead Group Plc	Credit Suisse	(16,520)
(60,271)	Ashtead Group Plc	Deutsche Bank	(177,162)
(31,100)	Ashtead Group Plc	Goldam Sachs	(91,416)
(37,600)	Associated British Foods Plc	Bank of America Merrill Lynch	(100,074)
(11,010)	Associated British Foods Plc	Barclays Bank	(21,757)
(20,330)	Associated British Foods Plc	HSBC	(36,754)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	英国(続き)		
(1,200)	AstraZeneca Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2,386)
(3,940)	AstraZeneca Plc	Goldam Sachs	(7,834)
(1,220)	AstraZeneca Plc	HSBC	(1,883)
337,162	Auto Trader Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	244,850
126,580	Auto Trader Group Plc	Goldam Sachs	91,924
(41,950)	Avast Plc	Bank of America Merrill Lynch	(19,667)
(253,484)	Avast Plc	Barclays Bank	8,265
(394,350)	Avast Plc	Deutsche Bank	(184,881)
(161,780)	Avast Plc	Goldam Sachs	(75,846)
7,247	AVEVA Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	25,688
2,690	AVEVA Group Plc	Deutsche Bank	9,535
12,550	AVEVA Group Plc	Goldam Sachs	44,485
10,718	AVEVA Group Plc	HSBC	13,191
4,000	AVEVA Group Plc	JP Morgan	4,545
268,100	Aviva Plc	Bank of America Merrill Lynch	69,866
1,203,513	Aviva Plc	Barclays Bank	211,069
329,670	Aviva Plc	Deutsche Bank	85,911
306,020	Aviva Plc	Goldam Sachs	79,747
102,250	Aviva Plc	HSBC	17,228
(111,120)	B&M European Value Retail SA	Barclays Bank	(44,740)
(12,540)	B&M European Value Retail SA	Credit Suisse	(7,992)
(88,740)	B&M European Value Retail SA	Goldam Sachs	(58,964)
(141,489)	Babcock International Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(38,095)
(43,440)	Babcock International Group Plc	Barclays Bank	1,770
(247,527)	Babcock International Group Plc	Credit Suisse	25,364
(51,710)	Babcock International Group Plc	Deutsche Bank	(13,922)
(388,947)	Babcock International Group Plc	Goldam Sachs	(104,720)
135,060	BAE Systems Plc	Bank of America Merrill Lynch	10,509
547,816	BAE Systems Plc	Barclays Bank	61,569
135,880	BAE Systems Plc	Credit Suisse	(336)
79,900	BAE Systems Plc	Deutsche Bank	6,217
47,260	BAE Systems Plc	Goldam Sachs	3,677
35,400	BAE Systems Plc	JP Morgan	(87)
(16,200)	Barratt Developments Plc	Bank of America Merrill Lynch	(4,942)
(250,440)	Barratt Developments Plc	Barclays Bank	(24,126)
(206,885)	Barratt Developments Plc	Deutsche Bank	(63,112)
(100,500)	Barratt Developments Plc	Goldam Sachs	(30,658)
(26,040)	Barratt Developments Plc	HSBC	(4,492)
(85,926)	Barrick Gold Corp	HSBC	202,323
(54,370)	Bellway Plc	Bank of America Merrill Lynch	(106,096)
(64,808)	Bellway Plc	Barclays Bank	(102,453)
(14,180)	Bellway Plc	Credit Suisse	-
(12,150)	Bellway Plc	Goldam Sachs	(23,709)
2,570	Berkeley Group Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	4,729
8,075	Berkeley Group Holdings Plc	Barclays Bank	19,647

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	英国(続き)		
46,040	Berkeley Group Holdings Plc	Deutsche Bank	84,724
4,900	Berkeley Group Holdings Plc	HSBC	507
114,461	BHP Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	241,451
72,030	BHP Group Plc	Barclays Bank	30,247
53,717	BHP Group Plc	Deutsche Bank	113,314
635,390	BP Plc	Deutsche Bank	58,071
(7,150)	British American Tobacco Plc	Bank of America Merrill Lynch	(13,687)
(171,873)	British American Tobacco Plc	Deutsche Bank	(329,021)
(22,170)	British American Tobacco Plc	Goldam Sachs	(42,441)
(254,870)	BT Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(31,950)
(521,468)	BT Group Plc	Deutsche Bank	(65,370)
165,317	Bunzl Plc	Bank of America Merrill Lynch	396,099
85,880	Bunzl Plc	Goldam Sachs	205,768
36,756	Burberry Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	91,472
5,620	Burberry Group Plc	Barclays Bank	6,976
94,851	Burberry Group Plc	Goldam Sachs	236,049
51,821	Carnival Plc	Barclays Bank	45,697
108,071	Carnival Plc	Deutsche Bank	223,167
396,350	Centrica Plc	Bank of America Merrill Lynch	1,517
601,460	Centrica Plc	Barclays Bank	7,874
180,200	Centrica Plc	Credit Suisse	(89)
361,500	Centrica Plc	Goldam Sachs	1,384
144,720	Centrica Plc	HSBC	(72)
41,795	Coca-Cola HBC AG	Bank of America Merrill Lynch	126,982
87,740	Coca-Cola HBC AG	Barclays Bank	200,472
9,810	Coca-Cola HBC AG	Citibank	22,414
155,046	Coca-Cola HBC AG	Goldam Sachs	471,064
40,850	Compass Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	56,732
184,150	Compass Group Plc	Barclays Bank	120,422
18,229	Compass Group Plc	Credit Suisse	(15,208)
102,530	Compass Group Plc	Deutsche Bank	142,392
112,850	Compass Group Plc	Goldam Sachs	156,725
26,630	Compass Group Plc	HSBC	(2,188)
10,530	Compass Group Plc	JP Morgan	(8,785)
44,580	ConvaTec Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	1,652
78,190	ConvaTec Group Plc	Citibank	(4,442)
104,170	ConvaTec Group Plc	Deutsche Bank	3,860
(3,870)	Croda International Plc	Barclays Bank	(3,122)
(3,540)	Croda International Plc	Deutsche Bank	(11,207)
(13,630)	Croda International Plc	Goldam Sachs	(43,148)
(7,859)	DCC Plc	Bank of America Merrill Lynch	(102,886)
(7,570)	DCC Plc	Barclays Bank	(5,610)
(68,182)	DCC Plc	Goldam Sachs	(892,607)
44,040	Direct Line Insurance Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	870
(811,993)	DS Smith Plc	Bank of America Merrill Lynch	(478,360)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	英国(続き)		
(522,314)	DS Smith Plc	Barclays Bank	(107,084)
(5,003)	DS Smith Plc	Credit Suisse	(1,668)
(309,468)	easyJet Plc	Deutsche Bank	(735,904)
(75,240)	easyJet Plc	Goldam Sachs	(178,918)
65,580	Evraz Plc	Bank of America Merrill Lynch	29,401
168,070	Evraz Plc	Credit Suisse	67,669
137,570	Evraz Plc	Deutsche Bank	61,676
14,570	Experian Plc	Bank of America Merrill Lynch	78,097
19,710	Experian Plc	Deutsche Bank	105,648
(11,380)	Ferguson Plc	Bank of America Merrill Lynch	(105,412)
(2,260)	Ferguson Plc	Barclays Bank	(5,806)
(4,330)	Ferguson Plc	Credit Suisse	(17,846)
(11,170)	Ferguson Plc	Deutsche Bank	(103,466)
(1,640)	Ferguson Plc	JP Morgan	(14,369)
(66,460)	Fresnillo Plc	Barclays Bank	4,432
(287,933)	Fresnillo Plc	Deutsche Bank	(181,362)
(138,770)	Fresnillo Plc	Goldam Sachs	(87,408)
(4,085)	Fresnillo Plc	JP Morgan	(5,146)
(118,690)	G4S Plc	Deutsche Bank	(2,170)
37,940	GlaxoSmithKline Plc	Bank of America Merrill Lynch	8,153
75,800	GlaxoSmithKline Plc	Barclays Bank	1,872
8,266	GlaxoSmithKline Plc	Credit Suisse	(1,286)
144,740	GlaxoSmithKline Plc	Goldam Sachs	31,104
(63,651)	Glencore Plc	Bank of America Merrill Lynch	(6,792)
(1,252,470)	Glencore Plc	Deutsche Bank	(133,649)
(464,210)	Glencore Plc	Goldam Sachs	(49,535)
(35,530)	GVC Holdings Plc	Credit Suisse	(10,684)
(14,890)	GVC Holdings Plc	Deutsche Bank	(11,328)
(27,700)	GVC Holdings Plc	JP Morgan	(10,126)
94,432	Halma Plc	Barclays Bank	138,321
(61,380)	Hargreaves Lansdown Plc	Bank of America Merrill Lynch	(166,397)
(8,850)	Hargreaves Lansdown Plc	Barclays Bank	(13,936)
(41,778)	Hargreaves Lansdown Plc	Deutsche Bank	(113,257)
(172,941)	Hargreaves Lansdown Plc	HSBC	(571,355)
(27,690)	Hikma Pharmaceuticals Plc	Barclays Bank	(24,965)
(30,685)	Hikma Pharmaceuticals Plc	Goldam Sachs	(68,216)
(3,700)	Hikma Pharmaceuticals Plc	JP Morgan	(4,373)
(89,037)	Hiscox Ltd	Barclays Bank	(27,931)
(12,990)	HomeServe Plc	Goldam Sachs	(28,772)
235,890	Howden Joinery Group Plc	Barclays Bank	180,628
92,750	Howden Joinery Group Plc	Citibank	71,022
280,868	Howden Joinery Group Plc	Deutsche Bank	246,289
200,990	Howden Joinery Group Plc	Goldam Sachs	176,245
16,820	Howden Joinery Group Plc	JP Morgan	13,586
(648,909)	HSBC Holdings Plc	Deutsche Bank	212,380

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	英国(続き)		
119,707	IMI Plc	Bank of America Merrill Lynch	118,275
487,301	IMI Plc	Barclays Bank	204,626
47,846	IMI Plc	Credit Suisse	32,205
158,328	IMI Plc	Deutsche Bank	156,434
26,604	IMI Plc	Goldam Sachs	26,286
(11,150)	Imperial Brands Plc	Bank of America Merrill Lynch	22,584
(17,310)	Imperial Brands Plc	Barclays Bank	10,155
830,359	Inchcape Plc	Barclays Bank	424,571
436,474	Inchcape Plc	Deutsche Bank	162,798
46,477	Inchcape Plc	Goldam Sachs	17,335
228,800	Informa Plc	Deutsche Bank	138,464
159,940	Informa Plc	Goldam Sachs	96,792
52,030	Informa Plc	HSBC	20,627
(4,930)	InterContinental Hotels Group Plc	Barclays Bank	(13,456)
(3,150)	InterContinental Hotels Group Plc	Goldam Sachs	(24,548)
87,530	Intermediate Capital Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	219,451
65,140	Intermediate Capital Group Plc	Barclays Bank	111,827
86,166	Intermediate Capital Group Plc	Deutsche Bank	216,031
33,000	Intermediate Capital Group Plc	Goldam Sachs	82,736
20,420	Intermediate Capital Group Plc	HSBC	37,577
24,580	Intermediate Capital Group Plc	JP Morgan	45,233
5,350	Intertek Group Plc	Deutsche Bank	76,383
80,530	Investec Plc	Bank of America Merrill Lynch	(4,476)
187,472	Investec Plc	Barclays Bank	3,473
35,930	Investec Plc	Citibank	666
33,770	Investec Plc	Credit Suisse	(2,065)
341,000	Investec Plc	Deutsche Bank	(18,952)
228,889	Investec Plc	Goldam Sachs	(12,721)
275,313	Investec Plc	HSBC	(16,831)
(1,103,480)	J Sainsbury Plc	Bank of America Merrill Lynch	(81,090)
(325,866)	J Sainsbury Plc	Barclays Bank	(40,447)
(80,550)	J Sainsbury Plc	Credit Suisse	1,523
(110,870)	J Sainsbury Plc	Deutsche Bank	(8,147)
(700,240)	J Sainsbury Plc	Goldam Sachs	(51,457)
15,040	JD Sports Fashion Plc	Bank of America Merrill Lynch	23,572
71,710	JD Sports Fashion Plc	Barclays Bank	72,712
25,580	JD Sports Fashion Plc	Deutsche Bank	40,091
72,370	JD Sports Fashion Plc	HSBC	96,263
107,130	John Wood Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	29,108
77,480	John Wood Group Plc	Deutsche Bank	21,052
(23,260)	Johnson Matthey Plc	Bank of America Merrill Lynch	(61,907)
(48,940)	Johnson Matthey Plc	Barclays Bank	(64,070)
(19,040)	Johnson Matthey Plc	Credit Suisse	(40,211)
(31,370)	Johnson Matthey Plc	Goldam Sachs	(83,492)
(45,273)	Just Eat Takeaway.com NV	Barclays Bank	12,301

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	英国(続き)		
(108,698)	KAZ Minerals Plc	Bank of America Merrill Lynch	(88,335)
(134,076)	KAZ Minerals Plc	Barclays Bank	(51,167)
(86,232)	KAZ Minerals Plc	Credit Suisse	(71,782)
(266,602)	KAZ Minerals Plc	Deutsche Bank	(216,658)
(319,293)	KAZ Minerals Plc	Goldam Sachs	(259,478)
(145,840)	KAZ Minerals Plc	HSBC	(121,401)
(5,390)	Kingfisher Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1,621)
(149,060)	Kingfisher Plc	Barclays Bank	(36,911)
(80,380)	Kingfisher Plc	Deutsche Bank	(24,173)
(97,000)	Kingfisher Plc	Goldam Sachs	(29,171)
(106,560)	Legal & General Group Plc	Barclays Bank	(14,674)
(786,870)	Legal & General Group Plc	Deutsche Bank	(155,006)
(559,970)	Legal & General Group Plc	Goldam Sachs	(110,309)
(155,340)	Legal & General Group Plc	HSBC	(12,065)
(6,060)	London Stock Exchange Group Plc	Barclays Bank	24,998
(905,250)	M&G Plc	Barclays Bank	(181,680)
(535,270)	Marks & Spencer Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(82,900)
(203,230)	Marks & Spencer Group Plc	Barclays Bank	(7,580)
(327,835)	Marks & Spencer Group Plc	Credit Suisse	(40,570)
(2,099,565)	Marks & Spencer Group Plc	Deutsche Bank	(325,171)
414,460	Meggitt Plc	Bank of America Merrill Lynch	126,434
655,097	Meggitt Plc	Barclays Bank	143,207
219,890	Meggitt Plc	Deutsche Bank	67,079
99,960	Meggitt Plc	Goldam Sachs	30,494
(710,420)	Melrose Industries Plc	Barclays Bank	(201,303)
(1,554,020)	Melrose Industries Plc	Deutsche Bank	(542,450)
(413,170)	Melrose Industries Plc	Goldam Sachs	(144,222)
57,460	Micro Focus International Plc	Credit Suisse	(37,443)
87,440	Micro Focus International Plc	Deutsche Bank	(1,944)
(21,010)	Mondi Plc	Bank of America Merrill Lynch	(55,789)
(12,940)	Mondi Plc	Deutsche Bank	(34,360)
(27,370)	Mondi Plc	Goldam Sachs	(72,677)
7	National Express Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	-
37	National Express Group Plc	Credit Suisse	(3)
2	National Express Group Plc	JP Morgan	-
(36,134)	National Grid Plc	Bank of America Merrill Lynch	(4,731)
(87,778)	National Grid Plc	Barclays Bank	(50,736)
(31,679)	National Grid Plc	Credit Suisse	(704)
(119,209)	National Grid Plc	Deutsche Bank	(15,606)
(217,036)	National Grid Plc	Goldam Sachs	(28,413)
7,530	Next Plc	Barclays Bank	34,968
(155,976)	Ocado Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(467,147)
(87,582)	Ocado Group Plc	Barclays Bank	(123,312)
(5,880)	Ocado Group Plc	Goldam Sachs	(17,611)
30,980	Pearson Plc	Bank of America Merrill Lynch	13,659

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	英国(続き)		
71,733	Pearson Plc	Barclays Bank	4,784
173,410	Pearson Plc	Deutsche Bank	76,459
37,840	Pearson Plc	Goldam Sachs	16,684
122,780	Pearson Plc	HSBC	7,477
(33,740)	Pennon Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(11,459)
(5,370)	Pennon Group Plc	Barclays Bank	(1,923)
(35,350)	Pennon Group Plc	Goldam Sachs	(12,006)
(13,110)	Persimmon Plc	Bank of America Merrill Lynch	(33,193)
(48,881)	Persimmon Plc	Barclays Bank	(84,519)
(189,628)	Persimmon Plc	Deutsche Bank	(480,110)
(15,850)	Phoenix Group Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	(10,297)
(23,810)	Prudential Plc	Barclays Bank	(11,322)
(58,915)	Prudential Plc	Credit Suisse	29,891
(321,940)	Prudential Plc	Deutsche Bank	-
(175,930)	Prudential Plc	Goldam Sachs	-
(180,870)	Prudential Plc	JP Morgan	159,719
(826,416)	Quilter Plc	Bank of America Merrill Lynch	(118,907)
(12,213)	Quilter Plc	Barclays Bank	(965)
(65,954)	Reckitt Benckiser Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(73,311)
(3,090)	Reckitt Benckiser Group Plc	Deutsche Bank	(3,435)
(19,597)	Reckitt Benckiser Group Plc	HSBC	(67,285)
11,808	RELX Plc	Bank of America Merrill Lynch	17,500
36,660	RELX Plc	Barclays Bank	9,282
47,450	RELX Plc	Deutsche Bank	70,324
9,210	RELX Plc	Goldam Sachs	13,650
(100,248)	Renishaw Plc	Barclays Bank	118,859
25,851	Rentokil Initial Plc	Barclays Bank	1,852
48,340	Rentokil Initial Plc	Deutsche Bank	20,120
163,662	Rentokil Initial Plc	Goldam Sachs	68,118
132,297	Rightmove Plc	Citibank	90,520
350,860	Rightmove Plc	Deutsche Bank	365,730
5,955	Rightmove Plc	Goldam Sachs	6,207
102,409	Rightmove Plc	HSBC	80,947
107,264	Rightmove Plc	JP Morgan	84,785
53,550	Rio Tinto Plc	Barclays Bank	31,084
35,030	Rolls-Royce Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	14,191
69,540	Rolls-Royce Holdings Plc	Barclays Bank	1,632
1,817,165	Rolls-Royce Holdings Plc	Deutsche Bank	736,127
346,210	Rolls-Royce Holdings Plc	Goldam Sachs	140,248
(698,310)	Royal Bank of Scotland Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(60,803)
(101,050)	Royal Bank of Scotland Group Plc	Barclays Bank	(9,111)
(292,360)	Royal Bank of Scotland Group Plc	Goldam Sachs	(25,456)
(644,294)	Royal Bank of Scotland Group Plc	HSBC	(7,957)
136,391	Royal Dutch Shell Plc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	60,642
163,420	Royal Dutch Shell Plc 'A'	Deutsche Bank	72,659

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	英国(続き)		
609,224	RSA Insurance Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	272,377
96,920	RSA Insurance Group Plc	Barclays Bank	26,813
33,680	RSA Insurance Group Plc	Citibank	9,318
507,520	RSA Insurance Group Plc	Deutsche Bank	226,906
406,110	RSA Insurance Group Plc	Goldam Sachs	181,567
72,440	RSA Insurance Group Plc	HSBC	13,241
300,440	Sage Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	190,724
393,650	Sage Group Plc	Barclays Bank	52,507
38,166	Sage Group Plc	Credit Suisse	22,626
85,510	Sage Group Plc	Deutsche Bank	54,283
124,680	Sage Group Plc	Goldam Sachs	79,149
(10,370)	Schroders Plc	Bank of America Merrill Lynch	(31,891)
(28,590)	Schroders Plc	Barclays Bank	(52,259)
(24,810)	Schroders Plc	Deutsche Bank	(76,298)
(50,327)	Schroders Plc	Goldam Sachs	(154,769)
(25,310)	Schroders Plc	HSBC	(60,955)
11,340	Severn Trent Plc	Bank of America Merrill Lynch	5,882
5,610	Severn Trent Plc	Barclays Bank	4,642
4,210	Severn Trent Plc	Citibank	3,484
12,230	Severn Trent Plc	Deutsche Bank	6,344
(68)	Signature Aviation Plc	Bank of America Merrill Lynch	(36)
(2)	Signature Aviation Plc	HSBC	(1)
(224)	Signature Aviation Plc	JP Morgan	(133)
172,191	Smith & Nephew Plc	Bank of America Merrill Lynch	306,237
11,360	Smith & Nephew Plc	Barclays Bank	1,263
19,757	Smith & Nephew Plc	Citibank	2,196
7,050	Smith & Nephew Plc	Credit Suisse	12,452
29,460	Smith & Nephew Plc	Deutsche Bank	52,394
131,420	Smith & Nephew Plc	Goldam Sachs	233,727
(150,993)	Smiths Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(185,551)
(37,801)	Smiths Group Plc	Barclays Bank	(21,709)
(172,537)	Smiths Group Plc	HSBC	(107,611)
(49,772)	Spirax-Sarco Engineering Plc	Barclays Bank	(109,418)
(16,360)	SSE Plc	Bank of America Merrill Lynch	(4,445)
(42,285)	SSE Plc	Barclays Bank	(32,379)
(811)	SSE Plc	Credit Suisse	(40)
(33,900)	SSE Plc	Deutsche Bank	(9,211)
(43,240)	SSE Plc	Goldam Sachs	(11,749)
(230,542)	St James 's Place Plc	Barclays Bank	(275,619)
391,518	Standard Chartered Plc	Deutsche Bank	(57,542)
(653,200)	Standard Life Aberdeen Plc	Deutsche Bank	(392,880)
694,509	Tate & Lyle Plc	Bank of America Merrill Lynch	372,265
599,137	Tate & Lyle Plc	Barclays Bank	331,504
117,201	Tate & Lyle Plc	Citibank	64,848
52,590	Tate & Lyle Plc	Deutsche Bank	28,189

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
英国(続き)			
321,715	Tate & Lyle Plc	Goldam Sachs	172,443
(51,680)	Taylor Wimpey Plc	Bank of America Merrill Lynch	(3,159)
(139,208)	Taylor Wimpey Plc	Barclays Bank	(7,651)
(1,785,560)	Taylor Wimpey Plc	Deutsche Bank	(109,160)
(577,955)	Taylor Wimpey Plc	HSBC	37,832
(674,810)	Tesco Plc	Bank of America Merrill Lynch	78,434
(1,109,800)	Tesco Plc	Barclays Bank	(45,081)
(58,090)	Tesco Plc	Credit Suisse	5,389
(632,293)	Tesco Plc	Deutsche Bank	73,492
(151,060)	Tesco Plc	Goldam Sachs	17,558
(165,840)	Tesco Plc	HSBC	24,293
(13,791)	Travis Perkins Plc	Bank of America Merrill Lynch	(10,134)
(943)	Travis Perkins Plc	Barclays Bank	(547)
(10,554)	Travis Perkins Plc	Credit Suisse	(6,811)
(138,191)	Travis Perkins Plc	Deutsche Bank	(101,550)
(21,684)	Travis Perkins Plc	Goldam Sachs	(15,935)
(192,720)	TUI AG	Bank of America Merrill Lynch	(366,549)
(226,984)	TUI AG	Barclays Bank	(318,462)
(64,596)	TUI AG	Credit Suisse	(118,951)
(104,920)	TUI AG	Deutsche Bank	(199,555)
(115,660)	TUI AG	Goldam Sachs	(219,983)
(29,010)	TUI AG	JP Morgan	(53,421)
58,340	Unilever Plc	Barclays Bank	163,560
(70,640)	United Utilities Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(23,730)
270,120	Vodafone Group Plc	Barclays Bank	14,212
321,380	Vodafone Group Plc	Credit Suisse	84,385
192,040	Vodafone Group Plc	Deutsche Bank	31,497
676,656	Vodafone Group Plc	Goldam Sachs	110,981
(302,304)	Weir Group Plc	Barclays Bank	5,227
(9,530)	Whitbread Plc	Bank of America Merrill Lynch	22,010
(84,854)	Whitbread Plc	Barclays Bank	123,663
(9,340)	Whitbread Plc	Goldam Sachs	21,571
(69,709)	Whitbread Plc	HSBC	281,932
(4,765)	Whitbread Plc (Rights)	Bank of America Merrill Lynch	(57,661)
(42,427)	Whitbread Plc (Rights)	Barclays Bank	(513,410)
(4,670)	Whitbread Plc (Rights)	Goldam Sachs	(56,512)
(34,854)	Whitbread Plc (Rights)	HSBC	(421,769)
756,691	Wm Morrison Supermarkets Plc	HSBC	(6,542)
25,860	WPP Plc	Bank of America Merrill Lynch	16,800
94,570	WPP Plc	Barclays Bank	16,585
22,360	WPP Plc	Credit Suisse	14,108
20,360	WPP Plc	Deutsche Bank	13,227
15,370	WPP Plc	Goldam Sachs	9,985
			(560,252)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国		
(125,695)	2U Inc	Barclays Bank	280,300
(9,017)	3M Co	Bank of America Merrill Lynch	(144,272)
(17,350)	3M Co	Barclays Bank	(143,138)
(15,840)	3M Co	Citibank	(130,680)
(5,260)	3M Co	Goldam Sachs	(84,160)
(7,300)	Abbott Laboratories	Bank of America Merrill Lynch	(20,805)
(7,360)	Abbott Laboratories	Barclays Bank	(9,347)
(890)	Abbott Laboratories	Goldam Sachs	(2,537)
30,964	AbbVie Inc	Bank of America Merrill Lynch	6,193
50	AbbVie Inc	Barclays Bank	(60)
810	ABIOMED Inc	Goldam Sachs	27,986
(64,750)	Acadia Healthcare Co Inc	Barclays Bank	(57,628)
(5,400)	Acadia Healthcare Co Inc	Citibank	(4,806)
(11,950)	Acadia Healthcare Co Inc	Goldam Sachs	(44,096)
(680)	Accenture Plc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(10,656)
(4,640)	Accenture Plc 'A'	Barclays Bank	(27,098)
(3,080)	Accenture Plc 'A'	Goldam Sachs	(48,264)
(2,930)	Accenture Plc 'A'	HSBC	(32,201)
(3,820)	Accenture Plc 'A'	JP Morgan	(41,982)
13,710	Activision Blizzard Inc	Barclays Bank	18,436
32,530	Acuity Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	293,746
25,040	Acuity Brands Inc	Barclays Bank	39,814
1,780	Acuity Brands Inc	Citibank	2,830
10,513	Acuity Brands Inc	Credit Suisse	4,100
6,060	Acuity Brands Inc	Goldam Sachs	54,722
5,024	Acuity Brands Inc	JP Morgan	25,941
20,456	Adobe Inc	Bank of America Merrill Lynch	356,139
320	Adobe Inc	Citibank	(816)
2,390	Adobe Inc	Credit Suisse	36,328
2,640	Adobe Inc	Goldam Sachs	45,962
10	Adobe Inc	JP Morgan	152
(162,300)	ADT Inc	Citibank	(79,527)
(139,935)	ADT Inc	Credit Suisse	(190,312)
(28,650)	ADT Inc	HSBC	(38,964)
(119,846)	ADT Inc	JP Morgan	(162,991)
15,700	Advance Auto Parts Inc	Barclays Bank	54,008
3,570	Advance Auto Parts Inc	Credit Suisse	42,827
2,020	Advance Auto Parts Inc	Goldam Sachs	21,937
1,290	Advance Auto Parts Inc	JP Morgan	15,570
36,790	Advanced Micro Devices Inc	Barclays Bank	48,331
(6,470)	AECOM	Bank of America Merrill Lynch	(42,508)
(19,880)	AECOM	Barclays Bank	(55,068)
(11,650)	AECOM	Credit Suisse	(28,543)
(135,610)	AECOM	Goldam Sachs	(890,958)
5,710	AerCap Holdings NV	Bank of America Merrill Lynch	38,371

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
10,840	AerCap Holdings NV	Barclays Bank	34,688
17,660	AerCap Holdings NV	Credit Suisse	27,903
42,960	AerCap Holdings NV	Goldam Sachs	288,691
6,798	AerCap Holdings NV	JP Morgan	10,741
(17,960)	Affiliated Managers Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(91,237)
(37,320)	Affiliated Managers Group Inc	Barclays Bank	(117,558)
(2,130)	Affiliated Managers Group Inc	HSBC	(10,958)
37,541	Aflac Inc	Citibank	43,923
21,203	AGCO Corp	Bank of America Merrill Lynch	215,422
3,360	AGCO Corp	Barclays Bank	13,608
8,593	AGCO Corp	Citibank	34,802
3,793	AGCO Corp	Credit Suisse	18,055
56,790	AGCO Corp	Goldam Sachs	576,986
27,021	AGCO Corp	HSBC	128,620
8,550	AGCO Corp	JP Morgan	40,698
(3,201)	Agios Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(20,006)
(31,540)	Agios Pharmaceuticals Inc	Goldam Sachs	(197,125)
560	Agnico Eagle Mines Ltd	Barclays Bank	(913)
37,400	Agnico Eagle Mines Ltd	Goldam Sachs	(183,634)
(8,580)	Air Lease Corp	Bank of America Merrill Lynch	(61,647)
(6,440)	Air Lease Corp	Credit Suisse	(45,076)
(690)	Air Products and Chemicals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,991)
(670)	Air Products and Chemicals Inc	Barclays Bank	(4,502)
41,117	Akamai Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	249,580
2,500	Akamai Technologies Inc	Barclays Bank	9,350
3,051	Akamai Technologies Inc	Citibank	11,411
1,750	Akamai Technologies Inc	Credit Suisse	5,268
4,090	Akamai Technologies Inc	JP Morgan	21,407
65,270	Alaska Air Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	522,160
48,690	Alaska Air Group Inc	Barclays Bank	127,081
23,680	Alaska Air Group Inc	Citibank	61,805
6,770	Alaska Air Group Inc	Credit Suisse	43,000
16,896	Alaska Air Group Inc	Goldam Sachs	135,168
10,450	Alaska Air Group Inc	HSBC	37,934
9,590	Alaska Air Group Inc	JP Morgan	34,812
(11,155)	Albemarle Corp	Citibank	(98,722)
(32,840)	Albemarle Corp	Goldam Sachs	(512,632)
20,130	Alcoa Corp	Bank of America Merrill Lynch	50,526
82,530	Alcoa Corp	Barclays Bank	79,229
23,330	Alexion Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	343,884
28,401	Alexion Pharmaceuticals Inc	Goldam Sachs	406,134
690	Align Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	31,457
900	Align Technology Inc	Barclays Bank	4,968
18,950	Align Technology Inc	Goldam Sachs	863,931
67,071	Alkermes Plc	Barclays Bank	(20,121)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
142,070	Alkermes Plc	Goldam Sachs	183,270
4,510	Alleghany Corp	Barclays Bank	80,188
360	Alleghany Corp	Citibank	6,401
360	Alleghany Corp	Credit Suisse	9,152
410	Alleghany Corp	Goldam Sachs	24,690
250	Alleghany Corp	HSBC	15,573
280	Alleghany Corp	JP Morgan	17,500
1,650	Allegion Plc	Bank of America Merrill Lynch	9,818
4,260	Allegion Plc	Barclays Bank	19,596
5,870	Allegion Plc	Citibank	27,002
2,900	Allegion Plc	Goldam Sachs	17,255
9,210	Allegion Plc	HSBC	(16,441)
2,800	Allegion Plc	JP Morgan	(7,445)
10,690	Alliance Data Systems Corp	Goldam Sachs	93,324
93,270	Alliant Energy Corp	Barclays Bank	220,117
6,648	Alliant Energy Corp	Citibank	15,689
18,187	Alliant Energy Corp	Credit Suisse	13,640
50,059	Alliant Energy Corp	Goldam Sachs	139,665
3,650	Alliant Energy Corp	HSBC	2,738
113,543	Allison Transmission Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	378,098
51,275	Allison Transmission Holdings Inc	Citibank	72,298
22,074	Allison Transmission Holdings Inc	Credit Suisse	(7,284)
47,160	Allison Transmission Holdings Inc	Goldam Sachs	157,043
8,549	Allison Transmission Holdings Inc	HSBC	(2,821)
18,916	Allison Transmission Holdings Inc	JP Morgan	(6,242)
53,112	Allstate Corp	Bank of America Merrill Lynch	79,934
1,150	Allstate Corp	Barclays Bank	2,375
2,720	Allstate Corp	Goldam Sachs	4,094
15,346	Allstate Corp	JP Morgan	(59,926)
375,177	Ally Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	913,556
42,128	Ally Financial Inc	Credit Suisse	79,833
(9,861)	Alnylam Pharmaceuticals Inc	Credit Suisse	31,259
1,330	Alphabet Inc 'A'	Barclays Bank	21,759
1,510	Alphabet Inc 'A'	Goldam Sachs	85,375
100	Alphabet Inc 'C'	Barclays Bank	1,799
2,530	Alphabet Inc 'C'	Goldam Sachs	139,707
(17,300)	Alteryx Inc 'A'	Goldam Sachs	(193,587)
(19,750)	Altice USA Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(43,450)
(20,310)	Altice USA Inc 'A'	Credit Suisse	(37,574)
(31,070)	Altria Group Inc	Goldam Sachs	(51,576)
280	Amazon.com Inc	Credit Suisse	8,828
(4,180)	AMC Networks Inc 'A'	Barclays Bank	4,891
(5,250)	AMC Networks Inc 'A'	Goldam Sachs	(2,153)
25,170	Amdocs Ltd	Bank of America Merrill Lynch	41,027
10,236	Amdocs Ltd	Goldam Sachs	16,685

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
28,718	Amdocs Ltd	HSBC	(39,918)
(15,779)	AMERCO	Bank of America Merrill Lynch	(509,188)
(3,010)	AMERCO	Goldam Sachs	(97,133)
8,492	Ameren Corp	Bank of America Merrill Lynch	43,139
16,910	Ameren Corp	Barclays Bank	67,978
2,739	Ameren Corp	Credit Suisse	8,162
13,950	Ameren Corp	Goldam Sachs	70,866
7,540	Ameren Corp	HSBC	22,469
9,717	Ameren Corp	JP Morgan	28,957
14,683	American Electric Power Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	94,118
4,816	American Electric Power Co Inc	Barclays Bank	29,185
5,986	American Electric Power Co Inc	Credit Suisse	29,810
12,730	American Electric Power Co Inc	Goldam Sachs	81,599
6,019	American Electric Power Co Inc	HSBC	29,975
21,966	American Express Co	Credit Suisse	147,392
5,730	American Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	37,474
4,319	American Financial Group Inc	Barclays Bank	5,053
1,091	American Financial Group Inc	Citibank	1,276
(17,340)	American International Group Inc	Barclays Bank	(26,704)
(33,710)	American International Group Inc	JP Morgan	(93,714)
1,330	American National Insurance Co	Goldam Sachs	7,887
16,040	American Water Works Co Inc	Barclays Bank	54,055
2,130	American Water Works Co Inc	Credit Suisse	12,887
8,775	American Water Works Co Inc	Goldam Sachs	55,458
7,140	American Water Works Co Inc	HSBC	50,204
10,300	American Water Works Co Inc	JP Morgan	62,315
4,940	Ameriprise Financial Inc	Barclays Bank	38,878
(19,050)	AmerisourceBergen Corp	Barclays Bank	(31,052)
(4,770)	AmerisourceBergen Corp	Citibank	(7,775)
22,810	AMETEK Inc	Barclays Bank	111,997
2,150	Amgen Inc	Bank of America Merrill Lynch	(34,314)
5,850	Amgen Inc	Goldam Sachs	(93,366)
510	Amgen Inc	HSBC	(8,676)
9,394	Amgen Inc	JP Morgan	(99,389)
(84)	Amneal Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(52)
(55,940)	Amphenol Corp 'A'	Barclays Bank	(227,676)
(9,500)	Amphenol Corp 'A'	Goldam Sachs	(119,320)
(33,570)	Analog Devices Inc	Bank of America Merrill Lynch	(330,664)
(10,120)	Analog Devices Inc	Barclays Bank	(5,971)
(2,370)	Analog Devices Inc	Credit Suisse	(7,371)
(6,130)	Analog Devices Inc	Goldam Sachs	(60,381)
36,440	Anaplan Inc	Barclays Bank	(185,480)
1,400	ANSYS Inc	Bank of America Merrill Lynch	33,824
560	ANSYS Inc	JP Morgan	16,497
(7,723)	Antero Midstream Corp	Bank of America Merrill Lynch	(8,341)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(185,070)	Antero Midstream Corp	JP Morgan	(94,386)
(91,909)	Antero Resources Corp	Bank of America Merrill Lynch	(65,255)
(1,022,110)	Antero Resources Corp	Barclays Bank	10,221
(178,916)	Antero Resources Corp	HSBC	(128,059)
(1,260)	Anthem Inc	Bank of America Merrill Lynch	(12,386)
(620)	Anthem Inc	Barclays Bank	(6,702)
(3,080)	Anthem Inc	Goldam Sachs	(30,276)
(660)	Anthem Inc	JP Morgan	(8,969)
20,370	AO Smith Corp	Barclays Bank	95,332
(16,350)	Aon Plc 'A'	Barclays Bank	(105,294)
(70,731)	Apache Corp	Bank of America Merrill Lynch	(44,561)
1	Apartment Investment and Management Co 'A' (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	3
(142,930)	Apergy Corp	Bank of America Merrill Lynch	(57,172)
(15,000)	Apergy Corp	Citibank	(3,000)
(24,610)	Apergy Corp	Goldam Sachs	(9,844)
(10,930)	Apergy Corp	HSBC	10,930
(21,205)	Apergy Corp	JP Morgan	21,205
(4,130)	Apple Inc	Bank of America Merrill Lynch	(43,943)
(5,780)	Apple Inc	Barclays Bank	3,121
(1,000)	Apple Inc	Credit Suisse	(1,765)
31,441	Applied Materials Inc	Bank of America Merrill Lynch	120,105
84,510	Applied Materials Inc	Barclays Bank	124,230
2,620	Applied Materials Inc	Goldam Sachs	10,008
4,400	Applied Materials Inc	HSBC	10,730
1,670	AptarGroup Inc	Bank of America Merrill Lynch	15,164
1,560	AptarGroup Inc	Credit Suisse	4,758
8,710	AptarGroup Inc	Goldam Sachs	79,087
3,330	AptarGroup Inc	JP Morgan	10,157
(14,550)	Aptiv Plc	Barclays Bank	(23,426)
(55,280)	Aptiv Plc	Goldam Sachs	(521,290)
(10,694)	Aptiv Plc	HSBC	(57,213)
50,310	Arch Capital Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	270,668
26,510	Arch Capital Group Ltd	Barclays Bank	1,591
7,440	Arch Capital Group Ltd	Citibank	446
16,410	Arch Capital Group Ltd	Credit Suisse	56,058
50,230	Arch Capital Group Ltd	Goldam Sachs	270,237
8,960	Arch Capital Group Ltd	HSBC	21,594
(60,430)	Archer-Daniels-Midland Co	Bank of America Merrill Lynch	(270,726)
(297,400)	Archer-Daniels-Midland Co	Barclays Bank	(957,628)
(84,940)	Archer-Daniels-Midland Co	Goldam Sachs	(380,531)
(3,207)	Arconic Corp	Barclays Bank	(2,181)
(8,924)	Arista Networks Inc	Bank of America Merrill Lynch	(147,692)
(6,960)	Arista Networks Inc	Barclays Bank	(47,537)
(228)	Arista Networks Inc	JP Morgan	(2,050)
18,200	Armstrong World Industries Inc	Goldam Sachs	151,333

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
2,320	Armstrong World Industries Inc	JP Morgan	17,311
(3,470)	Arrow Electronics Inc	Barclays Bank	(3,748)
(3,320)	Arrow Electronics Inc	Credit Suisse	(23,612)
(2,450)	Arrow Electronics Inc	Goldam Sachs	(14,529)
4,070	Arthur J Gallagher & Co	Barclays Bank	11,722
4,150	Arthur J Gallagher & Co	Credit Suisse	32,212
650	Ashland Global Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	5,096
2,630	Ashland Global Holdings Inc	Barclays Bank	9,021
39,180	Ashland Global Holdings Inc	Goldam Sachs	307,171
(80)	Aspen Technology Inc	Barclays Bank	(808)
(2,400)	Aspen Technology Inc	Goldam Sachs	(27,144)
28,400	Associated Banc-Corp	Barclays Bank	28,684
44,990	Associated Banc-Corp	Goldam Sachs	85,931
3,690	Assurant Inc	Bank of America Merrill Lynch	43,505
3,020	Assurant Inc	Barclays Bank	4,621
410	Assurant Inc	Citibank	627
4,150	Assurant Inc	Goldam Sachs	48,929
3,600	Assurant Inc	HSBC	14,760
61,482	Assured Guaranty Ltd	Bank of America Merrill Lynch	113,127
61,290	Assured Guaranty Ltd	Barclays Bank	12,258
26,900	Assured Guaranty Ltd	Credit Suisse	(59,180)
65,680	Assured Guaranty Ltd	Goldam Sachs	120,851
(22,760)	AT&T Inc	Goldam Sachs	(48,934)
(16,770)	Athene Holding Ltd 'A'	Barclays Bank	(40,919)
(12,470)	Athene Holding Ltd 'A'	Credit Suisse	(14,216)
(32,870)	Athene Holding Ltd 'A'	Goldam Sachs	(123,920)
(5,090)	Athene Holding Ltd 'A'	JP Morgan	(19,570)
(9,340)	Atlassian Corp Plc 'A'	Barclays Bank	7,659
(2,100)	Atlassian Corp Plc 'A'	Credit Suisse	(11,739)
(9,330)	Atlassian Corp Plc 'A'	Goldam Sachs	44,038
12,670	Atmos Energy Corp	Barclays Bank	48,526
2,670	Atmos Energy Corp	Goldam Sachs	18,824
30,686	Autodesk Inc	Barclays Bank	210,199
950	Autodesk Inc	Credit Suisse	25,753
23,341	Automatic Data Processing Inc	Bank of America Merrill Lynch	206,568
25,320	Automatic Data Processing Inc	Goldam Sachs	224,082
53,940	AutoNation Inc	Bank of America Merrill Lynch	255,136
40,764	AutoNation Inc	Barclays Bank	26,089
3,450	AutoNation Inc	Credit Suisse	17,147
38,410	AutoNation Inc	Goldam Sachs	181,679
1,890	AutoZone Inc	Barclays Bank	42,941
1,360	AutoZone Inc	Goldam Sachs	96,125
5,130	Avalara Inc	Barclays Bank	(15,698)
1,900	Avalara Inc	Citibank	(5,814)
1,160	Avalara Inc	Goldam Sachs	1,137

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
2,810	Avalara Inc	HSBC	21,131
(60,966)	Avangrid Inc	Barclays Bank	(187,775)
6,590	Avery Dennison Corp	Bank of America Merrill Lynch	63,396
5,060	Avery Dennison Corp	Barclays Bank	18,469
280	Avery Dennison Corp	Citibank	1,022
1,870	Avery Dennison Corp	Credit Suisse	1,571
6,010	Avery Dennison Corp	Goldam Sachs	57,816
10	Avery Dennison Corp	HSBC	8
7,614	Avery Dennison Corp	JP Morgan	6,396
(6)	Avista Corp	Bank of America Merrill Lynch	(14)
189	Avnet Inc	Bank of America Merrill Lynch	327
16,530	Avnet Inc	Goldam Sachs	28,597
8,337	Avnet Inc	HSBC	(14,590)
87,860	Axalta Coating Systems Ltd	Bank of America Merrill Lynch	288,181
145,386	Axalta Coating Systems Ltd	Barclays Bank	209,356
15,430	Axalta Coating Systems Ltd	Citibank	22,219
158,570	Axalta Coating Systems Ltd	Goldam Sachs	520,110
33,610	Axalta Coating Systems Ltd	JP Morgan	113,266
17,620	Axis Capital Holdings Ltd	Barclays Bank	1,586
19,270	Axis Capital Holdings Ltd	Credit Suisse	(24,858)
30,540	Axis Capital Holdings Ltd	Goldam Sachs	115,747
31,361	Axis Capital Holdings Ltd	JP Morgan	(20,577)
(74,498)	Baker Hughes Co	Bank of America Merrill Lynch	(184,010)
(96,220)	Baker Hughes Co	Goldam Sachs	(237,663)
(21,133)	Ball Corp	Bank of America Merrill Lynch	(170,543)
(42,630)	Ball Corp	Barclays Bank	(246,828)
(8,740)	Ball Corp	Citibank	(50,605)
(12,440)	Ball Corp	Goldam Sachs	(100,391)
(13,210)	Bank of America Corp	Barclays Bank	(23,382)
(5,770)	Bank of Hawaii Corp	Barclays Bank	(12,406)
(2,820)	Bank of Hawaii Corp	Credit Suisse	(20,514)
(2,370)	Bank of Hawaii Corp	HSBC	(16,297)
42,850	Bank of New York Mellon Corp	Goldam Sachs	215,536
(6,354)	Bank OZK	Bank of America Merrill Lynch	(17,346)
(167,904)	Bank OZK	Goldam Sachs	(458,378)
(17,184)	Bank OZK	JP Morgan	(8,076)
107,911	BankUnited Inc	Bank of America Merrill Lynch	473,729
277,346	BankUnited Inc	Barclays Bank	693,365
8,410	BankUnited Inc	Credit Suisse	4,121
179,938	BankUnited Inc	Goldam Sachs	789,928
95,395	BankUnited Inc	HSBC	46,744
33,362	BankUnited Inc	JP Morgan	16,347
(15,150)	Barrick Gold Corp	Bank of America Merrill Lynch	55,904
(13,890)	Barrick Gold Corp	Barclays Bank	27,363
(8,980)	Barrick Gold Corp	Credit Suisse	27,299

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(39,550)	Barrick Gold Corp	Goldam Sachs	145,940
(62,950)	Bausch Health Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	(164,300)
(148,984)	Bausch Health Cos Inc	Barclays Bank	(87,901)
(10,060)	Bausch Health Cos Inc	Credit Suisse	(15,492)
(6,310)	Baxter International Inc	Barclays Bank	(16,848)
(4,430)	Baxter International Inc	Goldam Sachs	(10,809)
(2,540)	Baxter International Inc	HSBC	(3,861)
(9,616)	Becton Dickinson and Co	Bank of America Merrill Lynch	145,490
(16,185)	Becton Dickinson and Co	Citibank	(62,636)
(2,270)	Berkshire Hathaway Inc ' B '	Goldam Sachs	(32,211)
(710)	Berkshire Hathaway Inc ' B '	JP Morgan	(4,693)
(7,050)	Berry Global Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(30,809)
(17,090)	Berry Global Group Inc	Goldam Sachs	(74,683)
79,426	Best Buy Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(186,651)
15,880	Best Buy Co Inc	Barclays Bank	(10,481)
6,420	Best Buy Co Inc	Credit Suisse	(15,215)
9,630	Best Buy Co Inc	HSBC	(22,823)
4,100	Best Buy Co Inc	JP Morgan	(9,717)
632,623	BGC Partners Inc ' A '	Barclays Bank	12,652
144,421	BGC Partners Inc ' A '	Credit Suisse	(40,438)
329,588	BGC Partners Inc ' A '	Goldam Sachs	9,888
129,843	BGC Partners Inc ' A '	HSBC	18,022
2,844	Biogen Inc	Bank of America Merrill Lynch	(45,618)
13,917	Biogen Inc	Citibank	(55,250)
16,320	Biogen Inc	HSBC	(219,667)
(1,400)	BioMarin Pharmaceutical Inc	Bank of America Merrill Lynch	(16,842)
(1,890)	BioMarin Pharmaceutical Inc	Barclays Bank	(15,611)
(9,390)	BioMarin Pharmaceutical Inc	Goldam Sachs	(112,962)
10,040	Bio-Rad Laboratories Inc ' A '	Barclays Bank	72,388
3,400	Bio-Rad Laboratories Inc ' A '	Goldam Sachs	43,996
(12,074)	Bio-Techne Corp	Bank of America Merrill Lynch	86,088
(26,300)	Black Knight Inc	Barclays Bank	(61,805)
(28,800)	Black Knight Inc	Goldam Sachs	(95,040)
(84)	BlackBerry Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(16)
(32,982)	Bluebird Bio Inc	Barclays Bank	187,997
(7,590)	Bluebird Bio Inc	Credit Suisse	(13,662)
(1,410)	Bluebird Bio Inc	Goldam Sachs	(6,232)
(15,760)	Boeing Co	Barclays Bank	(133,802)
(6,161)	Boeing Co	Goldam Sachs	(160,309)
(5,450)	Boeing Co	HSBC	(68,561)
(16,132)	BOK Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(154,545)
(105)	BOK Financial Corp	Credit Suisse	(203)
750	Booking Holdings Inc	Barclays Bank	4,860
660	Booking Holdings Inc	Goldam Sachs	167,290
63,197	Booz Allen Hamilton Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	431,004

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
8,400	Booz Allen Hamilton Holding Corp	Barclays Bank	15,036
32,810	Booz Allen Hamilton Holding Corp	Goldam Sachs	223,764
12,452	Booz Allen Hamilton Holding Corp	JP Morgan	57,528
(8,740)	BorgWarner Inc	Bank of America Merrill Lynch	(31,551)
(7,730)	BorgWarner Inc	Barclays Bank	(11,904)
(4,360)	BorgWarner Inc	Credit Suisse	(16,341)
(16,490)	BorgWarner Inc	Goldam Sachs	(59,529)
(4,800)	BorgWarner Inc	JP Morgan	(22,924)
(14,569)	Boston Scientific Corp	Bank of America Merrill Lynch	(38,316)
(29,300)	Boston Scientific Corp	Barclays Bank	(45,415)
(6,350)	Boston Scientific Corp	Goldam Sachs	(16,701)
23,680	Bright Horizons Family Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	323,706
2,150	Bright Horizons Family Solutions Inc	Barclays Bank	14,534
5,370	Bright Horizons Family Solutions Inc	Citibank	36,301
3,120	Bright Horizons Family Solutions Inc	Credit Suisse	1,373
13,420	Bright Horizons Family Solutions Inc	Goldam Sachs	183,451
6,290	Bright Horizons Family Solutions Inc	HSBC	2,768
1,360	Bright Horizons Family Solutions Inc	JP Morgan	598
(19,830)	Brighthouse Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(65,836)
(13,090)	Brighthouse Financial Inc	Barclays Bank	(15,054)
(31,050)	Brighthouse Financial Inc	Goldam Sachs	(103,086)
15	Brinker International Inc	Bank of America Merrill Lynch	100
6,617	Bristol-Myers Squibb Co	Barclays Bank	(3,772)
44,302	Bristol-Myers Squibb Co CVR (Rights)	Bank of America Merrill Lynch	3,101
54,930	Bristol-Myers Squibb Co CVR (Rights)	Barclays Bank	5,493
25,852	Bristol-Myers Squibb Co CVR (Rights)	Credit Suisse	(19,389)
1,600	Bristol-Myers Squibb Co CVR (Rights)	Goldam Sachs	112
19,640	Bristol-Myers Squibb Co CVR (Rights)	HSBC	(14,730)
5,425	Bristol-Myers Squibb Co CVR (Rights)	JP Morgan	(4,069)
(1,810)	Broadcom Inc	Bank of America Merrill Lynch	(44,055)
(1,130)	Broadcom Inc	Barclays Bank	(9,153)
(740)	Broadcom Inc	Citibank	(5,994)
(9,600)	Broadcom Inc	Goldam Sachs	(233,664)
(2,640)	Broadcom Inc	JP Morgan	(25,661)
(16,230)	Broadridge Financial Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	(55,994)
(1,360)	Broadridge Financial Solutions Inc	Barclays Bank	(2,978)
(13,760)	Broadridge Financial Solutions Inc	Goldam Sachs	(47,472)
(2,600)	Broadridge Financial Solutions Inc	HSBC	286
(53,625)	Brookfield Asset Management Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(97,598)
(76,005)	Brookfield Asset Management Inc 'A'	Barclays Bank	(111,727)
(15,935)	Brookfield Asset Management Inc 'A'	Goldam Sachs	(29,002)
32,230	Brown & Brown Inc	Barclays Bank	55,113
7,490	Brown & Brown Inc	Credit Suisse	25,875
30,657	Brown & Brown Inc	Goldam Sachs	95,956
(11,237)	Brown-Forman Corp 'B'	Bank of America Merrill Lynch	5,281

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(44,129)	Brown-Forman Corp 'B'	Barclays Bank	(47,218)
(10,880)	Brown-Forman Corp 'B'	Goldam Sachs	5,114
9,920	Bruker Corp	JP Morgan	46,591
5,360	Brunswick Corp	Bank of America Merrill Lynch	30,070
10,830	Brunswick Corp	HSBC	66,605
20,640	Brunswick Corp	JP Morgan	132,083
(18,900)	Bunge Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(74,277)
(27,583)	Bunge Ltd	Barclays Bank	(79,439)
(91,580)	Bunge Ltd	Goldam Sachs	(359,909)
(7,480)	Bunge Ltd	HSBC	(21,831)
4,686	Burlington Stores Inc	Bank of America Merrill Lynch	202,060
17,850	Burlington Stores Inc	Barclays Bank	152,618
3,210	Burlington Stores Inc	Citibank	27,446
2,060	Burlington Stores Inc	Credit Suisse	94,445
13,230	Burlington Stores Inc	Goldam Sachs	570,478
3,370	Burlington Stores Inc	HSBC	107,267
120	Burlington Stores Inc	JP Morgan	3,820
(1,518)	BWX Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11,172)
(18,950)	BWX Technologies Inc	Goldam Sachs	(139,472)
(828)	Cable One Inc	Barclays Bank	(47,858)
(1,660)	Cable One Inc	Goldam Sachs	2,390
12,365	Cabot Corp	Bank of America Merrill Lynch	86,926
8,470	Cabot Corp	Barclays Bank	15,839
8,690	Cabot Corp	Citibank	16,250
3,900	Cabot Corp	Credit Suisse	29,585
21,100	Cabot Corp	Goldam Sachs	148,333
12,600	Cabot Corp	HSBC	59,066
14,120	Cabot Corp	JP Morgan	51,397
5,990	Cabot Oil & Gas Corp	Citibank	3,953
24,490	Cabot Oil & Gas Corp	HSBC	(23,266)
22,049	CACI International Inc 'A'	Barclays Bank	147,508
14,224	Cadence Design Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	98,288
52,916	Cadence Design Systems Inc	Citibank	155,044
29,753	Cadence Design Systems Inc	Credit Suisse	193,990
(158,879)	Caesars Entertainment Corp	Bank of America Merrill Lynch	(204,954)
(90,909)	Caesars Entertainment Corp	JP Morgan	(147,273)
2,860	Campbell Soup Co	Goldam Sachs	(11,383)
2,190	Campbell Soup Co	HSBC	(6,789)
(2,558)	Cantel Medical Corp	Bank of America Merrill Lynch	(20,643)
(13,129)	Cantel Medical Corp	Barclays Bank	(82,713)
(74,760)	Cantel Medical Corp	Goldam Sachs	(603,313)
30,600	Capital One Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	276,930
11,805	Capital One Financial Corp	Barclays Bank	81,100
21,089	Capital One Financial Corp	Citibank	144,881
4,080	Capital One Financial Corp	HSBC	19,910

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
12,639	Capital One Financial Corp	JP Morgan	61,678
(53,530)	Capri Holdings Ltd	Barclays Bank	(60,489)
(104,360)	Capri Holdings Ltd	Goldam Sachs	(288,034)
(5,160)	Cardinal Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	(28,225)
(6,690)	Cardinal Health Inc	Barclays Bank	(5,553)
(10,490)	Cardinal Health Inc	Goldam Sachs	(57,380)
10,585	Carlisle Cos Inc	Goldam Sachs	157,399
(18,290)	CarMax Inc	Bank of America Merrill Lynch	(204,482)
(4,600)	CarMax Inc	Barclays Bank	(24,978)
(7,960)	CarMax Inc	Credit Suisse	(81,908)
(25,950)	CarMax Inc	Goldam Sachs	(290,121)
(86,760)	Carnival Corp	Barclays Bank	(69,408)
(12,530)	Carnival Corp	JP Morgan	(31,317)
16,406	Carter ' s Inc	Bank of America Merrill Lynch	166,357
3,780	Carter ' s Inc	Barclays Bank	15,196
16,410	Carter ' s Inc	Goldam Sachs	166,397
(25,080)	Carvana Co	Bank of America Merrill Lynch	(9,280)
(16,760)	Carvana Co	Barclays Bank	57,319
(9,270)	Carvana Co	Goldam Sachs	(3,430)
(8,170)	Carvana Co	HSBC	4,262
7,560	Casey ' s General Stores Inc	Bank of America Merrill Lynch	77,490
1,820	Casey ' s General Stores Inc	Barclays Bank	7,972
600	Casey ' s General Stores Inc	Citibank	2,628
1,860	Casey ' s General Stores Inc	Credit Suisse	7,459
880	Casey ' s General Stores Inc	HSBC	3,529
490	Casey ' s General Stores Inc	JP Morgan	1,965
(96,993)	Catalent Inc	Bank of America Merrill Lynch	(516,003)
(1,158)	Catalent Inc	Credit Suisse	(7,932)
(8,442)	Catalent Inc	Goldam Sachs	(44,911)
(37,959)	Catalent Inc	JP Morgan	(260,019)
(83)	Caterpillar Inc	Bank of America Merrill Lynch	(874)
(2,860)	Caterpillar Inc	Barclays Bank	(17,103)
(16,380)	Caterpillar Inc	Citibank	(97,952)
(40,860)	Caterpillar Inc	Goldam Sachs	(430,256)
18,400	Cboe Global Markets Inc	Bank of America Merrill Lynch	76,728
1,820	Cboe Global Markets Inc	Barclays Bank	8,627
4,020	Cboe Global Markets Inc	Credit Suisse	15,557
23,710	Cboe Global Markets Inc	Goldam Sachs	98,871
(14,850)	CBRE Group Inc ' A '	Bank of America Merrill Lynch	(111,227)
(37,550)	CBRE Group Inc ' A '	Barclays Bank	(119,409)
(10,430)	CBRE Group Inc ' A '	HSBC	(32,618)
13,140	CDK Global Inc	Barclays Bank	1,971
12,150	CDK Global Inc	Citibank	1,823
5,650	CDK Global Inc	Credit Suisse	(9,266)
5,740	CDK Global Inc	Goldam Sachs	16,129

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
3,730	CDK Global Inc	JP Morgan	(6,117)
5,726	CDW Corp	Bank of America Merrill Lynch	65,677
3,100	CDW Corp	Barclays Bank	10,974
26,160	CDW Corp	Goldam Sachs	300,055
(1,280)	Celanese Corp	Barclays Bank	(3,821)
(4,430)	Celanese Corp	Goldam Sachs	(52,252)
(5,447)	Centene Corp	Bank of America Merrill Lynch	13,454
(15,171)	Centene Corp	Barclays Bank	(21,088)
(2,540)	Centene Corp	Credit Suisse	(889)
(16,903)	Centene Corp	Goldam Sachs	41,750
3,582	Centene Corp	JP Morgan	1,254
(240,919)	Centennial Resource Development Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(42,619)
(883,840)	Centennial Resource Development Inc 'A'	Barclays Bank	(8,838)
(502,779)	Centennial Resource Development Inc 'A'	Citibank	(5,028)
(542,472)	Centennial Resource Development Inc 'A'	Goldam Sachs	(95,963)
(107,550)	Centennial Resource Development Inc 'A'	HSBC	(21,521)
(92,604)	Centennial Resource Development Inc 'A'	JP Morgan	(18,530)
12,460	CenturyLink Inc	Citibank	(2,118)
25,510	CenturyLink Inc	Goldam Sachs	9,694
91,320	CenturyLink Inc	JP Morgan	(24,468)
12,237	Cerence Inc	Barclays Bank	(66,936)
(99,857)	Ceridian HCM Holding Inc	Credit Suisse	(347,502)
71,570	Cerner Corp	Bank of America Merrill Lynch	381,468
54,300	Cerner Corp	Barclays Bank	171,588
4,520	Cerner Corp	Citibank	14,283
11,410	Cerner Corp	Credit Suisse	19,283
80,330	Cerner Corp	Goldam Sachs	428,159
4,290	Cerner Corp	JP Morgan	7,250
9,520	CF Industries Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	39,603
7,320	CF Industries Holdings Inc	Goldam Sachs	30,451
8,310	CF Industries Holdings Inc	HSBC	18,889
7,790	CF Industries Holdings Inc	JP Morgan	(390)
5,270	CH Robinson Worldwide Inc	Goldam Sachs	47,535
15,150	Change Healthcare Inc	Bank of America Merrill Lynch	20,301
(1,490)	Charles River Laboratories International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,404)
(8,750)	Charles River Laboratories International Inc	Goldam Sachs	(49,350)
(5,770)	Charles River Laboratories International Inc	HSBC	(91,685)
(19,315)	Charles Schwab Corp	Bank of America Merrill Lynch	(62,387)
(22,460)	Charles Schwab Corp	Barclays Bank	(66,482)
(44,830)	Charles Schwab Corp	Credit Suisse	32,278
(32,340)	Charles Schwab Corp	Goldam Sachs	(104,458)
(3,240)	Charles Schwab Corp	JP Morgan	(8,616)
(1,930)	Charter Communications Inc 'A'	Barclays Bank	(55,970)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(1,430)	Charter Communications Inc 'A'	Goldam Sachs	(55,069)
(2,100)	Charter Communications Inc 'A'	JP Morgan	(55,902)
25	Cheesecake Factory Inc	Bank of America Merrill Lynch	65
3,230	Chemed Corp	Goldam Sachs	72,772
(99,655)	Chemours Co	Bank of America Merrill Lynch	(228,210)
(108,136)	Chemours Co	Barclays Bank	(100,566)
(11,080)	Cheniere Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(24,376)
(30,330)	Cheniere Energy Inc	Barclays Bank	72,489
(5,000)	Cheniere Energy Inc	Credit Suisse	(8,501)
(21,150)	Cheniere Energy Inc	Goldam Sachs	(46,530)
(1,760)	Chevron Corp	Credit Suisse	462
(1,290)	Chevron Corp	HSBC	3,574
1,680	Chipotle Mexican Grill Inc	Barclays Bank	(100,430)
210	Chipotle Mexican Grill Inc	Goldam Sachs	5,076
(9,530)	Choice Hotels International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(94,728)
(5,220)	Choice Hotels International Inc	Barclays Bank	(14,668)
(4,430)	Choice Hotels International Inc	Credit Suisse	(32,295)
(42,364)	Choice Hotels International Inc	Goldam Sachs	(421,098)
(16,740)	Church & Dwight Co Inc	Barclays Bank	(29,881)
(5,360)	Church & Dwight Co Inc	Goldam Sachs	(616)
6,327	Ciena Corp	Bank of America Merrill Lynch	30,053
56,810	Ciena Corp	Barclays Bank	90,328
69,590	Ciena Corp	Goldam Sachs	330,553
(4,050)	Cigna Corp	Bank of America Merrill Lynch	(30,699)
(9,330)	Cigna Corp	Barclays Bank	(81,451)
(3,890)	Cigna Corp	Goldam Sachs	(29,486)
(5,280)	Cigna Corp	HSBC	(44,669)
2,580	Cincinnati Financial Corp	Citibank	3,380
2,210	Cincinnati Financial Corp	JP Morgan	21,136
31,770	Cinemark Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	101,346
24,490	Cinemark Holdings Inc	Barclays Bank	25,225
9,670	Cinemark Holdings Inc	Credit Suisse	9,090
74,320	Cinemark Holdings Inc	Goldam Sachs	237,081
18,520	Cinemark Holdings Inc	HSBC	17,409
44,630	Cinemark Holdings Inc	JP Morgan	41,952
2,030	Cintas Corp	Goldam Sachs	44,822
(57,120)	Cisco Systems Inc	Goldam Sachs	(89,107)
(8,970)	Cisco Systems Inc	JP Morgan	(25,475)
54,850	CIT Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	225,434
114,750	CIT Group Inc	Barclays Bank	269,663
3,934	CIT Group Inc	Citibank	9,245
5,230	CIT Group Inc	Goldam Sachs	21,495
60,423	CIT Group Inc	HSBC	112,387
1,000	CIT Group Inc	JP Morgan	1,860
17,010	Citigroup Inc	Barclays Bank	72,122

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
4,230	Citigroup Inc	Credit Suisse	32,266
47,280	Citigroup Inc	Goldam Sachs	303,538
3,800	Citigroup Inc	JP Morgan	24,602
46,194	Citizens Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	181,542
97,694	Citizens Financial Group Inc	Barclays Bank	251,074
79,650	Citizens Financial Group Inc	Goldam Sachs	313,025
25,822	Citrix Systems Inc	Citibank	190,308
2,548	Citrix Systems Inc	Credit Suisse	(16,740)
4,818	Citrix Systems Inc	HSBC	(31,654)
6,809	Citrix Systems Inc	JP Morgan	(44,735)
42,900	Clean Harbors Inc	Barclays Bank	97,812
(2,460)	Clorox Co	Goldam Sachs	13,112
8,590	CME Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,786)
10,210	CME Group Inc	Goldam Sachs	(8,066)
870	CME Group Inc	HSBC	1,569
2,150	CME Group Inc	JP Morgan	(2,688)
450	CMS Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,877
3,500	CMS Energy Corp	Citibank	7,910
40,450	CMS Energy Corp	Goldam Sachs	168,677
20,927	CNA Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	93,334
7,180	CNA Financial Corp	Barclays Bank	5,816
2,625	CNA Financial Corp	Goldam Sachs	11,708
(48,460)	Coca-Cola Co	Barclays Bank	(76,567)
(4,290)	Coca-Cola European Partners Plc	Credit Suisse	(13,112)
(21,680)	Coca-Cola European Partners Plc	Goldam Sachs	(71,978)
(66,940)	Cognex Corp	Barclays Bank	161,995
(24,350)	Cognex Corp	Goldam Sachs	(49,431)
11,460	Cognizant Technology Solutions Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	31,973
9,140	Cognizant Technology Solutions Corp 'A'	Goldam Sachs	25,501
10,910	Cognizant Technology Solutions Corp 'A'	JP Morgan	(45,713)
(26,886)	Coherent Inc	Bank of America Merrill Lynch	(262,945)
(17,968)	Coherent Inc	Goldam Sachs	(175,727)
(19,634)	Colfax Corp	Bank of America Merrill Lynch	(50,067)
(11,564)	Colfax Corp	Goldam Sachs	(29,488)
5,420	Colgate-Palmolive Co	Bank of America Merrill Lynch	17,398
3,570	Colgate-Palmolive Co	Barclays Bank	5,034
13,620	Colgate-Palmolive Co	Citibank	19,204
25,460	Colgate-Palmolive Co	Goldam Sachs	81,727
10,540	Colgate-Palmolive Co	HSBC	29,407
2,380	Colgate-Palmolive Co	JP Morgan	6,640
11,751	Columbia Sportswear Co	Barclays Bank	42,656
2,640	Columbia Sportswear Co	Goldam Sachs	26,585
(40,590)	Comcast Corp 'A'	Barclays Bank	(17,860)
(47,240)	Comcast Corp 'A'	Goldam Sachs	(154,002)
(6,220)	Comcast Corp 'A'	JP Morgan	(16,452)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
6,732	Comerica Inc	Bank of America Merrill Lynch	44,633
52,310	Comerica Inc	Barclays Bank	210,286
19,480	Comerica Inc	Goldam Sachs	129,152
(4,530)	Commerce Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	(39,547)
(10,370)	Commerce Bancshares Inc	Barclays Bank	(35,673)
(21,640)	Commerce Bancshares Inc	Credit Suisse	(88,724)
(49,870)	Commerce Bancshares Inc	Goldam Sachs	(435,365)
(1,970)	Commerce Bancshares Inc	HSBC	(19,507)
(216,791)	CommScope Holding Co Inc	Barclays Bank	(197,280)
(21,410)	Conagra Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	5,995
(138,923)	Conagra Brands Inc	JP Morgan	(51,402)
(41,621)	Concho Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	39,540
(3,640)	Concho Resources Inc	Barclays Bank	9,173
(29,390)	Concho Resources Inc	Goldam Sachs	27,921
(25,876)	Concho Resources Inc	JP Morgan	137,919
16,130	ConocoPhillips	Bank of America Merrill Lynch	20,001
21,877	ConocoPhillips	Citibank	(25,596)
27,934	ConocoPhillips	Credit Suisse	(27,096)
23,720	ConocoPhillips	Goldam Sachs	29,413
(7,600)	Consolidated Edison Inc	Barclays Bank	(23,332)
(14,380)	Constellation Brands Inc 'A'	Barclays Bank	(16,681)
500	Cooper Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	10,370
(10,040)	Copart Inc	Barclays Bank	(25,702)
(3,320)	Copart Inc	Credit Suisse	(17,600)
(41,140)	Copart Inc	Goldam Sachs	(381,368)
(4,580)	Copart Inc	HSBC	(22,992)
12,030	CoreLogic Inc	Barclays Bank	20,692
3,470	CoreLogic Inc	Credit Suisse	20,435
24,637	CoreLogic Inc	Goldam Sachs	140,924
4,270	CoreLogic Inc	HSBC	24,607
(920)	Corning Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,935)
(39,180)	Corning Inc	Barclays Bank	(57,203)
(9,090)	Corning Inc	Credit Suisse	(11,090)
(95,530)	Corning Inc	Goldam Sachs	(304,741)
(3,660)	CoStar Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,930)
(1,420)	CoStar Group Inc	Goldam Sachs	(3,465)
5,700	Costco Wholesale Corp	Bank of America Merrill Lynch	34,029
1,400	Costco Wholesale Corp	Credit Suisse	(1,064)
550	Costco Wholesale Corp	HSBC	(418)
3,110	Costco Wholesale Corp	JP Morgan	(2,364)
33,550	Coty Inc 'A'	Barclays Bank	4,865
25,010	Coty Inc 'A'	HSBC	(32,638)
(11,900)	Coupa Software Inc	Barclays Bank	25,228
(43,858)	Covetrus Inc	Bank of America Merrill Lynch	(139,468)
(42,867)	Covetrus Inc	Barclays Bank	10,288

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(34,797)	Covetrus Inc	Goldam Sachs	(110,654)
36,340	Crane Co	Barclays Bank	125,373
(8,730)	Credit Acceptance Corp	Barclays Bank	(232,742)
(33,735)	Cree Inc	Bank of America Merrill Lynch	(352,193)
(38,980)	Cree Inc	Barclays Bank	(56,911)
(61,360)	Cree Inc	Goldam Sachs	(640,598)
(16,070)	Crown Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(88,546)
(14,710)	Crown Holdings Inc	Barclays Bank	(41,335)
5,660	CSX Corp	Barclays Bank	11,829
1,790	CSX Corp	Citibank	3,741
4,160	CSX Corp	Credit Suisse	23,386
(16,900)	Cullen/Frost Bankers Inc	Bank of America Merrill Lynch	(175,844)
(29,937)	Cullen/Frost Bankers Inc	Credit Suisse	(180,969)
(24,230)	Cullen/Frost Bankers Inc	Goldam Sachs	(252,113)
25,557	Cummins Inc	Bank of America Merrill Lynch	336,075
14,130	Cummins Inc	Goldam Sachs	185,810
10,048	Curtiss-Wright Corp	Bank of America Merrill Lynch	145,796
37,290	Curtiss-Wright Corp	Barclays Bank	295,337
1,310	Curtiss-Wright Corp	Credit Suisse	3,144
11,680	Curtiss-Wright Corp	Goldam Sachs	169,477
6,830	Curtiss-Wright Corp	HSBC	60,402
15,868	Curtiss-Wright Corp	JP Morgan	54,575
(24,323)	Danaher Corp	Bank of America Merrill Lynch	(40,133)
(18,440)	Danaher Corp	Barclays Bank	(133,506)
(4,090)	Danaher Corp	Goldam Sachs	(6,749)
(8,700)	Danaher Corp	JP Morgan	(35,409)
27,221	Darden Restaurants Inc	Bank of America Merrill Lynch	233,284
4,200	Darden Restaurants Inc	Barclays Bank	10,710
4,350	Darden Restaurants Inc	Goldam Sachs	37,280
3,500	Darden Restaurants Inc	JP Morgan	29,319
31,080	DaVita Inc	Barclays Bank	81,430
9,960	DaVita Inc	Goldam Sachs	1,793
(17,870)	Deere & Co	Goldam Sachs	(410,653)
(6,422)	Deere & Co	JP Morgan	(77,000)
(34,860)	Dell Technologies Inc 'C'	Bank of America Merrill Lynch	(247,680)
9,800	Delta Air Lines Inc	Bank of America Merrill Lynch	55,860
28,480	Delta Air Lines Inc	Barclays Bank	62,656
6,620	Delta Air Lines Inc	Citibank	14,564
136,970	Delta Air Lines Inc	Goldam Sachs	780,729
25,950	Delta Air Lines Inc	HSBC	56,312
27,970	DENTSPLY SIRONA Inc	Bank of America Merrill Lynch	233,270
27,180	DENTSPLY SIRONA Inc	Barclays Bank	103,556
15,640	DENTSPLY SIRONA Inc	Citibank	59,588
6,880	DENTSPLY SIRONA Inc	Credit Suisse	37,152
35,790	DENTSPLY SIRONA Inc	Goldam Sachs	298,489

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
6,380	DENTSPLY SIRONA Inc	HSBC	34,452
268,546	Devon Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	(214,837)
148,031	Devon Energy Corp	Credit Suisse	(229,448)
740	DexCom Inc	Bank of America Merrill Lynch	(35,320)
850	DexCom Inc	Credit Suisse	(30,175)
(13,030)	Diamondback Energy Inc	HSBC	(7,989)
(3,050)	Diamondback Energy Inc	JP Morgan	(9,998)
61,125	Dick's Sporting Goods Inc	Bank of America Merrill Lynch	435,821
550	Dick's Sporting Goods Inc	Barclays Bank	1,557
187,809	Dick's Sporting Goods Inc	Goldam Sachs	1,339,078
20,170	Dick's Sporting Goods Inc	JP Morgan	103,069
24,918	Discover Financial Services	Bank of America Merrill Lynch	268,865
62,900	Discover Financial Services	Barclays Bank	523,328
43,841	Discover Financial Services	Credit Suisse	266,115
3,120	Discover Financial Services	Goldam Sachs	33,665
(50,640)	Discovery Inc 'C'	Goldam Sachs	(43,297)
(27,230)	DISH Network Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(166,103)
(73,220)	DISH Network Corp 'A'	Barclays Bank	(91,525)
(4,598)	DISH Network Corp 'A'	Credit Suisse	(23,358)
(23,610)	DocuSign Inc	Bank of America Merrill Lynch	(256,168)
16,129	Dolby Laboratories Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	109,516
79,347	Dolby Laboratories Inc 'A'	Barclays Bank	133,303
1,012	Dolby Laboratories Inc 'A'	Credit Suisse	2,388
23,740	Dolby Laboratories Inc 'A'	Goldam Sachs	161,195
5,990	Dolby Laboratories Inc 'A'	HSBC	40,885
12,410	Dollar General Corp	Bank of America Merrill Lynch	107,222
6,720	Dollar General Corp	Citibank	78,490
3,910	Dollar General Corp	Goldam Sachs	33,782
(8,258)	Dollar Tree Inc	Bank of America Merrill Lynch	(177,547)
(26,540)	Dollar Tree Inc	Goldam Sachs	(570,610)
(4,050)	Dollar Tree Inc	JP Morgan	(75,006)
(32,595)	Dominion Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(165,583)
(4,410)	Dominion Energy Inc	Barclays Bank	(12,304)
1,720	Domino's Pizza Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,747)
2,110	Domino's Pizza Inc	Barclays Bank	2,490
1,240	Domino's Pizza Inc	Citibank	1,463
420	Domino's Pizza Inc	HSBC	1,751
39,998	Domtar Corp	Bank of America Merrill Lynch	33,998
13,700	Domtar Corp	Barclays Bank	6,713
10,348	Donaldson Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	52,257
38,014	Donaldson Co Inc	Barclays Bank	78,309
8,810	Donaldson Co Inc	Credit Suisse	45,668
7,920	Donaldson Co Inc	Goldam Sachs	39,996
47,784	Dover Corp	Bank of America Merrill Lynch	559,551
2,557	Dover Corp	Credit Suisse	11,302

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
26,510	Dover Corp	Goldam Sachs	310,432
(22,580)	Dow Inc	Barclays Bank	(51,031)
(89,110)	Dow Inc	Goldam Sachs	(429,510)
(12,420)	Dow Inc	HSBC	(54,303)
(89,430)	Dow Inc	JP Morgan	(362,191)
(4,281)	DR Horton Inc	Bank of America Merrill Lynch	(38,786)
(22,770)	DR Horton Inc	Goldam Sachs	(206,296)
67,580	Dropbox Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(6,082)
49,695	Dropbox Inc 'A'	Barclays Bank	30,562
5,320	Dropbox Inc 'A'	Citibank	3,272
67,900	Dropbox Inc 'A'	Goldam Sachs	(6,111)
34,525	DTE Energy Co	Bank of America Merrill Lynch	307,273
755	DTE Energy Co	Credit Suisse	3,767
13,270	Duke Energy Corp	Goldam Sachs	50,957
1,600	Duke Energy Corp	HSBC	5,922
75,100	Dunkin' Brands Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	129,172
9,980	Dunkin' Brands Group Inc	Barclays Bank	3,493
24,354	Dunkin' Brands Group Inc	Credit Suisse	(26,302)
69,913	Dunkin' Brands Group Inc	Goldam Sachs	120,250
(10,500)	DuPont de Nemours Inc	Bank of America Merrill Lynch	(45,990)
(54,680)	DuPont de Nemours Inc	Barclays Bank	(62,335)
(7,130)	DuPont de Nemours Inc	Citibank	(8,128)
(52,200)	DuPont de Nemours Inc	Goldam Sachs	(228,636)
(13,410)	DuPont de Nemours Inc	HSBC	(38,889)
8,680	DXC Technology Co	Barclays Bank	(7,291)
12,070	DXC Technology Co	Citibank	(10,139)
8,140	DXC Technology Co	Credit Suisse	(24,501)
(6,230)	E*TRADE Financial Corp	Barclays Bank	(26,104)
(3,000)	E*TRADE Financial Corp	HSBC	(20,969)
15,460	Eagle Materials Inc	Bank of America Merrill Lynch	202,062
12,267	Eagle Materials Inc	Citibank	7,360
2,210	Eagle Materials Inc	Credit Suisse	16,133
16,590	Eagle Materials Inc	Goldam Sachs	216,831
5,430	Eagle Materials Inc	JP Morgan	39,639
(17,790)	East West Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(59,597)
(34,280)	East West Bancorp Inc	Barclays Bank	(51,763)
(11,540)	East West Bancorp Inc	Credit Suisse	(1,039)
(21,190)	East West Bancorp Inc	Goldam Sachs	(70,987)
(29,130)	Eastman Chemical Co	Bank of America Merrill Lynch	(222,262)
(28,340)	Eastman Chemical Co	Barclays Bank	(60,648)
(2,620)	Eastman Chemical Co	Citibank	(5,607)
(56,830)	Eastman Chemical Co	Goldam Sachs	(433,613)
(5,010)	Eastman Chemical Co	JP Morgan	(25,401)
(3,650)	Eaton Corp Plc	Barclays Bank	(16,936)
(31,780)	Eaton Corp Plc	Goldam Sachs	(305,088)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(5,060)	Eaton Corp Plc	HSBC	(5,364)
(1,860)	Eaton Corp Plc	JP Morgan	(1,972)
17,046	eBay Inc	Bank of America Merrill Lynch	39,547
88,790	eBay Inc	Barclays Bank	87,014
51,408	eBay Inc	Credit Suisse	117,210
26,750	eBay Inc	Goldam Sachs	62,060
13,586	eBay Inc	HSBC	30,976
(4,670)	EchoStar Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(18,026)
(46,930)	EchoStar Corp 'A'	Barclays Bank	(51,623)
(5,330)	EchoStar Corp 'A'	Credit Suisse	(20,757)
(99,691)	EchoStar Corp 'A'	Goldam Sachs	(384,807)
1,630	Ecolab Inc	Bank of America Merrill Lynch	22,771
2,520	Ecolab Inc	Citibank	20,714
1,640	Ecolab Inc	Credit Suisse	17,974
820	Ecolab Inc	Goldam Sachs	11,455
1,700	Ecolab Inc	HSBC	20,477
(24,152)	Edison International	Barclays Bank	(32,605)
(56,660)	Edison International	Goldam Sachs	(103,688)
(14,450)	Edison International	JP Morgan	(10,549)
3,110	Edwards Lifesciences Corp	Bank of America Merrill Lynch	32,064
25,330	Edwards Lifesciences Corp	Goldam Sachs	261,152
(40,230)	Elanco Animal Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	(82,069)
(112,850)	Elanco Animal Health Inc	Barclays Bank	(250,527)
(28,040)	Elanco Animal Health Inc	Credit Suisse	(37,013)
(119,680)	Elanco Animal Health Inc	Goldam Sachs	(244,147)
(47,821)	Elanco Animal Health Inc	HSBC	(66,767)
(27,520)	Elanco Animal Health Inc	JP Morgan	(36,326)
(7,010)	Elastic NV	Barclays Bank	5,748
(14,924)	Elastic NV	Credit Suisse	(163,119)
(23,990)	Elastic NV	Goldam Sachs	(287,880)
7,280	Electronic Arts Inc	Barclays Bank	8,518
26,610	Electronic Arts Inc	Credit Suisse	126,950
18,070	Electronic Arts Inc	Goldam Sachs	51,680
(127,050)	Element Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	(152,460)
(660)	Element Solutions Inc	Barclays Bank	(53)
(400,878)	Element Solutions Inc	Goldam Sachs	(481,054)
(33,104)	Element Solutions Inc	JP Morgan	(21,187)
20,510	Eli Lilly and Co	Barclays Bank	17,844
1,150	Eli Lilly and Co	Goldam Sachs	(8,280)
(2,140)	Emerson Electric Co	Bank of America Merrill Lynch	(14,937)
(5,360)	Emerson Electric Co	Barclays Bank	(21,708)
1,790	Encompass Health Corp	Bank of America Merrill Lynch	14,105
(46,705)	Energizer Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(101,817)
(4,901)	Energizer Holdings Inc	Barclays Bank	2,549
(109,471)	Energizer Holdings Inc	Goldam Sachs	(238,647)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(21,480)	Entegris Inc	Barclays Bank	(16,969)
(12,780)	Entegris Inc	Credit Suisse	(34,313)
(6,410)	Entegris Inc	Goldam Sachs	(24,166)
25,910	Entergy Corp	Bank of America Merrill Lynch	176,188
7,430	Entergy Corp	Barclays Bank	28,383
25,421	Entergy Corp	Credit Suisse	172,100
2,220	Entergy Corp	Goldam Sachs	15,096
(2,270)	EOG Resources Inc	Goldam Sachs	(5,698)
(8,083)	EPAM Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(130,055)
(5,150)	EPAM Systems Inc	Barclays Bank	(49,492)
(60,150)	EQT Corp	Bank of America Merrill Lynch	(36,692)
(13,170)	EQT Corp	Barclays Bank	5,136
(87,743)	EQT Corp	Credit Suisse	56,156
(78,196)	EQT Corp	HSBC	32,513
(20,123)	Equifax Inc	Bank of America Merrill Lynch	(199,620)
(19,210)	Equifax Inc	Goldam Sachs	(190,563)
4	Equitable Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	10
52,620	Equitable Holdings Inc	Barclays Bank	71,037
(150,315)	Equitrans Midstream Corp	Bank of America Merrill Lynch	(25,554)
(42,830)	Equitrans Midstream Corp	Barclays Bank	(1,713)
(147,289)	Equitrans Midstream Corp	Goldam Sachs	(25,039)
(12,385)	Erie Indemnity Co 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(117,410)
(5,380)	Erie Indemnity Co 'A'	Barclays Bank	(9,523)
(198,410)	Essential Utilities Inc	Barclays Bank	(416,661)
(6,430)	Estee Lauder Cos Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(158,049)
(2,260)	Estee Lauder Cos Inc 'A'	Barclays Bank	(35,685)
(4,480)	Estee Lauder Cos Inc 'A'	Goldam Sachs	(110,118)
(1,470)	Estee Lauder Cos Inc 'A'	HSBC	(34,919)
3,927	Etsy Inc	Barclays Bank	12,920
2,442	Euronet Worldwide Inc	Bank of America Merrill Lynch	29,548
12,100	Euronet Worldwide Inc	Barclays Bank	27,588
5,430	Euronet Worldwide Inc	Citibank	12,380
3,280	Euronet Worldwide Inc	Goldam Sachs	39,688
1,620	Euronet Worldwide Inc	JP Morgan	2,365
4,090	Evercore Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	25,563
3,480	Evercore Inc 'A'	Barclays Bank	10,057
(1,350)	Everest Re Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(43,119)
(6,890)	Everest Re Group Ltd	Goldam Sachs	(220,067)
14,999	Evergy Inc	Bank of America Merrill Lynch	80,245
16,817	Evergy Inc	Barclays Bank	31,784
2,077	Evergy Inc	Citibank	3,926
5,132	Evergy Inc	Credit Suisse	22,529
1,470	Evergy Inc	Goldam Sachs	7,865
(6,963)	Eversource Energy	Bank of America Merrill Lynch	(37,322)
(2,660)	Eversource Energy	Goldam Sachs	(14,258)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(15,064)	Exact Sciences Corp	Bank of America Merrill Lynch	41,426
(29,970)	Exact Sciences Corp	Goldam Sachs	82,418
36,530	Exelixis Inc	Goldam Sachs	(47,124)
23,370	Exelon Corp	Barclays Bank	22,435
7,300	Expedia Group Inc	Barclays Bank	(949)
4,730	Expedia Group Inc	Credit Suisse	56,370
14,890	Expedia Group Inc	Goldam Sachs	164,683
1,770	Expedia Group Inc	JP Morgan	27,059
22,697	Expeditors International of Washington Inc	Citibank	70,134
4,816	Expeditors International of Washington Inc	Credit Suisse	1,541
28,713	Expeditors International of Washington Inc	HSBC	9,188
71,956	Expeditors International of Washington Inc	JP Morgan	23,026
(38,800)	Extended Stay America Inc (Unit)	Bank of America Merrill Lynch	(28,712)
(105,959)	Extended Stay America Inc (Unit)	Goldam Sachs	(78,410)
(68,290)	Extended Stay America Inc (Unit)	HSBC	(20,284)
(130)	Exxon Mobil Corp	Bank of America Merrill Lynch	(338)
(70,380)	Exxon Mobil Corp	Citibank	-
(117,890)	Exxon Mobil Corp	Goldam Sachs	(306,514)
2,770	F5 Networks Inc	Bank of America Merrill Lynch	8,338
6,050	F5 Networks Inc	Barclays Bank	26,802
2,680	F5 Networks Inc	Citibank	11,872
11,151	F5 Networks Inc	Credit Suisse	(81,179)
7,290	F5 Networks Inc	Goldam Sachs	21,943
2,120	F5 Networks Inc	HSBC	(15,434)
1,560	F5 Networks Inc	JP Morgan	(11,357)
21,750	Facebook Inc 'A'	Goldam Sachs	339,735
3,417	Fair Isaac Corp	Bank of America Merrill Lynch	188,311
3,720	Fair Isaac Corp	Barclays Bank	67,220
3,790	Fair Isaac Corp	Goldam Sachs	208,867
(13,540)	Fastenal Co	Bank of America Merrill Lynch	(20,581)
(43,550)	Fastenal Co	Barclays Bank	(76,648)
(9,740)	Fastenal Co	Credit Suisse	(13,539)
(47,360)	Fastenal Co	Goldam Sachs	(71,987)
(1,910)	FedEx Corp	Bank of America Merrill Lynch	(38,525)
(33,740)	FedEx Corp	Barclays Bank	(360,681)
(20,722)	Fidelity National Information Services Inc	Barclays Bank	(23,830)
40,030	Fifth Third Bancorp	Barclays Bank	75,657
110,380	Fifth Third Bancorp	Goldam Sachs	373,084
29,370	FireEye Inc	Bank of America Merrill Lynch	9,105
25,850	FireEye Inc	Barclays Bank	(5,687)
11,790	FireEye Inc	Credit Suisse	(6,367)
40,690	FireEye Inc	Goldam Sachs	12,614
7,140	First American Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	40,627
2,920	First American Financial Corp	Citibank	2,248
37,710	First American Financial Corp	Goldam Sachs	214,570

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
13,948	First American Financial Corp	JP Morgan	44,494
7,790	First Citizens BancShares Inc 'A'	Barclays Bank	258,550
480	First Citizens BancShares Inc 'A'	Citibank	15,931
420	First Citizens BancShares Inc 'A'	HSBC	8,858
370	First Citizens BancShares Inc 'A'	JP Morgan	7,803
121,680	First Hawaiian Inc	Barclays Bank	130,198
75,860	First Horizon National Corp	Bank of America Merrill Lynch	131,996
76,280	First Horizon National Corp	Barclays Bank	54,159
(4,598)	First Republic Bank	Bank of America Merrill Lynch	(59,268)
(24,370)	First Republic Bank	Barclays Bank	(280,255)
(9,444)	First Republic Bank	Credit Suisse	(46,181)
(12,130)	First Republic Bank	Goldam Sachs	(156,356)
(1,260)	First Republic Bank	HSBC	(16,182)
(14,476)	First Solar Inc	Barclays Bank	(30,689)
(11,560)	First Solar Inc	Citibank	(24,507)
(54,562)	First Solar Inc	Credit Suisse	(78,024)
(14,800)	First Solar Inc	Goldam Sachs	(92,056)
(22,790)	First Solar Inc	HSBC	(32,590)
(10,900)	First Solar Inc	JP Morgan	(15,587)
20,980	FirstEnergy Corp	Bank of America Merrill Lynch	65,458
33,160	FirstEnergy Corp	Barclays Bank	58,693
7,340	FirstEnergy Corp	Goldam Sachs	22,901
10,900	Fiserv Inc	HSBC	16,739
(8,720)	Five Below Inc	Barclays Bank	(43,949)
3,240	FleetCor Technologies Inc	Barclays Bank	11,437
(12,710)	FLIR Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,207)
(7,000)	FLIR Systems Inc	Goldam Sachs	(665)
(89,774)	Floor & Decor Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(641,884)
(3,052)	Floor & Decor Holdings Inc 'A'	Goldam Sachs	(21,822)
11,650	Flowers Foods Inc	Bank of America Merrill Lynch	6,291
39,230	Flowers Foods Inc	Barclays Bank	13,338
55,990	Flowers Foods Inc	Goldam Sachs	30,235
10,678	Flowers Foods Inc	JP Morgan	9,183
(76,539)	Fluor Corp	Bank of America Merrill Lynch	(153,843)
(2,503)	Fluor Corp	Barclays Bank	(776)
(110,680)	Fluor Corp	Goldam Sachs	(222,467)
(32,580)	Fluor Corp	JP Morgan	(24,435)
7,318	FMC Corp	Bank of America Merrill Lynch	73,912
24,260	FMC Corp	Goldam Sachs	245,026
1,580	FMC Corp	HSBC	7,331
30,310	FNB Corp/PA	Bank of America Merrill Lynch	31,977
127,145	FNB Corp/PA	Barclays Bank	46,408
57,590	FNB Corp/PA	Credit Suisse	(19,293)
66,590	FNB Corp/PA	Goldam Sachs	70,252
94,185	Foot Locker Inc	Bank of America Merrill Lynch	178,952

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
8,980	Foot Locker Inc	Barclays Bank	4,400
11,530	Foot Locker Inc	Goldam Sachs	21,907
(475,290)	Ford Motor Co	Bank of America Merrill Lynch	(375,479)
(64,680)	Ford Motor Co	Barclays Bank	(2,587)
(402,172)	Ford Motor Co	Goldam Sachs	(317,716)
18,671	Fortinet Inc	Bank of America Merrill Lynch	(114,827)
(19,010)	Fortive Corp	Barclays Bank	(41,442)
4,060	Fortune Brands Home & Security Inc	Bank of America Merrill Lynch	28,501
3,730	Fortune Brands Home & Security Inc	Barclays Bank	149
26,210	Fortune Brands Home & Security Inc	Credit Suisse	131,843
22,190	Fortune Brands Home & Security Inc	Goldam Sachs	155,774
12,510	Fortune Brands Home & Security Inc	HSBC	56,170
4,390	Fortune Brands Home & Security Inc	JP Morgan	34,409
(42,570)	Fox Corp 'A'	Credit Suisse	(179,335)
(10,380)	Fox Corp 'A'	HSBC	(27,069)
(160,880)	Franklin Resources Inc	Goldam Sachs	(152,836)
(676,955)	Freeport-McMoRan Inc	Bank of America Merrill Lynch	(379,095)
(221,190)	Freeport-McMoRan Inc	Goldam Sachs	(123,866)
(38,730)	Freeport-McMoRan Inc	JP Morgan	(6,901)
3,534	frontdoor Inc	Bank of America Merrill Lynch	9,931
2,910	frontdoor Inc	Citibank	5,354
4,220	frontdoor Inc	Credit Suisse	12,322
2,920	frontdoor Inc	JP Morgan	8,283
85,360	Gap Inc	Bank of America Merrill Lynch	129,747
279,490	Gap Inc	Barclays Bank	254,336
108,640	Gap Inc	Credit Suisse	143,701
123,830	Gap Inc	Goldam Sachs	188,222
28,620	Gap Inc	JP Morgan	29,192
(1,440)	Garmin Ltd	Citibank	(9,886)
(1,680)	Garmin Ltd	Goldam Sachs	(21,370)
(2,930)	Garmin Ltd	HSBC	(38,046)
(1,490)	Gartner Inc	Barclays Bank	(7,718)
(18,090)	Gartner Inc	Goldam Sachs	(203,693)
(1,210)	Gartner Inc	HSBC	(254)
(179,640)	Gates Industrial Corp Plc	Barclays Bank	(79,042)
(69,268)	Gates Industrial Corp Plc	Citibank	(30,478)
(192,883)	Gates Industrial Corp Plc	Credit Suisse	(202,527)
(66,007)	Gates Industrial Corp Plc	HSBC	(69,307)
(118,054)	Gates Industrial Corp Plc	JP Morgan	(123,957)
(29,530)	GCI Liberty Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(223,542)
(9,000)	GCI Liberty Inc 'A'	Barclays Bank	(31,140)
(13,300)	GCI Liberty Inc 'A'	Goldam Sachs	(100,681)
(9,763)	GCI Liberty Inc 'A'	JP Morgan	(53,111)
(166,324)	General Electric Co	Bank of America Merrill Lynch	(181,293)
(11,840)	General Electric Co	Goldam Sachs	(12,906)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(13,820)	General Mills Inc	Bank of America Merrill Lynch	276
(5,660)	General Mills Inc	Goldam Sachs	113
(8,700)	General Mills Inc	HSBC	(23,577)
(5,900)	General Mills Inc	JP Morgan	(15,989)
6,260	General Motors Co	Barclays Bank	(157)
29,970	General Motors Co	Credit Suisse	60,689
22,960	General Motors Co	Goldam Sachs	76,342
5,160	General Motors Co	HSBC	21,459
3,810	Gentex Corp	Goldam Sachs	7,963
16,120	Gentex Corp	HSBC	5,803
(20,250)	Genuine Parts Co	Bank of America Merrill Lynch	(195,615)
(1,820)	Genuine Parts Co	Barclays Bank	(10,119)
(10,570)	Genuine Parts Co	Goldam Sachs	(102,106)
35,101	Gilead Sciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	(38,611)
9,015	Gilead Sciences Inc	JP Morgan	(21,005)
(12,079)	Global Payments Inc	Barclays Bank	(17,152)
(8,020)	Globe Life Inc	Barclays Bank	(26,947)
(2,900)	Globe Life Inc	Credit Suisse	(24,594)
(2,300)	Globe Life Inc	HSBC	(18,307)
36,482	GoDaddy Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(6,202)
41,160	GoDaddy Inc 'A'	Barclays Bank	27,989
3,010	GoDaddy Inc 'A'	Goldam Sachs	(512)
7,770	GoDaddy Inc 'A'	JP Morgan	10,023
69,889	Goodyear Tire & Rubber Co	Bank of America Merrill Lynch	85,963
238,249	Goodyear Tire & Rubber Co	Barclays Bank	113,168
44,290	Goodyear Tire & Rubber Co	Citibank	21,038
43,580	Goodyear Tire & Rubber Co	Credit Suisse	16,996
616,750	Goodyear Tire & Rubber Co	Goldam Sachs	758,603
18,680	Goodyear Tire & Rubber Co	HSBC	7,285
(35,900)	Graco Inc	Goldam Sachs	(147,190)
(23,100)	GrafTech International Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(23,793)
(40,990)	GrafTech International Ltd	JP Morgan	18,036
3,216	Graham Holdings Co 'B'	Bank of America Merrill Lynch	86,157
8,675	Graham Holdings Co 'B'	Barclays Bank	36,435
3,210	Graham Holdings Co 'B'	Citibank	13,482
455	Graham Holdings Co 'B'	Credit Suisse	(9,136)
1,790	Graham Holdings Co 'B'	Goldam Sachs	47,954
23	Graham Holdings Co 'B'	HSBC	(462)
11,860	Grand Canyon Education Inc	Goldam Sachs	9,488
24,030	Graphic Packaging Holding Co	Bank of America Merrill Lynch	39,890
84,630	Graphic Packaging Holding Co	Barclays Bank	88,015
61,670	Graphic Packaging Holding Co	Citibank	64,137
11,770	Graphic Packaging Holding Co	HSBC	10,005
(24,465)	Grubhub Inc	Bank of America Merrill Lynch	11,499
(3,050)	Grubhub Inc	Barclays Bank	8,693

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(34,790)	Grubhub Inc	Goldam Sachs	16,351
(32,327)	Guardant Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	282,861
(12,520)	Guardant Health Inc	Goldam Sachs	109,550
(2,730)	Guardant Health Inc	HSBC	(1,638)
(4,766)	Guidewire Software Inc	Bank of America Merrill Lynch	(43,323)
(42,482)	Guidewire Software Inc	Barclays Bank	(69,246)
250,900	H&R Block Inc	Bank of America Merrill Lynch	326,170
49,970	H&R Block Inc	Barclays Bank	(500)
43,810	H&R Block Inc	Credit Suisse	40,728
45,170	H&R Block Inc	Goldam Sachs	58,721
33,970	H&R Block Inc	JP Morgan	24,119
(25,482)	Hain Celestial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(27,266)
(70,598)	Hain Celestial Group Inc	Citibank	(111,545)
(44,624)	Hain Celestial Group Inc	Credit Suisse	(43,732)
(96,520)	Halliburton Co	Barclays Bank	(10,617)
(43,770)	Halliburton Co	Goldam Sachs	(82,288)
17,630	Hanesbrands Inc	Bank of America Merrill Lynch	21,861
15,760	Hanesbrands Inc	Goldam Sachs	19,542
9,338	Hanover Insurance Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	145,206
16,490	Hanover Insurance Group Inc	Barclays Bank	66,455
1,820	Hanover Insurance Group Inc	Credit Suisse	17,279
23,210	Hanover Insurance Group Inc	Goldam Sachs	360,916
1,910	Hanover Insurance Group Inc	HSBC	32,361
5,230	Hanover Insurance Group Inc	JP Morgan	34,120
(73,630)	Harley-Davidson Inc	Bank of America Merrill Lynch	(157,568)
(7,800)	Harley-Davidson Inc	Barclays Bank	20,124
(17,400)	Harley-Davidson Inc	Citibank	44,892
(5,570)	Harley-Davidson Inc	Credit Suisse	(15,124)
(19,587)	Harley-Davidson Inc	HSBC	(6,855)
(19,470)	Harley-Davidson Inc	JP Morgan	(22,567)
21,040	Hartford Financial Services Group Inc	Barclays Bank	31,350
30,690	Hartford Financial Services Group Inc	Goldam Sachs	160,509
(24,250)	Hasbro Inc	Bank of America Merrill Lynch	(210,732)
(12,760)	Hasbro Inc	Barclays Bank	(86,768)
(1,742)	Hasbro Inc	Goldam Sachs	(15,138)
13,230	Hawaiian Electric Industries Inc	Barclays Bank	19,845
2,732	HCA Healthcare Inc	Barclays Bank	(1,311)
30,647	HCA Healthcare Inc	Citibank	(14,711)
12,280	HCA Healthcare Inc	Goldam Sachs	91,732
2,316	HCA Healthcare Inc	HSBC	(3,960)
11,880	HCA Healthcare Inc	JP Morgan	(20,315)
763	HD Supply Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,892
15,640	HD Supply Holdings Inc	Barclays Bank	9,697
15,579	HD Supply Holdings Inc	Credit Suisse	23,836
69,500	HD Supply Holdings Inc	Goldam Sachs	263,405

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
63,429	HD Supply Holdings Inc	HSBC	97,046
(1,750)	HEICO Corp	Bank of America Merrill Lynch	(32,673)
(3,010)	HEICO Corp	Barclays Bank	(23,659)
(8,430)	HEICO Corp	HSBC	(134,540)
49,930	Helmerich & Payne Inc	Barclays Bank	81,885
7,810	Helmerich & Payne Inc	Citibank	12,808
21,850	Helmerich & Payne Inc	Credit Suisse	46,322
104,830	Helmerich & Payne Inc	Goldam Sachs	241,109
42,304	Henry Schein Inc	Bank of America Merrill Lynch	384,543
2,241	Henry Schein Inc	Credit Suisse	15,284
43,870	Henry Schein Inc	Goldam Sachs	398,778
3,517	Henry Schein Inc	HSBC	23,986
890	Herbalife Nutrition Ltd	Barclays Bank	1,531
3,860	Herbalife Nutrition Ltd	Citibank	6,639
21,550	Herbalife Nutrition Ltd	Goldam Sachs	72,624
19,040	Hershey Co	Bank of America Merrill Lynch	91,582
21,890	Hershey Co	Barclays Bank	107,918
5,359	Hershey Co	Citibank	26,420
12,870	Hershey Co	Goldam Sachs	61,905
2,681	Hershey Co	JP Morgan	5,362
(96,500)	Hess Corp	Barclays Bank	(36,670)
(45,020)	Hess Corp	Goldam Sachs	(153,518)
9,340	Hewlett Packard Enterprise Co	Bank of America Merrill Lynch	3,129
208,360	Hewlett Packard Enterprise Co	Barclays Bank	57,299
79,260	Hewlett Packard Enterprise Co	Goldam Sachs	26,552
26,370	Hexcel Corp	Goldam Sachs	196,193
1,910	Hexcel Corp	HSBC	10,161
4,410	Hexcel Corp	JP Morgan	32,333
3,870	Hill-Rom Holdings Inc	Barclays Bank	13,893
(107,301)	Hilton Grand Vacations Inc	Bank of America Merrill Lynch	(425,985)
53,040	HollyFrontier Corp	Barclays Bank	22,277
67,980	Hologic Inc	Barclays Bank	(10,197)
6,780	Home Depot Inc	Bank of America Merrill Lynch	43,663
10,970	Home Depot Inc	Barclays Bank	42,673
3,300	Home Depot Inc	JP Morgan	37,422
(5,530)	Honeywell International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(109,383)
(1,440)	Honeywell International Inc	Barclays Bank	(8,654)
(5,050)	Honeywell International Inc	HSBC	(41,814)
(47,990)	Horizon Therapeutics Plc	Goldam Sachs	(137,731)
(172,200)	Hormel Foods Corp	Barclays Bank	(144,648)
(50,803)	Howmet Aerospace Inc	Bank of America Merrill Lynch	(115,831)
(12,830)	Howmet Aerospace Inc	Barclays Bank	(8,724)
107,360	HP Inc	Bank of America Merrill Lynch	6,442
91,380	HP Inc	Barclays Bank	(190,070)
118,203	HP Inc	Credit Suisse	(87,470)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
278,200	HP Inc	Goldam Sachs	16,692
68,009	HP Inc	HSBC	(50,327)
9,920	Hubbell Inc	Bank of America Merrill Lynch	85,808
12,493	Hubbell Inc	Barclays Bank	67,212
2,740	Hubbell Inc	Credit Suisse	(630)
18,330	Hubbell Inc	Goldam Sachs	158,555
4,340	Hubbell Inc	HSBC	(998)
(3,530)	HubSpot Inc	Goldam Sachs	(31,735)
500	Humana Inc	Barclays Bank	4,880
1,620	Humana Inc	Credit Suisse	43,238
2,410	Humana Inc	Goldam Sachs	14,388
440	Humana Inc	HSBC	11,744
(61,150)	Huntington Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	(84,081)
(260,980)	Huntington Bancshares Inc	Barclays Bank	(204,869)
(9,958)	Huntington Bancshares Inc	Citibank	(7,817)
(78,730)	Huntington Bancshares Inc	JP Morgan	(18,108)
(7,990)	Huntington Ingalls Industries Inc	Barclays Bank	(116,255)
(124,995)	Huntsman Corp	Bank of America Merrill Lynch	(364,985)
(187,632)	Huntsman Corp	Barclays Bank	(67,548)
(11,193)	Huntsman Corp	Credit Suisse	(22,946)
(62,680)	Huntsman Corp	Goldam Sachs	(183,026)
(25,080)	Huntsman Corp	HSBC	(51,414)
(12,610)	Huntsman Corp	JP Morgan	(36,120)
(3,080)	Hyatt Hotels Corp 'A'	Citibank	(5,082)
(3,620)	Hyatt Hotels Corp 'A'	Credit Suisse	(4,706)
4,400	IAC/interactivecorp	Bank of America Merrill Lynch	141,636
4,020	IAC/interactivecorp	Barclays Bank	45,426
732	IAC/interactivecorp	Credit Suisse	27,274
1,370	IAC/interactivecorp	HSBC	51,046
930	IAC/interactivecorp	JP Morgan	34,652
(809)	ICU Medical Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,713)
(1,010)	ICU Medical Inc	Barclays Bank	(5,757)
(16,730)	ICU Medical Inc	Goldam Sachs	(180,182)
93,306	IDACORP Inc	Barclays Bank	306,044
(1,010)	IDEX Corp	Bank of America Merrill Lynch	(9,029)
(1,110)	IDEX Corp	Barclays Bank	(7,670)
(850)	IDEX Corp	Credit Suisse	(9,551)
(2,320)	IDEX Corp	Goldam Sachs	(20,741)
8,683	IDEXX Laboratories Inc	Bank of America Merrill Lynch	103,588
7,300	IDEXX Laboratories Inc	Goldam Sachs	87,089
840	IDEXX Laboratories Inc	HSBC	15,464
(12,130)	IHS Markit Ltd	Barclays Bank	(27,050)
5,880	Illinois Tool Works Inc	Bank of America Merrill Lynch	93,668
2,460	Illinois Tool Works Inc	Citibank	19,336
8,120	Illinois Tool Works Inc	Credit Suisse	86,072

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
2,500	Illinois Tool Works Inc	JP Morgan	26,500
1,850	Illumina Inc	Goldam Sachs	68,080
940	Illumina Inc	JP Morgan	58,214
9,970	Incyte Corp	Bank of America Merrill Lynch	44,267
55,230	Incyte Corp	Goldam Sachs	245,221
(95,083)	Ingersoll Rand Inc	Bank of America Merrill Lynch	(160,690)
(88,231)	Ingersoll Rand Inc	Barclays Bank	37,939
3,402	Ingersoll Rand Inc	Citibank	(1,463)
(43,976)	Ingersoll Rand Inc	Credit Suisse	46,615
(61,379)	Ingersoll Rand Inc	Goldam Sachs	(103,731)
(19,075)	Ingersoll Rand Inc	HSBC	20,220
(7,644)	Ingersoll Rand Inc	JP Morgan	8,103
(3,090)	Ingredion Inc	Bank of America Merrill Lynch	(15,728)
(30,070)	Ingredion Inc	Barclays Bank	(110,658)
(3,160)	Ingredion Inc	Goldam Sachs	(16,084)
1,060	Insulet Corp	Citibank	(5,470)
510	Insulet Corp	JP Morgan	(19,732)
(23,271)	Integra LifeSciences Holdings Corp	Goldam Sachs	(118,449)
15,640	Intel Corp	Bank of America Merrill Lynch	68,503
12,160	Intel Corp	Barclays Bank	4,925
22,050	Intel Corp	Credit Suisse	66,814
59,020	Intel Corp	Goldam Sachs	258,508
48,990	Intel Corp	HSBC	(12,233)
(35,738)	Interactive Brokers Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(186,552)
(35,522)	Interactive Brokers Group Inc 'A'	Credit Suisse	(47,244)
(68,320)	Interactive Brokers Group Inc 'A'	Goldam Sachs	(356,630)
23,980	Intercontinental Exchange Inc	Bank of America Merrill Lynch	39,087
30,260	Intercontinental Exchange Inc	Barclays Bank	40,246
5,960	Intercontinental Exchange Inc	Credit Suisse	9,417
10,940	Intercontinental Exchange Inc	HSBC	17,285
5,480	Intercontinental Exchange Inc	JP Morgan	8,658
(9,830)	International Business Machines Corp	Bank of America Merrill Lynch	(55,933)
(2,700)	International Business Machines Corp	Barclays Bank	(11,556)
(2,340)	International Business Machines Corp	Citibank	(10,015)
(5,780)	International Business Machines Corp	Credit Suisse	1,850
(1,420)	International Business Machines Corp	Goldam Sachs	(8,080)
(1,640)	International Business Machines Corp	JP Morgan	525
(27,883)	International Flavors & Fragrances Inc	Credit Suisse	57,160
(32,011)	International Flavors & Fragrances Inc	HSBC	65,623
(1,010)	International Flavors & Fragrances Inc	JP Morgan	(4,461)
(105,950)	International Game Technology Plc	Barclays Bank	(51,916)
(23,830)	International Game Technology Plc	Citibank	(11,677)
(9,590)	International Paper Co	Barclays Bank	(14,385)
85,270	Interpublic Group of Cos Inc	Barclays Bank	28,992
75,200	Interpublic Group of Cos Inc	Goldam Sachs	109,040

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
8,420	Intuit Inc	Bank of America Merrill Lynch	7,578
21,670	Intuit Inc	Barclays Bank	(50,274)
4,050	Intuit Inc	Citibank	(9,396)
5,070	Intuit Inc	Goldam Sachs	4,563
(1,805)	Intuitive Surgical Inc	Bank of America Merrill Lynch	(98,517)
(54,310)	Invesco Ltd	Credit Suisse	5,703
(36,070)	Invesco Ltd	HSBC	3,787
6,490	Ionis Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	21,936
12,430	Ionis Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	24,611
10,800	Ionis Pharmaceuticals Inc	Citibank	21,384
8,020	Ionis Pharmaceuticals Inc	Credit Suisse	16,441
5,140	Ionis Pharmaceuticals Inc	Goldam Sachs	17,373
11,150	Ionis Pharmaceuticals Inc	HSBC	22,858
4,290	Ionis Pharmaceuticals Inc	JP Morgan	8,795
(25,773)	IPG Photonics Corp	Bank of America Merrill Lynch	(141,236)
(16,790)	IPG Photonics Corp	Barclays Bank	96,207
(16,993)	IPG Photonics Corp	Goldam Sachs	(93,122)
(9,310)	IQVIA Holdings Inc	Barclays Bank	(42,361)
10,100	ITT Inc	Bank of America Merrill Lynch	85,244
23,320	ITT Inc	Barclays Bank	62,731
21,622	ITT Inc	Citibank	58,163
80	ITT Inc	Credit Suisse	449
49,480	ITT Inc	Goldam Sachs	417,611
12,890	ITT Inc	JP Morgan	72,313
3,060	Jabil Inc	Barclays Bank	2,448
59,463	Jabil Inc	Goldam Sachs	111,790
(8,940)	Jack Henry & Associates Inc	Barclays Bank	70,894
(2,240)	Jack Henry & Associates Inc	Goldam Sachs	24,192
(27,160)	Jacobs Engineering Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(311,525)
(35,550)	Jacobs Engineering Group Inc	Barclays Bank	(230,364)
(4,720)	Jacobs Engineering Group Inc	Credit Suisse	(55,140)
(59,190)	Jacobs Engineering Group Inc	Goldam Sachs	(678,909)
(5,276)	Jacobs Engineering Group Inc	HSBC	(19,046)
(307,750)	Janus Henderson Group Plc	Barclays Bank	(390,842)
(69,310)	Janus Henderson Group Plc	Goldam Sachs	(280,705)
1,390	Jazz Pharmaceuticals Plc	Bank of America Merrill Lynch	11,509
4,820	Jazz Pharmaceuticals Plc	Goldam Sachs	39,910
6,070	Jazz Pharmaceuticals Plc	HSBC	54,630
(9,260)	JB Hunt Transport Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(199,460)
(8,880)	JB Hunt Transport Services Inc	Barclays Bank	(99,634)
(7,850)	JB Hunt Transport Services Inc	Goldam Sachs	(169,089)
(65,030)	Jefferies Financial Group Inc	Barclays Bank	(81,288)
(13,680)	Jefferies Financial Group Inc	Citibank	(17,100)
(37,700)	Jefferies Financial Group Inc	Goldam Sachs	(75,777)
(13,140)	Jefferies Financial Group Inc	HSBC	(27,859)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(18,080)	Jefferies Financial Group Inc	JP Morgan	(7,232)
45,030	JetBlue Airways Corp	Bank of America Merrill Lynch	79,253
177,490	JetBlue Airways Corp	Barclays Bank	134,892
88,100	JetBlue Airways Corp	Citibank	66,956
185,200	JetBlue Airways Corp	Goldam Sachs	325,952
59,560	JetBlue Airways Corp	HSBC	54,200
20,790	JetBlue Airways Corp	JP Morgan	18,919
(5,513)	JM Smucker Co	Bank of America Merrill Lynch	18,083
(2,060)	JM Smucker Co	Barclays Bank	(5,953)
(21,330)	JM Smucker Co	Goldam Sachs	69,962
7,310	John Wiley & Sons Inc 'A'	Barclays Bank	13,597
4,220	John Wiley & Sons Inc 'A'	Citibank	7,849
7,980	John Wiley & Sons Inc 'A'	Goldam Sachs	36,788
9,030	John Wiley & Sons Inc 'A'	HSBC	37,168
9,738	Johnson & Johnson	Bank of America Merrill Lynch	(29,117)
10,690	Johnson & Johnson	Goldam Sachs	(31,963)
9,000	Johnson Controls International Plc	Barclays Bank	15,840
(3,120)	JPMorgan Chase & Co	Bank of America Merrill Lynch	(38,881)
(10,440)	JPMorgan Chase & Co	Goldam Sachs	(130,103)
84,225	Juniper Networks Inc	Bank of America Merrill Lynch	57,273
8,020	Juniper Networks Inc	Barclays Bank	3,769
43,000	Juniper Networks Inc	Goldam Sachs	29,240
4,990	Kansas City Southern	Bank of America Merrill Lynch	84,880
980	Kansas City Southern	Barclays Bank	3,538
11,680	Kansas City Southern	Goldam Sachs	198,677
1,880	Kansas City Southern	HSBC	26,752
(12,560)	KAR Auction Services Inc	Goldam Sachs	(30,018)
(28,110)	KAR Auction Services Inc	HSBC	(29,797)
(16,460)	Kellogg Co	Barclays Bank	(43,454)
(7,290)	Kellogg Co	Goldam Sachs	(4,811)
(1,770)	Kemper Corp	Bank of America Merrill Lynch	(8,691)
(26,160)	Kemper Corp	Barclays Bank	(15,434)
(5,560)	Kemper Corp	Credit Suisse	11,732
(2,380)	Kemper Corp	Goldam Sachs	(11,686)
(84,796)	Keurig Dr Pepper Inc	Bank of America Merrill Lynch	(137,370)
(24,070)	Keurig Dr Pepper Inc	Goldam Sachs	(38,993)
(20,348)	Keurig Dr Pepper Inc	HSBC	(32,150)
(94,130)	KeyCorp	Bank of America Merrill Lynch	(192,496)
(47,310)	KeyCorp	Barclays Bank	(48,493)
5,820	Keysight Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	68,152
2,530	Keysight Technologies Inc	Barclays Bank	11,208
2,260	Keysight Technologies Inc	Citibank	10,012
14,990	Keysight Technologies Inc	Credit Suisse	86,942
11,110	Keysight Technologies Inc	Goldam Sachs	130,098
1,660	Kimberly-Clark Corp	Barclays Bank	2,341

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
16,900	Kinder Morgan Inc	Credit Suisse	6,008
(17,303)	Kirby Corp	Bank of America Merrill Lynch	(80,805)
(19,120)	Kirby Corp	Barclays Bank	(53,727)
(3,190)	Kirby Corp	Citibank	(8,964)
(9,730)	Kirby Corp	Credit Suisse	778
(38,934)	Kirby Corp	Goldam Sachs	(181,822)
(3,380)	KLA Corp	Citibank	(15,075)
(2,160)	KLA Corp	Goldam Sachs	(21,665)
(1,200)	KLA Corp	JP Morgan	(7,152)
(56,829)	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(212,540)
(32,060)	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	Barclays Bank	(51,296)
(90,020)	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	Goldam Sachs	(336,675)
30,620	Kohl 's Corp	Bank of America Merrill Lynch	50,829
19,220	Kohl 's Corp	Barclays Bank	33,058
3,860	Kohl 's Corp	Credit Suisse	3,860
32,270	Kohl 's Corp	Goldam Sachs	53,568
11,230	Kohl 's Corp	JP Morgan	11,230
28,070	Kosmos Energy Ltd	Bank of America Merrill Lynch	6,175
45,890	Kosmos Energy Ltd	Barclays Bank	(3,671)
43,290	Kosmos Energy Ltd	Citibank	(3,463)
64,950	Kosmos Energy Ltd	Credit Suisse	19,485
29,720	Kosmos Energy Ltd	Goldam Sachs	6,538
202,970	Kosmos Energy Ltd	HSBC	60,891
109,670	Kosmos Energy Ltd	JP Morgan	32,901
(246,810)	Kraft Heinz Co	Barclays Bank	(14,809)
(23,780)	Kraft Heinz Co	Goldam Sachs	(19,262)
3,510	Kroger Co	Goldam Sachs	(2,492)
10,040	L Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	51,104
12,010	L Brands Inc	Barclays Bank	10,449
(6,250)	L3Harris Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(109,813)
(10,270)	L3Harris Technologies Inc	Barclays Bank	(142,753)
(10,900)	L3Harris Technologies Inc	Goldam Sachs	(191,513)
(7,000)	Laboratory Corp of America Holdings	Barclays Bank	(31,150)
(1,750)	Laboratory Corp of America Holdings	Credit Suisse	(12,863)
(1,300)	Laboratory Corp of America Holdings	Goldam Sachs	(9,334)
(6,000)	Laboratory Corp of America Holdings	HSBC	(44,100)
12,430	Lam Research Corp	Barclays Bank	140,708
9,910	Lamb Weston Holdings Inc	Goldam Sachs	58,865
5,090	Lamb Weston Holdings Inc	HSBC	(17,866)
(1,320)	Landstar System Inc	Goldam Sachs	(16,196)
(32,080)	Las Vegas Sands Corp	Bank of America Merrill Lynch	(95,278)
(55,570)	Las Vegas Sands Corp	Barclays Bank	(46,123)
(3,680)	Las Vegas Sands Corp	Goldam Sachs	(10,930)
(6,890)	Lear Corp	Bank of America Merrill Lynch	(61,872)
(5,520)	Lear Corp	Barclays Bank	5,299

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(3,910)	Lear Corp	Goldam Sachs	(35,112)
(3,210)	Lear Corp	JP Morgan	(9,855)
(5,810)	Legg Mason Inc	Barclays Bank	(523)
(11,370)	Legg Mason Inc	Credit Suisse	(1,592)
(5,270)	Leidos Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(35,678)
(5,200)	Leidos Holdings Inc	Barclays Bank	(13,676)
(1,000)	Leidos Holdings Inc	Goldam Sachs	(6,770)
(1,690)	Leidos Holdings Inc	HSBC	(1,504)
(6,153)	LendingTree Inc	Barclays Bank	(68,298)
(4,180)	Lennar Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(41,967)
(4,530)	Lennar Corp 'A'	Goldam Sachs	(45,481)
(3,720)	Lennar Corp 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(25,222)
(24,228)	Lennar Corp 'B'	Barclays Bank	(1,454)
(6,239)	Lennar Corp 'B'	Citibank	(374)
(8,870)	Lennar Corp 'B'	Credit Suisse	(38,939)
(7,134)	Lennar Corp 'B'	Goldam Sachs	(48,369)
(7,628)	Lennar Corp 'B'	HSBC	(33,487)
(1,240)	Lennox International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(36,989)
(2,130)	Lennox International Inc	Barclays Bank	(26,242)
(80)	Lennox International Inc	Goldam Sachs	(2,386)
2,300	Liberty Broadband Corp	Bank of America Merrill Lynch	27,278
(47,188)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'A'	Barclays Bank	(117,970)
(5,670)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'A'	Credit Suisse	(23,814)
(5,590)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'A'	Goldam Sachs	(26,888)
(4,670)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'A'	JP Morgan	(19,614)
4,947	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM (Rights)	Bank of America Merrill Lynch	52,537
16,212	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM (Rights)	Barclays Bank	53,824
7,235	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM (Rights)	Goldam Sachs	76,836
52,684	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C'	Bank of America Merrill Lynch	221,273
172,659	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C'	Barclays Bank	521,430
77,060	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C'	Goldam Sachs	323,652
(3,530)	Lincoln Electric Holdings Inc	HSBC	(30,040)
(84,043)	Lincoln National Corp	Bank of America Merrill Lynch	(440,385)
(2,250)	Lincoln National Corp	Barclays Bank	(6,728)
(33,010)	Lincoln National Corp	Goldam Sachs	(172,972)
(15,610)	Lincoln National Corp	JP Morgan	(20,917)
2,670	Linde Plc	Credit Suisse	34,016
2,250	Linde Plc	Goldam Sachs	41,760
2,310	Linde Plc	JP Morgan	29,429
(25,885)	Littelfuse Inc	Bank of America Merrill Lynch	(565,328)
(6,050)	Littelfuse Inc	Barclays Bank	(32,791)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(9,792)	Littelfuse Inc	Credit Suisse	(144,628)
(20,313)	Littelfuse Inc	Goldam Sachs	(443,636)
(21,430)	Live Nation Entertainment Inc	Bank of America Merrill Lynch	(174,440)
(32,710)	Live Nation Entertainment Inc	Barclays Bank	(55,934)
26,050	LKQ Corp	Bank of America Merrill Lynch	94,041
25,830	LKQ Corp	Barclays Bank	48,431
15,480	LKQ Corp	Goldam Sachs	55,883
410	LKQ Corp	JP Morgan	381
(28,410)	Loews Corp	Barclays Bank	(36,081)
52,881	LogMeIn Inc	Barclays Bank	29,613
1,040	Lowe's Cos Inc	Credit Suisse	16,623
1,020	Lowe's Cos Inc	HSBC	21,007
33,362	LPL Financial Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	305,596
7,990	LPL Financial Holdings Inc	Barclays Bank	32,759
41,920	LPL Financial Holdings Inc	Goldam Sachs	383,987
490	Lululemon Athletica Inc	Bank of America Merrill Lynch	20,600
2,800	Lululemon Athletica Inc	Barclays Bank	34,720
2,080	Lululemon Athletica Inc	Goldam Sachs	87,443
(35,540)	Lyft Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(116,571)
(85,170)	Lyft Inc 'A'	Barclays Bank	(14,479)
(6,460)	Lyft Inc 'A'	Goldam Sachs	(21,189)
(1,130)	LyondellBasell Industries NV 'A'	Credit Suisse	(7,232)
(12,282)	LyondellBasell Industries NV 'A'	HSBC	(78,605)
(3,810)	M&T Bank Corp	Bank of America Merrill Lynch	(62,713)
(1,350)	M&T Bank Corp	Barclays Bank	(10,193)
(1,080)	M&T Bank Corp	Credit Suisse	(767)
(3,640)	M&T Bank Corp	Goldam Sachs	(59,914)
(8)	Mack-Cali Realty Corp (REIT)	Citibank	(6)
(33,495)	Macquarie Infrastructure Corp	Bank of America Merrill Lynch	(30,815)
290,600	Macy's Inc	Barclays Bank	390,857
93,000	Macy's Inc	Goldam Sachs	115,785
(15,600)	Madison Square Garden Entertainment Corp	Barclays Bank	(39,624)
910	Madison Square Garden Sports C	HSBC	10,626
55,800	Magna International Inc	Bank of America Merrill Lynch	273,420
77,800	Magna International Inc	Barclays Bank	164,936
94,700	Magna International Inc	Goldam Sachs	464,030
44,649	Manhattan Associates Inc	Bank of America Merrill Lynch	684,023
3,510	Manhattan Associates Inc	Credit Suisse	38,154
31,730	Manhattan Associates Inc	Goldam Sachs	486,104
6,287	ManpowerGroup Inc	Bank of America Merrill Lynch	40,803
6,710	ManpowerGroup Inc	Barclays Bank	3,892
3,324	ManpowerGroup Inc	Citibank	1,928
7,560	ManpowerGroup Inc	Credit Suisse	(4,536)
34,750	ManpowerGroup Inc	HSBC	(20,850)
307,930	Marathon Oil Corp	Barclays Bank	(117,013)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
552	Marathon Oil Corp	Citibank	(210)
88,831	Marathon Oil Corp	HSBC	(23,984)
(12,120)	Marathon Petroleum Corp	Barclays Bank	10,908
(72,894)	Marathon Petroleum Corp	Goldam Sachs	(318,547)
(372)	Markel Corp	Bank of America Merrill Lynch	(29,935)
330	MarketAxess Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,700
1,350	MarketAxess Holdings Inc	Barclays Bank	14,688
250	MarketAxess Holdings Inc	Citibank	2,720
3,030	MarketAxess Holdings Inc	HSBC	26,906
(69,815)	Marriott International Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(700,943)
(3,480)	Marriott International Inc 'A'	Credit Suisse	(9,152)
(46,870)	Marriott International Inc 'A'	Goldam Sachs	(470,575)
(8,720)	Marriott International Inc 'A'	HSBC	(22,934)
13,150	Marsh & McLennan Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	16,701
12,040	Marsh & McLennan Cos Inc	Barclays Bank	14,930
19,360	Marsh & McLennan Cos Inc	Goldam Sachs	24,587
(4,570)	Martin Marietta Materials Inc	Barclays Bank	(62,426)
(1,400)	Martin Marietta Materials Inc	Goldam Sachs	(35,392)
(187,071)	Marvell Technology Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,192,578)
(90,730)	Marvell Technology Group Ltd	Citibank	(234,537)
(42,166)	Marvell Technology Group Ltd	Goldam Sachs	(268,808)
78,281	Masco Corp	Bank of America Merrill Lynch	249,716
12,970	Masco Corp	Barclays Bank	14,137
3,910	Masco Corp	Citibank	4,262
16,810	Masco Corp	Goldam Sachs	53,624
5,850	Masco Corp	HSBC	30,387
31,880	Masco Corp	JP Morgan	120,188
6,710	Masimo Corp	Bank of America Merrill Lynch	(43,481)
790	Masimo Corp	Citibank	(3,429)
3,810	Masimo Corp	Credit Suisse	10,928
5,230	Masimo Corp	Goldam Sachs	(33,890)
480	Masimo Corp	JP Morgan	2,496
8,425	Match Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	93,939
670	Match Group Inc	Barclays Bank	2,941
9,900	Match Group Inc	Goldam Sachs	110,385
65,440	Maxim Integrated Products Inc	Goldam Sachs	313,458
(5,860)	McCormick & Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	30,765
(6,440)	McCormick & Co Inc	Barclays Bank	(5,538)
(1,500)	McCormick & Co Inc	Goldam Sachs	7,875
1,780	McDonald's Corp	Bank of America Merrill Lynch	25,169
3,690	McDonald's Corp	Barclays Bank	13,063
3,630	McDonald's Corp	Goldam Sachs	51,328
(1,328)	McKesson Corp	Bank of America Merrill Lynch	(25,989)
(2,530)	McKesson Corp	Barclays Bank	(16,698)
(6,110)	McKesson Corp	JP Morgan	(122,506)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
83,070	MDU Resources Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	157,833
140,413	MDU Resources Group Inc	Barclays Bank	85,652
98,610	MDU Resources Group Inc	Credit Suisse	(11,833)
10,920	MDU Resources Group Inc	Goldam Sachs	20,748
16,770	MEDNAX Inc	Bank of America Merrill Lynch	28,341
40,000	MEDNAX Inc	Goldam Sachs	67,600
(2,450)	Medtronic Plc	Credit Suisse	(1,421)
(2,870)	Medtronic Plc	HSBC	5,625
12,720	Merck & Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,851)
11,733	Merck & Co Inc	Citibank	34,612
6,120	Merck & Co Inc	Credit Suisse	17,870
31,810	Merck & Co Inc	Goldam Sachs	(14,633)
8,570	Merck & Co Inc	HSBC	25,024
33,903	Merck & Co Inc	JP Morgan	98,997
(20,561)	Mercury General Corp	Bank of America Merrill Lynch	(43,384)
(53,926)	Mercury General Corp	Barclays Bank	(45,298)
(20,330)	MetLife Inc	Bank of America Merrill Lynch	(80,507)
(5,250)	MetLife Inc	Barclays Bank	(12,285)
(21,980)	MetLife Inc	Goldam Sachs	(87,041)
(35,660)	MetLife Inc	HSBC	(16,404)
1,860	Mettler-Toledo International Inc	Bank of America Merrill Lynch	175,751
290	Mettler-Toledo International Inc	Goldam Sachs	27,402
145,730	MGIC Investment Corp	Bank of America Merrill Lynch	234,625
380,680	MGIC Investment Corp	Barclays Bank	266,476
86,530	MGIC Investment Corp	Goldam Sachs	139,313
29,080	MGM Resorts International	Barclays Bank	35,187
124,815	MGM Resorts International	Goldam Sachs	406,897
(12,970)	Microchip Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(168,091)
(2,060)	Microchip Technology Inc	Barclays Bank	(17,922)
(15,714)	Microchip Technology Inc	Credit Suisse	(107,012)
(4,150)	Microchip Technology Inc	Goldam Sachs	(53,784)
(14,960)	Microchip Technology Inc	JP Morgan	(101,878)
9,300	Microsoft Corp	Goldam Sachs	24,418
(9,970)	Middleby Corp	Bank of America Merrill Lynch	(66,301)
(3,930)	Middleby Corp	Barclays Bank	(16,231)
(5,260)	MKS Instruments Inc	Bank of America Merrill Lynch	(65,119)
(4,858)	MKS Instruments Inc	Barclays Bank	(25,796)
(4,960)	MKS Instruments Inc	Citibank	(26,338)
(7,216)	MKS Instruments Inc	Credit Suisse	(22,730)
(29,519)	MKS Instruments Inc	Goldam Sachs	(365,445)
(360)	MKS Instruments Inc	JP Morgan	(1,134)
(3,010)	Moderna Inc	Barclays Bank	35,036
(8,000)	Moderna Inc	Goldam Sachs	74,640
(430)	Molina Healthcare Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,255)
(6,390)	Molina Healthcare Inc	Barclays Bank	(73,038)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(5,030)	Molina Healthcare Inc	Goldam Sachs	(61,467)
(49,010)	Molson Coors Beverage Co 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(63,713)
(38,210)	Molson Coors Beverage Co 'B'	Barclays Bank	(31,332)
(20,360)	Molson Coors Beverage Co 'B'	Credit Suisse	25,246
(44,760)	Molson Coors Beverage Co 'B'	Goldam Sachs	(58,188)
19,274	Mondelez International Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	28,526
16,090	Mondelez International Inc 'A'	Barclays Bank	27,997
13,220	Mondelez International Inc 'A'	Goldam Sachs	19,566
(5,280)	MongoDB Inc	Barclays Bank	(9,082)
(5,430)	MongoDB Inc	Goldam Sachs	(139,660)
(16,470)	Monolithic Power Systems Inc	Barclays Bank	(111,173)
6,880	Monster Beverage Corp	Barclays Bank	12,109
18,160	Monster Beverage Corp	Goldam Sachs	80,994
1,820	Moody's Corp	Bank of America Merrill Lynch	28,301
7,510	Moody's Corp	Barclays Bank	75,400
2,920	Moody's Corp	Goldam Sachs	45,406
2,590	Moody's Corp	JP Morgan	39,135
3,300	Morningstar Inc	Bank of America Merrill Lynch	16,467
14,645	Morningstar Inc	Barclays Bank	127,412
3,700	Morningstar Inc	Credit Suisse	18,332
9,478	Morningstar Inc	Goldam Sachs	47,295
1,100	Morningstar Inc	HSBC	7,667
(192,928)	Mosaic Co	Barclays Bank	(84,888)
(95,180)	Mosaic Co	Goldam Sachs	(182,746)
35,444	Motorola Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	196,714
15,150	Motorola Solutions Inc	Goldam Sachs	84,083
6,330	MSCI Inc	Bank of America Merrill Lynch	(73,934)
560	MSCI Inc	Citibank	(4,721)
2,050	MSCI Inc	HSBC	(8,282)
380	MSCI Inc	JP Morgan	(1,535)
(263,041)	Murphy Oil Corp	Bank of America Merrill Lynch	(231,476)
(107,230)	Murphy Oil Corp	Barclays Bank	10,723
(124,310)	Murphy Oil Corp	Goldam Sachs	(109,393)
(49,790)	Mylan NV	Barclays Bank	(63,980)
(30,830)	Mylan NV	Citibank	(39,617)
(46,480)	Mylan NV	Credit Suisse	29,980
(125,340)	Mylan NV	Goldam Sachs	(221,225)
12,610	Nasdaq Inc	Bank of America Merrill Lynch	61,032
24,800	Nasdaq Inc	Barclays Bank	39,184
4,450	Nasdaq Inc	HSBC	41,519
9,474	National Fuel Gas Co	Barclays Bank	(8,337)
69,377	National Instruments Corp	Bank of America Merrill Lynch	156,098
7,080	National Instruments Corp	Barclays Bank	6,160
16,703	National Instruments Corp	Credit Suisse	7,683
19,329	National Instruments Corp	Goldam Sachs	43,490

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
11,640	National Instruments Corp	HSBC	28,122
7,260	National Oilwell Varco Inc	Bank of America Merrill Lynch	7,333
33,070	National Oilwell Varco Inc	Barclays Bank	14,551
17,900	National Oilwell Varco Inc	Goldam Sachs	18,079
9,263	National Oilwell Varco Inc	HSBC	(6,114)
123,630	Navient Corp	Bank of America Merrill Lynch	95,195
375,880	Navient Corp	Barclays Bank	180,422
45,490	Navient Corp	Goldam Sachs	35,027
(7,680)	NCR Corp	Barclays Bank	(5,069)
(27,630)	NCR Corp	Goldam Sachs	(60,786)
(8,120)	NCR Corp	JP Morgan	(17,324)
(73,233)	Nektar Therapeutics	Bank of America Merrill Lynch	13,182
(68,590)	Nektar Therapeutics	Goldam Sachs	12,346
96,950	NetApp Inc	Barclays Bank	(74,652)
(3,270)	Netflix Inc	Goldam Sachs	121,252
4,690	Neurocrine Biosciences Inc	Barclays Bank	(17,588)
22,400	Neurocrine Biosciences Inc	Goldam Sachs	101,920
2,630	New Relic Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,366
4,750	New Relic Inc	Barclays Bank	6,460
3,770	New Relic Inc	Goldam Sachs	4,826
12,440	New Relic Inc	JP Morgan	82,353
(281,880)	New York Community Bancorp Inc	Barclays Bank	(273,424)
(35,146)	New York Times Co 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(86,108)
(57,801)	New York Times Co 'A'	Barclays Bank	(53,177)
(7,750)	New York Times Co 'A'	Goldam Sachs	(18,988)
(155,479)	Newell Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	(244,102)
(56,384)	Newell Brands Inc	Credit Suisse	(48,490)
(148,390)	Newell Brands Inc	Goldam Sachs	(232,972)
5,870	NewMarket Corp	Barclays Bank	25,182
2,580	NewMarket Corp	Credit Suisse	31,553
390	NewMarket Corp	HSBC	4,770
(6,600)	Newmont Corp	Bank of America Merrill Lynch	57,090
(3,000)	Newmont Corp	Barclays Bank	11,400
(8,660)	Newmont Corp	Credit Suisse	45,898
(14,875)	Nexstar Media Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(123,016)
(32,820)	Nexstar Media Group Inc 'A'	Barclays Bank	(39,384)
(10,390)	Nexstar Media Group Inc 'A'	Goldam Sachs	(85,925)
60	NextEra Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,504
4,890	NextEra Energy Inc	Goldam Sachs	122,592
8,290	Nielsen Holdings Plc	Barclays Bank	5,389
68,950	Nielsen Holdings Plc	Goldam Sachs	105,494
700	NIKE Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	7,889
39,010	NIKE Inc 'B'	Barclays Bank	175,935
2,720	NIKE Inc 'B'	Citibank	12,267
619	NIKE Inc 'B'	Credit Suisse	4,828

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
3,020	NIKE Inc 'B'	Goldam Sachs	34,035
1,330	NiSource Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,796
80,040	NiSource Inc	Barclays Bank	50,425
30,950	NiSource Inc	JP Morgan	13,928
(15,500)	Noble Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,208)
(11,580)	Noble Energy Inc	Barclays Bank	11,175
(24,140)	Noble Energy Inc	Credit Suisse	21,605
(34,340)	Noble Energy Inc	Goldam Sachs	(15,968)
(7,717)	Nordson Corp	Bank of America Merrill Lynch	(172,166)
(17,821)	Nordson Corp	Barclays Bank	(189,437)
(1,696)	Nordson Corp	JP Morgan	(31,308)
37,014	Nordstrom Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,331
56,840	Nordstrom Inc	Goldam Sachs	5,116
(21,683)	Norfolk Southern Corp	Bank of America Merrill Lynch	(382,705)
(7,380)	Norfolk Southern Corp	Barclays Bank	(48,265)
(780)	Norfolk Southern Corp	Credit Suisse	(13,104)
(10,420)	Norfolk Southern Corp	Goldam Sachs	(183,913)
10,200	Northern Trust Corp	Barclays Bank	52,938
6,400	Northern Trust Corp	Goldam Sachs	50,816
73,450	NortonLifeLock Inc	Barclays Bank	53,251
27,300	NortonLifeLock Inc	Citibank	19,793
8,750	NortonLifeLock Inc	HSBC	6,629
46,610	NortonLifeLock Inc	JP Morgan	(14,915)
53,995	NRG Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	172,784
118,630	NRG Energy Inc	Credit Suisse	359,449
25,127	NRG Energy Inc	Goldam Sachs	80,406
9,119	NRG Energy Inc	HSBC	27,631
91,207	Nu Skin Enterprises Inc 'A'	Barclays Bank	93,031
6,270	Nu Skin Enterprises Inc 'A'	Credit Suisse	4,138
27,291	Nu Skin Enterprises Inc 'A'	Goldam Sachs	70,138
3,930	Nu Skin Enterprises Inc 'A'	JP Morgan	9,013
13,470	Nuance Communications Inc	Bank of America Merrill Lynch	37,447
21,750	Nuance Communications Inc	Barclays Bank	28,493
14,870	Nuance Communications Inc	Citibank	19,480
6,390	Nuance Communications Inc	HSBC	18,431
12,050	Nuance Communications Inc	JP Morgan	27,584
(8,820)	Nucor Corp	Bank of America Merrill Lynch	(29,635)
(11,550)	Nucor Corp	Credit Suisse	(7,558)
(12,850)	Nucor Corp	Goldam Sachs	(43,176)
(5,450)	Nucor Corp	JP Morgan	4,197
(42,268)	Nutanix Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(146,036)
(121,125)	Nutanix Inc 'A'	Goldam Sachs	(418,487)
(14,140)	Nutrien Ltd	Barclays Bank	(16,544)
(14,290)	Nutrien Ltd	Credit Suisse	7,267
(8,710)	Nutrien Ltd	Goldam Sachs	(20,991)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
33,080	nVent Electric Plc	Goldam Sachs	41,350
51	NVR Inc	Bank of America Merrill Lynch	22,180
400	NVR Inc	Barclays Bank	38,440
870	NVR Inc	Goldam Sachs	378,363
(4,078)	Occidental Petroleum Corp	Barclays Bank	4,241
(401,980)	Occidental Petroleum Corp	Goldam Sachs	293,445
99,666	OGE Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	277,071
10,240	OGE Energy Corp	Barclays Bank	5,222
38,469	OGE Energy Corp	Credit Suisse	10,002
40,269	OGE Energy Corp	Goldam Sachs	111,948
(99,040)	O-I Glass Inc	Bank of America Merrill Lynch	(130,733)
(38,000)	O-I Glass Inc	Barclays Bank	(17,480)
(2,510)	O-I Glass Inc	Credit Suisse	552
(123,136)	O-I Glass Inc	Goldam Sachs	(162,540)
(31,260)	O-I Glass Inc	HSBC	6,877
(15,970)	Okta Inc	Goldam Sachs	(165,928)
(10,470)	Old Dominion Freight Line Inc	Barclays Bank	(93,497)
(750)	Old Dominion Freight Line Inc	Citibank	(6,698)
(1,005)	Old Dominion Freight Line Inc	Credit Suisse	(15,035)
(11,205)	Old Dominion Freight Line Inc	Goldam Sachs	(209,197)
(255)	Old Dominion Freight Line Inc	HSBC	(3,815)
65,020	Old Republic International Corp	Bank of America Merrill Lynch	87,777
77,150	Old Republic International Corp	Barclays Bank	43,976
40,470	Old Republic International Corp	Citibank	23,068
55,240	Old Republic International Corp	Credit Suisse	15,710
17,730	Old Republic International Corp	Goldam Sachs	23,936
11,760	Old Republic International Corp	HSBC	(3,058)
(165,663)	Olin Corp	Bank of America Merrill Lynch	(152,410)
(224,380)	Olin Corp	Barclays Bank	(204,186)
(145,530)	Olin Corp	Credit Suisse	(27,862)
(102,210)	Olin Corp	Goldam Sachs	(94,033)
(48,230)	Olin Corp	HSBC	9,646
(59,890)	Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,230,739)
(11,130)	Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc	Barclays Bank	(93,381)
30,195	Omnicom Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	92,699
(41,760)	ON Semiconductor Corp	Bank of America Merrill Lynch	(89,366)
(31,520)	ON Semiconductor Corp	Barclays Bank	(17,336)
(14,850)	ON Semiconductor Corp	Credit Suisse	12,326
(26,350)	ON Semiconductor Corp	Goldam Sachs	(56,389)
10,390	OneMain Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	38,651
116,696	OneMain Holdings Inc	Barclays Bank	263,733
31,680	OneMain Holdings Inc	Goldam Sachs	117,850
3,740	ONEOK Inc	Barclays Bank	1,608
6,250	ONEOK Inc	Citibank	2,688
(19,030)	Oracle Corp	Barclays Bank	(17,698)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(19,150)	Oracle Corp	Goldam Sachs	(12,065)
5,780	O'Reilly Automotive Inc	Bank of America Merrill Lynch	46,124
3,830	O'Reilly Automotive Inc	Barclays Bank	38,721
400	O'Reilly Automotive Inc	Credit Suisse	5,036
2,050	O'Reilly Automotive Inc	Goldam Sachs	16,359
8,950	Oshkosh Corp	Goldam Sachs	89,948
102,318	Ovintiv Inc	Barclays Bank	(42,462)
8	Ovintiv Inc	Credit Suisse	17
(20)	Owens Corning	Barclays Bank	(62)
(24,839)	Owens Corning	Credit Suisse	(196,476)
(1,690)	PACCAR Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10,258)
(3,190)	PACCAR Inc	Barclays Bank	(14,291)
(5,250)	PACCAR Inc	HSBC	(17,220)
(5,540)	Packaging Corp of America	Bank of America Merrill Lynch	(50,054)
(17,620)	Packaging Corp of America	Barclays Bank	(122,723)
(3,150)	Packaging Corp of America	Credit Suisse	(5,717)
(7,280)	Packaging Corp of America	Goldam Sachs	(65,775)
(3,470)	Packaging Corp of America	HSBC	(6,298)
(3,040)	Packaging Corp of America	JP Morgan	(5,518)
(22,400)	PacWest Bancorp	Barclays Bank	(25,088)
(22,640)	PacWest Bancorp	Goldam Sachs	(42,563)
(57,981)	PagerDuty Inc	Barclays Bank	110,164
(34,538)	PagerDuty Inc	HSBC	(48,699)
(810)	Palo Alto Networks Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,286)
(3,310)	Palo Alto Networks Inc	Barclays Bank	24,295
(2,230)	Parker-Hannifin Corp	Bank of America Merrill Lynch	(54,568)
(4,840)	Parker-Hannifin Corp	Barclays Bank	(52,659)
(31,550)	Parker-Hannifin Corp	Goldam Sachs	(772,028)
64,850	Parsley Energy Inc 'A'	Barclays Bank	(23,995)
116,843	Patterson-UTI Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	91,722
341,159	Patterson-UTI Energy Inc	Goldam Sachs	267,810
33,403	Paychex Inc	Bank of America Merrill Lynch	264,886
27,966	Paychex Inc	Citibank	105,711
38,840	Paychex Inc	Goldam Sachs	308,001
48,721	Paychex Inc	HSBC	207,064
(1,447)	Paycom Software Inc	Bank of America Merrill Lynch	(44,162)
(7,340)	Paycom Software Inc	Goldam Sachs	(224,017)
(3,070)	Paylocity Holding Corp	Credit Suisse	(26,992)
(1,920)	Paylocity Holding Corp	Goldam Sachs	(24,307)
1,320	PayPal Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	5,729
7,800	PayPal Holdings Inc	Barclays Bank	(7,878)
3,360	PayPal Holdings Inc	Credit Suisse	16,430
3,100	PayPal Holdings Inc	Goldam Sachs	13,454
12,900	PBF Energy Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	19,995
11,720	PBF Energy Inc 'A'	Citibank	2,110

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
10,890	PBF Energy Inc 'A'	Credit Suisse	109
1	Pebblebrook Hotel Trust (REIT)	Credit Suisse	2
(4,860)	Pegasystems Inc	Barclays Bank	(11,858)
3,740	Penske Automotive Group Inc	JP Morgan	19,475
20,593	Pentair Plc	Bank of America Merrill Lynch	116,762
15,711	Pentair Plc	Barclays Bank	42,105
10,171	Pentair Plc	Citibank	27,258
3,733	Pentair Plc	Credit Suisse	15,156
3,670	Pentair Plc	Goldam Sachs	20,809
25,522	Pentair Plc	JP Morgan	103,619
(8,888)	Penumbra Inc	Credit Suisse	49,151
(11,640)	People's United Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,730)
(53,010)	People's United Financial Inc	Barclays Bank	(30,216)
(22,950)	People's United Financial Inc	Citibank	(13,082)
(58,320)	People's United Financial Inc	Credit Suisse	36,742
(12,910)	People's United Financial Inc	JP Morgan	8,133
2,150	PepsiCo Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9,976)
33,070	PepsiCo Inc	Barclays Bank	27,448
12,900	PepsiCo Inc	Citibank	10,707
1,910	PepsiCo Inc	Goldam Sachs	(8,862)
6,689	PepsiCo Inc	JP Morgan	(19,532)
(9,275)	PerkinElmer Inc	Bank of America Merrill Lynch	(63,812)
(4,060)	PerkinElmer Inc	Barclays Bank	(25,700)
(1,400)	PerkinElmer Inc	Citibank	(8,862)
(48,790)	PerkinElmer Inc	Goldam Sachs	(335,675)
(28,220)	Perrigo Co Plc	Barclays Bank	(6,208)
(77,930)	Perrigo Co Plc	Goldam Sachs	(135,598)
(52,040)	Pfizer Inc	Bank of America Merrill Lynch	(17,173)
(18,520)	Pfizer Inc	Barclays Bank	(10,927)
(27,420)	Pfizer Inc	HSBC	(23,855)
10,690	PG&E Corp	Bank of America Merrill Lynch	4,490
12,620	PG&E Corp	HSBC	2,019
(3,110)	Philip Morris International Inc	Goldam Sachs	(13,000)
13,760	Phillips 66	Goldam Sachs	98,522
(30,288)	Pilgrim's Pride Corp	Bank of America Merrill Lynch	13,630
(14,100)	Pilgrim's Pride Corp	Barclays Bank	7,473
(45,040)	Pilgrim's Pride Corp	Goldam Sachs	20,268
55,190	Pinnacle Financial Partners Inc	Barclays Bank	176,056
5,663	Pinnacle West Capital Corp	Bank of America Merrill Lynch	24,464
(7,261)	Pioneer Natural Resources Co	Bank of America Merrill Lynch	(56,418)
(5,910)	Pioneer Natural Resources Co	Barclays Bank	10,579
(9,840)	Pioneer Natural Resources Co	Goldam Sachs	(76,457)
22,040	Planet Fitness Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	281,781
3,100	Planet Fitness Inc 'A'	Credit Suisse	50,284
(46,640)	Pluralsight Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(79,754)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(92,400)	Pluralsight Inc 'A'	Barclays Bank	76,692
4,270	Polaris Inc	Bank of America Merrill Lynch	58,670
6,620	Polaris Inc	Barclays Bank	26,281
1,610	Polaris Inc	Credit Suisse	23,764
26,430	Polaris Inc	Goldam Sachs	363,148
240	Polaris Inc	HSBC	3,542
1,950	Pool Corp	Barclays Bank	44,285
61,754	Popular Inc	Bank of America Merrill Lynch	272,953
58,585	Popular Inc	Barclays Bank	114,827
(59,990)	Post Holdings Inc	Barclays Bank	(166,172)
9,730	PPG Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	140,501
9,990	PPG Industries Inc	Barclays Bank	51,748
6,980	PPG Industries Inc	Citibank	36,156
5,690	PPG Industries Inc	Credit Suisse	53,372
38,160	PPG Industries Inc	Goldam Sachs	551,030
6,120	PPG Industries Inc	HSBC	57,406
(54,560)	PPL Corp	Barclays Bank	(96,026)
1,270	PRA Health Sciences Inc	Credit Suisse	14,525
(2,000)	Principal Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9,840)
(82,560)	Principal Financial Group Inc	Barclays Bank	(151,910)
(810)	Principal Financial Group Inc	Citibank	(1,490)
(1,990)	Principal Financial Group Inc	Goldam Sachs	(9,791)
240	Procter & Gamble Co	Bank of America Merrill Lynch	343
18,790	Procter & Gamble Co	Barclays Bank	64,638
3,110	Procter & Gamble Co	Goldam Sachs	4,447
3,490	Procter & Gamble Co	HSBC	314
(11,080)	Progressive Corp	Bank of America Merrill Lynch	(7,424)
(7,290)	Progressive Corp	Barclays Bank	(15,746)
(9,060)	Progressive Corp	Credit Suisse	(23,647)
(18,100)	Progressive Corp	Goldam Sachs	(12,127)
(2,190)	Proofpoint Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,438
(6,120)	Proofpoint Inc	Barclays Bank	(10,526)
(990)	Proofpoint Inc	Credit Suisse	7,059
(7,230)	Proofpoint Inc	Goldam Sachs	11,351
(19,703)	Prosperity Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	(170,825)
(36,530)	Prosperity Bancshares Inc	Goldam Sachs	(316,715)
(5,850)	Prosperity Bancshares Inc	HSBC	(35,068)
(2,100)	Prosperity Bancshares Inc	JP Morgan	(9,513)
(98,440)	Prudential Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(720,581)
(13,920)	Prudential Financial Inc	Barclays Bank	(55,262)
(230)	Prudential Financial Inc	Credit Suisse	(292)
(61,680)	Prudential Financial Inc	Goldam Sachs	(451,498)
(9,240)	Prudential Financial Inc	HSBC	(44,850)
(29,523)	PTC Inc	Bank of America Merrill Lynch	(288,440)
(26,223)	PTC Inc	Credit Suisse	(84,438)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(8,580)	PTC Inc	Goldam Sachs	(83,827)
27,250	PulteGroup Inc	Bank of America Merrill Lynch	180,395
15,460	PulteGroup Inc	Barclays Bank	15,924
32,060	PulteGroup Inc	Goldam Sachs	212,237
43,276	Pure Storage Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	146,706
23,640	Pure Storage Inc 'A'	Barclays Bank	33,332
9,820	Pure Storage Inc 'A'	Citibank	13,846
39,030	Pure Storage Inc 'A'	Goldam Sachs	132,312
15,850	Pure Storage Inc 'A'	HSBC	34,395
12,970	PVH Corp	Bank of America Merrill Lynch	88,196
13,150	PVH Corp	Barclays Bank	37,609
13,700	PVH Corp	Goldam Sachs	93,160
7,240	PVH Corp	HSBC	7,168
(44,069)	QIAGEN NV	Goldam Sachs	(77,121)
19,781	Qorvo Inc	Goldam Sachs	158,644
12,220	QUALCOMM Inc	Citibank	244
10,690	QUALCOMM Inc	Credit Suisse	(19,670)
31,300	QUALCOMM Inc	Goldam Sachs	92,335
32,091	Quanta Services Inc	Goldam Sachs	148,902
(8,170)	Quest Diagnostics Inc	Citibank	(28,840)
(1,820)	Quest Diagnostics Inc	Goldam Sachs	(9,610)
(4,540)	Quest Diagnostics Inc	HSBC	(18,796)
(2,560)	Quest Diagnostics Inc	JP Morgan	(10,598)
98,917	Qurate Retail Inc 'A'	Barclays Bank	35,610
50,275	Ralph Lauren Corp	Bank of America Merrill Lynch	627,935
32,740	Ralph Lauren Corp	Barclays Bank	164,682
3,060	Ralph Lauren Corp	Citibank	15,392
6,309	Ralph Lauren Corp	Credit Suisse	36,529
33,500	Ralph Lauren Corp	Goldam Sachs	418,415
(144,681)	Range Resources Corp	Barclays Bank	(7,234)
(26,380)	Range Resources Corp	Credit Suisse	3,166
(52,320)	Range Resources Corp	Goldam Sachs	(60,168)
(120,950)	Range Resources Corp	HSBC	14,514
(1,710)	Raymond James Financial Inc	Citibank	(7,370)
(2,830)	Raymond James Financial Inc	Credit Suisse	(7,613)
(10,510)	Raymond James Financial Inc	Goldam Sachs	(89,125)
(2,240)	Regal Beloit Corp	Credit Suisse	(8,131)
(4,480)	Regal Beloit Corp	Goldam Sachs	(43,456)
310	Regeneron Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	37
410	Regeneron Pharmaceuticals Inc	HSBC	5,510
(99,990)	Regions Financial Corp	Barclays Bank	(117,988)
(42,040)	Regions Financial Corp	Goldam Sachs	(81,558)
(7,190)	Reinsurance Group of America Inc	Bank of America Merrill Lynch	(57,089)
(8,490)	Reinsurance Group of America Inc	Barclays Bank	(7,217)
50,582	Reliance Steel & Aluminum Co	Bank of America Merrill Lynch	392,011

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
69,731	Reliance Steel & Aluminum Co	Barclays Bank	267,767
21,720	Reliance Steel & Aluminum Co	Goldam Sachs	168,330
9,230	RenaissanceRe Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	65,810
3,120	RenaissanceRe Holdings Ltd	Goldam Sachs	22,246
20,940	Republic Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	111,401
25,060	Republic Services Inc	Barclays Bank	91,970
1,540	Republic Services Inc	Credit Suisse	5,359
15,950	Republic Services Inc	Goldam Sachs	84,854
1,680	Republic Services Inc	HSBC	9,446
(11,387)	Resideo Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10,248)
(168,571)	Resideo Technologies Inc	Goldam Sachs	(151,714)
(7,740)	ResMed Inc	Goldam Sachs	34,753
18,235	Restaurant Brands International Inc	Bank of America Merrill Lynch	51,787
1,270	Restaurant Brands International Inc	Barclays Bank	1,575
6,960	Restaurant Brands International Inc	Goldam Sachs	19,766
(19,770)	Reynolds Consumer Products Inc	Bank of America Merrill Lynch	16,211
(29,500)	Reynolds Consumer Products Inc	Barclays Bank	(590)
(12,740)	Reynolds Consumer Products Inc	Credit Suisse	(1,019)
(37,640)	Reynolds Consumer Products Inc	Goldam Sachs	30,865
14,400	RingCentral Inc 'A'	Barclays Bank	301,941
(2)	RLI Corp	Bank of America Merrill Lynch	(18)
35,217	Robert Half International Inc	Bank of America Merrill Lynch	198,624
87,160	Robert Half International Inc	Barclays Bank	293,729
(14,370)	Roku Inc	Bank of America Merrill Lynch	36,787
(1,490)	Roku Inc	Barclays Bank	(2,771)
(6,570)	Roku Inc	Credit Suisse	107,025
(11,100)	Roku Inc	Goldam Sachs	28,416
(11,455)	Rollins Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,467)
(3,157)	Roper Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(75,610)
(1,660)	Roper Technologies Inc	Barclays Bank	(30,527)
(3,560)	Roper Technologies Inc	Credit Suisse	(96,291)
(3,050)	Roper Technologies Inc	Goldam Sachs	(73,048)
(10,030)	Roper Technologies Inc	JP Morgan	(271,713)
(35,670)	Royal Caribbean Cruises Ltd	Barclays Bank	(275,016)
(17,630)	Royal Caribbean Cruises Ltd	Goldam Sachs	(236,242)
18,350	Royal Gold Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,707)
4,210	Royal Gold Inc	Barclays Bank	(14,230)
1,960	Royal Gold Inc	Goldam Sachs	(823)
6,690	RPM International Inc	Bank of America Merrill Lynch	49,907
13,830	RPM International Inc	Barclays Bank	60,714
2,600	RPM International Inc	Citibank	11,414
9,660	RPM International Inc	Credit Suisse	51,584
17,600	RPM International Inc	Goldam Sachs	131,296
2,660	RPM International Inc	HSBC	14,204
14,370	RPM International Inc	JP Morgan	76,736

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(24,010)	Ryder System Inc	Bank of America Merrill Lynch	(100,362)
(21,730)	Ryder System Inc	Barclays Bank	(64,755)
(19,717)	Ryder System Inc	Goldam Sachs	(82,417)
2,270	S&P Global Inc	Bank of America Merrill Lynch	43,720
16,040	S&P Global Inc	Barclays Bank	169,062
440	S&P Global Inc	Citibank	4,638
910	S&P Global Inc	Credit Suisse	22,523
10,540	S&P Global Inc	Goldam Sachs	203,000
478	S&P Global Inc	JP Morgan	11,831
34,200	Sabre Corp	Bank of America Merrill Lynch	58,824
48,940	Sabre Corp	Goldam Sachs	84,177
(3,617)	Sage Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(543)
(19,450)	Sage Therapeutics Inc	Barclays Bank	35,983
(6,828)	Sage Therapeutics Inc	Credit Suisse	14,407
(43,590)	Sage Therapeutics Inc	Goldam Sachs	(6,539)
15,540	salesforce.com Inc	Bank of America Merrill Lynch	19,736
2,520	salesforce.com Inc	Barclays Bank	(13,230)
22,580	salesforce.com Inc	Goldam Sachs	28,677
14,020	Santander Consumer USA Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	31,265
14,300	Santander Consumer USA Holdings Inc	Citibank	16,588
39,830	Santander Consumer USA Holdings Inc	Credit Suisse	33,457
35,790	Santander Consumer USA Holdings Inc	HSBC	30,064
(780)	Sarepta Therapeutics Inc	Barclays Bank	(2,231)
(28,740)	Sarepta Therapeutics Inc	Goldam Sachs	(350,915)
206,021	Schneider National Inc 'B'	Goldam Sachs	580,979
(14,597)	Scotts Miracle-Gro Co	Goldam Sachs	(37,952)
(389)	Seaboard Corp	Bank of America Merrill Lynch	29,241
(341)	Seaboard Corp	Barclays Bank	8,184
(50)	Seaboard Corp	Credit Suisse	12,101
(720)	Seaboard Corp	Goldam Sachs	54,122
(26)	Seaboard Corp	HSBC	6,292
(83)	Seaboard Corp	JP Morgan	20,087
32,659	Sealed Air Corp	Bank of America Merrill Lynch	88,832
9,039	Sealed Air Corp	Barclays Bank	15,186
14,945	Sealed Air Corp	Credit Suisse	27,499
67,130	Sealed Air Corp	Goldam Sachs	182,594
36,311	Sealed Air Corp	JP Morgan	67,352
(13,538)	Seattle Genetics Inc	Credit Suisse	48,331
(10,850)	Seattle Genetics Inc	Goldam Sachs	67,596
14,390	SEI Investments Co	Bank of America Merrill Lynch	37,414
58,760	SEI Investments Co	Goldam Sachs	152,776
16,128	SEI Investments Co	HSBC	23,708
(9,530)	Sempra Energy	Bank of America Merrill Lynch	(66,519)
(4,090)	Sempra Energy	Credit Suisse	(11,593)
(1,220)	Sempra Energy	Goldam Sachs	(8,516)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
米国(続き)			
(4,350)	Sensata Technologies Holding Plc	Barclays Bank	(4,176)
(40,691)	Sensata Technologies Holding Plc	Credit Suisse	32,553
(38,740)	Sensata Technologies Holding Plc	Goldam Sachs	(101,886)
(25,050)	Service Corp International	Barclays Bank	(10,020)
(66,486)	ServiceMaster Global Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(317,138)
(15,650)	ServiceMaster Global Holdings Inc	Barclays Bank	(39,908)
(4,420)	ServiceMaster Global Holdings Inc	Credit Suisse	(8,707)
(61,720)	ServiceMaster Global Holdings Inc	Goldam Sachs	(294,404)
13,940	ServiceNow Inc	Barclays Bank	106,370
1,620	Sherwin-Williams Co	Bank of America Merrill Lynch	34,020
1,350	Sherwin-Williams Co	Barclays Bank	16,308
860	Sherwin-Williams Co	Citibank	10,389
830	Sherwin-Williams Co	Credit Suisse	32,951
690	Sherwin-Williams Co	Goldam Sachs	14,490
5,730	Signature Bank	Barclays Bank	48,934
270	Signature Bank	HSBC	419
450	Signature Bank	JP Morgan	698
34,724	Silgan Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	9,375
22,363	Silgan Holdings Inc	Credit Suisse	(15,207)
41,410	Silgan Holdings Inc	Goldam Sachs	11,181
2,761	Silgan Holdings Inc	JP Morgan	(1,877)
(119,450)	Sinclair Broadcast Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(307,584)
(125,012)	Sinclair Broadcast Group Inc 'A'	Barclays Bank	(20,002)
(35,730)	Sinclair Broadcast Group Inc 'A'	Citibank	(5,717)
(11,720)	Sinclair Broadcast Group Inc 'A'	Credit Suisse	(20,041)
(45,760)	Sinclair Broadcast Group Inc 'A'	Goldam Sachs	(117,832)
(15,440)	Sinclair Broadcast Group Inc 'A'	JP Morgan	(36,979)
129,560	Sirius XM Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	45,346
107,990	Sirius XM Holdings Inc	Barclays Bank	41,576
68,070	Sirius XM Holdings Inc	Goldam Sachs	23,825
6,660	Six Flags Entertainment Corp	Bank of America Merrill Lynch	30,103
4,570	Six Flags Entertainment Corp	Barclays Bank	411
48,260	Six Flags Entertainment Corp	Credit Suisse	128,832
8,940	Six Flags Entertainment Corp	HSBC	21,814
30,080	Six Flags Entertainment Corp	JP Morgan	93,785
67,710	Skechers USA Inc 'A'	Barclays Bank	129,326
5,530	Skyworks Solutions Inc	Goldam Sachs	56,461
(99,660)	SLM Corp	Bank of America Merrill Lynch	(9,966)
(60,180)	SLM Corp	Barclays Bank	(13,240)
(107,630)	SLM Corp	Citibank	(23,679)
(49,450)	Smartsheet Inc 'A'	Barclays Bank	18,297
1,690	Snap-on Inc	Bank of America Merrill Lynch	12,117
2,960	Snap-on Inc	Barclays Bank	3,670
8,780	Snap-on Inc	Credit Suisse	37,297
4,700	Snap-on Inc	HSBC	13,113

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(72,717)	SolarWinds Corp	Bank of America Merrill Lynch	(109,076)
(12,240)	SolarWinds Corp	Barclays Bank	(490)
(116,221)	SolarWinds Corp	Goldam Sachs	(174,331)
(65,120)	SolarWinds Corp	HSBC	(70,330)
(9,210)	Sonoco Products Co	Bank of America Merrill Lynch	(56,273)
(5,460)	Sonoco Products Co	Barclays Bank	(12,558)
(18,680)	Sonoco Products Co	Goldam Sachs	(114,135)
16,700	Southern Co	Barclays Bank	39,913
11,120	Southern Co	Goldam Sachs	49,262
25,030	Southwest Airlines Co	Goldam Sachs	198,989
(8,014)	Spectrum Brands Holdings Inc	Barclays Bank	(20,195)
(38,622)	Spectrum Brands Holdings Inc	JP Morgan	(120,501)
39,260	Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	145,655
11,730	Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A'	Barclays Bank	12,434
24,180	Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A'	Citibank	25,631
14,870	Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A'	Goldam Sachs	55,168
9,310	Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A'	HSBC	14,151
(11,770)	Splunk Inc	Bank of America Merrill Lynch	(309,080)
(27,330)	Splunk Inc	Goldam Sachs	(717,686)
1,330	Spotify Technology SA	HSBC	37,493
17,410	Spotify Technology SA	JP Morgan	490,788
4,167	Sprouts Farmers Market Inc	Bank of America Merrill Lynch	(458)
164,675	Sprouts Farmers Market Inc	Barclays Bank	75,751
5,100	Sprouts Farmers Market Inc	Citibank	2,346
146,535	Sprouts Farmers Market Inc	Goldam Sachs	(16,119)
1,610	Square Inc 'A'	HSBC	8,372
2,600	SS&C Technologies Holdings Inc	Goldam Sachs	6,838
83,283	Starbucks Corp	Bank of America Merrill Lynch	338,962
19,406	Starbucks Corp	Barclays Bank	11,838
25,630	Starbucks Corp	Citibank	15,634
1,650	Starbucks Corp	Credit Suisse	594
(27,913)	State Street Corp	Bank of America Merrill Lynch	(202,090)
(3,050)	State Street Corp	Barclays Bank	(19,307)
(2,480)	State Street Corp	Credit Suisse	(17,878)
(17,160)	State Street Corp	Goldam Sachs	(124,238)
(10,150)	State Street Corp	HSBC	(23,567)
13,779	Steel Dynamics Inc	Barclays Bank	23,287
4,850	Steel Dynamics Inc	Citibank	8,197
(4,882)	Stericycle Inc	Bank of America Merrill Lynch	(30,708)
(57,010)	Stericycle Inc	Goldam Sachs	(358,593)
16,390	STERIS Plc	Barclays Bank	107,682
61,412	Sterling Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	164,277
43,480	Sterling Bancorp	Barclays Bank	65,872
12,870	Sterling Bancorp	Credit Suisse	8,945
41,200	Sterling Bancorp	Goldam Sachs	110,210

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
6,080	Stryker Corp	Barclays Bank	61,955
4,530	Stryker Corp	Goldam Sachs	63,692
(2,020)	SVB Financial Group	Bank of America Merrill Lynch	(83,002)
(2,210)	SVB Financial Group	Barclays Bank	(53,902)
(250)	SVB Financial Group	Citibank	(6,098)
(10,600)	SVB Financial Group	Goldam Sachs	(435,554)
(7,353)	Switch Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(8,088)
(93,542)	Switch Inc 'A'	Barclays Bank	(1,871)
(58,013)	Switch Inc 'A'	Credit Suisse	(92,241)
(136,784)	Switch Inc 'A'	HSBC	(217,487)
(881)	Switch Inc 'A'	JP Morgan	(1,401)
107,644	Synchrony Financial	Credit Suisse	207,753
37,515	Synchrony Financial	Goldam Sachs	150,435
3,846	Synchrony Financial	HSBC	7,423
19,423	Synchrony Financial	JP Morgan	37,486
(460)	SYNNEX Corp	Bank of America Merrill Lynch	(7,259)
(4,583)	SYNNEX Corp	Barclays Bank	(30,431)
12,063	Synopsys Inc	Bank of America Merrill Lynch	228,111
8,000	Synopsys Inc	Barclays Bank	52,240
17,917	Synopsys Inc	Citibank	116,998
4,740	Synopsys Inc	Goldam Sachs	89,633
1,950	Synopsys Inc	HSBC	34,067
(87,380)	Synovus Financial Corp	Barclays Bank	(150,294)
(7,057)	Synovus Financial Corp	Credit Suisse	4,446
(32,840)	Synovus Financial Corp	Goldam Sachs	(101,147)
2,600	Sysco Corp	Barclays Bank	9,048
14,920	Sysco Corp	Goldam Sachs	113,541
(13,670)	T Rowe Price Group Inc	Barclays Bank	(67,803)
(8,470)	T Rowe Price Group Inc	Citibank	(42,011)
(2,870)	T Rowe Price Group Inc	Credit Suisse	(17,191)
360	Take-Two Interactive Software Inc	Citibank	(1,987)
6,610	Take-Two Interactive Software Inc	Goldam Sachs	16,195
20,910	Take-Two Interactive Software Inc	HSBC	35,005
(13,500)	Tapestry Inc	Bank of America Merrill Lynch	(20,385)
(15,140)	Tapestry Inc	Barclays Bank	4,088
(60,320)	Tapestry Inc	Goldam Sachs	(91,083)
(77,921)	Targa Resources Corp	Bank of America Merrill Lynch	(223,633)
15,291	Target Corp	Bank of America Merrill Lynch	(18,043)
5,020	Target Corp	Barclays Bank	11,395
5,670	Target Corp	Goldam Sachs	(6,691)
3,110	Target Corp	JP Morgan	12,222
(74,720)	TCF Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(458,781)
(33,200)	TCF Financial Corp	Barclays Bank	(114,540)
(7,260)	TCF Financial Corp	Credit Suisse	(9,874)
(34,730)	TCF Financial Corp	Goldam Sachs	(213,242)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(41,590)	TD Ameritrade Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	(160,537)
(13,610)	TD Ameritrade Holding Corp	Barclays Bank	(46,002)
(4,690)	TD Ameritrade Holding Corp	Credit Suisse	2,064
(36,570)	TD Ameritrade Holding Corp	Goldam Sachs	(141,160)
9,555	Teledyne Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	477,559
1,360	Teledyne Technologies Inc	Goldam Sachs	67,973
400	Teleflex Inc	Barclays Bank	(1,524)
870	Teleflex Inc	Credit Suisse	11,959
17,038	Telephone and Data Systems Inc	Goldam Sachs	41,062
14,143	Telephone and Data Systems Inc	JP Morgan	14,284
7,220	Tempur Sealy International Inc	Barclays Bank	43,753
3,970	Tempur Sealy International Inc	Credit Suisse	37,159
34,870	Tempur Sealy International Inc	Goldam Sachs	442,500
21,010	Tempur Sealy International Inc	JP Morgan	196,654
31,190	Teradata Corp	Barclays Bank	22,457
44,850	Teradata Corp	Goldam Sachs	67,275
75,628	Teradyne Inc	Bank of America Merrill Lynch	689,727
79,090	Teradyne Inc	Barclays Bank	257,833
3,893	Teradyne Inc	Citibank	12,691
6,140	Teradyne Inc	Goldam Sachs	55,997
(6,680)	Tesla Inc	Goldam Sachs	(69,004)
11,800	Texas Capital Bancshares Inc	Goldam Sachs	36,816
35,269	Texas Instruments Inc	Bank of America Merrill Lynch	324,827
5,027	Texas Instruments Inc	Citibank	20,209
25,804	Texas Instruments Inc	Credit Suisse	63,220
(67,397)	TFS Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(81,550)
(64,365)	TFS Financial Corp	Barclays Bank	(62,434)
(17,855)	TFS Financial Corp	Citibank	(17,319)
(41,447)	TFS Financial Corp	Credit Suisse	(3,316)
(114,737)	TFS Financial Corp	Goldam Sachs	(138,832)
(12,090)	TFS Financial Corp	HSBC	(967)
(47,237)	TFS Financial Corp	JP Morgan	(3,779)
(2,020)	Thermo Fisher Scientific Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,676)
(2,360)	Thermo Fisher Scientific Inc	Barclays Bank	(12,909)
(2,300)	Thermo Fisher Scientific Inc	Goldam Sachs	(6,463)
(8,480)	Thomson Reuters Corp	Bank of America Merrill Lynch	(7,547)
(2,620)	Thomson Reuters Corp	Barclays Bank	(2,751)
(5,450)	Thomson Reuters Corp	Citibank	(5,723)
(2,130)	Thomson Reuters Corp	HSBC	2,045
(15,770)	Thor Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(214,787)
(53,894)	Thor Industries Inc	Goldam Sachs	(734,036)
(7,305)	Thor Industries Inc	HSBC	(59,682)
(6,560)	Tiffany & Co	Bank of America Merrill Lynch	(4,198)
(6,180)	Tiffany & Co	Barclays Bank	(15,944)
(11,960)	Tiffany & Co	Goldam Sachs	(7,654)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
29,728	Timken Co	Bank of America Merrill Lynch	134,371
56,161	TJX Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	363,923
19,020	TJX Cos Inc	Barclays Bank	4,565
15,870	TJX Cos Inc	Citibank	3,809
8,720	TJX Cos Inc	Goldam Sachs	56,506
6,790	TJX Cos Inc	HSBC	34,901
(160)	T-Mobile US Inc	Bank of America Merrill Lynch	(360)
(26,815)	T-Mobile US Inc	Barclays Bank	(101,093)
(61,960)	T-Mobile US Inc	Goldam Sachs	(139,410)
(5,760)	T-Mobile US Inc	HSBC	(6,048)
(3,170)	T-Mobile US Inc	JP Morgan	(3,329)
(5,170)	Toll Brothers Inc	Barclays Bank	(20,318)
(23,970)	Toll Brothers Inc	Goldam Sachs	(193,198)
5,380	Toro Co	Bank of America Merrill Lynch	39,489
10,070	Toro Co	Barclays Bank	28,800
2,660	Toro Co	Citibank	7,608
2,190	Toro Co	JP Morgan	13,490
56,110	Tractor Supply Co	Barclays Bank	462,346
(3,910)	Trade Desk Inc 'A'	Barclays Bank	12,551
(1,270)	Trade Desk Inc 'A'	Credit Suisse	(5,238)
(14,410)	Trade Desk Inc 'A'	Goldam Sachs	(63,116)
36,650	Trane Technologies Plc	Barclays Bank	230,529
(1,184,963)	Transocean Ltd	Goldam Sachs	112,571
6,570	TransUnion	Bank of America Merrill Lynch	64,452
5,450	TransUnion	Barclays Bank	26,542
4,180	TransUnion	Citibank	20,357
2,250	TransUnion	JP Morgan	23,536
(12,430)	Travelers Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	(199,501)
(4,650)	Travelers Cos Inc	Barclays Bank	(29,109)
(17,960)	TreeHouse Foods Inc	Bank of America Merrill Lynch	180
(26,760)	TreeHouse Foods Inc	Barclays Bank	(30,774)
(29,820)	TreeHouse Foods Inc	Goldam Sachs	298
(851)	TreeHouse Foods Inc	HSBC	1,277
(15,600)	Trimble Inc	Bank of America Merrill Lynch	(59,904)
(37,700)	Trimble Inc	Barclays Bank	3,393
(128,261)	Trinity Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(207,783)
(134,640)	Trinity Industries Inc	Barclays Bank	9,425
78,430	TripAdvisor Inc	Bank of America Merrill Lynch	385,091
66,110	TripAdvisor Inc	Barclays Bank	109,082
8,650	TripAdvisor Inc	Citibank	14,273
42,760	TripAdvisor Inc	Goldam Sachs	209,952
(206,958)	Truist Financial Corp	Barclays Bank	(813,345)
(11,135)	Truist Financial Corp	Goldam Sachs	(65,362)
(14,253)	Twilio Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(87,513)
(4,400)	Twilio Inc 'A'	Barclays Bank	58,344

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(580)	Twilio Inc 'A'	Goldam Sachs	(3,561)
(31,380)	Twitter Inc	Bank of America Merrill Lynch	(51,463)
(22,220)	Twitter Inc	Barclays Bank	43,996
(58,730)	Twitter Inc	Goldam Sachs	(96,317)
(7,315)	Tyler Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(170,074)
(1,270)	Tyson Foods Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(2,972)
(31,034)	Tyson Foods Inc 'A'	Goldam Sachs	(72,620)
(7,050)	Tyson Foods Inc 'A'	HSBC	(1,128)
(10)	Tyson Foods Inc 'A'	JP Morgan	(2)
(800)	Ubiquiti Inc	Barclays Bank	(2,312)
(1,610)	Ubiquiti Inc	Credit Suisse	12,413
(28,030)	UGI Corp	Bank of America Merrill Lynch	(79,886)
(37,910)	UGI Corp	Barclays Bank	(31,465)
2,720	Ulta Beauty Inc	Bank of America Merrill Lynch	96,342
10,040	Ulta Beauty Inc	Barclays Bank	153,110
1,650	Ulta Beauty Inc	Credit Suisse	45,638
1,050	Ulta Beauty Inc	HSBC	6,090
(26,840)	Umpqua Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(45,628)
(15,700)	Umpqua Holdings Corp	Barclays Bank	(8,007)
(23,070)	Umpqua Holdings Corp	Goldam Sachs	(39,219)
50,728	Under Armour Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	55,040
44,970	Under Armour Inc 'A'	Barclays Bank	20,461
8,881	Under Armour Inc 'A'	Citibank	4,041
20,540	Under Armour Inc 'A'	Credit Suisse	(24,340)
41,120	Under Armour Inc 'A'	Goldam Sachs	44,615
83,964	Under Armour Inc 'A'	HSBC	(20,797)
56,090	Under Armour Inc 'A'	JP Morgan	(66,467)
(18,990)	Union Pacific Corp	Bank of America Merrill Lynch	(346,378)
90,703	United Airlines Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	723,810
128,070	United Airlines Holdings Inc	Barclays Bank	320,175
6,403	United Airlines Holdings Inc	Citibank	16,008
84,314	United Airlines Holdings Inc	Goldam Sachs	672,826
10,200	United Parcel Service Inc 'B'	Barclays Bank	22,899
2,260	United Parcel Service Inc 'B'	Citibank	5,074
(19,400)	United Rentals Inc	Barclays Bank	(115,236)
(6,770)	United Rentals Inc	Credit Suisse	(114,548)
(12,740)	United Rentals Inc	Goldam Sachs	(228,428)
(4,130)	United Rentals Inc	HSBC	(69,880)
(7,680)	United States Cellular Corp	Bank of America Merrill Lynch	(25,114)
(3,913)	United States Cellular Corp	Goldam Sachs	(12,796)
(437,182)	United States Steel Corp	Barclays Bank	(310,399)
(8,477)	United States Steel Corp	JP Morgan	3,899
1,280	United Therapeutics Corp	HSBC	1,742
2,230	United Therapeutics Corp	JP Morgan	(4,666)
(1,440)	UnitedHealth Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(18,288)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(490)	UnitedHealth Group Inc	Barclays Bank	(6,723)
(4,210)	UnitedHealth Group Inc	Credit Suisse	(70,139)
(5,570)	UnitedHealth Group Inc	Goldam Sachs	(70,739)
(111,849)	Univar Solutions Inc	Barclays Bank	(109,612)
(930)	Universal Display Corp	Citibank	(828)
14,040	Universal Health Services Inc 'B'	Barclays Bank	6,599
5,420	Universal Health Services Inc 'B'	Goldam Sachs	65,094
(16,460)	Unum Group	Goldam Sachs	(21,892)
(8,930)	Urban Outfitters Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,170)
(31,480)	Urban Outfitters Inc	Barclays Bank	5,352
(17,190)	Urban Outfitters Inc	Credit Suisse	12,377
(16,960)	Urban Outfitters Inc	Goldam Sachs	(6,021)
(16,430)	Urban Outfitters Inc	HSBC	11,830
(4,240)	US Bancorp	Credit Suisse	(4,113)
57,610	US Foods Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	103,698
35,680	US Foods Holding Corp	Barclays Bank	40,675
35,870	US Foods Holding Corp	Goldam Sachs	64,566
(3,324)	Vail Resorts Inc	Bank of America Merrill Lynch	(95,266)
(1,560)	Vail Resorts Inc	Barclays Bank	(4,134)
(1,590)	Vail Resorts Inc	Goldam Sachs	(45,569)
(19,430)	Valero Energy Corp	Goldam Sachs	(150,000)
(8,915)	Valmont Industries Inc	Barclays Bank	(68,111)
(2,140)	Valmont Industries Inc	HSBC	(22,945)
(4,670)	Valmont Industries Inc	JP Morgan	(33,986)
6,340	Valvoline Inc	Bank of America Merrill Lynch	11,666
32,080	Valvoline Inc	Barclays Bank	(321)
77,606	Valvoline Inc	Credit Suisse	78,382
83,125	Valvoline Inc	Goldam Sachs	152,950
14,360	Valvoline Inc	HSBC	14,504
(6,030)	Varian Medical Systems Inc	Goldam Sachs	(52,763)
2,810	Veeva Systems Inc 'A'	Barclays Bank	23,520
3,290	Veeva Systems Inc 'A'	Goldam Sachs	35,861
6,686	VeriSign Inc	Bank of America Merrill Lynch	(16,448)
34,520	VeriSign Inc	Barclays Bank	36,936
106	VeriSign Inc	Citibank	113
8,669	VeriSign Inc	JP Morgan	41,178
(6,690)	Verisk Analytics Inc	Barclays Bank	(91,252)
6,700	Verizon Communications Inc	Barclays Bank	8,442
52,500	Verizon Communications Inc	Goldam Sachs	34,125
2,480	Verizon Communications Inc	JP Morgan	(4,067)
17,620	Vertex Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(119,464)
4,490	Vertex Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	(13,695)
100	Vertex Pharmaceuticals Inc	Citibank	(305)
4,920	Vertex Pharmaceuticals Inc	Goldam Sachs	(33,358)
(15,010)	VF Corp	Bank of America Merrill Lynch	(75,050)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(7,160)	VF Corp	Barclays Bank	(9,451)
(27,190)	VF Corp	Goldam Sachs	(135,950)
(11,509)	ViacomCBS Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(53,287)
(25,130)	ViacomCBS Inc 'A'	Barclays Bank	(49,255)
(5,449)	ViacomCBS Inc 'A'	HSBC	(23,049)
107,587	ViacomCBS Inc 'B'	Barclays Bank	107,587
1	ViacomCBS Inc 'B'	Credit Suisse	3
7	ViacomCBS Inc 'B'	HSBC	18
(4,380)	ViaSat Inc	Bank of America Merrill Lynch	(29,521)
(59,703)	ViaSat Inc	Barclays Bank	18,508
(3,220)	ViaSat Inc	Citibank	998
(5,630)	ViaSat Inc	Goldam Sachs	(37,946)
(3,750)	ViaSat Inc	HSBC	(2,100)
(4,680)	ViaSat Inc	JP Morgan	(2,621)
(23,090)	Virtu Financial Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(8,082)
(8,630)	Virtu Financial Inc 'A'	Barclays Bank	(11,651)
(123,801)	Virtu Financial Inc 'A'	Goldam Sachs	(43,330)
(5,770)	Visa Inc 'A'	Barclays Bank	(18,233)
(2,360)	Visa Inc 'A'	Citibank	(7,458)
(6,750)	Visa Inc 'A'	Credit Suisse	(60,278)
(5,990)	Visa Inc 'A'	Goldam Sachs	(63,075)
70,930	Vistra Energy Corp	Barclays Bank	57,453
309	Vistra Energy Corp	Goldam Sachs	633
2,290	VMware Inc 'A'	Barclays Bank	45,617
20,610	VMware Inc 'A'	Credit Suisse	316,644
(15,500)	Voya Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(55,490)
(14,250)	Voya Financial Inc	Barclays Bank	(32,205)
(9,460)	Voya Financial Inc	Goldam Sachs	(33,867)
(14,250)	Voya Financial Inc	HSBC	(11,675)
(5,140)	Vulcan Materials Co	Bank of America Merrill Lynch	(64,815)
(6,140)	Vulcan Materials Co	Barclays Bank	(54,278)
(8,370)	Vulcan Materials Co	Goldam Sachs	(105,546)
3,370	Walgreens Boots Alliance Inc	Bank of America Merrill Lynch	10,413
5,130	Walgreens Boots Alliance Inc	Barclays Bank	9,696
12,430	Walgreens Boots Alliance Inc	Citibank	23,493
8,710	Walgreens Boots Alliance Inc	Credit Suisse	(1,568)
7,770	Walgreens Boots Alliance Inc	Goldam Sachs	24,009
(7,010)	Walmart Inc	Goldam Sachs	14,090
(7,050)	Walt Disney Co	Bank of America Merrill Lynch	(49,209)
(58,720)	Walt Disney Co	Barclays Bank	116,853
(17,490)	Walt Disney Co	Citibank	34,805
(68,080)	Walt Disney Co	Goldam Sachs	(475,198)
(9,009)	Walt Disney Co	HSBC	(61,892)
(20,947)	Walt Disney Co	JP Morgan	(143,906)
3,310	Waste Management Inc	Bank of America Merrill Lynch	34,656

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
1,500	Waste Management Inc	Barclays Bank	11,220
1,590	Waste Management Inc	Goldam Sachs	16,647
1,620	Waste Management Inc	HSBC	8,797
7,470	Waters Corp	Bank of America Merrill Lynch	158,289
14,430	Waters Corp	Barclays Bank	187,157
1,670	Waters Corp	Credit Suisse	21,159
3,590	Waters Corp	Goldam Sachs	76,072
2,450	Waters Corp	HSBC	31,042
(13,066)	Watsco Inc	Bank of America Merrill Lynch	(231,530)
(10,764)	Watsco Inc	Barclays Bank	(108,932)
(1,790)	Watsco Inc	Goldam Sachs	(31,719)
(2,070)	Watsco Inc	HSBC	(27,593)
(21,660)	Wayfair Inc 'A'	Barclays Bank	(209,019)
(17,310)	Webster Financial Corp	Barclays Bank	(58,681)
(10,860)	Webster Financial Corp	Credit Suisse	(24,978)
(21,780)	Webster Financial Corp	Goldam Sachs	(133,947)
(6,940)	Webster Financial Corp	HSBC	(43,118)
(12,192)	Wells Fargo & Co	Bank of America Merrill Lynch	(35,357)
(77,920)	Wells Fargo & Co	Barclays Bank	(162,853)
(1,770)	Wells Fargo & Co	Citibank	(3,699)
(3,550)	Wells Fargo & Co	Goldam Sachs	(10,295)
9,983	WESCO International Inc	Bank of America Merrill Lynch	56,154
90,280	WESCO International Inc	Barclays Bank	325,459
31,694	WESCO International Inc	Credit Suisse	113,623
36,880	WESCO International Inc	Goldam Sachs	207,450
41,380	WESCO International Inc	HSBC	148,347
16,876	West Pharmaceutical Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(59,066)
1,160	West Pharmaceutical Services Inc	Barclays Bank	(893)
17,080	West Pharmaceutical Services Inc	Goldam Sachs	(59,780)
9,480	Western Alliance Bancorp	Goldam Sachs	81,054
(47,646)	Western Digital Corp	Bank of America Merrill Lynch	(214,883)
(16,020)	Western Digital Corp	Barclays Bank	(20,826)
(6,260)	Western Digital Corp	Credit Suisse	3,005
(7,490)	Western Digital Corp	Goldam Sachs	(33,780)
(3,810)	Western Digital Corp	HSBC	1,829
(42,316)	Western Digital Corp	JP Morgan	20,312
31,150	Western Union Co	Goldam Sachs	46,881
2,080	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	Goldam Sachs	16,432
(95,880)	Westlake Chemical Corp	Barclays Bank	(266,546)
(40,030)	Westlake Chemical Corp	Goldam Sachs	(330,648)
(640)	Westlake Chemical Corp	HSBC	(2,093)
(17,121)	Westlake Chemical Corp	JP Morgan	(55,986)
(5,050)	Westrock Co	Bank of America Merrill Lynch	(19,443)
(82,370)	Westrock Co	Barclays Bank	(223,223)
(11,490)	Westrock Co	Credit Suisse	(12,179)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(43,230)	Westrock Co	Goldam Sachs	(166,436)
(7,660)	Westrock Co	JP Morgan	(8,120)
(8,835)	WEX Inc	Bank of America Merrill Lynch	(235,011)
(9,180)	WEX Inc	Barclays Bank	(76,837)
(2,650)	WEX Inc	Credit Suisse	(35,749)
(420)	WEX Inc	Goldam Sachs	(11,172)
2,600	Whirlpool Corp	Barclays Bank	754
31,590	Whirlpool Corp	Goldam Sachs	353,492
4,147	White Mountains Insurance Group Ltd	Barclays Bank	(6,988)
593	White Mountains Insurance Group Ltd	Goldam Sachs	22,027
127	White Mountains Insurance Group Ltd	JP Morgan	1,394
(15,650)	Williams Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	(16,120)
(6,200)	Williams Cos Inc	Goldam Sachs	(6,386)
39,170	Williams-Sonoma Inc	Bank of America Merrill Lynch	586,375
7,720	Williams-Sonoma Inc	Barclays Bank	115,800
5,817	Williams-Sonoma Inc	Credit Suisse	76,668
24,520	Williams-Sonoma Inc	Goldam Sachs	367,064
16,075	Williams-Sonoma Inc	HSBC	211,869
23,980	Willis Towers Watson Plc	Barclays Bank	160,906
880	Willis Towers Watson Plc	Citibank	5,905
3,620	Willis Towers Watson Plc	HSBC	28,489
3,630	Willis Towers Watson Plc	JP Morgan	28,568
15,010	Wintrust Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	154,153
8,630	Wintrust Financial Corp	Barclays Bank	39,612
4,830	Wintrust Financial Corp	Goldam Sachs	49,604
2,670	Woodward Inc	Bank of America Merrill Lynch	37,941
13,330	Woodward Inc	Barclays Bank	81,313
1,960	Woodward Inc	Goldam Sachs	27,852
1,950	Workday Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	52,748
16,820	Workday Inc 'A'	Barclays Bank	222,024
3,190	Workday Inc 'A'	Citibank	42,108
1,010	Workday Inc 'A'	Credit Suisse	18,587
900	Workday Inc 'A'	Goldam Sachs	24,345
2,130	Workday Inc 'A'	HSBC	47,313
(97,146)	World Wrestling Entertainment Inc 'A'	Barclays Bank	(132,119)
(20,456)	WPX Energy Inc	Goldam Sachs	(7,773)
(19,240)	WPX Energy Inc	HSBC	2,990
31,067	WR Berkley Corp	Barclays Bank	41,630
3,870	WR Grace & Co	Bank of America Merrill Lynch	17,841
13,950	WR Grace & Co	Barclays Bank	(8,370)
9,310	WR Grace & Co	Goldam Sachs	42,919
9,350	WR Grace & Co	JP Morgan	(6,826)
24,880	Wyndham Destinations Inc	Bank of America Merrill Lynch	204,638
3,150	Wyndham Destinations Inc	Barclays Bank	9,938
30,824	Wyndham Destinations Inc	Credit Suisse	190,030

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
125,335	Wyndham Destinations Inc	Goldam Sachs	1,030,880
21,958	Wyndham Destinations Inc	HSBC	135,371
(36,733)	Wyndham Hotels & Resorts Inc	Bank of America Merrill Lynch	(182,563)
(51,998)	Wyndham Hotels & Resorts Inc	Barclays Bank	43,678
(14,186)	Wyndham Hotels & Resorts Inc	Credit Suisse	(37,309)
(18,240)	Wyndham Hotels & Resorts Inc	Goldam Sachs	(90,653)
(4,940)	Wyndham Hotels & Resorts Inc	JP Morgan	(25,541)
(36,791)	Wynn Resorts Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(154,890)
(1,840)	Wynn Resorts Ltd	Barclays Bank	(6,734)
(35,100)	Wynn Resorts Ltd	Goldam Sachs	(147,771)
(2,290)	Xcel Energy Inc	Barclays Bank	(8,381)
70,659	Xerox Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	88,324
110,390	Xerox Holdings Corp	Barclays Bank	(92,728)
12,310	Xerox Holdings Corp	Citibank	(10,340)
33,110	Xerox Holdings Corp	Credit Suisse	(16,060)
146,780	Xerox Holdings Corp	Goldam Sachs	183,475
20,417	Xerox Holdings Corp	JP Morgan	(40,630)
(2,320)	XPO Logistics Inc	Credit Suisse	(30,018)
(23,940)	XPO Logistics Inc	Goldam Sachs	(312,896)
(93,557)	Xylem Inc	Bank of America Merrill Lynch	(762,490)
(24,540)	Xylem Inc	Goldam Sachs	(200,001)
600	Yum! Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,132
37,507	Yum! Brands Inc	Barclays Bank	107,645
2,201	Yum! Brands Inc	Credit Suisse	8,672
16,940	Yum! Brands Inc	Goldam Sachs	88,427
10,752	Yum! Brands Inc	HSBC	42,363
4,220	Zebra Technologies Corp 'A'	Barclays Bank	61,654
1,500	Zendesk Inc	Bank of America Merrill Lynch	14,475
1,930	Zendesk Inc	Barclays Bank	4,381
1,870	Zendesk Inc	Citibank	4,245
2,900	Zendesk Inc	HSBC	18,357
1,810	Zendesk Inc	JP Morgan	11,457
(6,250)	Zillow Group Inc 'C'	Barclays Bank	(1,813)
(29,458)	Zillow Group Inc 'C'	Credit Suisse	(112,530)
(73,460)	Zillow Group Inc 'C'	Goldam Sachs	(588,415)
(3,910)	Zimmer Biomet Holdings Inc	Goldam Sachs	(58,572)
(2,600)	Zimmer Biomet Holdings Inc	JP Morgan	(14,326)
47,400	Zions Bancorp NA	Barclays Bank	145,044
85,957	Zions Bancorp NA	Credit Suisse	217,471
6,720	Zions Bancorp NA	HSBC	17,002
(4,080)	Zoetis Inc	Barclays Bank	(32,069)
(20,180)	Zoetis Inc	Goldam Sachs	(211,486)
(5,200)	Zoetis Inc	JP Morgan	(65,000)
(44,650)	Zscaler Inc	Goldam Sachs	(678,233)
148,500	Zynga Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	60,143

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
181,140	Zynga Inc 'A'	Barclays Bank	11,774
132,070	Zynga Inc 'A'	Goldam Sachs	53,488
			<u>3,960,959</u>
合計(基礎となるエクスポージャー総額 - 7,122,451,604米ドル)			<u>4,568,937</u>

0.5米ドル未満の投資は端数切捨てにより0と表示されている。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

スワップ 2020年5月31日現在

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現純評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CCIRS	SEK 191,648,000	ファンドは0.450%の固定金利を受け取り、3ヶ月SEK STIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2030	97,244	108,111
CCIRS	GBP 322,107,000	ファンドは0.516%の固定金利を受け取り、6ヶ月GBP LIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2025	4,216,255	4,285,178
CCIRS	USD 16,432,000	ファンドは0.610%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2030	(121,197)	(140,414)
CCIRS	USD 20,135,000	ファンドは0.640%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2030	(115,466)	(112,526)
CCIRS	USD 6,752,500	ファンドは0.675%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2030	(16,566)	(14,445)
CCIRS	USD 13,337,000	ファンドは0.680%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2030	(8,451)	(21,959)
CCIRS	AUD 27,866,000	ファンドは0.879%の固定金利を受け取り、6ヶ月AUD Australia Bank Bill Swap Rateの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2030	(91,344)	(90,971)
CCIRS	CAD 33,958,000	ファンドは0.985%の固定金利を受け取り、3ヶ月CAD Canada Bankers Acceptancesの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2030	(112,496)	(104,245)
CCIRS	USD 26,457,000	ファンドは0.985%の固定金利を受け取り、3ヶ月USD LIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2030	729,477	751,693
CCIRS	AUD 154,567,400	ファンドは1.032%の固定金利を受け取り、6ヶ月AUD Australia Bank Bill Swap Rateの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2030	1,024,040	1,025,942
CCIRS	CAD 46,910,000	ファンドは1.079%の固定金利を受け取り、3ヶ月CAD CDORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2030	165,564	166,228
CCIRS	ZAR 1,068,584,224	ファンドは6.700%の固定金利を受け取り、3ヶ月ZAR JIBARの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2025	3,044,476	3,045,433
CCIRS	AUD 220,136,284	ファンドは6ヶ月AUD Australia Bank Bill Swap Rateの変動金利を受け取り、0.652%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2025	(1,011,221)	(1,009,117)
CCIRS	AUD 59,383,804	ファンドは6ヶ月AUD Australia Bank Bill Swap Rateの変動金利を受け取り、0.685%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2025	(337,379)	(336,809)
CCIRS	AUD 299,818,943	ファンドは6ヶ月AUD Australia Bank Bill Swap Rateの変動金利を受け取り、0.800%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2025	(2,839,567)	(2,836,924)
CCIRS	CAD 39,087,000	ファンドは3ヶ月CAD Canada Bankers Acceptancesの変動金利を受け取り、0.760%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2025	24,621	28,111

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現純評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CCIRS	CAD 142,073,000	ファンドは3ヶ月CAD Canada Bankers Acceptancesの変動金利を受け取り、0.840%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2025	(307,838)	(306,396)
CCIRS	EUR 15,263,500	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、0.080%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2030	(349,415)	(337,014)
CCIRS	EUR 35,892,000	ファンドは6ヶ月EUR EURIBORの変動金利を受け取り、0.160%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2030	(1,147,301)	(1,119,175)
CCIRS	GBP 163,660,500	ファンドは6ヶ月GBP LIBORの変動金利を受け取り、0.607%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2030	(3,875,264)	(3,946,869)
CCIRS	HKD 617,768,538	ファンドは3ヶ月HKD HIBORの変動金利を受け取り、1.003%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2025	177,878	179,023
CCIRS	HKD 152,667,271	ファンドは3ヶ月HKD HIBORの変動金利を受け取り、1.205%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2025	(151,321)	(151,038)
CCIRS	MXN 52,022,000	ファンドは1ヶ月MXN Mexican Interbank Rateの変動金利を受け取り、5.355%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	11/9/2025	(3,917)	(3,883)
CCIRS	PLN 102,856,000	ファンドは6ヶ月PLN WIBORの変動金利を受け取り、0.590%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2025	(132,755)	(132,400)
CCIRS	PLN 348,672,196	ファンドは6ヶ月PLN WIBORの変動金利を受け取り、1.232%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2025	(3,249,419)	(3,248,092)
CCIRS	SEK 377,849,000	ファンドは3ヶ月SEK STIBORの変動金利を受け取り、0.250%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2025	(156,413)	(142,471)
CCIRS	SGD 21,165,600	ファンドは6ヶ月SGD STIBORの変動金利を受け取り、0.890%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2025	(246,001)	(245,787)
CCIRS	SGD 31,748,400	ファンドは6ヶ月SGD STIBORの変動金利を受け取り、0.930%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2025	(414,038)	(413,718)
CCIRS	USD 32,158,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、0.375%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2025	33,393	39,767
CCIRS	USD 72,785,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、0.530%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2025	(542,215)	(472,789)
CCIRS	USD 46,800,000	ファンドは3ヶ月USD LIBORの変動金利を受け取り、0.545%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2025	(339,692)	(339,018)
IRS	EUR 40,630,000	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR LIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2025	354,945	367,927
IRS	EUR 76,211,000	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR LIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2025	889,817	905,480
IRS	EUR 31,397,000	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR LIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2025	(70,566)	(69,348)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現純評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	EUR 41,758,000	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR LIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2025	(62,632)	(61,978)
IRS	EUR 44,845,000	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、6ヶ月EUR LIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2025	(35,985)	(41,977)
IRS	THB 252,450,622	ファンドは0.725%の固定金利を受け取り、6ヶ月THB Thailand Fixing Rateの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2025	(27,862)	(27,862)
IRS	THB 394,858,664	ファンドは0.730%の固定金利を受け取り、6ヶ月THB Thailand Fixing Rateの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2025	(40,538)	(40,538)
IRS	THB 395,056,714	ファンドは0.740%の固定金利を受け取り、6ヶ月THB Thailand Fixing Rateの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2025	(34,475)	(34,475)
IRS	THB 222,770,000	ファンドは0.805%の固定金利を受け取り、6ヶ月THB Thailand Fixing Rateの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2025	2,859	2,859
IRS	AUD 112,875,000	ファンドは0.912%の固定金利を受け取り、6ヶ月AUD Australia Bank Bill Swap Rateの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2030	(127,418)	(127,418)
IRS	KRW 15,400,009,167	ファンドは0.950%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KSDAの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2025	85,718	85,718
IRS	KRW 33,023,535,200	ファンドは0.970%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KSDAの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2025	209,895	209,895
IRS	KRW 15,590,330,035	ファンドは0.998%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KSDAの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2025	116,330	116,330
IRS	CNY 59,053,000	ファンドは3ヶ月CNY 7D China Fixing Repo Ratesの変動金利を受け取り、2.038%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2025	(15,916)	(15,916)
IRS	EUR 13,160,000	ファンドは6ヶ月EUR LIBORの変動金利を受け取り、0.000%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2030	(157,600)	(157,311)
IRS	EUR 12,744,000	ファンドは6ヶ月EUR LIBORの変動金利を受け取り、0.000%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2030	2,305	4,156
IRS	EUR 18,259,000	ファンドは6ヶ月EUR LIBORの変動金利を受け取り、0.000%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2030	33,746	34,145
IRS	EUR 22,406,000	ファンドは6ヶ月EUR LIBORの変動金利を受け取り、0.000%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2030	50,379	55,411
IRS	INR 1,205,248,500	ファンドは3ヶ月INR KSDAの変動金利を受け取り、4.230%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2025	(73,049)	(73,049)
IRS	INR 2,421,025,760	ファンドは3ヶ月INR MIBORの変動金利を受け取り、3.910%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/9/2025	309,154	309,154
IRS	KRW 30,037,790,479	ファンドは0.898%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KSDAの変動金利を支払う	BNP Paribas	16/9/2025	105,510	105,510

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現純評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	KRW 44,402,835,804	ファンドは0.907%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KSDAの変動金利を支払う	BNP Paribas	16/9/2025	171,750	171,750
IRS	KRW 16,567,987,005	ファンドは0.960%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KSDAの変動金利を支払う	Citibank	16/9/2025	98,762	98,762
IRS	KRW 67,085,456,745	ファンドは0.941%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KSDAの変動金利を支払う	Goldman Sachs	16/9/2025	349,562	349,562
IRS	KRW 33,506,721,662	ファンドは0.949%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KSDAの変動金利を支払う	HSBC	16/9/2025	184,914	184,914
IRS	KRW 7,110,685,379	ファンドは1.049%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KSDAの変動金利を支払う	HSBC	16/9/2025	67,379	67,379
IRS	INR 1,205,248,500	ファンドは3ヶ月INR KSDAの変動金利を受け取り、4.230%の固定金利を支払う	HSBC	16/9/2025	(73,049)	(73,049)
IRS	INR 1,139,306,240	ファンドは3ヶ月INR MIBORの変動金利を受け取り、3.985%の固定金利を支払う	HSBC	16/9/2025	95,202	95,202
IRS	INR 2,095,606,000	ファンドは3ヶ月INR MIBORの変動金利を受け取り、4.160%の固定金利を支払う	HSBC	16/9/2025	(40,691)	(40,691)
IRS	KRW 15,447,823,860	ファンドは0.942%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KSDAの変動金利を支払う	JP Morgan	16/9/2025	81,409	81,409
IRS	KRW 15,796,938,380	ファンドは0.992%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KSDAの変動金利を支払う	JP Morgan	16/9/2025	114,440	114,440
IRS	KRW 16,273,741,763	ファンドは0.998%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KSDAの変動金利を支払う	JP Morgan	16/9/2025	121,108	121,108
IRS	KRW 10,849,161,175	ファンドは1.005%の固定金利を受け取り、3ヶ月KRW KSDAの変動金利を支払う	JP Morgan	16/9/2025	83,952	83,952
TRS	BRL 59	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、Ibovespa Indexを支払う	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2020	(87,855)	(87,855)
TRS	BRL 221	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、Ibovespa Indexを支払う	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2020	(220,339)	(220,339)
TRS	KRW 324,250,000	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、KOSPI 200 Indexを支払う	Bank of America Merrill Lynch	11/6/2020	(827,899)	(827,899)
TRS	KRW 64,250,000	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、KOSPI 200 Indexを支払う	Bank of America Merrill Lynch	11/6/2020	(806,371)	(806,371)
TRS	TWD 544,800	ファンドはTAIEX Indexを受け取り、0.000%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2020	3,905,948	3,905,948
TRS	TWD 13,800	ファンドはTAIEX Indexを受け取り、0.000%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2020	(22,654)	(22,654)
TRS	THB 246,200	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、SET50 Futures Indexを支払う	Credit Suisse	29/6/2020	(285,986)	(285,986)
TRS	THB 404,200	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、SET50 Futures Indexを支払う	Credit Suisse	29/6/2020	(351,674)	(351,674)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現純評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
TRS	THB 82,200	ファンドは0.000%の固定金利を受 け取り、SET50 Futures Indexを支 払う	Credit Suisse	29/6/2020	(14,980)	(14,980)
TRS	PLN 38,640	ファンドは0.000%の固定金利を受 け取り、WIG20 Indexを支払う	JP Morgan	19/6/2020	(2,986,360)	(2,986,360)
合計(基礎となるエクスポージャー総額 - 3,139,746,671米ドル)					(4,985,143)	(4,793,293)

CCIRS：中央決済機関で決済される金利スワップ

IRS：金利スワップ

TRS：トータル・リターン・スワップ

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

先物取引 2020年5月31日現在

契約数	契約通貨	契約 / 摘要	満期日	基礎となるエクス ポージャー総額 (米ドル)	未実現評価益/ (損) (米ドル)
205	EUR	Amsterdam Index Futures June 2020	2020年6月	24,313,121	885,339
243	AUD	Australian 10 Year Bond Futures June 2020	2020年6月	24,025,640	124,573
2,032	EUR	CAC 40 Index Futures June 2020	2020年6月	106,647,571	7,399,676
7,338	CAD	Canadian 10 Year Bond Futures September 2020	2020年9月	818,369,857	434,053
(95)	EUR	DAX Index Futures June 2020	2020年6月	30,739,858	(2,063,559)
(579)	USD	E-Mini S&P 500 Index Futures June 2020	2020年6月	87,495,585	(13,223,918)
(963)	EUR	Euro Bund Futures June 2020	2020年6月	184,543,028	340,129
(1,852)	GBP	FTSE 100 Index Futures June 2020	2020年6月	139,823,388	(5,848,482)
175	EUR	FTSE MIB Index Futures June 2020	2020年6月	17,732,128	863,086
(5,228)	ZAR	FTSE/JSE Top 40 Index Futures June 2020	2020年6月	139,532,684	(15,087,364)
1,270	HKD	Hang Seng China Enterprises Futures June 2020	2020年6月	77,758,277	627,158
452	HKD	Hang Seng Index Futures June 2020	2020年6月	66,356,672	(122,460)
2,106	EUR	IBEX 35 Index Futures June 2020	2020年6月	166,312,273	8,840,703
134	JPY	Japan 10 Year Bond Futures June 2020	2020年6月	189,604,425	(317,575)
220	SGD	MSCI Singapore Index Futures June 2020	2020年6月	4,481,856	(47,315)
(10,346)	SEK	OMX Stockholm 30 Index Futures June 2020	2020年6月	178,908,833	(11,140,673)
(390)	CAD	S&P/TSX 60 Index Futures June 2020	2020年6月	51,937,711	(2,120,567)
(1,142)	USD	SGX NIFTY 50 Futures June 2020	2020年6月	21,729,976	(1,096,708)
(1,195)	AUD	SPI 200 Index Futures June 2020	2020年6月	113,991,375	(5,713,650)
1,053	CHF	Swiss Market Index Futures June 2020	2020年6月	108,044,010	10,131,502
180	JPY	Topix Index Futures June 2020	2020年6月	26,088,412	1,063,979
(1,217)	GBP	UK Long Gilt Bond Futures September 2020	2020年9月	206,354,491	538,592
(2,524)	USD	US Treasury 10 Year Note Futures September 2020	2020年9月	350,441,625	165,592
合計				3,135,232,796	(25,367,889)

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

未決済先渡為替予約 2020年5月31日現在

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	11,892,000	USD	7,690,460	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2020	202,378
AUD	18,586,572	USD	11,863,490	Barclays Bank	17/6/2020	472,601
AUD	1,834,000	USD	1,204,747	BNP Paribas	17/6/2020	12,497
AUD	11,594,000	USD	7,623,063	Citibank	17/6/2020	71,990
AUD	30,779,230	USD	18,722,698	Deutsche Bank	17/6/2020	1,705,783
AUD	46,525,000	USD	27,902,345	Goldman Sachs	17/6/2020	2,976,759
AUD	117,369,034	USD	72,556,892	JP Morgan	17/6/2020	5,342,101
AUD	40,677,663	USD	24,974,773	Morgan Stanley	17/6/2020	2,023,396
AUD	11,887,000	USD	7,687,666	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2020	201,760
AUD	18,580,605	USD	11,859,933	Barclays Bank	15/7/2020	472,051
AUD	1,831,000	USD	1,202,819	BNP Paribas	15/7/2020	12,420
AUD	11,592,000	USD	7,622,000	Citibank	15/7/2020	71,634
AUD	53,886,395	USD	34,157,735	JP Morgan	15/7/2020	1,606,776
AUD	9,806,000	USD	6,464,507	Morgan Stanley	15/7/2020	43,755
AUD	7,612,000	USD	4,898,893	Bank of America Merrill Lynch	19/8/2020	153,036
AUD	1,831,000	USD	1,202,846	BNP Paribas	19/8/2020	12,351
AUD	11,592,000	USD	7,622,164	Citibank	19/8/2020	71,210
AUD	9,806,000	USD	6,464,558	Morgan Stanley	19/8/2020	43,484
BRL	44,439,000	USD	8,661,770	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2020	(489,331)
BRL	16,035,000	USD	3,416,427	Barclays Bank	17/6/2020	(467,552)
BRL	48,395,000	USD	9,599,961	Citibank	17/6/2020	(700,006)
BRL	46,542,000	USD	8,579,171	Deutsche Bank	17/6/2020	(19,986)
BRL	45,002,000	USD	9,364,385	Goldman Sachs	17/6/2020	(1,088,410)
BRL	161,635,000	USD	30,424,815	HSBC	17/6/2020	(699,753)
BRL	105,307,000	USD	19,203,253	JP Morgan	17/6/2020	162,956
BRL	162,592,000	USD	32,660,909	Morgan Stanley	17/6/2020	(2,759,852)
BRL	46,603,000	USD	8,577,766	Deutsche Bank	15/7/2020	(21,362)
BRL	131,741,000	USD	24,468,329	HSBC	15/7/2020	(280,419)
BRL	81,936,000	USD	14,691,067	JP Morgan	15/7/2020	352,545
BRL	30,873,000	USD	5,656,675	Morgan Stanley	15/7/2020	11,669
BRL	32,242,000	USD	5,431,604	HSBC	19/8/2020	479,670
CAD	24,495,606	USD	17,395,107	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2020	388,418
CAD	77,200,699	USD	55,633,008	BNP Paribas	17/6/2020	413,803
CAD	40,852,797	USD	29,071,711	Goldman Sachs	17/6/2020	586,944
CAD	400,849,947	USD	292,546,295	JP Morgan	17/6/2020	(1,533,888)
CAD	142,840,000	USD	101,877,110	Morgan Stanley	17/6/2020	1,823,070
CAD	11,543,301	USD	8,336,680	Societe Generale	17/6/2020	43,622
CAD	43,843,000	USD	31,436,748	UBS	17/6/2020	392,761
CAD	17,469,683	USD	12,450,678	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2020	232,224
CAD	42,993,000	USD	30,718,233	BNP Paribas	15/7/2020	494,469
CAD	138,754,253	USD	98,120,957	Goldman Sachs	15/7/2020	2,613,934
CAD	34,231,274	USD	24,398,401	JP Morgan	15/7/2020	453,332
CAD	143,736,030	USD	102,471,474	Citibank	19/8/2020	1,880,161

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)
CHF	8,155,000	EUR	7,703,607	Deutsche Bank	17/6/2020	(98,720)
CHF	4,832,000	EUR	4,576,096	JP Morgan	17/6/2020	(71,346)
CHF	20,934,000	USD	21,827,564	Barclays Bank	17/6/2020	(85,457)
CHF	8,462,000	USD	8,755,294	JP Morgan	17/6/2020	33,362
CLP	1,950,454,000	USD	2,360,182	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2020	55,586
CLP	5,094,948,000	USD	6,309,768	Barclays Bank	17/6/2020	666
CLP	8,062,562,000	USD	9,575,257	Citibank	17/6/2020	410,764
CLP	16,439,145,000	USD	19,891,073	Credit Suisse	17/6/2020	469,906
CLP	9,420,276,000	USD	11,337,887	Deutsche Bank	17/6/2020	329,754
CLP	2,345,807,000	USD	2,754,911	Goldman Sachs	17/6/2020	150,527
CLP	3,808,795,000	USD	4,446,929	HSBC	17/6/2020	270,518
CLP	23,250,719,000	USD	27,519,599	JP Morgan	17/6/2020	1,277,970
CLP	8,703,770,000	USD	10,149,431	Morgan Stanley	17/6/2020	630,770
CLP	1,948,735,000	USD	2,359,300	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2020	54,368
CLP	5,092,626,000	USD	6,309,783	Barclays Bank	15/7/2020	(2,148)
CLP	3,261,834,000	USD	3,985,234	Citibank	15/7/2020	54,815
CLP	9,439,805,000	USD	11,493,186	Credit Suisse	15/7/2020	198,786
CLP	3,424,377,000	USD	4,157,614	Deutsche Bank	15/7/2020	83,758
CLP	2,072,414,000	USD	2,459,839	Morgan Stanley	15/7/2020	107,016
CLP	5,088,753,000	USD	6,309,675	Barclays Bank	19/8/2020	(5,750)
CLP	4,890,500,000	USD	5,997,449	Credit Suisse	19/8/2020	60,881
CLP	3,422,901,000	USD	4,157,437	Deutsche Bank	19/8/2020	82,838
CLP	3,260,334,000	USD	3,985,982	Goldman Sachs	19/8/2020	52,905
EUR	2,784,821	CHF	2,942,164	Deutsche Bank	17/6/2020	41,746
EUR	11,593,442	CHF	12,209,500	Morgan Stanley	17/6/2020	214,270
EUR	13,194,119	CHF	13,934,836	UBS	17/6/2020	202,722
EUR	15,623,479	USD	16,960,360	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2020	417,234
EUR	196,636,752	USD	218,610,077	Barclays Bank	17/6/2020	103,930
EUR	30,676,000	USD	33,410,142	BNP Paribas	17/6/2020	709,985
EUR	7,596,521	USD	8,229,060	Deutsche Bank	17/6/2020	220,355
EUR	28,358,000	USD	31,294,726	JP Morgan	17/6/2020	247,149
EUR	15,607,784	USD	16,955,869	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2020	414,545
EUR	20,019,000	USD	21,751,244	BNP Paribas	15/7/2020	528,556
EUR	25,000,000	USD	27,487,860	Citibank	15/7/2020	335,457
EUR	7,589,216	USD	8,226,187	Deutsche Bank	15/7/2020	220,100
EUR	39,095,069	USD	42,340,972	JP Morgan	15/7/2020	1,169,208
EUR	50,659,896	USD	54,869,592	Barclays Bank	19/8/2020	1,553,808
GBP	44,339,080	USD	56,898,346	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2020	(2,134,331)
GBP	13,000,000	USD	16,179,131	Barclays Bank	17/6/2020	(122,591)
GBP	4,692,000	USD	5,844,881	BNP Paribas	17/6/2020	(49,705)
GBP	38,208,433	USD	47,081,762	Deutsche Bank	17/6/2020	110,177
GBP	3,242,420	USD	3,958,213	Goldman Sachs	17/6/2020	46,559
GBP	3,292,630	USD	4,258,852	HSBC	17/6/2020	(192,064)
GBP	5,559,067	USD	6,829,926	JP Morgan	17/6/2020	36,180

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	14,217,000	USD	17,377,483	Morgan Stanley	17/6/2020	182,196
GBP	1,354,000	USD	1,665,955	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2020	6,602
GBP	4,690,000	USD	5,843,187	BNP Paribas	15/7/2020	(49,767)
GBP	20,919,329	USD	26,056,341	Deutsche Bank	15/7/2020	(215,307)
GBP	1,673,671	USD	2,068,362	JP Morgan	15/7/2020	(926)
GBP	14,211,000	USD	17,372,415	Morgan Stanley	15/7/2020	182,016
GBP	22,814,270	USD	28,134,186	JP Morgan	19/8/2020	51,348
GBP	14,209,000	USD	17,372,287	Morgan Stanley	19/8/2020	182,001
HKD	28,499,943	USD	3,674,263	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2020	(115)
HKD	32,344,057	USD	4,169,983	Deutsche Bank	17/6/2020	(261)
HKD	49,324,000	USD	6,359,426	HSBC	17/6/2020	(688)
HUF	4,170,105,591	USD	12,761,428	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2020	547,905
HUF	622,442,000	USD	1,898,521	Barclays Bank	17/6/2020	88,069
HUF	15,224,543,464	USD	48,900,444	BNP Paribas	17/6/2020	(309,703)
HUF	6,546,994,422	USD	20,447,081	Credit Suisse	17/6/2020	448,346
HUF	495,949,000	USD	1,610,625	JP Morgan	17/6/2020	(27,751)
HUF	8,093,560,522	USD	24,764,162	Societe Generale	17/6/2020	1,067,293
HUF	2,060,132,039	USD	6,296,311	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2020	277,618
HUF	622,454,000	USD	1,897,987	Barclays Bank	15/7/2020	88,279
HUF	1,820,396,223	USD	5,510,923	BNP Paribas	15/7/2020	298,004
HUF	4,663,978,000	USD	14,561,915	Credit Suisse	15/7/2020	320,948
HUF	4,423,277,738	USD	13,335,236	Societe Generale	15/7/2020	779,547
HUF	1,079,325,000	USD	3,401,958	Credit Suisse	19/8/2020	41,052
INR	4,274,571,350	USD	56,820,037	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2020	(361,248)
INR	11,691,925,000	USD	155,483,817	HSBC	17/6/2020	(1,056,187)
INR	1,378,221,000	USD	17,678,566	JP Morgan	17/6/2020	525,058
INR	6,855,532,570	USD	87,443,017	Barclays Bank	15/7/2020	2,822,354
INR	148,441,000	USD	1,908,882	Goldman Sachs	15/7/2020	45,610
INR	4,403,800,740	USD	57,423,403	Morgan Stanley	19/8/2020	346,193
JPY	4,045,591,042	USD	38,104,517	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2020	(486,490)
JPY	1,074,547,000	USD	9,984,538	BNP Paribas	17/6/2020	7,163
JPY	1,918,067,000	USD	17,910,661	Citibank	17/6/2020	(75,470)
JPY	1,225,469,870	USD	11,755,309	Goldman Sachs	17/6/2020	(360,249)
JPY	1,465,202,605	USD	13,767,695	JP Morgan	17/6/2020	(143,474)
JPY	2,132,368,353	USD	19,872,759	Morgan Stanley	17/6/2020	(44,880)
JPY	2,442,679,957	USD	22,746,286	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2020	(22,988)
JPY	1,073,509,000	USD	9,981,348	BNP Paribas	15/7/2020	5,087
JPY	1,022,062,000	USD	9,534,479	Citibank	15/7/2020	(26,635)
JPY	675,010,596	USD	6,322,767	JP Morgan	15/7/2020	(43,407)
JPY	1,375,486,447	USD	12,798,888	Morgan Stanley	15/7/2020	(3,274)
JPY	1,605,464,105	USD	14,916,553	Bank of America Merrill Lynch	19/8/2020	26,525
JPY	1,021,416,000	USD	9,534,128	Citibank	19/8/2020	(27,157)
JPY	1,077,648,895	USD	10,016,236	Morgan Stanley	19/8/2020	14,130

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)
KRW	67,593,142,000	USD	55,020,080	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2020	(385,059)
KRW	7,797,970,260	USD	6,292,456	Citibank	17/6/2020	10,583
KRW	39,925,858,740	USD	32,564,769	HSBC	17/6/2020	(293,001)
KRW	8,203,640,000	USD	6,751,967	JP Morgan	17/6/2020	(121,027)
KRW	28,429,043,000	USD	23,194,544	Morgan Stanley	17/6/2020	(215,565)
KRW	11,208,683,000	USD	9,206,139	UBS	17/6/2020	(146,246)
KRW	14,543,946,000	USD	11,980,882	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2020	(223,004)
KRW	2,109,608,000	USD	1,738,115	Citibank	15/7/2020	(32,628)
KRW	20,691,916,000	USD	16,972,863	HSBC	15/7/2020	(244,732)
KRW	1,267,057,000	USD	1,039,764	Morgan Stanley	15/7/2020	(15,428)
MXN	113,305,552	USD	4,667,984	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2020	442,305
MXN	947,055,000	USD	47,177,016	HSBC	17/6/2020	(4,463,091)
MXN	814,116,688	USD	38,455,808	JP Morgan	17/6/2020	(1,737,646)
MXN	173,994,000	USD	7,888,143	UBS	17/6/2020	(40,693)
MXN	113,709,000	USD	4,665,682	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2020	441,128
MXN	2,439,200	USD	97,384	Citibank	15/7/2020	12,163
MXN	39,405,000	USD	1,740,668	JP Morgan	15/7/2020	29,057
MXN	88,306,900	USD	3,601,174	Bank of America Merrill Lynch	19/8/2020	345,079
MXN	39,596,100	USD	1,740,483	JP Morgan	19/8/2020	28,984
NOK	26,873,836	USD	2,582,357	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2020	183,370
NOK	704,387,404	USD	67,587,002	Credit Suisse	17/6/2020	4,905,166
NOK	932,610,977	USD	86,741,166	Deutsche Bank	17/6/2020	9,238,677
NOK	730,463,000	USD	72,757,163	JP Morgan	17/6/2020	2,418,581
NOK	106,066,283	USD	10,089,514	Morgan Stanley	17/6/2020	826,319
NOK	26,861,913	USD	2,581,657	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2020	183,440
NOK	253,848,770	USD	24,381,103	Barclays Bank	15/7/2020	1,749,445
NOK	145,190,000	USD	13,763,005	Credit Suisse	15/7/2020	1,182,485
NOK	208,525,573	USD	20,007,203	Deutsche Bank	15/7/2020	1,457,890
NOK	86,786,514	USD	8,336,406	Morgan Stanley	15/7/2020	597,178
NZD	19,984,057	USD	11,979,610	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2020	416,876
NZD	664,902	USD	401,687	Barclays Bank	17/6/2020	10,764
NZD	60,454,832	USD	36,191,820	BNP Paribas	17/6/2020	1,309,449
NZD	8,632,733	USD	5,161,571	Citibank	17/6/2020	193,475
NZD	14,968,000	USD	9,456,922	Credit Suisse	17/6/2020	(171,991)
NZD	48,790,040	USD	30,678,861	Deutsche Bank	17/6/2020	(413,483)
NZD	11,692,143	USD	7,034,384	Goldman Sachs	17/6/2020	218,471
NZD	14,662,831	USD	8,707,156	HSBC	17/6/2020	388,474
NZD	49,679,404	USD	29,251,678	JP Morgan	17/6/2020	1,565,389
NZD	7,803,098	USD	4,709,248	Morgan Stanley	17/6/2020	131,161
NZD	14,418,301	USD	8,671,442	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2020	271,074
NZD	35,205,941	USD	21,200,754	BNP Paribas	15/7/2020	634,666
NZD	8,631,622	USD	5,160,113	Citibank	15/7/2020	193,389
NZD	11,691,388	USD	7,032,267	Goldman Sachs	15/7/2020	218,963

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)
NZD	103,570,588	USD	60,809,270	JP Morgan	15/7/2020	3,427,255
NZD	19,486,897	USD	11,727,348	BNP Paribas	19/8/2020	355,950
NZD	8,633,103	USD	5,159,980	Citibank	19/8/2020	193,174
NZD	126,294,600	USD	76,726,495	Morgan Stanley	19/8/2020	1,585,374
PLN	36,925,885	USD	8,817,907	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2020	421,404
PLN	8,309,000	USD	1,972,824	Citibank	17/6/2020	106,190
PLN	57,019,000	USD	13,620,765	Credit Suisse	17/6/2020	646,090
PLN	14,077,737	USD	3,333,113	Deutsche Bank	17/6/2020	189,310
PLN	248,971,220	USD	64,735,107	HSBC	17/6/2020	(2,439,445)
PLN	4,933,378	USD	1,178,768	Societe Generale	17/6/2020	55,624
PLN	29,025,277	USD	6,899,140	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2020	363,071
PLN	105,058,440	USD	24,756,516	Citibank	15/7/2020	1,529,422
PLN	41,607,000	USD	9,948,385	Credit Suisse	15/7/2020	461,812
PLN	14,073,390	USD	3,331,942	Deutsche Bank	15/7/2020	189,263
PLN	4,932,333	USD	1,178,433	Societe Generale	15/7/2020	55,651
PLN	15,068,127	USD	3,567,079	Bank of America Merrill Lynch	19/8/2020	203,059
PLN	115,578,310	USD	27,393,100	Citibank	19/8/2020	1,525,301
PLN	14,073,873	USD	3,331,993	Deutsche Bank	19/8/2020	189,376
RUB	5,244,809,000	USD	71,594,558	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2020	2,535,708
RUB	4,881,188,600	USD	66,775,891	Goldman Sachs	17/6/2020	2,214,955
RUB	464,986,000	USD	6,304,895	HSBC	17/6/2020	267,229
RUB	232,490,000	USD	3,149,418	JP Morgan	17/6/2020	136,602
RUB	233,425,000	USD	3,149,497	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2020	137,505
RUB	2,487,201,490	USD	31,965,207	Goldman Sachs	15/7/2020	3,058,618
RUB	466,855,000	USD	6,307,036	HSBC	15/7/2020	267,038
RUB	233,425,000	USD	3,150,518	JP Morgan	15/7/2020	136,484
RUB	2,519,544,600	USD	33,856,201	JP Morgan	19/8/2020	1,472,802
SEK	27,912,000	USD	2,897,895	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2020	56,422
SEK	420,335,921	USD	41,771,179	Barclays Bank	17/6/2020	2,718,843
SEK	11,717,000	USD	1,219,132	Citibank	17/6/2020	21,042
SEK	955,307,500	USD	96,451,875	Credit Suisse	17/6/2020	4,661,661
SEK	149,311,530	USD	14,989,442	Deutsche Bank	17/6/2020	814,284
SEK	159,864,000	USD	16,885,779	Goldman Sachs	17/6/2020	34,861
SEK	399,247,000	USD	40,998,670	HSBC	17/6/2020	1,259,217
SEK	208,812,000	USD	21,911,312	JP Morgan	17/6/2020	190,178
SEK	117,376,549	USD	11,679,229	Morgan Stanley	17/6/2020	744,370
SEK	27,895,000	USD	2,896,942	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2020	56,354
SEK	24,975,786	USD	2,492,176	Barclays Bank	15/7/2020	152,058
SEK	11,710,000	USD	1,218,719	Citibank	15/7/2020	21,041
SEK	676,878,000	USD	68,440,793	Credit Suisse	15/7/2020	3,221,552
SEK	65,547,000	USD	6,643,625	Deutsche Bank	15/7/2020	295,959
SEK	11,455,000	USD	1,169,282	Goldman Sachs	15/7/2020	43,480
SEK	65,095,000	USD	6,775,067	JP Morgan	15/7/2020	116,663

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)
SEK	33,434,214	USD	3,334,766	Morgan Stanley	15/7/2020	204,977
SEK	27,890,000	USD	2,897,295	Bank of America Merrill Lynch	19/8/2020	56,408
SEK	11,706,000	USD	1,218,691	Citibank	19/8/2020	21,038
SEK	210,709,000	USD	21,752,484	Credit Suisse	19/8/2020	562,746
SEK	65,070,000	USD	6,774,566	JP Morgan	19/8/2020	116,701
SGD	61,840,000	USD	44,889,500	Barclays Bank	17/6/2020	(1,144,638)
SGD	2,929,000	USD	2,021,659	BNP Paribas	17/6/2020	50,280
SGD	2,728,500	USD	1,920,592	Goldman Sachs	17/6/2020	9,515
SGD	144,285,200	USD	103,874,790	JP Morgan	17/6/2020	(1,809,199)
SGD	22,553,990	USD	15,730,873	Societe Generale	15/7/2020	224,904
THB	10,769,243	USD	330,598	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2020	7,929
THB	451,275,000	USD	13,822,379	BNP Paribas	17/6/2020	363,292
THB	91,785,757	USD	2,818,800	Deutsche Bank	17/6/2020	66,453
THB	1,146,461,000	USD	35,346,436	HSBC	17/6/2020	692,161
THB	219,157,000	USD	6,842,491	JP Morgan	17/6/2020	46,631
THB	1,503,708,500	USD	47,087,830	Morgan Stanley	17/6/2020	180,717
THB	2,541,588,000	USD	78,876,815	Standard Chartered Bank	17/6/2020	1,017,106
THB	351,580,000	USD	10,752,442	BNP Paribas	15/7/2020	298,363
THB	565,698,000	USD	17,662,164	HSBC	15/7/2020	118,762
THB	342,900,000	USD	10,481,903	Morgan Stanley	15/7/2020	296,073
THB	2,416,954,000	USD	75,036,682	Standard Chartered Bank	15/7/2020	932,616
THB	1,263,444,070	USD	39,341,857	BNP Paribas	19/8/2020	366,569
THB	179,565,000	USD	5,642,262	HSBC	19/8/2020	1,235
THB	921,005,000	USD	28,815,297	Standard Chartered Bank	19/8/2020	130,708
TWD	2,749,258,000	USD	92,560,587	Credit Suisse	17/6/2020	(937,907)
TWD	237,070,000	USD	7,970,079	HSBC	17/6/2020	(69,406)
TWD	1,182,738,000	USD	39,757,656	JP Morgan	17/6/2020	(341,339)
TWD	384,770,000	USD	12,920,416	Standard Chartered Bank	17/6/2020	(97,444)
TWD	935,578,000	USD	31,492,892	Credit Suisse	15/7/2020	(247,919)
TWD	37,668,170	USD	1,262,127	Goldman Sachs	15/7/2020	(4,144)
TWD	231,046,000	USD	7,806,927	JP Morgan	15/7/2020	(90,813)
TWD	165,187,000	USD	5,567,100	Credit Suisse	19/8/2020	(35,038)
TWD	291,081,340	USD	9,879,555	HSBC	19/8/2020	(131,331)
USD	71,120,785	AUD	112,676,499	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2020	(3,663,726)
USD	45,568,815	AUD	69,700,000	Barclays Bank	17/6/2020	(691,767)
USD	30,509,152	AUD	48,976,974	BNP Paribas	17/6/2020	(1,997,351)
USD	45,022,534	AUD	71,431,148	Deutsche Bank	17/6/2020	(2,387,027)
USD	57,956,085	AUD	89,799,727	Goldman Sachs	17/6/2020	(1,644,885)
USD	37,617,246	AUD	58,810,602	JP Morgan	17/6/2020	(1,415,937)
USD	47,283,908	AUD	73,975,706	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2020	(1,813,920)
USD	13,968,535	AUD	21,873,000	BNP Paribas	15/7/2020	(548,620)
USD	4,793,943	AUD	7,548,043	Goldman Sachs	15/7/2020	(215,708)
USD	19,013,614	AUD	29,964,251	JP Morgan	15/7/2020	(873,721)

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)
USD	80,634,488	AUD	134,648,620	Morgan Stanley	15/7/2020	(8,732,077)
USD	113,186,216	AUD	174,841,150	Bank of America Merrill Lynch	19/8/2020	(2,852,286)
USD	109,538,046	BRL	515,507,950	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2020	14,734,904
USD	7,006,855	BRL	37,604,000	Citibank	17/6/2020	91,390
USD	19,536,132	BRL	90,970,000	Goldman Sachs	17/6/2020	2,806,532
USD	5,713,936	BRL	30,385,000	Citibank	15/7/2020	135,190
USD	1,289,846	BRL	7,258,000	Goldman Sachs	15/7/2020	(42,737)
USD	53,564,145	BRL	284,693,430	HSBC	15/7/2020	1,293,865
USD	3,171,892	BRL	18,433,450	Bank of America Merrill Lynch	19/8/2020	(207,712)
USD	1,000,000	BRL	5,626,880	BNP Paribas	19/8/2020	(31,637)
USD	5,714,044	BRL	30,433,000	Citibank	19/8/2020	134,434
USD	292,351	BRL	1,645,120	Morgan Stanley	19/8/2020	(9,266)
USD	1,090,741	CAD	1,517,409	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2020	(10,880)
USD	4,100,854	CAD	5,703,591	BNP Paribas	17/6/2020	(39,887)
USD	96,605,448	CAD	137,804,605	Citibank	17/6/2020	(3,439,095)
USD	36,266,122	CAD	50,338,264	Deutsche Bank	17/6/2020	(278,873)
USD	89,089,281	CAD	125,456,611	Goldman Sachs	17/6/2020	(1,990,760)
USD	120,164,755	CAD	170,830,519	JP Morgan	17/6/2020	(3,856,220)
USD	84,454,177	CAD	118,084,000	Morgan Stanley	17/6/2020	(1,273,436)
USD	1,090,327	CAD	1,516,779	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2020	(10,847)
USD	4,099,283	CAD	5,701,221	BNP Paribas	15/7/2020	(39,775)
USD	13,632,837	CAD	19,139,705	Deutsche Bank	15/7/2020	(262,493)
USD	27,206,283	CAD	38,007,318	Goldman Sachs	15/7/2020	(386,839)
USD	16,428,655	CAD	23,056,977	JP Morgan	15/7/2020	(310,594)
USD	8,053,135	CAD	11,203,000	Morgan Stanley	15/7/2020	(80,187)
USD	1,090,353	CAD	1,516,779	Bank of America Merrill Lynch	19/8/2020	(10,820)
USD	4,099,548	CAD	5,701,221	BNP Paribas	19/8/2020	(39,510)
USD	4,842,687	CAD	6,677,000	Goldman Sachs	19/8/2020	(4,781)
USD	8,053,530	CAD	11,203,000	Morgan Stanley	19/8/2020	(79,792)
USD	15,839,153	CHF	14,693,000	Citibank	17/6/2020	578,965
USD	6,812,946	CHF	6,456,000	JP Morgan	17/6/2020	107,727
USD	59,208,755	CLP	49,359,379,000	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2020	(1,926,133)
USD	4,360,622	CLP	3,770,630,000	Barclays Bank	17/6/2020	(309,555)
USD	53,403,205	CLP	43,875,005,000	Citibank	17/6/2020	(938,920)
USD	37,228,744	CLP	30,947,786,000	Credit Suisse	17/6/2020	(1,102,158)
USD	2,373,458	CLP	1,969,970,000	JP Morgan	17/6/2020	(66,482)
USD	8,134,902	CLP	6,874,582,000	Credit Suisse	15/7/2020	(379,832)
USD	80,426,627	CLP	69,200,678,500	Goldman Sachs	15/7/2020	(5,284,092)
USD	82,331,871	CLP	67,523,660,500	Goldman Sachs	19/8/2020	(1,316,143)
USD	22,981,581	EUR	21,176,405	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2020	(572,390)
USD	30,543,260	EUR	27,707,000	Barclays Bank	17/6/2020	(274,523)
USD	65,391,821	EUR	59,950,916	BNP Paribas	17/6/2020	(1,290,041)
USD	31,557,861	EUR	28,592,000	Citibank	17/6/2020	(244,286)

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)
USD	49,374,094	EUR	44,269,500	Deutsche Bank	17/6/2020	134,267
USD	101,685,847	EUR	91,448,000	Goldman Sachs	17/6/2020	(29,413)
USD	18,077,876	EUR	16,648,595	HSBC	17/6/2020	(439,928)
USD	23,350,394	EUR	20,841,084	JP Morgan	17/6/2020	169,391
USD	6,003,344	EUR	5,450,000	Morgan Stanley	17/6/2020	(58,551)
USD	3,245,433	EUR	2,940,000	UBS	17/6/2020	(24,653)
USD	19,382,703	EUR	17,848,000	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2020	(480,921)
USD	65,373,751	EUR	59,895,905	BNP Paribas	15/7/2020	(1,286,362)
USD	1,076,713	EUR	991,095	JP Morgan	15/7/2020	(26,309)
USD	1,545,802	EUR	1,403,000	UBS	15/7/2020	(15,643)
USD	34,924,672	EUR	31,815,000	BNP Paribas	19/8/2020	(509,875)
USD	1,545,856	EUR	1,402,000	UBS	19/8/2020	(15,647)
USD	16,633,473	GBP	14,224,412	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2020	(935,361)
USD	31,489,129	GBP	24,384,000	Barclays Bank	17/6/2020	1,372,002
USD	12,909,233	GBP	10,384,000	BNP Paribas	17/6/2020	83,763
USD	7,237,259	GBP	5,819,000	Deutsche Bank	17/6/2020	50,105
USD	18,639,410	GBP	15,059,000	Goldman Sachs	17/6/2020	39,762
USD	32,574,272	GBP	27,039,588	JP Morgan	17/6/2020	(822,822)
USD	9,954,252	GBP	8,123,000	Morgan Stanley	17/6/2020	(78,614)
USD	7,234,959	GBP	5,816,000	Deutsche Bank	15/7/2020	50,624
USD	11,523,361	GBP	9,375,950	JP Morgan	15/7/2020	(58,475)
USD	9,950,684	GBP	8,119,000	Morgan Stanley	15/7/2020	(78,478)
USD	9,950,707	GBP	8,118,000	Morgan Stanley	19/8/2020	(78,549)
USD	9,925,860	HKD	77,115,000	Citibank	17/6/2020	(15,631)
USD	8,696,834	HKD	67,549,000	JP Morgan	17/6/2020	(11,430)
USD	1,469,730	HUF	468,491,000	BNP Paribas	17/6/2020	(25,509)
USD	19,549,654	HUF	6,375,686,000	Credit Suisse	17/6/2020	(799,024)
USD	124,004,179	HUF	37,196,516,650	Deutsche Bank	17/6/2020	5,287,557
USD	1,601,787	HUF	483,679,000	HSBC	17/6/2020	58,074
USD	1,469,275	HUF	468,427,000	BNP Paribas	15/7/2020	(25,486)
USD	19,543,363	HUF	6,375,892,000	Credit Suisse	15/7/2020	(802,257)
USD	47,097,741	HUF	15,901,874,000	Deutsche Bank	15/7/2020	(3,645,511)
USD	1,469,335	HUF	468,571,000	BNP Paribas	19/8/2020	(25,390)
USD	18,992,632	HUF	6,163,359,790	Citibank	19/8/2020	(668,276)
USD	10,901,959	HUF	3,575,074,000	Credit Suisse	19/8/2020	(502,405)
USD	23,218,512	INR	1,793,137,953	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2020	(465,360)
USD	20,776,986	INR	1,608,383,000	Citibank	17/6/2020	(466,630)
USD	12,544,661	INR	960,605,000	Deutsche Bank	17/6/2020	(143,065)
USD	14,370,936	INR	1,110,984,048	HSBC	17/6/2020	(303,008)
USD	66,449,120	INR	5,055,784,000	JP Morgan	17/6/2020	(327,973)
USD	9,302,071	INR	725,378,000	Morgan Stanley	17/6/2020	(278,764)
USD	1,437,464	INR	109,299,000	Societe Generale	17/6/2020	(6,164)
USD	28,804,193	INR	2,209,725,000	UBS	17/6/2020	(381,983)
USD	9,902,330	INR	765,580,000	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2020	(177,902)
USD	3,026,033	INR	233,386,000	BNP Paribas	15/7/2020	(46,912)

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)
USD	7,471,790	INR	572,694,000	Citibank	15/7/2020	(68,753)
USD	11,685,807	INR	900,213,200	HSBC	15/7/2020	(167,114)
USD	257,090	INR	19,773,800	JP Morgan	15/7/2020	(3,268)
USD	728,118	INR	55,476,000	Standard Chartered Bank	15/7/2020	(2,323)
USD	8,381,631	INR	653,725,000	UBS	15/7/2020	(225,830)
USD	4,777,424	INR	365,664,000	HSBC	19/8/2020	(19,401)
USD	728,080	INR	55,732,000	Standard Chartered Bank	19/8/2020	(3,019)
USD	24,932,521	JPY	2,692,679,000	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2020	(105,420)
USD	24,347,280	JPY	2,580,952,000	BNP Paribas	17/6/2020	348,237
USD	8,366,705	JPY	891,485,000	Deutsche Bank	17/6/2020	77,211
USD	17,181,459	JPY	1,855,978,000	Goldman Sachs	17/6/2020	(76,397)
USD	25,642,672	JPY	2,769,462,000	JP Morgan	17/6/2020	(109,236)
USD	26,201,128	JPY	2,753,027,000	Morgan Stanley	17/6/2020	602,041
USD	24,924,913	JPY	2,689,815,000	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2020	(97,386)
USD	3,639,884	JPY	391,155,000	BNP Paribas	15/7/2020	1,121
USD	3,636,987	JPY	391,155,000	Deutsche Bank	15/7/2020	(1,776)
USD	20,509,216	JPY	2,212,757,150	JP Morgan	15/7/2020	(75,200)
USD	46,742,498	JPY	5,020,409,350	JP Morgan	19/8/2020	14,347
USD	11,279,559	KRW	13,789,533,000	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2020	133,584
USD	48,265,633	KRW	57,256,554,680	Deutsche Bank	17/6/2020	1,985,596
USD	132,243,367	KRW	157,865,868,000	HSBC	17/6/2020	4,641,589
USD	7,437,689	KRW	9,110,425,000	UBS	17/6/2020	73,802
USD	75,140,855	KRW	92,517,515,540	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2020	346,182
USD	5,078,363	KRW	6,239,048,000	HSBC	15/7/2020	34,479
USD	7,432,869	KRW	9,100,805,000	UBS	15/7/2020	75,433
USD	6,779,276	KRW	8,344,272,000	Bank of America Merrill Lynch	19/8/2020	32,685
USD	53,858,199	KRW	65,942,306,230	HSBC	19/8/2020	541,888
USD	6,154,761	MXN	148,883,870	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2020	(560,176)
USD	10,362,336	MXN	229,186,912	Barclays Bank	17/6/2020	25,585
USD	1,277,834	MXN	30,566,805	Citibank	17/6/2020	(100,786)
USD	34,332,683	MXN	764,049,205	Credit Suisse	17/6/2020	(127,345)
USD	2,425,398	MXN	58,604,454	Deutsche Bank	17/6/2020	(217,771)
USD	5,185,544	MXN	120,523,695	Goldman Sachs	17/6/2020	(250,297)
USD	8,834,456	MXN	210,868,262	JP Morgan	17/6/2020	(676,091)
USD	4,725,884	MXN	110,215,797	Morgan Stanley	17/6/2020	(245,052)
USD	1,233,112	MXN	28,223,500	UBS	17/6/2020	(39,820)
USD	1,639,232	MXN	39,561,766	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2020	(137,534)
USD	1,277,661	MXN	30,689,805	Citibank	15/7/2020	(100,655)
USD	4,968,071	MXN	119,012,883	JP Morgan	15/7/2020	(376,942)
USD	188,544	MXN	4,556,546	Morgan Stanley	15/7/2020	(16,096)
USD	20,093,210	MXN	486,484,360	Barclays Bank	19/8/2020	(1,646,770)
USD	8,337,592	NOK	85,361,348	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2020	(447,388)

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)
USD	146,177,917	NOK	1,518,047,773	Credit Suisse	17/6/2020	(10,052,271)
USD	38,346,384	NOK	394,713,281	Deutsche Bank	17/6/2020	(2,275,612)
USD	134,711,412	NOK	1,256,469,280	JP Morgan	17/6/2020	5,401,628
USD	5,116,296	NOK	52,297,275	Morgan Stanley	17/6/2020	(265,888)
USD	1,125,481	NOK	11,687,823	UBS	17/6/2020	(77,374)
USD	8,334,716	NOK	85,309,878	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2020	(446,866)
USD	100,841,413	NOK	1,041,064,347	Credit Suisse	15/7/2020	(6,323,107)
USD	26,675,226	NOK	272,209,699	Deutsche Bank	15/7/2020	(1,345,349)
USD	6,968,461	NOK	69,104,000	JP Morgan	15/7/2020	(144,930)
USD	5,114,573	NOK	52,267,076	Morgan Stanley	15/7/2020	(265,667)
USD	8,654,953	NOK	86,005,710	Credit Suisse	19/8/2020	(200,295)
USD	18,340,021	NOK	186,934,442	Deutsche Bank	19/8/2020	(906,968)
USD	6,968,349	NOK	69,086,000	JP Morgan	19/8/2020	(144,826)
USD	44,396,716	NOK	457,079,738	Morgan Stanley	19/8/2020	(2,664,748)
USD	16,806,740	NZD	28,232,224	Barclays Bank	17/6/2020	(706,239)
USD	6,089,848	NZD	9,867,000	BNP Paribas	17/6/2020	(30,837)
USD	10,113,745	NZD	16,780,000	Citibank	17/6/2020	(295,205)
USD	3,888,275	NZD	6,552,977	Deutsche Bank	17/6/2020	(176,660)
USD	19,982,616	NZD	33,066,621	Goldman Sachs	17/6/2020	(529,229)
USD	2,156,989	NZD	3,535,178	JP Morgan	17/6/2020	(35,948)
USD	6,088,764	NZD	9,870,000	Morgan Stanley	17/6/2020	(33,783)
USD	6,090,061	NZD	9,869,000	BNP Paribas	15/7/2020	(30,888)
USD	3,210,073	NZD	5,249,000	Citibank	15/7/2020	(45,460)
USD	11,715,007	NZD	19,274,000	Goldman Sachs	15/7/2020	(239,109)
USD	6,084,771	NZD	9,865,000	Morgan Stanley	15/7/2020	(33,696)
USD	6,088,581	NZD	9,869,000	BNP Paribas	19/8/2020	(30,919)
USD	3,209,924	NZD	5,250,000	Citibank	19/8/2020	(45,460)
USD	6,086,375	NZD	9,870,000	Morgan Stanley	19/8/2020	(33,745)
USD	12,746,990	PLN	51,731,000	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2020	(196,743)
USD	1,815,743	PLN	7,092,109	BNP Paribas	17/6/2020	41,210
USD	8,919,482	PLN	38,088,000	Citibank	17/6/2020	(610,604)
USD	17,089,469	PLN	70,818,000	Credit Suisse	17/6/2020	(630,066)
USD	1,974,496	PLN	8,164,000	Goldman Sachs	17/6/2020	(68,238)
USD	7,664,415	PLN	29,116,000	HSBC	17/6/2020	379,233
USD	7,011,616	PLN	28,570,891	JP Morgan	17/6/2020	(137,172)
USD	12,742,729	PLN	51,723,000	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2020	(198,522)
USD	7,363,025	PLN	30,807,000	Credit Suisse	15/7/2020	(344,980)
USD	1,973,817	PLN	8,162,000	Goldman Sachs	15/7/2020	(68,340)
USD	12,742,500	PLN	51,727,000	Bank of America Merrill Lynch	19/8/2020	(199,913)
USD	34,661,167	RUB	2,623,363,000	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2020	(2,417,514)
USD	1,523,866	RUB	116,210,000	Barclays Bank	17/6/2020	(118,649)
USD	8,464,380	RUB	621,052,000	Citibank	17/6/2020	(313,586)
USD	7,384,453	RUB	536,385,000	Credit Suisse	17/6/2020	(196,826)
USD	14,401,249	RUB	1,071,758,000	Goldman Sachs	17/6/2020	(747,006)

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)
USD	6,895,711	RUB	504,835,000	HSBC	17/6/2020	(239,640)
USD	26,823,485	RUB	2,014,625,000	JP Morgan	17/6/2020	(1,651,277)
USD	19,352,792	RUB	1,480,307,000	Morgan Stanley	17/6/2020	(1,569,905)
USD	3,322,669	RUB	251,237,000	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2020	(215,154)
USD	1,523,508	RUB	116,655,000	Barclays Bank	15/7/2020	(119,183)
USD	1,522,315	RUB	116,655,000	Citibank	15/7/2020	(120,376)
USD	1,058,434	RUB	79,483,000	Goldman Sachs	15/7/2020	(60,815)
USD	11,668,533	RUB	854,217,000	JP Morgan	15/7/2020	(360,224)
USD	8,235,583	RUB	598,358,000	JP Morgan	19/8/2020	(154,582)
USD	4,543,970	SEK	44,231,000	Barclays Bank	17/6/2020	(137,614)
USD	19,221,451	SEK	188,000,000	Citibank	17/6/2020	(677,214)
USD	7,002,113	SEK	70,070,000	Credit Suisse	17/6/2020	(414,374)
USD	20,905,403	SEK	205,566,232	Deutsche Bank	17/6/2020	(852,543)
USD	93,017,268	SEK	876,418,000	Goldman Sachs	17/6/2020	253,710
USD	23,485,575	SEK	234,146,000	JP Morgan	17/6/2020	(1,297,367)
USD	17,339,135	SEK	176,165,769	Morgan Stanley	17/6/2020	(1,306,949)
USD	16,524,715	SEK	170,000,000	Standard Chartered Bank	17/6/2020	(1,468,760)
USD	62,161,786	SEK	629,305,140	JP Morgan	15/7/2020	(4,463,932)
USD	11,701,169	SEK	115,234,140	Citibank	19/8/2020	(502,754)
USD	17,591,664	SGD	25,024,911	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2020	(110,652)
USD	12,462,739	SGD	17,585,000	Barclays Bank	17/6/2020	23,324
USD	87,962,482	SGD	124,656,642	BNP Paribas	17/6/2020	(218,105)
USD	11,226,550	SGD	15,945,756	Citibank	17/6/2020	(53,283)
USD	43,978,259	SGD	62,777,888	Deutsche Bank	17/6/2020	(430,054)
USD	22,988,135	SGD	32,926,279	Goldman Sachs	17/6/2020	(303,513)
USD	25,175,178	SGD	36,003,229	JP Morgan	17/6/2020	(293,065)
USD	654,684	SGD	938,296	Morgan Stanley	17/6/2020	(9,055)
USD	10,751,118	SGD	14,949,000	Standard Chartered Bank	17/6/2020	176,378
USD	11,039,785	SGD	15,630,375	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2020	(17,895)
USD	60,611,771	SGD	86,201,988	BNP Paribas	15/7/2020	(371,661)
USD	11,221,561	SGD	15,933,647	Citibank	15/7/2020	(50,668)
USD	15,866,667	SGD	22,556,597	Deutsche Bank	15/7/2020	(90,956)
USD	2,862,833	SGD	4,073,393	JP Morgan	15/7/2020	(18,881)
USD	11,207,720	SGD	15,903,255	BNP Paribas	19/8/2020	(44,466)
USD	4,310,469	SGD	6,099,745	Deutsche Bank	19/8/2020	(5,343)
USD	62,033,242	SGD	87,881,440	Morgan Stanley	19/8/2020	(146,376)
USD	22,798,638	THB	720,250,000	BNP Paribas	17/6/2020	157,833
USD	76,640,473	THB	2,411,262,570	HSBC	17/6/2020	843,287
USD	14,856,240	THB	473,550,000	Standard Chartered Bank	17/6/2020	(29,637)
USD	39,877,556	THB	1,316,230,530	HSBC	15/7/2020	(1,493,984)
USD	1,638,851	TWD	48,699,286	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2020	15,883
USD	749,317	TWD	22,502,000	Barclays Bank	17/6/2020	(592)
USD	68,930,798	TWD	2,046,749,880	BNP Paribas	17/6/2020	720,136

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)
USD	8,035,214	TWD	238,523,000	Credit Suisse	17/6/2020	86,118
USD	1,661,332	TWD	49,624,000	Deutsche Bank	17/6/2020	7,547
USD	49,484,660	TWD	1,469,165,459	HSBC	17/6/2020	522,766
USD	18,319,993	TWD	544,277,000	JP Morgan	17/6/2020	181,238
USD	1,220,584	TWD	36,298,255	UBS	17/6/2020	10,896
USD	94,138	TWD	2,788,300	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2020	1,019
USD	5,346,653	TWD	158,293,000	BNP Paribas	15/7/2020	60,230
USD	1,000,000	TWD	29,616,700	Citibank	15/7/2020	10,908
USD	6,369,385	TWD	187,865,000	Credit Suisse	15/7/2020	95,363
USD	19,064,759	TWD	564,060,000	JP Morgan	15/7/2020	227,164
USD	3,281,790	TWD	97,221,000	UBS	15/7/2020	34,955
USD	748,161	TWD	22,370,000	Goldman Sachs	19/8/2020	(1,004)
USD	8,950,220	TWD	264,658,000	JP Morgan	19/8/2020	86,905
USD	13,186,664	ZAR	222,928,444	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2020	483,526
USD	2,683,751	ZAR	47,650,000	BNP Paribas	17/6/2020	(31,490)
USD	36,186,409	ZAR	635,425,000	Citibank	17/6/2020	(22,035)
USD	12,563,055	ZAR	228,746,000	Goldman Sachs	17/6/2020	(471,585)
USD	3,267,926	ZAR	54,826,000	HSBC	17/6/2020	143,775
USD	8,432,243	ZAR	157,903,000	JP Morgan	17/6/2020	(565,548)
USD	3,183,680	ZAR	57,725,556	Societe Generale	17/6/2020	(105,698)
USD	1,744,963	ZAR	32,438,000	Standard Chartered Bank	17/6/2020	(103,452)
USD	1,206,663	ZAR	21,144,000	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2020	5,249
USD	12,225,854	ZAR	226,270,000	Citibank	15/7/2020	(630,941)
USD	3,624,190	ZAR	67,880,000	Goldman Sachs	15/7/2020	(232,791)
USD	8,434,484	ZAR	158,392,000	JP Morgan	15/7/2020	(565,442)
USD	815,131	ZAR	15,651,000	Societe Generale	15/7/2020	(74,168)
USD	1,744,111	ZAR	32,508,000	Standard Chartered Bank	15/7/2020	(103,013)
USD	1,206,710	ZAR	21,220,000	Bank of America Merrill Lynch	19/8/2020	5,168
USD	819,869	ZAR	15,420,000	Standard Chartered Bank	19/8/2020	(53,259)
ZAR	20,863,000	USD	1,132,137	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2020	56,700
ZAR	146,114,000	USD	8,787,673	Deutsche Bank	17/6/2020	(461,654)
ZAR	24,740,000	USD	1,333,355	Goldman Sachs	17/6/2020	76,405
ZAR	808,330,730	USD	51,126,755	HSBC	17/6/2020	(5,065,620)
ZAR	88,679,000	USD	4,860,509	JP Morgan	17/6/2020	192,689
ZAR	75,108,000	USD	4,114,309	Standard Chartered Bank	17/6/2020	165,572
ZAR	20,917,000	USD	1,132,172	Bank of America Merrill Lynch	15/7/2020	56,345
ZAR	316,949,190	USD	16,683,858	Citibank	15/7/2020	1,325,382
ZAR	24,818,000	USD	1,338,864	Deutsche Bank	15/7/2020	71,309
ZAR	24,815,000	USD	1,333,015	Goldman Sachs	15/7/2020	76,988
ZAR	24,815,000	USD	1,338,643	JP Morgan	15/7/2020	71,360
ZAR	75,300,000	USD	4,113,306	Standard Chartered Bank	15/7/2020	165,285
ZAR	25,332,750	USD	1,356,800	HSBC	19/8/2020	77,619

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)
ZAR	28,513,000	USD	1,578,549	Standard Chartered Bank	19/8/2020	35,946
						734,393
ヘッジを使用した豪ドル建投資証券クラス						
AUD	1,614,343,943	USD	1,051,678,133	State Street Bank & Trust Company	15/6/2020	19,777,968
USD	34,025,078	AUD	51,941,865	State Street Bank & Trust Company	15/6/2020	(449,253)
						19,328,715
ヘッジを使用したブラジル・リアル建投資証券クラス						
BRL	13,660,232	USD	2,569,483	State Street Bank & Trust Company	2/7/2020	(60,118)
						(60,118)
ヘッジを使用したスイス・フラン建投資証券クラス						
CHF	21,311,064	USD	21,978,043	State Street Bank & Trust Company	15/6/2020	154,383
USD	731,262	CHF	708,193	State Street Bank & Trust Company	15/6/2020	(4,225)
						150,158
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	323,357,315	USD	350,640,519	State Street Bank & Trust Company	15/6/2020	9,006,613
USD	71,700,206	EUR	65,878,598	State Street Bank & Trust Company	15/6/2020	(1,571,829)
						7,434,784
ヘッジを使用した英ポンド建投資証券クラス						
GBP	401,207,313	USD	495,485,515	State Street Bank & Trust Company	15/6/2020	48,143
USD	16,280,065	GBP	13,249,657	State Street Bank & Trust Company	15/6/2020	(84,670)
						(36,527)
ヘッジを使用した日本円建投資証券クラス						
JPY	21,249,669,431	USD	197,856,644	State Street Bank & Trust Company	15/6/2020	(272,493)
USD	57,238,500	JPY	6,161,687,840	State Street Bank & Trust Company	15/6/2020	(54,243)
						(326,736)
ヘッジを使用したニュージーランド・ドル建投資証券クラス						
NZD	88,751,517	USD	54,143,490	State Street Bank & Trust Company	15/6/2020	911,284
USD	7,678,126	NZD	12,713,073	State Street Bank & Trust Company	15/6/2020	(208,110)
						703,174
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	32,184	USD	3,287	State Street Bank & Trust Company	15/6/2020	119
USD	109	SEK	1,059	State Street Bank & Trust Company	15/6/2020	(3)
						116
合計(基礎となるエクスポージャー総額 - 13,618,740,342米ドル)						27,927,959

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

業種別内訳 2020年5月31日現在

	純資産比率 (%)
政府	69.55
金融	6.64
投資有価証券 - 時価	76.19
その他の純資産	23.81
	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。

ブラックロック・ICS・USTレジャーリー・ファンド
要約損益計算書

	2020年3月31日に 終了した会計期間	2019年3月31日に 終了した会計期間
	千米ドル	千米ドル
営業収益	114,639	136,200
金融商品に係る純利益	111	149
投資収益合計	114,750	136,349
営業費用	(11,511)	(9,731)
純営業利益 / (費用)	103,239	126,618
財務費用：		
償還可能投資証券保有者への分配金	(99,813)	(120,083)
財務費用合計	(99,813)	(120,083)
純利益	3,426	6,535
償還可能投資証券保有者に帰属する純資産の増加	3,426	6,535

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

ブラックロック・ICS・USTレジャーリー・ファンド
償還可能投資証券保有者に帰属する要約純資産変動計算書

	2020年3月31日に 終了した会計期間	2019年3月31日に 終了した会計期間
	千米ドル	千米ドル
期首純資産	14,146,140	11,308,849
償還可能投資証券保有者に帰属する純資産の増加	3,426	6,535
投資証券取引：		
償還可能投資証券の発行	69,747,935	30,997,407
償還可能投資証券の買戻	(60,032,664)	(32,071,854)
分配金再投資額	50,078	37,689
投資証券取引による純資産の増加 / (減少)	9,765,349	(1,036,758)
期末純資産	23,914,915	10,278,626

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・ICS・USTレジャー・ファンド
要約貸借対照表

	2020年3月31日現在	2019年9月30日現在
	千米ドル	千米ドル
流動資産		
現金	348,307	377,875
未収金	18,806	11,789
損益を通じて公正価値で測定する金融資産	24,972,917	13,842,168
流動資産合計	25,340,030	14,231,832
流動負債		
未払金	1,425,115	85,692
流動負債合計	1,425,115	85,692
償還可能投資証券保有者に帰属する純資産	23,914,915	14,146,140

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・ICS・USTレジャリー・ファンド

投資有価証券明細表 2020年3月31日現在

保有高	通貨	銘柄	公正価値 (千米ドル)	純資産比率 (%)
債券				
国債(2019年9月30日:38.78%)				
米国(2019年9月30日:38.78%)				
50,115,000	USD	US Treasury, 2.38%, 30/04/2020	50,135	0.21
45,810,000	USD	US Treasury, 1.50%, 15/05/2020	45,781	0.19
116,005,000	USD	US Treasury, 3.50%, 15/05/2020	116,230	0.49
68,695,000	USD	US Treasury, 1.38%, 01/06/2020	68,668	0.29
53,500,000	USD	US Treasury, 1.50%, 01/06/2020	53,479	0.22
3,030,000	USD	US Treasury, 1.63%, 30/06/2020	3,028	0.01
43,015,000	USD	US Treasury, 2.63%, 15/08/2020	43,177	0.18
11,315,000	USD	US Treasury, 1.38%, 31/08/2020	11,303	0.05
19,325,000	USD	US Treasury, 2.13%, 31/08/2020	19,365	0.08
8,080,000	USD	US Treasury, 2.63%, 31/08/2020	8,113	0.03
54,640,000	USD	US Treasury, 1.38%, 15/09/2020	54,739	0.23
36,370,000	USD	US Treasury, 1.38%, 30/09/2020	36,326	0.15
14,940,000	USD	US Treasury, 2.75%, 30/09/2020	15,023	0.06
13,405,000	USD	US Treasury, 1.75%, 16/11/2020	13,416	0.06
25,685,000	USD	US Treasury, 2.63%, 16/11/2020	25,841	0.11
114,510,000	USD	US Treasury, 1.63%, 30/11/2020	114,512	0.48
89,655,000	USD	US Treasury, 2.00%, 30/11/2020	89,880	0.38
150,255,000	USD	US Treasury, 2.75%, 30/11/2020	152,147	0.64
23,160,000	USD	US Treasury, 1.75%, 31/12/2020	23,176	0.10
18,070,000	USD	US Treasury, 2.38%, 31/12/2020	18,237	0.08
233,630,000	USD	US Treasury, 2.50%, 31/12/2020	235,132	0.98
26,590,000	USD	US Treasury, 3.63%, 15/02/2021	27,295	0.11
110,000,000	USD	US Treasury, 2.50%, 28/02/2021	111,745	0.47
38,300,000	USD	US Treasury, 2.25%, 31/03/2021	38,963	0.16
467,075,000	USD	US Treasury, FRN, 0.12%, 30/04/2020	467,033	1.95
943,610,000	USD	US Treasury, FRN, 0.13%, 31/07/2020	943,261	3.94
2,171,000,000	USD	US Treasury, FRN, 0.13%, 31/10/2020	2,169,340	9.07
2,030,000,000	USD	US Treasury, FRN, 0.20%, 01/02/2021	2,029,906	8.49
79,410,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 07/04/2020	79,402	0.33
208,605,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 09/04/2020	208,529	0.87
62,515,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 16/04/2020	62,473	0.26
500,000,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 21/04/2020	499,735	2.09
825,400,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 23/04/2020	824,519	3.45
150,000,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 30/04/2020	149,805	0.63
6,120,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 05/05/2020	6,116	0.03
98,895,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 07/05/2020	98,743	0.41
692,140,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 14/05/2020	691,491	2.89
97,860,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 09/06/2020	97,847	0.41
950,000,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 02/07/2020	949,800	3.97
250,000,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 30/07/2020	248,725	1.04
24,710,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 20/08/2020	24,564	0.10

保有高	通貨	銘柄	公正価値 (千米ドル)	純資産比率 (%)
		米国(2019年9月30日:38.78%)(続き)		
48,175,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 03/09/2020	48,006	0.20
28,330,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 10/09/2020	28,108	0.12
140,000,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 17/09/2020	139,803	0.58
		米国合計	11,142,917	46.59
		国債に対する投資合計	11,142,917	46.59
		債券に対する投資合計	11,142,917	46.59

保有高	通貨	取引相手	金利	期日	公正価値 (千米ドル)	純資産比率 (%)
		リバースレポ取引 ¹ (2019年9月30日:59.07%)				
		フランス(2019年9月30日:0.78%)				
110,000,000	USD	Natixis	0.01%	31/12/2020	110,000	0.46
		フランス合計			110,000	0.46
		米国(2019年9月30日:58.29%)				
553,000,000	USD	Bank of Nova Scotia	0.01%	01/04/2020	553,000	2.31
2,900,000,000	USD	Barclays	0.01%	01/04/2020	2,900,000	12.13
2,700,000,000	USD	BNP Paribas	0.01%	01/04/2020	2,700,000	11.29
683,000,000	USD	BofA Securities	0.01%	01/04/2020	683,000	2.85
100,000,000	USD	BofA Securities	0.01%	01/04/2020	100,000	0.42
200,000,000	USD	Citigroup	0.02%	01/04/2020	200,000	0.84
60,000,000	USD	Citigroup	0.01%	01/04/2020	60,000	0.25
2,900,000,000	USD	Credit Suisse	0.01%	01/04/2020	2,900,000	12.13
521,000,000	USD	HSBC	0.01%	01/04/2020	521,000	2.18
2,141,000,000	USD	Societe Generale	0.01%	01/04/2020	2,141,000	8.95
624,000,000	USD	TD Securities (USA)	0.01%	01/04/2020	624,000	2.61
338,000,000	USD	Wells Fargo	0.01%	01/04/2020	338,000	1.41
		米国合計			13,720,000	57.37
		リバースレポ取引に対する投資合計			13,830,000	57.83
		損益を通じて公正価値で測定する金融資産合計			24,972,917	104.42
		現金			348,307	1.46
		その他の資産および負債			(1,406,309)	(5.88)
		償還可能参加型投資証券保有者に帰属する純資産			23,914,915	100.00

資産合計額の内訳	資産合計に 対する割合 (%)
公認の証券取引所に上場されている譲渡可能な有価証券合計	27.56
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	70.99
その他の資産	1.45
資産合計	100.00

¹ 担保として保有する有価証券は13,965,828,000米ドルであった。

【中間財務諸表】

【ブラックロック・スタイル・アドバンテージ・ポートフォリオ(円/年1回決算コース)】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

当中間計算期間末 (2021年7月15日現在)	
資産の部	
流動資産	
親投資信託受益証券	5,533,206,688
未収入金	24,104,769
流動資産合計	5,557,311,457
資産合計	5,557,311,457
負債の部	
流動負債	
未払解約金	24,104,769
未払受託者報酬	555,426
未払委託者報酬	19,002,792
その他未払費用	2,923,452
流動負債合計	46,586,439
負債合計	46,586,439
純資産の部	
元本等	
元本	7,885,982,805
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金()	2,375,257,787
(分配準備積立金)	-
元本等合計	5,510,725,018
純資産合計	5,510,725,018
負債純資産合計	5,557,311,457

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	当中間計算期間 (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	290,958,472
営業収益合計	290,958,472
営業費用	
受託者報酬	555,426
委託者報酬	19,002,792
その他費用	2,923,452
営業費用合計	22,481,670
営業利益又は営業損失()	268,476,802
経常利益又は経常損失()	268,476,802
中間純利益又は中間純損失()	268,476,802
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	15,915,452
期首剰余金又は期首欠損金()	2,761,730,761
剰余金増加額又は欠損金減少額	322,157,250
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	322,157,250
剰余金減少額又は欠損金増加額	188,245,626
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	188,245,626
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金()	2,375,257,787

(3)【中間注記表】

(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。

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	当中間計算期間末 (2021年7月15日現在)
1 当該中間計算期間の末日における受益権総数	7,885,982,805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 2,375,257,787円
3 1口当たり純資産額	0.6988円

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

当中間計算期間末 (2021年7月15日現在)	
1	<p>中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間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、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2	<p>時価の算定方法</p> <p>(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。</p> <p>(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>
3	<p>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>
4	<p>金銭債権の中間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>

(その他の注記)

1 期中元本変動額

項目	当中間計算期間末 (2021年7月15日現在)
期首元本額	8,229,161,317円
期中追加設定元本額	618,193,379円
期中一部解約元本額	961,371,891円

2 有価証券関係

該当事項はありません。

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

(参考情報)

当ファンドは、「スタイル・アドバンテージ・マザー・ポートフォリオ（円）」受益証券を主要投資対象としており、中間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。

「スタイル・アドバンテージ・マザー・ポートフォリオ（円）」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	66,039,748
投資証券	5,490,839,476
派生商品評価勘定	109,227
流動資産合計	5,556,988,451
資産合計	5,556,988,451
負債の部	
流動負債	
未払解約金	24,104,769
流動負債合計	24,104,769
負債合計	24,104,769
純資産の部	
元本等	
元本	7,672,222,253
剰余金又は欠損金（ ）	2,139,338,571
元本等合計	5,532,883,682
純資産合計	5,532,883,682
負債純資産合計	5,556,988,451

(注)親投資信託の計算期間は、原則として、毎年1月16日から翌年1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事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

2 デリバティブの評価基準及び評価方法

為替予約取引

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

3 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準

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

4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

外貨建資産等の会計処理

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2021年7月15日現在)
1 当該計算日における受益権総数	7,672,222,253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 2,139,338,571
3 1口当たり純資産額	0.7212円

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

(2021年7月15日現在)	
1 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2 時価の算定方法	<p>(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。</p> <p>(2) デリバティブ取引 デリバティブ取引については、「(その他の注記)」の「3 デリバティブ取引関係」に記載しております。</p> <p>(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>
3 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>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>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>
4 金銭債権の計算日後の償還予定額	金銭債権はすべて1年以内に償還予定であります。

(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中間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)	
同中間計算期間の期首元本額	8,045,366,448円
同中間計算期間中の追加設定元本額	599,656,906円
同中間計算期間中の一部解約元本額	972,801,101円
同中間計算期間末日の元本額	7,672,222,253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・スタイル・アドバンテージ・ポートフォリオ（円/年 1回決算コース）	7,672,222,253円
合計	7,672,222,253円

- 2 有価証券関係

該当事項はありません。

- 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	(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	56,269,557	-	56,160,330	109,227
合計		56,269,557	-	56,160,330	109,227

(注1) 時価の算定方法

為替予約取引

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

(注2) 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(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・スタイル・アドバンテージ・ファンド クラスI投資証券」及び「インスティテューショナル・キャッシュ・シリーズplc ブラックロック・ICS・USTレジャーリー・ファンド エージェンシークラス投資証券」(以下、両者を併せて「同ファンド」という。)を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された投資証券は、すべて同ファンドの投資証券であります。同ファンドの状況は以下のとおりであります。

なお、以下に記載した情報は監査意見の対象外です。

同ファンドの状況

(1)「ブラックロック・ストラテジック・ファンズ ブラックロック・スタイル・アドバンテージ・ファンド クラスI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)「インスティテューショナル・キャッシュ・シリーズplc ブラックロック・ICS・USTレジャーリー・ファンド エージェンシークラス投資証券」は、アイルランドにおいて設立されたオープンエンド型投資法人が発行するファンドであり、当該ファンドの現時点で日本語に翻訳された直近の情報は、2020年9月30日に終了する計算期間(2019年10月1日から2020年9月30日まで)に係る財務書類であります。

当該財務書類は、当該ファンドを含む「インスティテューショナル・キャッシュ・シリーズplc」の2020年9月30日現在の財務書類のうち、当該ファンドにかかる部分を、委託会社において抜粋し、その原文を翻訳したものです。なお、財務書類に含まれる「投資有価証券明細表」の銘柄については原文通り英語表記で行っております。

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・スタイル・アドバンテージ・ファンド 米ドル
資産		
投資有価証券 - 取得原価		661,544,320
未実現評価益		73,542
投資有価証券 - 時価	2 (a)	661,617,862
銀行預金	2 (a)	134,765,603
ブローカーに対する債権	14	102,258,870
未収利息および未収配当金	2 (a)、 2 (d)	1,586,385
売却投資有価証券未収金	2 (a)、 2 (d)	117,406,799
販売投資証券未収金	2 (a)	14,108
以下に係る未実現純評価益：		
先物取引	2 (d)	9,270,787
未決済先渡為替予約	2 (d)	46,660,056
差金決済契約	2 (d)	36,202,153
スワップの時価	2 (d)	3,901,967
資産合計		1,113,684,590
負債		
ブローカーに対する債務	14	3,167,758
未払利息および未払配当金	2 (a)、 2 (d)	1,361,439
購入投資有価証券未払金	2 (a)、 2 (d)	152,057,901
買戻し投資証券未払金	2 (a)	118,109,745
以下に係る未実現純評価損：		
先物取引	2 (d)	13,511,212
未決済先渡為替予約	2 (d)	40,210,587
差金決済契約	2 (d)	39,928,029
スワップの時価	2 (d)	7,682,432
未払費用およびその他の負債	2 (a)、 4、 5、 6、 7、 8	1,043,227
負債合計		377,072,330
純資産合計		736,612,260

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)

	通貨	ブラックロック・スタイル・アドバンテージ・ファンド			
		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	736,612,260	2,150,166,004	3,245,426,903	3,328,390,128
以下の1口当たり純資産価額:					
クラスA分配型投資証券	米ドル	78.77	86.16	106.29	108.61
クラスAユーロ・ヘッジ分配型投資証券	ユーロ	71.81	78.78	99.40	104.64
クラスA無分配投資証券	米ドル	77.51	84.79	104.62	106.88
クラスAユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	63.40	69.57	87.87	92.47
クラスAスウェーデン・クロスウェーデン・ネ・ヘッジ無分配投資証券	クローネ	65.16	71.25	89.53	94.21
クラスDスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	スイス・フラン	65.32	71.55	89.83	94.16
クラスD無分配投資証券(ユーロ)	ユーロ	74.25	87.23	106.55	103.48
クラスD無分配英国報告型投資証券	米ドル	80.52	87.73	107.43	108.95
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	73.00	79.82	100.01	104.46
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	70.03	76.20	94.37	97.66
クラスE無分配投資証券(ユーロ)	ユーロ	70.38	83.25	102.91	101.13
クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	69.40	76.34	96.82	102.41
クラスIスイス・フラン・ヘッジPF無分配投資証券	スイス・フラン	67.36	73.69	92.11	96.06
クラスIユーロ・ヘッジPF無分配投資証券	ユーロ	74.39	81.13	101.38	105.47
クラスIブラジル・レアル・ヘッジ無分配投資証券	米ドル	48.00	50.61	83.34	86.97
クラスIスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	スイス・フラン	65.72	71.90	90.29	94.43
クラスI無分配英国報告型投資証券	米ドル	71.60	77.97	95.35	96.53
クラスIユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	ユーロ	73.66	80.42	100.61	104.90
クラスI英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	英ポンド	70.03	76.24	94.73	97.80
クラスI日本円ヘッジ無分配英国報告型投資証券	日本円	7,472.07	8,162.20	10,175.36	10,592.54
クラスX無分配投資証券	米ドル	83.97	91.12	110.60	111.12
クラスX豪ドル・ヘッジ無分配投資証券 ⁽¹⁾	豪ドル	84.67	91.81	111.75	112.90
クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	69.26	75.30	93.42	96.68
クラスXニュージーランド・ドニュージーランド・ヘッジ無分配投資証券	ド・ドル	84.16	91.00	110.98	112.02
クラスX英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	英ポンド	79.78	86.47	106.63	109.28
クラスZ無分配投資証券	米ドル	81.08	88.28	107.92	109.28
クラスZユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	73.65	80.39	100.55	104.87

(1) 終値で評価された1口当たり純資産価額、詳細については注記2を参照のこと。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

損益および純資産変動計算書 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・スタイル・ アドバンテージ・ファンド
		米ドル
期首純資産		2,150,166,004
収益		
預金利息	2 (c)	9,024
債券利息	2 (c)	3,518,153
差金決済契約に係る受取利息	2 (c)、2 (d)	25,741
スワップに係る受取利息および受取配当金	2 (c)	287,561
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)	18,693,935
その他の収益		4,898
収益合計		22,539,312
費用		
銀行利息	2 (c)	468,551
差金決済契約に係る支払利息	2 (c)、2 (d)	5,832,195
スワップに係る支払利息および支払配当金	2 (c)	201,092
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)	19,027,780
管理事務代行報酬	5	379,088
預託報酬	2 (i)、6	221,818
税金	8	62,777
販売報酬	4	1,955
投資運用報酬および投資運用再委託報酬	4	1,405,735
その他の費用		7,338
費用合計		27,608,329
投資純損失		(5,069,017)
以下に係る実現純利益 / (損失) :		
投資有価証券	2 (a)、2 (b)	1,701,474
差金決済契約	2 (d)	(90,891,868)
先物取引	2 (d)	(53,013,576)
外貨および先渡為替予約	2 (d)、2 (e)、2 (j)	142,878,416
スワップ取引	2 (d)	35,912,875
当期実現純利益		36,587,321
以下に係る未実現評価益 / (損) の純変動額 :		
投資有価証券	2 (a)	(1,028,763)
差金決済契約	2 (d)	(8,294,813)
先物取引	2 (d)	21,127,464
外貨および先渡為替予約	2 (d)、2 (e)、2 (j)	(23,610,665)
スワップ取引	2 (d)	691,524
当期末実現評価益 / (損) の純変動		(11,115,253)
運用成績による純資産の増加		20,403,051
資本の変動		
投資証券発行による正味受取額		9,854,284
投資証券買戻しによる正味支払額		(1,443,811,079)
資本の変動による純資産の減少		(1,433,956,795)
期末純資産		736,612,260

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・スタイル・アドバンテージ・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分配型投資証券	152	40	20	172
クラスAユーロ・ヘッジ分配型投資証券	1,857	99	98	1,858
クラスA無分配投資証券	8,637	1,883	3,906	6,614
クラスAユーロ・ヘッジ無分配投資証	129	-	84	45
クラスAスウェーデン・クローネ・ヘッジ 無分配投資証券	440	-	-	440
クラスDスイス・フラン・ヘッジ 無分配投資証券	5,369	-	-	5,369
クラスD無分配投資証券(ユーロ)	46	-	-	46
クラスD無分配英国報告型投資証券	54,270	9,130	11,104	52,296
クラスDユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	1,029,434	2,879	1,003,323	28,990
クラスD英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	3,718	35	131	3,622
クラスE無分配投資証券(ユーロ)	6,901	2,983	5,274	4,610
クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券	3,165	-	981	2,184
クラスIスイス・フラン・ヘッジPF無分配投資証券	276,538	-	276,488	50
クラスIユーロ・ヘッジPF無分配投資証券	15,129	137	-	15,266
クラスIブラジル・リアル・ヘッジ無分配投資証券	50,186	-	202	49,984
クラスIスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	48	-	-	48
クラスI無分配英国報告型投資証券	853,113	4,300	70,270	787,143
クラスIユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	2,104,362	29,822	1,865,344	268,840
クラスI英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	1,677,619	26,696	1,516,411	187,904
クラスI日本円ヘッジ無分配英国報告型投資証券	1,862,526	-	233,954	1,628,572
クラスX無分配投資証券	571,186	177	2	571,361
クラスX豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	17,141,879	44,793	11,723,490	5,463,182
クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券	42	-	-	42
クラスXニュージーランド・ドル・ヘッジ 無分配投資証券	841,786	-	841,784	2
クラスX英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	3,038,590	-	1,904,321	1,134,269
クラスZ無分配投資証券	50	-	-	50
クラスZユーロ・ヘッジ無分配投資証券	79,409	-	79,363	46

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・スタイル・アドバンテージ・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			
ドイツ			
USD 25,000,000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1.625% 15/3/2021	25,104,500	3.41
		25,104,500	3.41
国際機関 (International)			
USD 20,000,000	African Development Bank 1.25% 26/7/2021	20,141,590	2.73
USD 30,000,000	Asian Development Bank 1.75% 8/6/2021	30,251,116	4.11
USD 40,000,000	International Bank for Reconstruction & Development 1.375% 24/5/2021	40,230,800	5.46
		90,623,506	12.30
国際機関 (Supranational)			
USD 40,000,000	African Development Bank 2.625% 22/3/2021	40,288,612	5.47
USD 20,000,000	Asian Development Bank 1.625% 16/3/2021	20,085,800	2.73
USD 32,000,000	European Bank for Reconstruction & Development 2.00% 1/2/2021	32,093,018	4.36
USD 42,000,000	European Bank for Reconstruction & Development 2.75% 26/4/2021	42,411,783	5.76
USD 30,000,000	European Investment Bank 2.50% 15/4/2021	30,263,368	4.11
USD 20,000,000	Inter-American Development Bank 2.625% 19/4/2021	20,180,775	2.74
USD 11,478,000	International Bank for Reconstruction & Development 1.625% 9/3/2021	11,523,728	1.56
USD 30,000,000	International Finance Corp 2.25% 25/1/2021	30,095,309	4.08
USD 20,000,000	International Finance Corp 1.125% 20/7/2021	20,122,848	2.73
		247,065,241	33.54
米国			
USD 50,000,000	United States Treasury Bill 28/1/2021 (Zero Coupon)	49,999,195	6.79
USD 50,000,000	United States Treasury Bill 25/3/2021 (Zero Coupon)	49,981,000	6.79
USD 50,000,000	United States Treasury Bill 22/4/2021 (Zero Coupon)	49,969,529	6.78
USD 70,000,000	United States Treasury Bill 20/5/2021 (Zero Coupon)	69,941,326	9.49
USD 17,000,000	United States Treasury Bill 17/6/2021 (Zero Coupon)	16,987,974	2.31
USD 17,000,000	United States Treasury Bill 15/7/2021 (Zero Coupon)	16,985,891	2.31
USD 45,000,000	United States Treasury Bill 7/10/2021 (Zero Coupon)	44,959,700	6.10
		298,824,615	40.57
債券合計		661,617,862	89.82
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		661,617,862	89.82
投資有価証券(時価)合計		661,617,862	89.82
その他の純資産		74,994,398	10.18
純資産合計(米ドル)		736,612,260	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		
(753)	Afterpay Ltd	Barclays Bank	2,050
(7,645)	Afterpay Ltd	Goldman Sachs	25,826
12,825	AGL Energy Ltd	Barclays Bank	1,041
65,080	AGL Energy Ltd	Goldman Sachs	19,688
(1,081,228)	AMP Ltd	HSBC	-
(12,547)	Ampol Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(24,441)
(3,300)	Ampol Ltd	Credit Suisse	(10,592)
(33,904)	Ampol Ltd	Goldman Sachs	(65,667)
3,550	Aristocrat Leisure Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,519)
7,737	Aristocrat Leisure Ltd	Goldman Sachs	(3,140)
2,130	Aristocrat Leisure Ltd	HSBC	(849)
2,909	ASX Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(11,140)
3,393	ASX Ltd	Barclays Bank	(5,433)
83,838	Aurizon Holdings Ltd	Credit Suisse	19,177
14,492	Aurizon Holdings Ltd	Goldman Sachs	3,315
169,441	Aurizon Holdings Ltd	JP Morgan	38,757
(23,176)	CIMIC Group Ltd	Barclays Bank	(30,610)
(3,237)	CIMIC Group Ltd	Goldman Sachs	(5,398)
(9,523)	CIMIC Group Ltd	HSBC	(28,528)
6,312	Cochlear Ltd	Barclays Bank	(29,341)
6,290	Cochlear Ltd	Goldman Sachs	(58,106)
(557)	CSL Ltd	Deutsche Bank	6,616
(1)	Deterra Royalties Ltd	Bank of America Merrill Lynch	-
(1)	Iluka Resources Ltd	Bank of America Merrill Lynch	-
(591,209)	Insurance Australia Group Ltd	Barclays Bank	(8,725)
(13,188)	Insurance Australia Group Ltd	Credit Suisse	(1,362)
(7,197)	Insurance Australia Group Ltd	Goldman Sachs	850
(24,907)	Lendlease Corp Ltd (Unit)	Goldman Sachs	4,227
1,126	Macquarie Group Ltd	Barclays Bank	2,152
(107,559)	Medibank Pvt Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4,762
(374,872)	Medibank Pvt Ltd	Goldman Sachs	16,596
(27,752)	Newcrest Mining Ltd	Bank of America Merrill Lynch	59,485
(20,128)	Newcrest Mining Ltd	Barclays Bank	20,792
(24,819)	Newcrest Mining Ltd	Goldman Sachs	53,107
(6,662)	Orica Ltd	Credit Suisse	(737)
(45,200)	Orica Ltd	Deutsche Bank	15,675
(6,055)	Orica Ltd	Goldman Sachs	2,100
139,927	Qantas Airways Ltd	Barclays Bank	98,083
24,971	QBE Insurance Group Ltd	Deutsche Bank	1,842
43,862	QBE Insurance Group Ltd	Goldman Sachs	3,236
(32,275)	Ramsay Health Care Ltd	Barclays Bank	53,820
(22,455)	Ramsay Health Care Ltd	Deutsche Bank	75,386
(4,766)	Ramsay Health Care Ltd	Goldman Sachs	16,000

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)		
1,470	REA Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	5,499
8,150	REA Group Ltd	Barclays Bank	27,662
7,900	REA Group Ltd	Credit Suisse	33,458
10,193	REA Group Ltd	Goldman Sachs	38,131
775	Rio Tinto Ltd	Deutsche Bank	1,913
83,505	Santos Ltd	Goldman Sachs	18,484
(18,499)	SEEK Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(8,326)
(94,440)	SEEK Ltd	Barclays Bank	(27,873)
(3,354)	SEEK Ltd	Goldman Sachs	(1,485)
(19,964)	SEEK Ltd	HSBC	(41,982)
(8,680)	SEEK Ltd	JP Morgan	(18,253)
123,264	South32 Ltd	Bank of America Merrill Lynch	14,552
743,437	South32 Ltd	Goldman Sachs	87,767
31,413	Suncorp Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	19,238
96,998	Suncorp Group Ltd	Barclays Bank	28,628
49,861	Suncorp Group Ltd	Goldman Sachs	30,536
(102,587)	Sydney Airport (Unit)	Bank of America Merrill Lynch	6,812
(138,349)	Sydney Airport (Unit)	Barclays Bank	18,375
(132,428)	Sydney Airport (Unit)	Credit Suisse	(65,467)
52,651	Tabcorp Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(11,266)
37,731	Tabcorp Holdings Ltd	Barclays Bank	(5,846)
61,214	Tabcorp Holdings Ltd	Citibank	(9,485)
21,476	Tabcorp Holdings Ltd	Credit Suisse	(2,218)
96,622	Tabcorp Holdings Ltd	Deutsche Bank	(19,249)
27,840	Tabcorp Holdings Ltd	HSBC	(2,876)
37,820	Tabcorp Holdings Ltd	JP Morgan	(3,907)
(211,119)	Transurban Group (Unit)	Bank of America Merrill Lynch	165,121
(6,509)	Transurban Group (Unit)	Citibank	3,602
(123,661)	Transurban Group (Unit)	Goldman Sachs	96,718
(1,574)	Treasury Wine Estates Ltd	Bank of America Merrill Lynch	952
(11,073)	Treasury Wine Estates Ltd	Barclays Bank	11,602
(12,030)	Treasury Wine Estates Ltd	Credit Suisse	3,728
(57,736)	Treasury Wine Estates Ltd	Deutsche Bank	54,602
(22,100)	Treasury Wine Estates Ltd	Goldman Sachs	14,024
(906)	Treasury Wine Estates Ltd	JP Morgan	281
7,105	Wesfarmers Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4,875
13,737	Wesfarmers Ltd	Barclays Bank	4,156
23,240	Wesfarmers Ltd	Deutsche Bank	13,283
117,685	Wesfarmers Ltd	Goldman Sachs	80,755
(24,857)	WiseTech Global Ltd	Bank of America Merrill Lynch	17,240
36,874	Woodside Petroleum Ltd	Barclays Bank	111,551
96,584	Woolworths Group Ltd	Deutsche Bank	(101,956)
			852,351
	オーストリア		
76	ANDRITZ AG	Bank of America Merrill Lynch	53

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	オーストリア(続き)		
106	ANDRITZ AG	Deutsche Bank	74
22,659	ANDRITZ AG	Goldman Sachs	15,765
1,448	ANDRITZ AG	HSBC	4,342
23,934	OMV AG	Barclays Bank	218,770
47,005	OMV AG	Citibank	20,299
41,710	OMV AG	Deutsche Bank	76,050
7,763	OMV AG	JP Morgan	53,824
34,913	Raiffeisen Bank International AG	Deutsche Bank	21,806
(12,806)	voestalpine AG	Bank of America Merrill Lynch	(11,828)
(35,966)	voestalpine AG	Barclays Bank	(29,769)
(48,987)	voestalpine AG	Deutsche Bank	(45,247)
(12,552)	voestalpine AG	Goldman Sachs	(11,594)
(3,963)	voestalpine AG	HSBC	(8,034)
			<u>304,511</u>
	ベルギー		
(6,482)	Ageas SA	Bank of America Merrill Lynch	(9,175)
(12,409)	Ageas SA	Barclays Bank	(2,977)
(945)	Ageas SA	Credit Suisse	(4,319)
(7,204)	Ageas SA	Deutsche Bank	(10,197)
(10,613)	Anheuser-Busch InBev SA	Bank of America Merrill Lynch	10,439
(20,500)	Anheuser-Busch InBev SA	Deutsche Bank	20,164
(21,976)	Elia Group SA	Bank of America Merrill Lynch	(39,542)
(18,508)	Elia Group SA/NV	Deutsche Bank	(33,302)
(992)	Galapagos NV	Deutsche Bank	2,520
5,460	Groupe Bruxelles Lambert SA	Bank of America Merrill Lynch	8,514
8,548	Groupe Bruxelles Lambert SA	Barclays Bank	4,512
9,773	Groupe Bruxelles Lambert SA	Deutsche Bank	15,240
8,911	Groupe Bruxelles Lambert SA	Goldman Sachs	13,896
17,619	Groupe Bruxelles Lambert SA	HSBC	69,322
17,144	KBC Group NV	Deutsche Bank	56,760
30,001	Proximus SADP	Bank of America Merrill Lynch	(1,260)
25,106	Proximus SADP	Barclays Bank	17,016
11,353	Proximus SADP	Credit Suisse	18,249
67,641	Proximus SADP	Deutsche Bank	(2,840)
16,347	Proximus SADP	Goldman Sachs	(686)
7,097	Proximus SADP	HSBC	11,408
18,104	Telenet Group Holding NV	Bank of America Merrill Lynch	29,535
19,762	Telenet Group Holding NV	Deutsche Bank	32,240
2,881	Telenet Group Holding NV	Goldman Sachs	4,700
(756)	UCB SA	Barclays Bank	834
(1,817)	UCB SA	Deutsche Bank	5,405
(251)	UCB SA	Goldman Sachs	747
(13,911)	Umicore SA	Bank of America Merrill Lynch	(34,542)
(16,324)	Umicore SA	Deutsche Bank	(40,534)
(27,067)	Umicore SA	Goldman Sachs	(67,209)

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		
84,894	Axalta Coating Systems Ltd	Barclays Bank	168,939
1	Brookfield Property Partners LP	JP Morgan	1
(53,736)	Bunge Ltd	Goldman Sachs	32,779
(18,000)	CK Infrastructure Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	697
(152,500)	CK Infrastructure Holdings Ltd	Barclays Bank	(6,886)
(33,500)	CK Infrastructure Holdings Ltd	Citibank	(1,513)
(110,000)	CK Infrastructure Holdings Ltd	HSBC	(17,738)
(10,000)	CK Infrastructure Holdings Ltd	JP Morgan	(1,613)
50,900	Dairy Farm International Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(25,450)
39,600	Dairy Farm International Holdings Ltd	Barclays Bank	(9,108)
11,800	Dairy Farm International Holdings Ltd	Citibank	(2,714)
79,000	Dairy Farm International Holdings Ltd	Goldman Sachs	(39,500)
(850)	Everest Re Group Ltd	Citibank	1,318
(697)	Everest Re Group Ltd	JP Morgan	(341)
(497)	GOME Retail Holdings Ltd	JP Morgan	2
59,300	Hongkong Land Holdings Ltd	Barclays Bank	(13,046)
43,800	Hongkong Land Holdings Ltd	Deutsche Bank	(8,102)
16,400	Hongkong Land Holdings Ltd	Goldman Sachs	(3,230)
(2,449)	IHS Markit Ltd	Barclays Bank	(15,439)
(7,847)	Invesco Ltd	Barclays Bank	(3,178)
(13,369)	Invesco Ltd	Citibank	(5,414)
(50,268)	Invesco Ltd	Credit Suisse	(95,258)
(26,515)	Invesco Ltd	Goldman Sachs	(19,754)
(42,979)	Invesco Ltd	HSBC	(81,445)
(9,100)	Jardine Matheson Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(12,467)
(19,400)	Jardine Matheson Holdings Ltd	Barclays Bank	21,922
(6,123)	Jardine Matheson Holdings Ltd	HSBC	(41,147)
67,000	Kerry Properties Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3,976)
330,000	Kerry Properties Ltd	Barclays Bank	(45,125)
270,500	Kerry Properties Ltd	Goldman Sachs	(16,052)
(56,110)	Marvell Technology Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(138,031)
(1,724)	RenaissanceRe Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	26,877
(3,430)	RenaissanceRe Holdings Ltd	Credit Suisse	3,739
(3,552)	RenaissanceRe Holdings Ltd	Goldman Sachs	55,376
(653)	RenaissanceRe Holdings Ltd	JP Morgan	712
(145)	Shenzhen International	Holdings Ltd JP Morgan	-
			(294,165)
	カナダ		
(878)	Agnico Eagle Mines Ltd	Bank of America Merrill Lynch	8,608
(924)	Agnico Eagle Mines Ltd	Citibank	1,222
(2,597)	Agnico Eagle Mines Ltd	Credit Suisse	13,722
(862)	Agnico Eagle Mines Ltd	JP Morgan	10,617
10,692	Air Canada	HSBC	37,036
8,971	Air Canada	JP Morgan	28,055
4,532	AltaGas Ltd	Goldman Sachs	2,593

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)		
8,793	AltaGas Ltd	HSBC	8,974
(2,099)	Atco Ltd 'I'	Bank of America Merrill Lynch	(1,960)
(3,191)	Atco Ltd 'I'	Credit Suisse	(3,693)
183,094	B2Gold Corp	Bank of America Merrill Lynch	(113,253)
431,340	B2Gold Corp	Goldman Sachs	(266,805)
27,420	B2Gold Corp	JP Morgan	(27,773)
(25,262)	Bank of Montreal	Bank of America Merrill Lynch	(117,685)
(5,727)	Bank of Montreal	Citibank	(4,694)
(7,318)	Bank of Montreal	Goldman Sachs	(28,458)
(2,708)	Bank of Nova Scotia	Goldman Sachs	(2,996)
(85,926)	Barrick Gold Corp	HSBC	426,277
(50,755)	Bausch Health Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	53,371
(10,074)	Bausch Health Cos Inc	Credit Suisse	1,714
(11,062)	Bausch Health Cos Inc	Goldman Sachs	11,632
7,010	BCE Inc	Bank of America Merrill Lynch	(311)
8,546	BCE Inc	Credit Suisse	(130)
10,858	BCE Inc	Goldman Sachs	238
3,117	BCE Inc	HSBC	4,386
(13,428)	Brookfield Asset Management Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(8,929)
(31,564)	Brookfield Asset Management Inc 'A'	Credit Suisse	(152,042)
(4,270)	CAE Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,896)
(5,116)	CAE Inc	JP Morgan	(18,512)
(1,740)	Canadian Imperial Bank of Commerce	Bank of America Merrill Lynch	(2,596)
(2,905)	Canadian Imperial Bank of Commerce	Citibank	(1,662)
(2,459)	Canadian Imperial Bank of Commerce	Goldman Sachs	(1,740)
(1,206)	Canadian Imperial Bank of Commerce	JP Morgan	(7,637)
(5,404)	Canadian Natural Resources Ltd	Citibank	(3,802)
(3,597)	Canadian Natural Resources Ltd	Credit Suisse	(12,543)
(7,979)	Canadian Natural Resources Ltd	HSBC	(27,823)
(36,056)	Canadian Utilities Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(32,524)
(29,767)	Canadian Utilities Ltd 'A'	Goldman Sachs	(26,108)
(19,398)	Canadian Utilities Ltd 'A'	HSBC	(18,298)
(21,433)	Canadian Utilities Ltd 'A'	JP Morgan	(17,699)
(21,768)	CGI Inc	Bank of America Merrill Lynch	(68,333)
(11,914)	CGI Inc	Citibank	(26,438)
(6,009)	CGI Inc	Credit Suisse	(26,854)
(7,076)	CGI Inc	JP Morgan	(31,623)
27,134	CI Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,727
10,939	CI Financial Corp	Citibank	(1,269)
7,018	CI Financial Corp	Goldman Sachs	705
1,583	Constellation Software Inc	Bank of America Merrill Lynch	152,639
3,354	Constellation Software Inc	Goldman Sachs	323,406
85	Constellation Software Inc	HSBC	6,290
(36,959)	Dollarama Inc	Bank of America Merrill Lynch	(54,866)
(6,427)	Dollarama Inc	Goldman Sachs	(9,541)

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)		
(103,346)	Emera Inc	Bank of America Merrill Lynch	105,670
(25,859)	Emera Inc	Citibank	15,195
(2,403)	Emera Inc	Credit Suisse	1,726
(17,995)	Emera Inc	JP Morgan	20,870
18,250	Empire Co Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(8,184)
31,980	Empire Co Ltd 'A'	Goldman Sachs	(14,341)
12,798	Empire Co Ltd 'A'	HSBC	(3,760)
(3,544)	Fairfax Financial Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(13,262)
(718)	Fairfax Financial Holdings Ltd	Citibank	328
(1,872)	Fairfax Financial Holdings Ltd	Goldman Sachs	(7,005)
(295)	Fairfax Financial Holdings Ltd	JP Morgan	(10,225)
(3,960)	Fortis Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,752
(1,597)	Fortis Inc	Citibank	1,198
(3,104)	Fortis Inc	Goldman Sachs	2,302
8,673	George Weston Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(12,003)
15,438	George Weston Ltd	HSBC	(23,873)
(3,085)	Gildan Activewear Inc	Credit Suisse	(8,372)
(15,870)	Gildan Activewear Inc	Goldman Sachs	(34,603)
20,809	Hydro One Ltd	Bank of America Merrill Lynch	12,067
180,834	Hydro One Ltd	Goldman Sachs	104,864
59,152	Hydro One Ltd	HSBC	(9,604)
4,082	iA Financial Corp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,302)
1,546	iA Financial Corp Inc	Citibank	(992)
(21,637)	IGM Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(13,551)
(7,370)	IGM Financial Inc	Goldman Sachs	(4,616)
5,785	Intact Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(16,763)
1,943	Intact Financial Corp	HSBC	(4,686)
(129,380)	Inter Pipeline Ltd	Goldman Sachs	(83,029)
(3,128)	Keyera Corp	HSBC	(7,843)
74,519	Kinross Gold Corp	Bank of America Merrill Lynch	(68,276)
10,549	Kinross Gold Corp	Goldman Sachs	(9,665)
21,409	Loblaw Cos Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(20,857)
27,764	Loblaw Cos Ltd	Goldman Sachs	(27,048)
21,076	Loblaw Cos Ltd	HSBC	(32,754)
4,817	Loblaw Cos Ltd	JP Morgan	(7,486)
8,837	Magna International Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,621
3,992	Magna International Inc	Citibank	833
3,173	Magna International Inc	Goldman Sachs	(398)
2,718	Magna International Inc	HSBC	2,037
92,780	Manulife Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	20,086
28,708	Manulife Financial Corp	Citibank	9,323
991	Manulife Financial Corp	Goldman Sachs	215
(5,809)	Metro Inc	Credit Suisse	13,115
(60,670)	Metro Inc	Goldman Sachs	67,549
(51,195)	Nutrien Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(270,354)

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)		
(8,432)	Nutrien Ltd	Citibank	(17,603)
13,769	Open Text Corp	Bank of America Merrill Lynch	26,402
3,576	Open Text Corp	Citibank	2,129
6,436	Open Text Corp	Credit Suisse	23,786
15,971	Open Text Corp	Goldman Sachs	30,624
11,162	Open Text Corp	HSBC	41,253
5,720	Open Text Corp	JP Morgan	21,140
2,733	Parkland Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,219)
4,759	Parkland Corp	Citibank	368
9,258	Parkland Corp	Goldman Sachs	(7,516)
2,847	Parkland Corp	HSBC	616
4,392	Quebecor Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(1,460)
7,503	Quebecor Inc 'B'	Citibank	986
3,826	Quebecor Inc 'B'	Credit Suisse	(1,006)
6,821	Quebecor Inc 'B'	Goldman Sachs	(2,268)
7,831	Quebecor Inc 'B'	HSBC	(2,059)
15,645	Quebecor Inc 'B'	JP Morgan	(4,113)
(1,212)	Restaurant Brands International Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,565
10,569	Saputo Inc	Bank of America Merrill Lynch	9,970
3,434	Saputo Inc	Goldman Sachs	3,239
10,086	Saputo Inc	HSBC	16,610
(9,883)	Shaw Communications Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	4,203
(141)	Shopify Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(10,724)
(273)	Shopify Inc 'A'	HSBC	(34,920)
16,086	Sun Life Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(16,293)
8,767	Sun Life Financial Inc	Citibank	(7,863)
18,133	Suncor Energy Inc	Goldman Sachs	33,789
8,492	Suncor Energy Inc	JP Morgan	12,944
(3,859)	TC Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	(7,411)
(13,720)	TC Energy Corp	Citibank	(15,912)
(1,770)	TC Energy Corp	HSBC	(7,253)
(49,898)	Teck Resources Ltd 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(44,753)
(7,939)	TELUS Corp	HSBC	(6,384)
(15,856)	Thomson Reuters Corp	Bank of America Merrill Lynch	37,871
(4,195)	Thomson Reuters Corp	Citibank	5,125
(2,395)	Thomson Reuters Corp	Goldman Sachs	6,892
(1,972)	Thomson Reuters Corp	HSBC	9,697
(4,805)	Thomson Reuters Corp	JP Morgan	7,171
(3,212)	TMX Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3,895)
(718)	TMX Group Ltd	Citibank	(683)
(2,264)	TMX Group Ltd	Credit Suisse	(890)
(6,856)	TMX Group Ltd	Goldman Sachs	796
(12,739)	Toronto-Dominion Bank	Bank of America Merrill Lynch	(21,567)
(16,672)	Toronto-Dominion Bank	Citibank	(7,605)
(1,052)	Toronto-Dominion Bank	Goldman Sachs	400

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)			
(20,464)	Toronto-Dominion Bank	HSBC	(73,375)
(16,549)	Waste Connections Inc	Barclays Bank	(42,635)
(5,234)	Waste Connections Inc	Goldman Sachs	16,068
(2,623)	Waste Connections Inc	HSBC	4,564
			<u>(384,581)</u>
ケイマン諸島			
(13,000)	ASM Pacific Technology Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(16,770)
(33,200)	ASM Pacific Technology Ltd	Barclays Bank	(41,116)
(89,000)	ASM Pacific Technology Ltd	HSBC	(202,070)
(17,400)	ASM Pacific Technology Ltd	JP Morgan	(39,506)
(1,458)	BeiGene Ltd ADR	Bank of America Merrill Lynch	4,272
(154)	BeiGene Ltd ADR	Credit Suisse	1,093
(484)	BeiGene Ltd ADR	Goldman Sachs	1,418
(113,300)	Budweiser Brewing Co APAC Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(8,039)
(191,800)	Budweiser Brewing Co APAC Ltd	Citibank	60,620
(65,900)	Budweiser Brewing Co APAC Ltd	Goldman Sachs	(4,676)
178,000	CK Asset Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	18,370
278,000	CK Asset Holdings Ltd	Barclays Bank	(21,518)
29,000	CK Asset Holdings Ltd	Citibank	(2,245)
29,000	CK Asset Holdings Ltd	Credit Suisse	16,274
88,000	CK Asset Holdings Ltd	Goldman Sachs	9,082
394,500	CK Asset Holdings Ltd	HSBC	221,379
72,000	CK Asset Holdings Ltd	JP Morgan	40,404
82,000	CK Hutchison Holdings Ltd	Goldman Sachs	11,636
(38,000)	Microport Scientific Corp	Citibank	7,353
(16,000)	Microport Scientific Corp	HSBC	(7,121)
(11)	Semiconductor Manufacturing International Corp	JP Morgan	4
(330,000)	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	Citibank	34,057
(141,600)	Wynn Macau Ltd	Barclays Bank	(27,035)
			<u>55,866</u>
中国			
(866)	China Everbright Bank Co Ltd 'H'	Citibank	5
			<u>5</u>
キュラソー島			
20,914	Schlumberger NV	Barclays Bank	3,973
7,334	Schlumberger NV	JP Morgan	26,036
			<u>30,009</u>
デンマーク			
(6,210)	Ambu A/S 'B'	Citibank	(12,313)
(10,336)	Ambu A/S 'B'	Deutsche Bank	(12,180)
95	AP Moller - Maersk A/S 'A'	Deutsche Bank	21,746
4,816	Carlsberg A/S 'B'	Deutsche Bank	(26,395)
11,486	Carlsberg A/S 'B'	JP Morgan	28,514
(17,066)	Chr Hansen Holding A/S	Deutsche Bank	139,202

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)			
441	Coloplast A/S 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(140)
13,542	Coloplast A/S 'B'	Deutsche Bank	(1,370)
21,021	Danske Bank A/S	Deutsche Bank	(1,825)
2,926	Danske Bank A/S	HSBC	(673)
(1,363)	Demant A/S	Deutsche Bank	(4,568)
(5,413)	DSV PANALPINA A/S	Bank of America Merrill Lynch	4,188
(4,191)	DSV PANALPINA A/S	Deutsche Bank	14,151
2,660	Genmab A/S	Deutsche Bank	53,214
6,924	GN Store Nord A/S	Bank of America Merrill Lynch	33,931
(21,976)	H Lundbeck A/S	Deutsche Bank	34,362
13,770	Novo Nordisk A/S 'B'	Citibank	(2,664)
61,284	Novo Nordisk A/S 'B'	Deutsche Bank	(20,679)
9,054	Novozymes A/S 'B'	Deutsche Bank	(20,313)
2,996	Novozymes A/S 'B'	HSBC	(10,528)
4,460	Pandora A/S	Deutsche Bank	27,608
1,309	Pandora A/S	JP Morgan	13,125
(6,118)	Tryg A/S	Deutsche Bank	8,186
(1,611)	Vestas Wind Systems A/S	Deutsche Bank	(25,511)
			<u>239,068</u>
フィンランド			
11,693	Elisa Oyj	Deutsche Bank	(4,453)
(63,257)	Nokia Oyj	Deutsche Bank	(5,263)
12,922	Nordea Bank Abp	Bank of America Merrill Lynch	612
150,925	Nordea Bank Abp	Deutsche Bank	1,422
1,309	Orion Oyj 'B'	Credit Suisse	1,504
1,994	Orion Oyj 'B'	Deutsche Bank	223
2,302	Sampo Oyj 'A'	Deutsche Bank	197
(241,716)	Wartsila Oyj Abp	Deutsche Bank	(58,570)
(59,321)	Wartsila Oyj Abp	Goldman Sachs	(14,374)
			<u>(78,702)</u>
フランス			
8,290	Accor SA	Deutsche Bank	(9,944)
(845)	Aeroports de Paris	Bank of America Merrill Lynch	8,210
(2,316)	Aeroports de Paris	Barclays Bank	(56,119)
(690)	Aeroports de Paris	Credit Suisse	910
(2,250)	Aeroports de Paris	Deutsche Bank	21,862
(2,246)	Aeroports de Paris	Goldman Sachs	21,823
(700)	Aeroports de Paris	HSBC	924
7,216	Alstom SA	Barclays Bank	30,902
16,965	Alstom SA	Deutsche Bank	46,275
(10,018)	Amundi SA	Bank of America Merrill Lynch	6,609
(12,847)	Amundi SA	Barclays Bank	12,328
(965)	Amundi SA	Deutsche Bank	637
(14,993)	Amundi SA	HSBC	(12,589)
(67,951)	AXA SA	Deutsche Bank	(89,988)

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)		
2,222	BioMerieux	Deutsche Bank	(2,932)
1,812	BioMerieux	HSBC	8,260
27,961	BNP Paribas SA	Bank of America Merrill Lynch	98,945
18,207	BNP Paribas SA	Deutsche Bank	64,429
95,055	Bollore SA	Bank of America Merrill Lynch	(21,436)
155,570	Bollore SA	Barclays Bank	(24,260)
276,881	Bollore SA	Deutsche Bank	(62,441)
61,217	Bollore SA	Goldman Sachs	(13,805)
(8,203)	Bouygues SA	Barclays Bank	(31,980)
(68,131)	Bouygues SA	Deutsche Bank	17,163
(9,908)	Bureau Veritas SA	Barclays Bank	(951)
(9,329)	Bureau Veritas SA	Citibank	(895)
(61,078)	Bureau Veritas SA	Deutsche Bank	(4,568)
(639)	Bureau Veritas SA	Goldman Sachs	169
(3,720)	Bureau Veritas SA	JP Morgan	(4,016)
(1,945)	Capgemini SE	Deutsche Bank	(6,416)
(7,639)	Carrefour SA	Deutsche Bank	346
5,513	Cie de Saint-Gobain	Barclays Bank	32,470
26,690	Cie de Saint-Gobain	Deutsche Bank	27,534
6,060	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	Barclays Bank	1,817
7,932	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	Deutsche Bank	3,711
4,129	CNP Assurances	Deutsche Bank	(1,326)
49,664	Credit Agricole SA	Barclays Bank	29,430
4,078	Credit Agricole SA	Citibank	2,417
130,510	Credit Agricole SA	Deutsche Bank	157,104
49,413	Credit Agricole SA	Goldman Sachs	59,985
13,546	Credit Agricole SA	HSBC	22,034
(39,037)	Danone SA	Deutsche Bank	32,992
(450)	Dassault Aviation SA	Bank of America Merrill Lynch	21,862
(563)	Dassault Aviation SA	Barclays Bank	(98,263)
(1,089)	Dassault Aviation SA	Credit Suisse	(73,807)
(420)	Dassault Aviation SA	Deutsche Bank	20,404
(746)	Dassault Aviation SA	Goldman Sachs	36,242
(11,511)	Edenred	Deutsche Bank	(34,106)
(15,090)	Eiffage SA	Deutsche Bank	724
(20,532)	Electricite de France SA	Deutsche Bank	(27,031)
32,292	Engie SA	Deutsche Bank	3,680
(5,469)	EssilorLuxottica SA	Deutsche Bank	(26,241)
473	Eurazeo SE	Bank of America Merrill Lynch	624
30,764	Eurazeo SE	Barclays Bank	(12,916)
20,802	Eurazeo SE	Deutsche Bank	27,448
4,993	Eurazeo SE	Goldman Sachs	6,588
(25,021)	Getlink SE	Bank of America Merrill Lynch	5,102
(88,529)	Getlink SE	Deutsche Bank	18,053
(20,193)	Getlink SE	Goldman Sachs	4,118

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)		
(594)	Hermes International	Deutsche Bank	12,683
(540)	Iliad SA	Bank of America Merrill Lynch	162
(859)	Iliad SA	Barclays Bank	(1,288)
7,170	Ipsen SA	Deutsche Bank	(38,703)
(1,324)	Kering SA	Barclays Bank	(52,093)
(286)	Kering SA	Credit Suisse	(1,784)
(1,161)	Kering SA	Deutsche Bank	16,991
(526)	Kering SA	JP Morgan	(3,281)
2,948	Legrand SA	Barclays Bank	1,132
11,778	Legrand SA	Credit Suisse	(283)
5,024	Legrand SA	Deutsche Bank	(294)
1,755	Legrand SA	Goldman Sachs	(42)
43,022	Legrand SA	HSBC	(1,032)
(2,380)	L'Oréal SA	Deutsche Bank	25,694
(7,574)	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	Deutsche Bank	(171,260)
(63)	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	HSBC	(2,063)
(164,870)	Natixis SA	Barclays Bank	(104,422)
(32,104)	Orpea SA	Deutsche Bank	90,499
32,933	Peugeot SA	Barclays Bank	148,340
(3,783)	Remy Cointreau SA	Deutsche Bank	31,311
(1,478)	Renault SA	Deutsche Bank	(5,499)
(10,807)	Safran SA	Deutsche Bank	(39,539)
5,882	Sartorius Stedim Biotech	Barclays Bank	57,857
14,085	Schneider Electric SE	Citibank	(29,567)
20,463	Schneider Electric SE	Deutsche Bank	12,273
1,030	Schneider Electric SE	JP Morgan	(988)
(5,159)	SEB SA	Bank of America Merrill Lynch	(24,135)
(9,517)	SEB SA	Barclays Bank	(49,089)
5,867	Societe Generale SA	Bank of America Merrill Lynch	5,489
4,692	Societe Generale SA	Barclays Bank	2,882
1,667	Societe Generale SA	Credit Suisse	3,155
64,480	Societe Generale SA	Deutsche Bank	59,889
9,653	Societe Generale SA	Goldman Sachs	9,032
(1,944)	Thales SA	Deutsche Bank	2,669
24,562	TOTAL SE	Deutsche Bank	83,923
1,194	TOTAL SE	Goldman Sachs	4,385
(11,230)	Ubisoft Entertainment SA	Deutsche Bank	(6,021)
(16,380)	Valeo SA	Barclays Bank	(33,010)
2,068	Veolia Environnement SA	Barclays Bank	2,394
28,852	Veolia Environnement SA	Deutsche Bank	24,547
(14,676)	Vinci SA	Deutsche Bank	(10,211)
17,783	Vivendi SA	Deutsche Bank	(2,560)
869	Wendel SE	Bank of America Merrill Lynch	990
14,613	Wendel SE	Barclays Bank	10,517
2,012	Wendel SE	Deutsche Bank	2,293

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)		
3,180	Wendel SE	Goldman Sachs	3,624
(12,318)	Worldline SA	Deutsche Bank	(72,994)
			<u>200,674</u>
	ドイツ		
(1,081)	adidas AG	Deutsche Bank	3,760
(1,647)	adidas AG	Goldman Sachs	5,729
3,058	Allianz SE RegS	Deutsche Bank	9,368
313	Allianz SE RegS	JP Morgan	1,793
5,345	BASF SE	Barclays Bank	26,865
19,341	BASF SE	Deutsche Bank	105,983
(16,878)	Bayer AG RegS	Deutsche Bank	(35,741)
(1,243)	Bayerische Motoren Werke AG (Pref)	Bank of America Merrill Lynch	(745)
(2,991)	Bayerische Motoren Werke AG (Pref)	Deutsche Bank	(1,794)
(7,737)	Beiersdorf AG	Deutsche Bank	67,379
(11,477)	Beiersdorf AG	Goldman Sachs	99,950
10,141	Brenntag AG	Bank of America Merrill Lynch	28,952
8,841	Brenntag AG	Deutsche Bank	25,240
1,280	Brenntag AG	Goldman Sachs	3,654
(2,157)	Carl Zeiss Meditec AG	Barclays Bank	8,797
(8,364)	Carl Zeiss Meditec AG	Deutsche Bank	55,182
(257)	Carl Zeiss Meditec AG	Goldman Sachs	1,696
(33,817)	Commerzbank AG	Deutsche Bank	(12,251)
2,020	Covestro AG	Barclays Bank	3,368
7,842	Covestro AG	Deutsche Bank	12,417
(11,469)	Delivery Hero SE	Deutsche Bank	(56,144)
(13,528)	Deutsche Bank AG RegS	HSBC	(10,434)
6	Deutsche EuroShop AG	HSBC	30
28,035	Deutsche Post AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	71,631
6,952	Deutsche Post AG RegS	Credit Suisse	2,835
94,412	Deutsche Post AG RegS	Deutsche Bank	241,227
25,328	Deutsche Post AG RegS	HSBC	10,330
1,040	Deutsche Post AG RegS	JP Morgan	424
11,653	Deutsche Telekom AG RegS	Deutsche Bank	6,073
1,009	Deutsche Wohnen SE	Bank of America Merrill Lynch	1,389
204	Deutsche Wohnen SE	Deutsche Bank	(158)
1,062	Deutsche Wohnen SE	Goldman Sachs	188
(91,199)	E.ON SE	Deutsche Bank	7,714
(4,367)	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	Deutsche Bank	(8,064)
(2,248)	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	JP Morgan	(8,513)
(8,216)	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	Deutsche Bank	12,973
88,880	GEA Group AG	Deutsche Bank	(24,522)
478	Hannover Rueck SE	Barclays Bank	(1,376)
1,813	Hannover Rueck SE	Deutsche Bank	(10,618)
22,997	HeidelbergCement AG	Barclays Bank	36,965

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)		
3,650	HeidelbergCement AG	Deutsche Bank	3,790
(20,150)	Henkel AG & Co KGaA	Deutsche Bank	(51,121)
(5,479)	Henkel AG & Co KGaA (Pref)	Deutsche Bank	(18,168)
(1,985)	Infineon Technologies AG	Deutsche Bank	(3,853)
(2,358)	KION Group AG	Barclays Bank	15,896
(3,203)	KION Group AG	Barclays Bank	(1,710)
(13,238)	KION Group AG	HSBC	86,703
(13,238)	KION Group AG	HSBC	(7,066)
(3,660)	LEG Immobilien AG	Deutsche Bank	(9,898)
(2,180)	METRO AG	Bank of America Merrill Lynch	1,752
(93,720)	METRO AG	Deutsche Bank	47,540
(31,548)	METRO AG	JP Morgan	29,745
(2,242)	MTU Aero Engines AG	Bank of America Merrill Lynch	9,682
(279)	MTU Aero Engines AG	Citibank	(1,205)
2,510	Nemetschek SE	Bank of America Merrill Lynch	9,785
139	Nemetschek SE	Citibank	634
1,540	Nemetschek SE	Credit Suisse	2,217
4,132	Nemetschek SE	Deutsche Bank	15,120
(20,635)	Porsche Automobil Holding SE (Pref)	Barclays Bank	54,951
(41,194)	Porsche Automobil Holding SE (Pref)	Deutsche Bank	118,594
(4,018)	Porsche Automobil Holding SE (Pref)	Goldman Sachs	11,568
19,402	Puma SE	Deutsche Bank	22,808
(5,901)	Scout24 AG	Deutsche Bank	(1,650)
(1,678)	Scout24 AG	Goldman Sachs	(604)
1,302	Siemens AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	781
(12,681)	Siemens Healthineers AG	Bank of America Merrill Lynch	(1,901)
(16,457)	Siemens Healthineers AG	Barclays Bank	(20,827)
(36,467)	Siemens Healthineers AG	Deutsche Bank	(28,608)
1,864	Symrise AG	Deutsche Bank	6,649
(7,498)	TeamViewer AG	Deutsche Bank	(12,451)
177,952	Telefonica Deutschland Holding AG	Barclays Bank	31,379
(5,195)	Uniper SE	Barclays Bank	(11,092)
(10,741)	Uniper SE	Deutsche Bank	(3,504)
(210)	United Internet AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	(144)
(7,511)	United Internet AG RegS	Barclays Bank	(7,839)
(3,936)	United Internet AG RegS	Deutsche Bank	(2,691)
(6,679)	United Internet AG RegS	HSBC	(32,768)
(14,435)	United Internet AG RegS	JP Morgan	(70,820)
3,072	Zalando SE	Barclays Bank	13,340
3,087	Zalando SE	Deutsche Bank	15,553
6,123	Zalando SE	Goldman Sachs	30,848
			922,967
	香港		
39,800	AIA Group Ltd	Barclays Bank	(10,525)
(222,400)	Bank of East Asia Ltd	Barclays Bank	(29,264)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	香港(続き)		
(609,200)	Bank of East Asia Ltd	Citibank	(80,160)
(199)	Bank of East Asia Ltd	JP Morgan	(67)
211,500	BOC Hong Kong Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	36,834
128,500	BOC Hong Kong Holdings Ltd	Barclays Bank	9,946
40,500	BOC Hong Kong Holdings Ltd	Goldman Sachs	7,053
178,000	BOC Hong Kong Holdings Ltd	HSBC	53,962
28,500	BOC Hong Kong Holdings Ltd	JP Morgan	8,640
(97,000)	Hang Lung Properties Ltd	Bank of America Merrill Lynch	14,766
(88,000)	Hang Lung Properties Ltd	Citibank	19,072
(306,000)	Hang Lung Properties Ltd	Goldman Sachs	46,580
(54,000)	Hang Lung Properties Ltd	JP Morgan	8,220
70,000	Henderson Land Development Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	13,545
132,000	Henderson Land Development Co Ltd	Barclays Bank	22,988
263,000	Henderson Land Development Co Ltd	Goldman Sachs	50,892
(634,000)	Hong Kong & China Gas Co Ltd	Barclays Bank	6,543
(31,950)	Hong Kong & China Gas Co Ltd	HSBC	(1,731)
10,200	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	Barclays Bank	11,316
1,300	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	HSBC	(402)
(253,500)	MTR Corp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3,270)
(729,952)	MTR Corp Ltd	Barclays Bank	(47,083)
(146,500)	MTR Corp Ltd	Citibank	(9,449)
(109,000)	MTR Corp Ltd	JP Morgan	(33,044)
12,000	New World Development Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(542)
13,000	New World Development Co Ltd	Barclays Bank	(503)
50,000	New World Development Co Ltd	Goldman Sachs	(2,258)
15,000	New World Development Co Ltd	HSBC	3,870
19,000	New World Development Co Ltd	JP Morgan	4,902
101,500	Power Assets Holdings Ltd	Goldman Sachs	(6,547)
64,000	Sun Hung Kai Properties Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4,954)
66,000	Sun Hung Kai Properties Ltd	Barclays Bank	(3,406)
12,000	Sun Hung Kai Properties Ltd	Credit Suisse	6,657
33,500	Sun Hung Kai Properties Ltd	Goldman Sachs	(2,593)
22,500	Sun Hung Kai Properties Ltd	HSBC	12,481
13,500	Sun Hung Kai Properties Ltd	JP Morgan	7,489
160,000	Swire Pacific Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	40,249
166,500	Swire Pacific Ltd 'A'	Barclays Bank	(10,740)
144,000	Swire Pacific Ltd 'A'	Citibank	(9,288)
63,000	Swire Pacific Ltd 'A'	Credit Suisse	54,046
1,000	Swire Pacific Ltd 'A'	Goldman Sachs	252
250,000	Swire Pacific Ltd 'A'	HSBC	214,468
38,500	Swire Pacific Ltd 'A'	JP Morgan	33,028
(217,400)	Swire Properties Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,805
(311,600)	Swire Properties Ltd	Barclays Bank	4,020
(106,400)	Swire Properties Ltd	HSBC	(27,452)
12,500	Techtronic Industries Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(9,111)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
香港(続き)			
21,000	Techtronic Industries Co Ltd	Barclays Bank	(21,808)
14,000	Techtronic Industries Co Ltd	Citibank	(14,539)
29,500	Techtronic Industries Co Ltd	Credit Suisse	(41,481)
22,500	Techtronic Industries Co Ltd	Goldman Sachs	(16,400)
21,000	Techtronic Industries Co Ltd	HSBC	(22,164)
19,000	Techtronic Industries Co Ltd	JP Morgan	(28,065)
			<u>257,778</u>
アイルランド			
3,256	Accenture Plc 'A'	Barclays Bank	1,574
1,586	Accenture Plc 'A'	HSBC	11,825
1,056	Allegion Plc	Goldman Sachs	(1,325)
(1,928)	Aon Plc 'A'	Barclays Bank	(4,955)
(3,131)	Aon Plc 'A'	Citibank	(8,047)
(2,133)	Aon Plc 'A'	JP Morgan	(27,388)
780	DCC Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1,752)
7,556	DCC Plc	Barclays Bank	13,540
27,671	DCC Plc	Deutsche Bank	(42,991)
1,982	DCC Plc	Goldman Sachs	(4,453)
5,428	DCC Plc	HSBC	6,388
4,384	Eaton Corp Plc	Bank of America Merrill Lynch	14,686
7,617	Eaton Corp Plc	Citibank	4,494
9,237	Eaton Corp Plc	HSBC	67,892
22,252	James Hardie Industries Plc - CDI	Bank of America Merrill Lynch	5,090
2,503	James Hardie Industries Plc - CDI	Deutsche Bank	573
52,189	James Hardie Industries Plc - CDI	Goldman Sachs	11,937
(9,896)	Kerry Group Plc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	71,224
(1,578)	Kerry Group Plc 'A'	Barclays Bank	(20,978)
(13,228)	Kerry Group Plc 'A'	Citibank	9,521
(240)	Kerry Group Plc 'A'	JP Morgan	(1,180)
1,791	Kingspan Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(7,197)
1,727	Kingspan Group Plc	Barclays Bank	1,036
2,628	Kingspan Group Plc	Citibank	1,576
1,181	Kingspan Group Plc	HSBC	(8,713)
464	Kingspan Group Plc	JP Morgan	(3,423)
(2,200)	Medtronic Plc	Citibank	(6,666)
17,775	Pentair Plc	Barclays Bank	26,008
(16,296)	Perrigo Co Plc	Barclays Bank	(47,095)
(13,780)	Perrigo Co Plc	Goldman Sachs	11,300
(16,049)	Seagate Technology Plc	Barclays Bank	(112,320)
(17,034)	Seagate Technology Plc	Citibank	(30,321)
271	STERIS Plc	Goldman Sachs	559
(1,895)	Trane Technologies Plc	Barclays Bank	(23,195)
(5,174)	Willis Towers Watson Plc	Barclays Bank	(23,438)
			<u>(116,214)</u>

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
マン島			
9,601	GVC Holdings Plc	Barclays Bank	10,015
17,950	GVC Holdings Plc	Deutsche Bank	12,962
358	GVC Holdings Plc	HSBC	346
			23,323
イスラエル			
(4,186)	CyberArk Software Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(33,739)
(5,538)	CyberArk Software Ltd	Barclays Bank	(16,614)
(1)	Sisram Medical Ltd	JP Morgan	-
(73,180)	Teva Pharmaceutical Industries Ltd ADR	Bank of America Merrill Lynch	(6,586)
(21,161)	Teva Pharmaceutical Industries Ltd ADR	Barclays Bank	(2,328)
(13,024)	Teva Pharmaceutical Industries Ltd ADR	Citibank	(1,433)
(16,592)	Teva Pharmaceutical Industries Ltd ADR	Goldman Sachs	(1,493)
390	Wix.com Ltd	Bank of America Merrill Lynch	6,653
487	Wix.com Ltd	Barclays Bank	4,816
75	Wix.com Ltd	Goldman Sachs	1,280
			(49,444)
イタリア			
(27,105)	Atlantia SpA	Barclays Bank	(15,444)
(19,926)	Atlantia SpA	Deutsche Bank	(22,310)
(10,348)	Atlantia SpA	Goldman Sachs	(13,654)
(3,862)	Atlantia SpA	JP Morgan	(2,154)
6	Autogrill SpA	Citibank	(1)
3	Autogrill SpA	JP Morgan	3
510	DiaSorin SpA	Bank of America Merrill Lynch	2,202
883	DiaSorin SpA	Deutsche Bank	3,813
1,050	DiaSorin SpA	Goldman Sachs	4,534
1,609	DiaSorin SpA	HSBC	17,178
5,528	Enel SpA	Bank of America Merrill Lynch	2,473
60,100	Enel SpA	Barclays Bank	27,540
47,781	Enel SpA	Deutsche Bank	21,379
194,721	Enel SpA	Goldman Sachs	87,124
14,356	Eni SpA	Bank of America Merrill Lynch	9,936
42,924	Eni SpA	Credit Suisse	60,088
244,852	Eni SpA	Deutsche Bank	169,472
28,207	Eni SpA	HSBC	39,486
17,761	Eni SpA	JP Morgan	24,863
(127,821)	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	Barclays Bank	(250,691)
(157,544)	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	Deutsche Bank	(117,169)
685,295	Intesa Sanpaolo SpA	Barclays Bank	332,928
109,283	Intesa Sanpaolo SpA	Deutsche Bank	13,345
1,422,658	Intesa Sanpaolo SpA	Goldman Sachs	173,727
(50,328)	Leonardo SpA	Bank of America Merrill Lynch	(18,474)
(54,770)	Leonardo SpA	Barclays Bank	(5,387)
(10,090)	Leonardo SpA	Citibank	(992)
(9,596)	Leonardo SpA	Credit Suisse	(10,751)

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)			
(59,250)	Leonardo SpA	Deutsche Bank	(21,748)
(25,395)	Leonardo SpA	Goldman Sachs	(9,322)
(10,050)	Leonardo SpA	JP Morgan	(11,260)
(56,487)	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	Bank of America Merrill Lynch	(16,533)
(56,862)	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	Barclays Bank	(2,319)
(8,210)	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	Citibank	(335)
(17,480)	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	Credit Suisse	(8,597)
(65,991)	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	Deutsche Bank	(19,315)
(3,814)	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	Goldman Sachs	(1,116)
(49,198)	Nexi SpA	Barclays Bank	(11,803)
(2,686)	Pirelli & C SpA	Barclays Bank	(1,115)
(35,850)	Pirelli & C SpA	Citibank	(14,879)
(324,800)	Pirelli & C SpA	Deutsche Bank	(106,365)
(70,942)	Pirelli & C SpA	Goldman Sachs	(23,232)
(26,686)	Pirelli & C SpA	JP Morgan	(9,155)
124,436	Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	Bank of America Merrill Lynch	1,194
22,017	Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	Barclays Bank	1,162
96,717	Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	Deutsche Bank	928
115,307	Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	Goldman Sachs	1,107
(7)	Tod's SpA	Citibank	(8)
			280,353
日本			
8,300	ABC-Mart Inc	Bank of America Merrill Lynch	(53,340)
4,600	ABC-Mart Inc	Barclays Bank	(24,267)
700	ABC-Mart Inc	Citibank	(3,693)
11,400	ABC-Mart Inc	Goldman Sachs	(73,263)
1,400	ABC-Mart Inc	HSBC	(5,103)
3,900	ABC-Mart Inc	JP Morgan	(14,215)
(180,600)	Acom Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(20,787)
(389,500)	Acom Co Ltd	Barclays Bank	56,040
(69,700)	Acom Co Ltd	Goldman Sachs	(8,023)
(19,100)	Acom Co Ltd	HSBC	(2,748)
(1,400)	Advantest Corp	Barclays Bank	(134)
(10,000)	Aeon Co Ltd	Barclays Bank	2,302
(22,500)	Aeon Mall Co Ltd	Barclays Bank	9,928
(10,000)	Aeon Mall Co Ltd	Credit Suisse	4,700
(13,500)	Aeon Mall Co Ltd	Goldman Sachs	13,855
(13,400)	Aeon Mall Co Ltd	JP Morgan	6,298
69,500	AGC Inc	Bank of America Merrill Lynch	(49,998)
(45,800)	Air Water Inc	Goldman Sachs	10,543
10,100	Amada Co Ltd	Barclays Bank	(3,972)
4,100	Amada Co Ltd	Citibank	(1,612)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
21,500	Amada Co Ltd	Credit Suisse	15,879
8,200	Amada Co Ltd	Goldman Sachs	(1,337)
242,300	Amada Co Ltd	JP Morgan	178,956
(51,600)	ANA Holdings Inc	Goldman Sachs	13,858
(23,500)	Asahi Kasei Corp	Bank of America Merrill Lynch	4,486
(36,200)	Asahi Kasei Corp	Goldman Sachs	6,910
121,100	Astellas Pharma Inc	Credit Suisse	(113,254)
(3,500)	Bandai Namco Holdings Inc	Barclays Bank	(5,069)
(1,100)	Bank of Kyoto Ltd	Bank of America Merrill Lynch	-
(8,300)	Bank of Kyoto Ltd	Barclays Bank	7,165
(4,000)	Bank of Kyoto Ltd	Citibank	3,453
(4,300)	Bank of Kyoto Ltd	Credit Suisse	(12,374)
(15,900)	Bank of Kyoto Ltd	JP Morgan	(45,753)
40,100	Benesse Holdings Inc	Barclays Bank	(51,156)
8,800	Bridgestone Corp	Bank of America Merrill Lynch	3,967
103,300	Bridgestone Corp	Barclays Bank	(205,104)
26,600	Bridgestone Corp	Citibank	(52,815)
32,800	Bridgestone Corp	Credit Suisse	32,405
14,600	Bridgestone Corp	HSBC	14,424
34,800	Brother Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	65,424
35,700	Brother Industries Ltd	Barclays Bank	5,479
39,700	Brother Industries Ltd	Citibank	6,093
65,600	Brother Industries Ltd	Credit Suisse	186,251
11,100	Brother Industries Ltd	Goldman Sachs	20,868
72,100	Brother Industries Ltd	HSBC	204,706
54,700	Brother Industries Ltd	JP Morgan	155,304
15,300	Calbee Inc	Bank of America Merrill Lynch	10,273
11,700	Calbee Inc	Barclays Bank	7,295
79,200	Calbee Inc	Goldman Sachs	53,177
2,400	Canon Inc	Credit Suisse	(1,063)
2,000	Central Japan Railway Co	Bank of America Merrill Lynch	(16,306)
2,800	Central Japan Railway Co	Barclays Bank	(37,869)
2,000	Central Japan Railway Co	Goldman Sachs	(16,306)
(10,300)	Chiba Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,680
(20,900)	Chiba Bank Ltd	Barclays Bank	6,415
(37,400)	Chiba Bank Ltd	Goldman Sachs	6,099
(121,500)	Chubu Electric Power Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	12,820
(12,800)	Chubu Electric Power Co Inc	Barclays Bank	9,024
3,000	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	Barclays Bank	13,870
(37,400)	Chugoku Electric Power Co Inc	Barclays Bank	28,340
30,400	Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(25,660)
25,500	Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc	Barclays Bank	(33,998)
27,100	Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc	Citibank	(36,132)
4,300	Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc	Credit Suisse	3,960
14,300	Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc	Goldman Sachs	(12,070)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
31,300	Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc	HSBC	28,822
18,700	Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc	JP Morgan	17,219
(21,500)	Dai Nippon Printing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	9,899
(20,900)	Dai Nippon Printing Co Ltd	Barclays Bank	14,835
(4,500)	Dai Nippon Printing Co Ltd	Citibank	3,194
(20,000)	Dai Nippon Printing Co Ltd	Credit Suisse	28,584
(30,400)	Dai Nippon Printing Co Ltd	Goldman Sachs	13,996
(6,900)	Dai Nippon Printing Co Ltd	JP Morgan	9,861
9,800	Daicel Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,444)
7,900	Daicel Corp	HSBC	(2,425)
(4,900)	Daifuku Co Ltd	Citibank	(25,380)
(23,500)	Daifuku Co Ltd	Credit Suisse	60,860
(91,600)	Dai-ichi Life Holdings Inc	Goldman Sachs	50,081
(1,100)	Daikin Industries Ltd	Barclays Bank	1,266
(5,600)	Daikin Industries Ltd	Credit Suisse	(60,966)
(14,900)	Daiwa House Industry Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,143
(34,300)	Daiwa House Industry Co Ltd	Barclays Bank	99,029
(4,600)	Daiwa House Industry Co Ltd	Goldman Sachs	353
(66,600)	Daiwa Securities Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,280
(118,300)	Daiwa Securities Group Inc	Barclays Bank	38,467
(40,100)	Daiwa Securities Group Inc	Citibank	13,039
(61,200)	Daiwa Securities Group Inc	Credit Suisse	(9,862)
(31,400)	Daiwa Securities Group Inc	Goldman Sachs	2,018
(99,600)	Daiwa Securities Group Inc	JP Morgan	(16,050)
17,300	Denso Corp	Barclays Bank	(44,140)
10,900	Dentsu Group Inc	Barclays Bank	(4,182)
(600)	Disco Corp	Bank of America Merrill Lynch	(16,114)
(100)	Disco Corp	Barclays Bank	(1,055)
(1,100)	Disco Corp	Goldman Sachs	(29,543)
15,400	East Japan Railway Co	Bank of America Merrill Lynch	33,679
16,200	East Japan Railway Co	Barclays Bank	(41,333)
3,900	East Japan Railway Co	Citibank	(9,951)
7,600	East Japan Railway Co	Credit Suisse	69,909
14,200	East Japan Railway Co	Goldman Sachs	31,055
3,800	East Japan Railway Co	JP Morgan	34,955
(72,300)	Electric Power Development Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	75,591
(34,600)	Electric Power Development Co Ltd	Goldman Sachs	36,175
(2,900)	FANUC Corp	Bank of America Merrill Lynch	(33,658)
(200)	Fast Retailing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	58
(600)	Fast Retailing Co Ltd	Barclays Bank	(16,920)
(1,100)	Fast Retailing Co Ltd	Citibank	(31,020)
16,400	Fuji Electric Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	34,607
23,800	Fuji Electric Co Ltd	Barclays Bank	38,809
(11,200)	FUJIFILM Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	4,942
(2,600)	FUJIFILM Holdings Corp	Barclays Bank	3,167

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(17,400)	FUJIFILM Holdings Corp	Goldman Sachs	7,677
6,400	Fujitsu Ltd	Goldman Sachs	77,349
(5,400)	Fukuoka Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,558
(47,200)	Fukuoka Financial Group Inc	Barclays Bank	52,517
(3,400)	Fukuoka Financial Group Inc	Credit Suisse	(620)
(8,700)	Fukuoka Financial Group Inc	Goldman Sachs	7,344
(7,400)	Fukuoka Financial Group Inc	HSBC	(1,349)
(6,800)	GMO Payment Gateway Inc	Bank of America Merrill Lynch	(120,013)
(500)	GMO Payment Gateway Inc	Barclays Bank	(4,077)
48,900	Hakuhodo DY Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	30,488
54,100	Hakuhodo DY Holdings Inc	Barclays Bank	(8,822)
20,700	Hakuhodo DY Holdings Inc	Goldman Sachs	12,906
50,900	Hankyu Hanshin Holdings Inc	Barclays Bank	(173,320)
(200)	Hikari Tsushin Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,439
(900)	Hikari Tsushin Inc	Barclays Bank	(6,906)
(300)	Hikari Tsushin Inc	Citibank	(2,302)
(100)	Hikari Tsushin Inc	Credit Suisse	748
(1,900)	Hikari Tsushin Inc	Goldman Sachs	13,668
(1,000)	Hikari Tsushin Inc	HSBC	7,482
23,800	Hino Motors Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(9,131)
67,000	Hino Motors Ltd	Goldman Sachs	(25,706)
400	Hirose Electric Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,458
700	Hirose Electric Co Ltd	Goldman Sachs	2,551
4,100	Hisamitsu Pharmaceutical Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	11,011
10,600	Hisamitsu Pharmaceutical Co Inc	Barclays Bank	18,301
1,900	Hisamitsu Pharmaceutical Co Inc	Credit Suisse	11,846
6,300	Hisamitsu Pharmaceutical Co Inc	Goldman Sachs	16,920
2,300	Hisamitsu Pharmaceutical Co Inc	JP Morgan	14,340
(11,100)	Hitachi Construction Machinery Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4,472)
(28,500)	Hitachi Construction Machinery Co Ltd	Goldman Sachs	(11,481)
(33,100)	Hitachi Construction Machinery Co Ltd	HSBC	(59,053)
6,800	Hitachi Ltd	Credit Suisse	24,459
8,800	Hitachi Ltd	JP Morgan	31,653
(23,100)	Hitachi Metals Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(21,049)
(43,800)	Hitachi Metals Ltd	Barclays Bank	(7,142)
(5,400)	Hitachi Metals Ltd	Citibank	(881)
(900)	Hitachi Metals Ltd	Credit Suisse	(1,243)
(13,700)	Hitachi Metals Ltd	Goldman Sachs	(12,484)
(4,200)	Hitachi Metals Ltd	HSBC	(5,801)
6,000	Hoya Corp	Bank of America Merrill Lynch	68,774
1,900	Hoya Corp	Goldman Sachs	21,778
(35,200)	Hulic Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4,389)
(42,800)	Hulic Co Ltd	Barclays Bank	9,853
(5,800)	Hulic Co Ltd	HSBC	(1,836)
(55,500)	Idemitsu Kosan Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	16,503

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(15,500)	Idemitsu Kosan Co Ltd	Barclays Bank	7,136
(21,200)	Idemitsu Kosan Co Ltd	Credit Suisse	(4,474)
(38,100)	Idemitsu Kosan Co Ltd	Goldman Sachs	11,329
(34,600)	Idemitsu Kosan Co Ltd	HSBC	(7,301)
(58,200)	Iida Group Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	7,257
(10,300)	Iida Group Holdings Co Ltd	Citibank	10,571
(101,900)	Iida Group Holdings Co Ltd	Credit Suisse	(2,932)
(2,300)	Iida Group Holdings Co Ltd	JP Morgan	(2,471)
(11,200)	Inpex Corp	Goldman Sachs	(550)
(26,400)	Isuzu Motors Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(8,356)
(24,300)	Isuzu Motors Ltd	Barclays Bank	2,797
19,900	Ito En Ltd	Bank of America Merrill Lynch	34,358
25,200	Ito En Ltd	Citibank	(50,760)
2,000	Ito En Ltd	Credit Suisse	14,771
(29,500)	ITOCHU Corp	Bank of America Merrill Lynch	(13,865)
(10,100)	ITOCHU Corp	Barclays Bank	6,733
(45,700)	ITOCHU Corp	Citibank	30,465
(5,800)	ITOCHU Corp	Goldman Sachs	(2,726)
2,400	Japan Airlines Co Ltd	Barclays Bank	(2,757)
4,500	Japan Airlines Co Ltd	Citibank	(1,424)
6,400	Japan Airlines Co Ltd	Credit Suisse	300
(5,000)	Japan Airport Terminal Co Ltd	Barclays Bank	2,878
(8,100)	Japan Airport Terminal Co Ltd	Goldman Sachs	(21,754)
(11,900)	Japan Airport Terminal Co Ltd	HSBC	(191,761)
(12,100)	Japan Airport Terminal Co Ltd	JP Morgan	(194,983)
(3,600)	Japan Exchange Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,526)
(7,200)	Japan Exchange Group Inc	Goldman Sachs	(13,053)
(3,600)	Japan Exchange Group Inc	HSBC	(2,089)
(142,900)	Japan Post Bank Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	145,292
(100)	Japan Post Bank Co Ltd	Barclays Bank	68
(9,600)	Japan Post Bank Co Ltd	Citibank	6,538
(400)	Japan Post Bank Co Ltd	Credit Suisse	161
(88,600)	Japan Post Bank Co Ltd	Goldman Sachs	90,083
(74,100)	Japan Post Bank Co Ltd	HSBC	29,852
(21,600)	Japan Post Bank Co Ltd	JP Morgan	8,702
(8,400)	Japan Post Insurance Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4,834
(58,400)	Japan Post Insurance Co Ltd	Barclays Bank	44,813
(19,800)	Japan Post Insurance Co Ltd	JP Morgan	(9,496)
10,700	JFE Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	5,645
64,500	JFE Holdings Inc	Barclays Bank	-
27,200	JFE Holdings Inc	Credit Suisse	38,352
42,200	JFE Holdings Inc	Goldman Sachs	22,263
121,600	JTEKT Corp	Bank of America Merrill Lynch	(97,975)
26,500	JTEKT Corp	Barclays Bank	(12,963)
55,300	JTEKT Corp	Citibank	(27,052)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
52,000	JTEKT Corp	Credit Suisse	(27,433)
26,500	JTEKT Corp	Goldman Sachs	(21,351)
23,400	JTEKT Corp	HSBC	(12,345)
33,500	JTEKT Corp	JP Morgan	(17,673)
397,300	JXTG Holdings Inc	Barclays Bank	(70,120)
(128,500)	Kajima Corp	Barclays Bank	19,721
(43,300)	Kajima Corp	Goldman Sachs	(35,718)
(2,400)	Kakaku.com Inc	Goldman Sachs	5,088
78,600	Kamigumi Co Ltd	Goldman Sachs	(52,774)
(46,000)	Kansai Electric Power Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	18,752
(226,500)	Kansai Electric Power Co Inc	Barclays Bank	81,036
(4,500)	Kansai Electric Power Co Inc	JP Morgan	1,010
(1)	Kawasaki Kisen Kaisha Ltd	Credit Suisse	(2)
(1,900)	KDDI Corp	Barclays Bank	392
(7,500)	KDDI Corp	Credit Suisse	6,670
(1,800)	KDDI Corp	JP Morgan	1,538
(12,100)	Keihan Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(38,300)
(7,000)	Keihan Holdings Co Ltd	Barclays Bank	(9,064)
(4,200)	Keihan Holdings Co Ltd	Citibank	(5,439)
(34,200)	Keihan Holdings Co Ltd	Credit Suisse	(239,471)
(3,600)	Keihan Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(11,395)
(14,300)	Keikyu Corp	Barclays Bank	11,522
(14,200)	Keikyu Corp	Goldman Sachs	(4,222)
(300)	Keio Corp	Citibank	1,784
(5,800)	Keio Corp	Credit Suisse	(37,274)
(22,100)	Keio Corp	JP Morgan	(142,027)
(3,600)	Keisei Electric Railway Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	7,424
(5,000)	Keyence Corp	HSBC	(39,327)
900	Kikkoman Corp	Goldman Sachs	(1,587)
(7,800)	Kintetsu Group Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	5,611
(5,200)	Kintetsu Group Holdings Co Ltd	Barclays Bank	15,462
(5,700)	Kintetsu Group Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	4,101
(7,300)	Kintetsu Group Holdings Co Ltd	HSBC	(13,654)
(15,000)	Kirin Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(4,748)
(1,100)	Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd	Citibank	(6,647)
(16,000)	Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd	Goldman Sachs	(174,956)
(33,500)	Kobe Bussan Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(146,204)
(2,400)	Koito Manufacturing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(9,669)
(14,100)	Koito Manufacturing Co Ltd	Barclays Bank	70,328
(1,300)	Koito Manufacturing Co Ltd	JP Morgan	(10,350)
(4,300)	Komatsu Ltd	HSBC	(162)
(13,600)	Konami Holdings Corp	Goldman Sachs	(31,308)
(131,500)	Kubota Corp	Bank of America Merrill Lynch	59,913
22,400	Kuraray Co Ltd	Barclays Bank	(14,610)
13,000	Kuraray Co Ltd	Credit Suisse	2,494

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
15,200	Kuraray Co Ltd	HSBC	2,916
7,700	Kurita Water Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	21,788
9,700	Kurita Water Industries Ltd	Citibank	13,956
14,400	Kurita Water Industries Ltd	Credit Suisse	54,559
20,200	Kurita Water Industries Ltd	Goldman Sachs	57,158
4,300	Kurita Water Industries Ltd	HSBC	16,292
4,500	Kurita Water Industries Ltd	JP Morgan	17,050
11,000	Kyocera Corp	Barclays Bank	(14,877)
(132,200)	Kyushu Electric Power Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	59,598
(123,500)	Kyushu Electric Power Co Inc	Barclays Bank	81,737
15,000	Kyushu Railway Co	Bank of America Merrill Lynch	(19,136)
9,500	Kyushu Railway Co	Barclays Bank	(21,323)
9,000	Kyushu Railway Co	Citibank	(20,200)
16,900	Kyushu Railway Co	Credit Suisse	(11,996)
29,400	Kyushu Railway Co	Goldman Sachs	(37,506)
17,600	Kyushu Railway Co	HSBC	(12,492)
3,300	Kyushu Railway Co	JP Morgan	(2,342)
(6,400)	Lasertec Corp	Barclays Bank	(37,447)
13,200	Lawson Inc	Bank of America Merrill Lynch	(48,113)
34,500	Lawson Inc	Barclays Bank	(71,148)
(55)	LINE Corp	Bank of America Merrill Lynch	(5)
(3,900)	LINE Corp	Credit Suisse	374
(4,848)	LINE Corp	JP Morgan	465
59,100	LIXIL Group Corp	Bank of America Merrill Lynch	56,688
(9,400)	M3 Inc	Barclays Bank	(88,811)
(1,500)	M3 Inc	Credit Suisse	(20,488)
(5,000)	M3 Inc	Goldman Sachs	(73,857)
(5,400)	M3 Inc	HSBC	(73,758)
(3,300)	Makita Corp	Bank of America Merrill Lynch	(7,913)
(2,100)	Makita Corp	Barclays Bank	1,611
(2,100)	Makita Corp	Citibank	1,611
(8,500)	Makita Corp	Goldman Sachs	(20,383)
(1,100)	Makita Corp	JP Morgan	(739)
(130,700)	Marui Group Co Ltd	Barclays Bank	105,307
(5,000)	Maruichi Steel Tube Ltd	Bank of America Merrill Lynch	10,311
(3,700)	Maruichi Steel Tube Ltd	Barclays Bank	3,833
(4,000)	Maruichi Steel Tube Ltd	Goldman Sachs	8,249
1,500	McDonald's Holdings Co Japan Ltd	Goldman Sachs	(3,453)
1,300	McDonald's Holdings Co Japan Ltd	HSBC	(249)
(55,200)	Mebuki Financial Group Inc	Barclays Bank	6,883
(37,500)	Mebuki Financial Group Inc	Credit Suisse	8,633
(27,900)	Mebuki Financial Group Inc	HSBC	-
(392,000)	Mebuki Financial Group Inc	JP Morgan	-
3,000	Medipal Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	58
2,200	Medipal Holdings Corp	Citibank	(1,287)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
4,000	Medipal Holdings Corp	Credit Suisse	4,336
3,700	Medipal Holdings Corp	Goldman Sachs	71
5,200	MEIJI Holdings Co Ltd	Barclays Bank	(14,465)
29,900	MEIJI Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(48,755)
1,300	Mercari Inc	Citibank	2,494
2,100	Mercari Inc	HSBC	4,633
25,700	MINEBEA MITSUMI Inc	Barclays Bank	11,586
29,900	MINEBEA MITSUMI Inc	Credit Suisse	85,752
13,800	MINEBEA MITSUMI Inc	Goldman Sachs	23,694
7,200	MINEBEA MITSUMI Inc	JP Morgan	20,649
32,200	MISUMI Group Inc	Barclays Bank	(13,899)
6,600	MISUMI Group Inc	Goldman Sachs	(5,381)
52,500	Mitsubishi Chemical Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(8,510)
144,000	Mitsubishi Chemical Holdings Corp	Barclays Bank	(27,072)
143,100	Mitsubishi Chemical Holdings Corp	Goldman Sachs	(23,197)
49,600	Mitsubishi Chemical Holdings Corp	HSBC	5,091
8,200	Mitsubishi Chemical Holdings Corp	JP Morgan	842
(29,900)	Mitsubishi Corp	Barclays Bank	27,819
(8,500)	Mitsubishi Corp	Credit Suisse	(1,549)
(9,200)	Mitsubishi Corp	HSBC	1,379
204,900	Mitsubishi Electric Corp	Bank of America Merrill Lynch	232,897
16,500	Mitsubishi Electric Corp	Barclays Bank	2,057
72,100	Mitsubishi Electric Corp	Citibank	8,990
44,900	Mitsubishi Electric Corp	Credit Suisse	74,722
301,400	Mitsubishi Electric Corp	Goldman Sachs	342,582
4,700	Mitsubishi Electric Corp	JP Morgan	7,822
10,800	Mitsubishi Estate Co Ltd	Citibank	(4,765)
40,000	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(37,025)
17,600	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Barclays Bank	(44,652)
15,000	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Citibank	(38,056)
116,000	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Goldman Sachs	(107,371)
15,600	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	HSBC	4,639
11,400	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	JP Morgan	3,390
49,700	Mitsubishi Materials Corp	Bank of America Merrill Lynch	(22,882)
86,600	Mitsubishi Materials Corp	Barclays Bank	(14,952)
39,300	Mitsubishi Motors Corp	Bank of America Merrill Lynch	(5,277)
74,600	Mitsubishi Motors Corp	Barclays Bank	(5,724)
28,000	Mitsubishi Motors Corp	Citibank	(2,149)
62,200	Mitsubishi Motors Corp	Credit Suisse	-
37,000	Mitsubishi Motors Corp	Goldman Sachs	(4,969)
94,200	Mitsubishi Motors Corp	HSBC	-
27,200	Mitsubishi Motors Corp	JP Morgan	-
56,700	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	Barclays Bank	(12,454)
(52,500)	Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,007)
(75,700)	Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co Ltd	Credit Suisse	(18,153)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(264,100)	Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co Ltd	HSBC	(63,330)
(9,400)	Mitsui & Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4,688
(26,300)	Mitsui & Co Ltd	Barclays Bank	25,857
(15,200)	Mitsui Fudosan Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(7,581)
(25,800)	Mitsui Fudosan Co Ltd	HSBC	(83,026)
(1,100)	Mitsui Fudosan Co Ltd	JP Morgan	(3,540)
(1,400)	Miura Co Ltd	Goldman Sachs	(1,746)
(23,700)	Miura Co Ltd	HSBC	(20,459)
45,990	Mizuho Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(36,173)
78,280	Mizuho Financial Group Inc	Goldman Sachs	(61,570)
(22,300)	MonotaRO Co Ltd	Barclays Bank	(149,729)
(3,800)	Murata Manufacturing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(36,267)
(7,600)	Murata Manufacturing Co Ltd	JP Morgan	(104,900)
4,400	NEC Corp	Bank of America Merrill Lynch	5,487
(33,300)	Nexon Co Ltd	Barclays Bank	(109,877)
8,600	NGK Insulators Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3,300)
45,100	NGK Insulators Ltd	Barclays Bank	(11,247)
1,600	NGK Insulators Ltd	Citibank	(399)
5,600	NGK Insulators Ltd	Credit Suisse	4,136
38,000	NGK Insulators Ltd	Goldman Sachs	(14,580)
47,000	NGK Insulators Ltd	HSBC	34,713
(35,600)	NGK Spark Plug Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(20,830)
(7,100)	NGK Spark Plug Co Ltd	Goldman Sachs	(4,154)
(3,500)	NGK Spark Plug Co Ltd	HSBC	(2,014)
(9,400)	Nidec Corp	Bank of America Merrill Lynch	(147,417)
(4,200)	Nidec Corp	JP Morgan	(74,730)
(4,900)	Nihon M&A Center Inc	Bank of America Merrill Lynch	(53,110)
(5,800)	Nihon M&A Center Inc	Barclays Bank	(30,598)
(1,400)	Nihon M&A Center Inc	Citibank	(7,386)
(12,300)	Nihon M&A Center Inc	HSBC	(90,845)
11,100	Nikon Corp	Citibank	(4,365)
14,400	Nikon Corp	Credit Suisse	(5,875)
12,000	Nikon Corp	Goldman Sachs	(6,801)
6,200	Nikon Corp	HSBC	(4,061)
(5,000)	Nippon Express Co Ltd	Credit Suisse	(12,469)
(20,700)	Nippon Paint Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(520,205)
(1,100)	Nippon Shinyaku Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(106)
(2,400)	Nippon Shinyaku Co Ltd	Barclays Bank	4,144
(1,100)	Nippon Shinyaku Co Ltd	Credit Suisse	3,693
67,900	Nippon Steel Corp	Barclays Bank	(326)
(3,600)	Nippon Yusen KK	Barclays Bank	(4,040)
(6,700)	Nissan Chemical Corp	Barclays Bank	8,355
2,100	Nissin Foods Holdings Co Ltd	Barclays Bank	(2,417)
8,100	Nissin Foods Holdings Co Ltd	Credit Suisse	(36,516)
3,500	Nissin Foods Holdings Co Ltd	JP Morgan	(15,779)

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	Nitori Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	10,868
100	Nitori Holdings Co Ltd	Barclays Bank	609
100	Nitori Holdings Co Ltd	Citibank	609
5,700	Nitori Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	56,314
26,000	Nitto Denko Corp	Bank of America Merrill Lynch	147,139
7,400	Nitto Denko Corp	Credit Suisse	61,752
13,200	Nitto Denko Corp	JP Morgan	110,153
(89,400)	Nomura Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,289)
(112,400)	Nomura Holdings Inc	Barclays Bank	4,528
(46,600)	Nomura Holdings Inc	Citibank	1,877
(29,100)	Nomura Holdings Inc	JP Morgan	(6,587)
(23,300)	Nomura Real Estate Holdings Inc	Barclays Bank	(29,054)
(7,300)	Nomura Real Estate Holdings Inc	Goldman Sachs	(19,326)
(14,600)	Nomura Research Institute Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(13,304)
(10,300)	Nomura Research Institute Ltd	Barclays Bank	(6,916)
(13,500)	Nomura Research Institute Ltd	Goldman Sachs	(12,302)
(1,500)	Nomura Research Institute Ltd	HSBC	(1,439)
71,600	NSK Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(48,761)
76,400	NSK Ltd	Barclays Bank	(33,710)
11,900	NSK Ltd	Citibank	(5,251)
24,000	NSK Ltd	Credit Suisse	(3,223)
24,400	NSK Ltd	Goldman Sachs	(16,617)
6,900	NSK Ltd	HSBC	(927)
11,600	NSK Ltd	JP Morgan	(1,558)
6,100	NTT Data Corp	Bank of America Merrill Lynch	351
14,900	NTT Data Corp	HSBC	3,430
(62,100)	NTT DOCOMO Inc	Barclays Bank	2,383
(17,600)	Obayashi Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,013
(22,300)	Obayashi Corp	Citibank	11,978
(13,400)	Obayashi Corp	HSBC	(2,442)
(31,000)	Obayashi Corp	JP Morgan	(5,650)
(6,700)	Obic Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(196,652)
(800)	Obic Co Ltd	HSBC	(20,872)
(37,500)	Odakyu Electric Railway Co Ltd	Barclays Bank	41,365
(11,700)	Odakyu Electric Railway Co Ltd	Citibank	12,906
(17,600)	Odakyu Electric Railway Co Ltd	Credit Suisse	(64,319)
(16,300)	Odakyu Electric Railway Co Ltd	Goldman Sachs	(19,543)
(141,900)	Oji Holdings Corp	Barclays Bank	35,388
(124,800)	Oji Holdings Corp	Goldman Sachs	21,547
17,700	Olympus Corp	Goldman Sachs	8,913
8,500	Olympus Corp	JP Morgan	2,405
39,100	Ono Pharmaceutical Co Ltd	Barclays Bank	20,252
(5,700)	Oracle Corp Japan	Goldman Sachs	(17,496)
(6,800)	Oriental Land Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(39,461)
(1,700)	Oriental Land Co Ltd	Barclays Bank	2,854

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(900)	Oriental Land Co Ltd	Credit Suisse	(16,532)
(5,500)	Oriental Land Co Ltd	HSBC	(101,026)
5,300	ORIX Corp	Barclays Bank	(1,398)
36,700	Osaka Gas Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(65,828)
36,200	Osaka Gas Co Ltd	Barclays Bank	(75,695)
3,800	Osaka Gas Co Ltd	Citibank	(7,946)
4,800	Osaka Gas Co Ltd	Credit Suisse	(1,611)
12,300	Osaka Gas Co Ltd	Goldman Sachs	(22,062)
19,300	Osaka Gas Co Ltd	HSBC	(6,479)
16,500	Osaka Gas Co Ltd	JP Morgan	(5,539)
(20,800)	Otsuka Corp	Bank of America Merrill Lynch	(40,900)
(200)	Otsuka Corp	Citibank	(38)
(4,000)	Otsuka Corp	Credit Suisse	6,522
(9,600)	Otsuka Corp	Goldman Sachs	(18,877)
3,300	Otsuka Holdings Co Ltd	Barclays Bank	(4,843)
(47,200)	Pan Pacific International Holdings Corp	Barclays Bank	8,149
(33,100)	Pan Pacific International Holdings Corp	Goldman Sachs	13,017
5,100	Park24 Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,174
7,000	Park24 Co Ltd	Citibank	(4,566)
4,400	Park24 Co Ltd	Goldman Sachs	1,013
(15,000)	PeptiDream Inc	Bank of America Merrill Lynch	(31,653)
(30,000)	PeptiDream Inc	Barclays Bank	(135,245)
(5,200)	PeptiDream Inc	Credit Suisse	(11,971)
(5,500)	Pigeon Corp	Bank of America Merrill Lynch	4,748
(20,600)	Pigeon Corp	Goldman Sachs	17,783
(10,800)	Pigeon Corp	HSBC	(22,272)
28,100	Pola Orbis Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,695)
45,700	Pola Orbis Holdings Inc	Barclays Bank	23,671
9,000	Pola Orbis Holdings Inc	Goldman Sachs	(863)
4,200	Pola Orbis Holdings Inc	HSBC	(645)
(15,400)	Rakuten Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9,158)
(11,200)	Rakuten Inc	Barclays Bank	(1,074)
(1,100)	Rakuten Inc	Citibank	(106)
(35,100)	Rakuten Inc	Goldman Sachs	(20,874)
(5,000)	Rakuten Inc	HSBC	(4,048)
2,400	Recruit Holdings Co Ltd	Barclays Bank	(5,134)
6,700	Recruit Holdings Co Ltd	Citibank	(14,331)
(5,100)	Renesas Electronics Corp	Barclays Bank	832
(47,400)	Resona Holdings Inc	Barclays Bank	10,184
(129,000)	Resona Holdings Inc	Goldman Sachs	16,086
(205,300)	Resona Holdings Inc	HSBC	(25,600)
24,700	Ricoh Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	6,397
203,200	Ricoh Co Ltd	Barclays Bank	-
33,900	Ricoh Co Ltd	Credit Suisse	19,510
24,600	Ricoh Co Ltd	Goldman Sachs	6,371

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
11,100	Ricoh Co Ltd	HSBC	6,388
2,000	Ricoh Co Ltd	JP Morgan	1,151
(2,400)	Ryohin Keikaku Co Ltd	Barclays Bank	3,430
(6,300)	Ryohin Keikaku Co Ltd	Goldman Sachs	9,608
28,700	Santen Pharmaceutical Co Ltd	Barclays Bank	12,113
(3,200)	SBI Holdings Inc	Citibank	(1,258)
(3,000)	SBI Holdings Inc	Credit Suisse	(4,748)
(19,500)	SBI Holdings Inc	Goldman Sachs	(27,495)
(18,300)	SBI Holdings Inc	HSBC	(28,963)
(21,900)	SCSK Corp	Barclays Bank	(86,125)
(3,100)	SCSK Corp	Citibank	(12,191)
(4,700)	SCSK Corp	Credit Suisse	(20,287)
(1,300)	SCSK Corp	Goldman Sachs	(2,120)
(400)	SCSK Corp	HSBC	(1,727)
(2,900)	Secom Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(10,014)
(100)	Secom Co Ltd	Barclays Bank	(10)
(400)	Secom Co Ltd	Goldman Sachs	(1,381)
35,600	Sega Sammy Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(25,269)
17,700	Sega Sammy Holdings Inc	Barclays Bank	(9,338)
25,300	Sega Sammy Holdings Inc	Credit Suisse	(3,397)
53,300	Sega Sammy Holdings Inc	Goldman Sachs	(37,832)
85,900	Seibu Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(137,598)
74,500	Seibu Holdings Inc	Goldman Sachs	(119,337)
88,400	Seiko Epson Corp	Barclays Bank	11,871
12,500	Seiko Epson Corp	Citibank	1,679
23,600	Seiko Epson Corp	Goldman Sachs	34,861
81,600	Sekisui Chemical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	31,308
59,100	Sekisui Chemical Co Ltd	Citibank	17,573
129,500	Sekisui Chemical Co Ltd	Credit Suisse	134,152
95,400	Sekisui Chemical Co Ltd	JP Morgan	98,827
137,500	Sekisui House Ltd	HSBC	118,699
(52,400)	Seven Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	5,529
(102,000)	Seven Bank Ltd	Barclays Bank	3,913
(68,100)	Seven Bank Ltd	Credit Suisse	12,411
(146,700)	Seven Bank Ltd	Goldman Sachs	15,478
(71,000)	SG Holdings Co Ltd	HSBC	(254,021)
(34,200)	Sharp Corp	Barclays Bank	(5,577)
(47,800)	Sharp Corp	Goldman Sachs	(99,493)
(3,600)	Shimamura Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	17,956
(4,700)	Shimano Inc	Barclays Bank	(19,160)
10,500	Shimizu Corp	Bank of America Merrill Lynch	(403)
14,000	Shimizu Corp	Credit Suisse	2,149
23,500	Shimizu Corp	Goldman Sachs	(902)
(500)	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(9,616)
(57,700)	Shinsei Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	68,074

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(14,700)	Shinsei Bank Ltd	Barclays Bank	13,677
(5,900)	Shinsei Bank Ltd	Citibank	5,489
(12,800)	Shinsei Bank Ltd	Credit Suisse	12,278
(9,200)	Shinsei Bank Ltd	Goldman Sachs	10,854
(1,300)	Shinsei Bank Ltd	HSBC	1,247
(6,200)	Shinsei Bank Ltd	JP Morgan	5,947
(4,800)	Shiseido Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4,972)
(4,700)	Shiseido Co Ltd	Goldman Sachs	(4,869)
(8,900)	Shizuoka Bank Ltd	Citibank	4,439
(13,600)	Shizuoka Bank Ltd	Credit Suisse	(2,087)
(3,500)	Showa Denko KK	Barclays Bank	470
(4,000)	Showa Denko KK	Citibank	537
(48,200)	Showa Denko KK	Goldman Sachs	2,774
(1,400)	SMC Corp	Bank of America Merrill Lynch	(84,869)
(300)	SMC Corp	Citibank	(9,467)
(100)	SMC Corp	Goldman Sachs	(6,062)
(400)	SMC Corp	HSBC	(21,639)
(22,700)	SoftBank Group Corp	HSBC	(41,152)
(2,300)	Sompo Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,647
(4,300)	Sompo Holdings Inc	Barclays Bank	-
(4,000)	Sompo Holdings Inc	Credit Suisse	(115)
(23,000)	Sompo Holdings Inc	Goldman Sachs	26,474
(6,500)	Sompo Holdings Inc	HSBC	(187)
(3,900)	Sompo Holdings Inc	JP Morgan	(112)
(2,100)	Sony Corp	Bank of America Merrill Lynch	(10,592)
(5,700)	Sony Corp	Barclays Bank	(11,700)
5,600	Stanley Electric Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,686
3,500	Stanley Electric Co Ltd	JP Morgan	2,753
2,500	Subaru Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,662)
4,500	Subaru Corp	Barclays Bank	(6,388)
8,300	Subaru Corp	Goldman Sachs	(8,837)
(137,600)	Sumitomo Chemical Co Ltd	Barclays Bank	23,757
(145,000)	Sumitomo Chemical Co Ltd	Goldman Sachs	12,517
(64,500)	Sumitomo Corp	Bank of America Merrill Lynch	13,920
(14,000)	Sumitomo Corp	Barclays Bank	8,661
(115,500)	Sumitomo Corp	Goldman Sachs	24,927
26,300	Sumitomo Dainippon Pharma Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(24,974)
28,300	Sumitomo Dainippon Pharma Co Ltd	Barclays Bank	(11,401)
27,600	Sumitomo Dainippon Pharma Co Ltd	Goldman Sachs	(26,209)
92,700	Sumitomo Electric Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(124,928)
113,500	Sumitomo Electric Industries Ltd	Barclays Bank	(76,207)
34,100	Sumitomo Electric Industries Ltd	Citibank	(22,896)
2,800	Sumitomo Electric Industries Ltd	Credit Suisse	(1,611)
226,000	Sumitomo Electric Industries Ltd	Goldman Sachs	(304,571)
7,800	Sumitomo Heavy Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(10,549)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
38,000	Sumitomo Heavy Industries Ltd	Barclays Bank	(36,085)
100	Sumitomo Heavy Industries Ltd	Citibank	(95)
14,200	Sumitomo Heavy Industries Ltd	Credit Suisse	(22,882)
31,200	Sumitomo Heavy Industries Ltd	Goldman Sachs	(42,197)
17,400	Sumitomo Heavy Industries Ltd	JP Morgan	(28,039)
(56,600)	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(73,291)
(1,500)	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	Barclays Bank	(1,655)
(14,700)	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	Credit Suisse	(78,819)
1,700	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,365)
43,400	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	Credit Suisse	26,308
(12,600)	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	Goldman Sachs	11,361
98,300	Sumitomo Rubber Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(109,374)
16,900	Sumitomo Rubber Industries Ltd	Barclays Bank	(14,103)
4,900	Sumitomo Rubber Industries Ltd	Credit Suisse	(1,833)
68,100	Sumitomo Rubber Industries Ltd	Goldman Sachs	(75,772)
14,500	Sumitomo Rubber Industries Ltd	HSBC	(5,424)
29,800	Sumitomo Rubber Industries Ltd	JP Morgan	(11,148)
40,100	Suntory Beverage & Food Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(23,078)
48,900	Suntory Beverage & Food Ltd	Barclays Bank	(56,285)
2,600	Suntory Beverage & Food Ltd	Citibank	(2,993)
5,800	Suntory Beverage & Food Ltd	Goldman Sachs	(3,338)
13,900	Suntory Beverage & Food Ltd	HSBC	19,999
600	Suntory Beverage & Food Ltd	JP Morgan	863
(9,800)	Suzuken Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(10,810)
(2,000)	Suzuken Co Ltd	Barclays Bank	(192)
(4,800)	Suzuken Co Ltd	Citibank	(460)
(20,000)	Suzuken Co Ltd	Goldman Sachs	(22,061)
(6,100)	Suzuken Co Ltd	HSBC	(12,872)
(15,100)	Suzuki Motor Corp	Bank of America Merrill Lynch	(29,836)
(3,500)	Suzuki Motor Corp	Citibank	(2,048)
(1,600)	Suzuki Motor Corp	JP Morgan	(9,270)
(29,700)	T&D Holdings Inc	Barclays Bank	4,558
(13,400)	T&D Holdings Inc	Goldman Sachs	(2,571)
(82,700)	T&D Holdings Inc	JP Morgan	(118,987)
48,300	Taiheiyo Cement Corp	Goldman Sachs	(68,567)
(15,400)	Taisei Corp	Bank of America Merrill Lynch	(22,157)
(9,100)	Taisei Corp	Goldman Sachs	(13,093)
1,400	Taisho Pharmaceutical Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,074
13,400	Taisho Pharmaceutical Holdings Co Ltd	Barclays Bank	2,571
12,900	Taisho Pharmaceutical Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	9,899
(12,000)	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(20,718)
(1,200)	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	Barclays Bank	(978)
(5,400)	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	Citibank	(4,403)
(66,200)	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	Goldman Sachs	(114,297)
(6,400)	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	(16,575)

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	TDK Corp	Barclays Bank	15,194
77,600	Teijin Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(49,870)
9,400	Teijin Ltd	Citibank	(6,492)
68,000	Teijin Ltd	Credit Suisse	46,310
125,100	Teijin Ltd	Goldman Sachs	(80,396)
50,500	Teijin Ltd	HSBC	34,392
101,600	Teijin Ltd	JP Morgan	69,192
2,900	Terumo Corp	Bank of America Merrill Lynch	(8,846)
9,100	Terumo Corp	Barclays Bank	(4,015)
2,700	Terumo Corp	Goldman Sachs	(8,236)
(8,400)	THK Co Ltd	Credit Suisse	(23,527)
(2,000)	THK Co Ltd	Goldman Sachs	(2,973)
(22,100)	TIS Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,664)
(17,100)	TIS Inc	Barclays Bank	(164)
(6,700)	TIS Inc	Citibank	(64)
(5,400)	TIS Inc	Goldman Sachs	(1,140)
(21,000)	TIS Inc	HSBC	28,200
(700)	TIS Inc	JP Morgan	940
(3,500)	Tobu Railway Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	11,246
(20,400)	Tobu Railway Co Ltd	Barclays Bank	74,356
(6,600)	Tobu Railway Co Ltd	Credit Suisse	3,798
(6,800)	Tobu Railway Co Ltd	Goldman Sachs	21,850
(8,500)	Toho Co Ltd	Barclays Bank	13,045
(8,200)	Toho Co Ltd	Credit Suisse	(11,405)
(31,700)	Toho Co Ltd	HSBC	(44,089)
(8,800)	Toho Co Ltd	JP Morgan	(12,239)
(7,700)	Tohoku Electric Power Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	5,318
(226,900)	Tohoku Electric Power Co Inc	Barclays Bank	143,642
(2,100)	Tokio Marine Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,732
(1,400)	Tokio Marine Holdings Inc	Barclays Bank	4,740
(2,100)	Tokyo Century Corp	Bank of America Merrill Lynch	(8,259)
(2,700)	Tokyo Century Corp	Citibank	(3,367)
(32,900)	Tokyo Century Corp	Goldman Sachs	(129,385)
(300)	Tokyo Electron Ltd	Goldman Sachs	(10,435)
62,100	Tokyo Gas Co Ltd	Barclays Bank	(170,953)
10,600	Tokyu Corp	Barclays Bank	(13,421)
20,400	Tokyu Corp	Citibank	(25,829)
22,600	Tokyu Corp	Credit Suisse	(7,154)
5,900	Tokyu Corp	Goldman Sachs	(6,338)
4,400	Tokyu Corp	JP Morgan	(1,393)
(323,900)	Tokyu Fudosan Holdings Corp	HSBC	(83,884)
29,500	Toppan Printing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(9,621)
27,200	Toray Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	7,149
110,100	Toray Industries Inc	Barclays Bank	(4,964)
148,800	Toray Industries Inc	Credit Suisse	93,629

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
143,800	Toray Industries Inc	Goldman Sachs	37,793
39,900	Toray Industries Inc	HSBC	25,106
15,100	Toray Industries Inc	JP Morgan	9,501
(4,100)	Toshiba Corp	Barclays Bank	157
(4,300)	Toshiba Corp	HSBC	(7,300)
(4,800)	Toshiba Corp	JP Morgan	(8,149)
1,300	Tosoh Corp	Bank of America Merrill Lynch	(848)
15,300	Tosoh Corp	Barclays Bank	(9,979)
10,000	Tosoh Corp	Goldman Sachs	(6,522)
4,000	Tosoh Corp	HSBC	(3,223)
44,800	TOTO Ltd	Barclays Bank	8,594
10,100	TOTO Ltd	Credit Suisse	54,252
5,100	TOTO Ltd	Goldman Sachs	6,359
6,000	TOTO Ltd	HSBC	32,229
26,800	Toyo Suisan Kaisha Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(33,418)
19,200	Toyo Suisan Kaisha Ltd	Barclays Bank	(33,150)
15,800	Toyo Suisan Kaisha Ltd	HSBC	(59,105)
51,600	Toyoda Gosei Co Ltd	Goldman Sachs	(46,524)
(700)	Toyota Motor Corp	Citibank	2,901
(1,600)	Toyota Motor Corp	Goldman Sachs	7,290
(7,900)	Toyota Tsusho Corp	Bank of America Merrill Lynch	(11,745)
(6,200)	Toyota Tsusho Corp	Credit Suisse	(21,409)
(3,600)	Toyota Tsusho Corp	Goldman Sachs	(5,352)
5,700	Trend Micro Inc	Bank of America Merrill Lynch	6,515
1,100	Tsuruha Holdings Inc	Barclays Bank	(844)
2,800	Tsuruha Holdings Inc	Goldman Sachs	(2,954)
(18,700)	Unicharm Corp	Barclays Bank	17,040
(8,800)	Unicharm Corp	HSBC	15,616
(41,800)	USS Co Ltd	Barclays Bank	38,490
(21,900)	USS Co Ltd	Citibank	20,166
(30,300)	USS Co Ltd	Credit Suisse	(41,851)
(17,500)	USS Co Ltd	Goldman Sachs	3,189
10,500	Welcia Holdings Co Ltd	Barclays Bank	3,021
200	Welcia Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(211)
14,700	West Japan Railway Co	Bank of America Merrill Lynch	(23,124)
9,200	West Japan Railway Co	Barclays Bank	(40,505)
13,000	West Japan Railway Co	Goldman Sachs	(20,450)
2,100	Yakult Honsha Co Ltd	Barclays Bank	(2,719)
2,500	Yakult Honsha Co Ltd	HSBC	(4,676)
(21,300)	Yamada Holdings Co Ltd	Barclays Bank	1,430
(52,000)	Yamada Holdings Co Ltd	Citibank	3,491
4,800	Yamaha Corp	Bank of America Merrill Lynch	3,683
4,800	Yamaha Corp	Goldman Sachs	3,683
10,700	Yamaha Motor Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,539
26,500	Yamaha Motor Co Ltd	Barclays Bank	3,304

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
1,700	Yamaha Motor Co Ltd	Credit Suisse	7,321
14,600	Yamaha Motor Co Ltd	Goldman Sachs	2,101
10,000	Yamaha Motor Co Ltd	HSBC	43,067
1,200	Yamaha Motor Co Ltd	JP Morgan	5,168
(17,600)	Yamato Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(12,324)
3,400	Yamazaki Baking Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,739)
52,200	Yamazaki Baking Co Ltd	Barclays Bank	(58,581)
5,700	Yamazaki Baking Co Ltd	Citibank	(6,397)
3,200	Yamazaki Baking Co Ltd	Credit Suisse	31
(8,900)	Yaskawa Electric Corp	Barclays Bank	(11,951)
52,500	Yokogawa Electric Corp	Bank of America Merrill Lynch	(11,582)
70,700	Yokohama Rubber Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(105,791)
64,500	Yokohama Rubber Co Ltd	Barclays Bank	(57,537)
9,400	Yokohama Rubber Co Ltd	Goldman Sachs	(14,066)
(118,500)	Z Holdings Corp	HSBC	7,388
			<u>(4,605,532)</u>
	ジャージー		
(82,320)	Ancor Plc	Barclays Bank	(32,928)
(27,280)	Ancor Plc	Citibank	3,546
(121,950)	Ancor Plc	Credit Suisse	73,170
(8,640)	Ancor Plc	Goldman Sachs	6,135
(30,387)	Ancor Plc	HSBC	18,232
19,354	Experian Plc	Bank of America Merrill Lynch	(88,517)
14,418	Experian Plc	Deutsche Bank	(57,942)
4,253	Ferguson Plc	Bank of America Merrill Lynch	25,822
18,364	Ferguson Plc	Barclays Bank	98,724
8,203	Ferguson Plc	Deutsche Bank	49,803
2,099	Ferguson Plc	Goldman Sachs	12,744
6,354	Ferguson Plc	HSBC	8,837
39,867	WPP Plc	Barclays Bank	(640)
79,692	WPP Plc	Deutsche Bank	(27,922)
			<u>89,064</u>
	リベリア		
(2,218)	Royal Caribbean Cruises Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(10,447)
(7,933)	Royal Caribbean Cruises Ltd	Barclays Bank	(35,143)
(1,005)	Royal Caribbean Cruises Ltd	Credit Suisse	(4,804)
(1,045)	Royal Caribbean Cruises Ltd	Goldman Sachs	(4,922)
			<u>(55,316)</u>
	ルクセンブルグ		
(4,001)	ArcelorMittal SA	Deutsche Bank	(7,110)
37,853	Aroundtown SA	Deutsche Bank	18,980
(1,540)	Eurofins Scientific SE	Deutsche Bank	1,626
(5,040)	Eurofins Scientific SE	HSBC	(10,822)
(36,480)	SES SA	Bank of America Merrill Lynch	38,334
(49,665)	SES SA	Deutsche Bank	52,188

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)			
(23,957)	SES SA	Goldman Sachs	25,174
43,263	Tenaris SA	Deutsche Bank	23,353
7,980	Tenaris SA	Goldman Sachs	4,308
			146,031
オランダ			
451	Adyen NV	Deutsche Bank	3,202
(74,036)	Aegon NV	Barclays Bank	(65,719)
(362,888)	Aegon NV	Deutsche Bank	(91,414)
(4,982)	AerCap Holdings NV	Goldman Sachs	1,893
(1,152)	AerCap Holdings NV	HSBC	1,414
538	Akzo Nobel NV	Barclays Bank	852
13,029	Akzo Nobel NV	Deutsche Bank	27,820
(1,203)	Argenx SE	Credit Suisse	(26,841)
(253)	Argenx SE	Goldman Sachs	(4,856)
(197)	Argenx SE	HSBC	(4,395)
(417)	Argenx SE	JP Morgan	(9,304)
(16,120)	CNH Industrial NV	Bank of America Merrill Lynch	(9,243)
(6,849)	CNH Industrial NV	Barclays Bank	(1,906)
(25,550)	CNH Industrial NV	Goldman Sachs	(14,650)
(90,760)	CNH Industrial NV	HSBC	(117,363)
(19,120)	Davide Campari-Milano NV	Barclays Bank	(4,083)
(32,450)	Davide Campari-Milano NV	Citibank	(6,929)
(5,144)	Davide Campari-Milano NV	Deutsche Bank	296
(939)	Ferrari NV	Deutsche Bank	(3,379)
(68,821)	Fiat Chrysler Automobiles NV	Deutsche Bank	(52,670)
(33,659)	Heineken NV	Deutsche Bank	151,005
5,110	ING Groep NV	Barclays Bank	2,305
24,454	ING Groep NV	Deutsche Bank	20,453
(16,316)	Just Eat Takeaway.com NV	Deutsche Bank	36,369
55,151	Koninklijke Ahold Delhaize NV	Bank of America Merrill Lynch	67,479
177,945	Koninklijke Ahold Delhaize NV	Deutsche Bank	217,723
(44,323)	Koninklijke KPN NV	Deutsche Bank	1,329
64,009	Koninklijke Philips NV	Deutsche Bank	(75,630)
(5,254)	Koninklijke Vopak NV	Citibank	(2,017)
(14,235)	Koninklijke Vopak NV	Credit Suisse	16,222
(2,446)	Koninklijke Vopak NV	Deutsche Bank	(1,672)
(25,342)	Koninklijke Vopak NV	Goldman Sachs	(17,327)
(10,082)	LyondellBasell Industries NV 'A'	Barclays Bank	(108,481)
(1,120)	LyondellBasell Industries NV 'A'	Citibank	(1,490)
(10,371)	LyondellBasell Industries NV 'A'	HSBC	(73,738)
3,816	NXP Semiconductors NV	Barclays Bank	93,988
45	NXP Semiconductors NV	HSBC	660
(210)	Prosus NV	Bank of America Merrill Lynch	(897)
(20,927)	Prosus NV	Deutsche Bank	(86,077)
(3,329)	Prosus NV	Goldman Sachs	(14,216)

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)			
(9,001)	QIAGEN NV	Goldman Sachs	(17,707)
18,446	Randstad NV	Bank of America Merrill Lynch	21,242
746	Randstad NV	Barclays Bank	2,506
592	Randstad NV	Citibank	1,988
25,499	Randstad NV	Deutsche Bank	29,364
7,746	Randstad NV	HSBC	32,335
4,279	Randstad NV	JP Morgan	17,862
29,058	STMicroelectronics NV	Deutsche Bank	118,164
			<u>54,467</u>
ニュージーランド			
100,561	a2 Milk Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(38,968)
5,694	a2 Milk Co Ltd	HSBC	(2,808)
(449,064)	Auckland International Airport Ltd	HSBC	(211,980)
(30,795)	Auckland International Airport Ltd	JP Morgan	(14,537)
13,586	Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd	Barclays Bank	28,907
97,361	Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd	Goldman Sachs	90,546
(99,206)	Mercury NZ Ltd	HSBC	(24,463)
(68,217)	Mercury NZ Ltd	JP Morgan	(16,822)
22,661	Meridian Energy Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,076
34,524	Meridian Energy Ltd	Deutsche Bank	3,162
(133,228)	Ryman Healthcare Ltd	HSBC	16,896
(16,864)	Ryman Healthcare Ltd	JP Morgan	2,139
			<u>(165,852)</u>
ノルウェー			
(40,659)	Adevinta ASA	Deutsche Bank	(36,494)
15,052	DNB ASA	Barclays Bank	3,249
15,790	DNB ASA	Deutsche Bank	11,865
29,379	Gjensidige Forsikring ASA	Deutsche Bank	(8,159)
(104,474)	Mowi ASA	Bank of America Merrill Lynch	113,357
(38,551)	Mowi ASA	Deutsche Bank	41,829
163,274	Orkla ASA	Deutsche Bank	(54,909)
7	TOMRA Systems ASA	Bank of America Merrill Lynch	2
(3,092)	Yara International ASA	Deutsche Bank	1,619
			<u>72,359</u>
パプアニューギニア			
(51,092)	Oil Search Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3,393
(164,341)	Oil Search Ltd	Barclays Bank	(97,007)
(407,677)	Oil Search Ltd	Goldman Sachs	36,096
			<u>(57,518)</u>
ポルトガル			
22,681	EDP - Energias de Portugal SA	Deutsche Bank	1,007
14,927	Galp Energia SGPS SA	Deutsche Bank	3,203
(3,911)	Jeronimo Martins SGPS SA	Bank of America Merrill Lynch	(1,056)
(85,896)	Jeronimo Martins SGPS SA	Deutsche Bank	(32,840)
			<u>(29,686)</u>

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			
152,500	City Developments Ltd	Bank of America Merrill Lynch	45,609
73,400	City Developments Ltd	Barclays Bank	(5,488)
40,800	City Developments Ltd	Citibank	(3,051)
33,000	City Developments Ltd	Credit Suisse	28,128
16,000	City Developments Ltd	Deutsche Bank	721
7,900	City Developments Ltd	Goldman Sachs	1,517
65,400	City Developments Ltd	JP Morgan	55,745
(192,100)	Jardine Cycle & Carriage Ltd	Goldman Sachs	83,306
(6,100)	Jardine Cycle & Carriage Ltd	HSBC	(410)
(400)	Jardine Cycle & Carriage Ltd	JP Morgan	(27)
(43,300)	Keppel Corp Ltd	Barclays Bank	5,504
(655,700)	Keppel Corp Ltd	Goldman Sachs	(9,805)
(398,300)	Keppel Corp Ltd	HSBC	(107,210)
29,000	United Overseas Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	16,696
130,300	United Overseas Bank Ltd	Barclays Bank	(60,403)
34,100	United Overseas Bank Ltd	Goldman Sachs	19,632
(150,900)	UOL Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(19,181)
(80,700)	Venture Corp Ltd	Barclays Bank	29,566
(136,800)	Venture Corp Ltd	Goldman Sachs	34,777
113,100	Wilmar International Ltd	Barclays Bank	(10,993)
178,900	Wilmar International Ltd	Deutsche Bank	(12,039)
44,700	Wilmar International Ltd	Goldman Sachs	(3,008)
17,400	Wilmar International Ltd	JP Morgan	(2,212)
			87,374
韓国			
(1,310)	AMOREPACIFIC Group (Pref)	Barclays Bank	(143)
(47)	AMOREPACIFIC Group (Pref)	Credit Suisse	(121)
(252)	AMOREPACIFIC Group (Pref)	JP Morgan	(648)
(5,047)	Celltrion Healthcare Co Ltd	Citibank	(102,814)
(14,912)	Celltrion Healthcare Co Ltd	Credit Suisse	(409,296)
1	Doosan Co Ltd	Citibank	5
50,860	Hana Financial Group Inc	Goldman Sachs	(117,717)
9,606	Hana Financial Group Inc	HSBC	9,154
1	HDC Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	-
1	HDC Holdings Co Ltd	JP Morgan	-
1,839	Hyundai Mobis Co Ltd	Barclays Bank	25,614
(19,682)	Hyundai Motor Co (Pref)	Barclays Bank	(3,499)
(8,264)	Hyundai Motor Co (Pref)	Credit Suisse	(29,243)
(15,128)	Hyundai Motor Co (Pref)	Goldman Sachs	(11,064)
(16,956)	Kangwon Land Inc	Citibank	4,167
(50,975)	Kangwon Land Inc	Goldman Sachs	(2,517)
20,541	KB Financial Group Inc	Credit Suisse	49,492
3,872	KB Financial Group Inc	Deutsche Bank	(835)
8,501	KB Financial Group Inc	HSBC	20,483
23,654	Kia Motors Corp	HSBC	124,498

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
韓国(続き)			
(11,849)	Korea Shipbuilding & Offshore Engineering Co Ltd	Barclays Bank	(14,446)
(4,932)	Korea Shipbuilding & Offshore Engineering Co Ltd	Citibank	(6,013)
(23,489)	Korea Shipbuilding & Offshore Engineering Co Ltd	Credit Suisse	(285,684)
(5,048)	Korea Shipbuilding & Offshore Engineering Co Ltd	Goldman Sachs	(19,802)
(1,530)	Korea Zinc Co Ltd	Goldman Sachs	8,380
10,775	KT&G Corp	Goldman Sachs	(20,387)
(467)	LG Chem Ltd (Pref)	Goldman Sachs	(8,786)
2,097	LG Corp	Credit Suisse	(3,503)
5,815	LG Corp	HSBC	(9,713)
44,595	LG Electronics Inc	Goldman Sachs	(31,815)
106,850	LG Uplus Corp	Barclays Bank	52,064
31,882	LG Uplus Corp	Citibank	15,535
35,508	LG Uplus Corp	Credit Suisse	7,160
117,390	LG Uplus Corp	Goldman Sachs	55,999
25,450	LG Uplus Corp	HSBC	5,132
38,020	LG Uplus Corp	JP Morgan	7,612
(1)	Lotte Shopping Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(5)
1,030	NCSOFT Corp	Goldman Sachs	11,121
3,726	POSCO	JP Morgan	4,777
(1,390)	Samsung Biologics Co Ltd	Goldman Sachs	(37,490)
(2,098)	Samsung C&T Corp	Credit Suisse	(11,779)
(11,890)	Samsung C&T Corp	Goldman Sachs	34,364
974	Samsung Electro-Mechanics Co Ltd	Barclays Bank	3,979
5,121	Samsung Electro-Mechanics Co Ltd	Deutsche Bank	10,991
30,128	Samsung Electronics Co Ltd (Pref)	Goldman Sachs	66,519
(2,509)	SK Holdings Co Ltd	Barclays Bank	5,138
(1,660)	SK Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	10,452
(15,189)	SK Hynix Inc	Barclays Bank	29,618
(1,032)	SK Innovation Co Ltd	Barclays Bank	(36,985)
2,330	SK Telecom Co Ltd	Barclays Bank	15,351
12	SK Telecom Co Ltd	Credit Suisse	145
(25,830)	S-Oil Corp	Barclays Bank	(77,675)
(16,430)	S-Oil Corp	Citibank	(49,408)
			<u>(713,638)</u>
スペイン			
17,573	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	Deutsche Bank	23,398
(2,669)	Aena SME SA	Barclays Bank	18,889
(9,700)	Aena SME SA	Deutsche Bank	59,342
(4,548)	Aena SME SA	Goldman Sachs	27,823
(1,301)	Aena SME SA	JP Morgan	624
(4,270)	Amadeus IT Group SA	Bank of America Merrill Lynch	(6,966)
(6,882)	Amadeus IT Group SA	Barclays Bank	(112,355)

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)		
(16,049)	Amadeus IT Group SA	Deutsche Bank	(26,182)
127,431	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Barclays Bank	234,640
159,118	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Deutsche Bank	58,025
472,117	Banco Santander SA	Deutsche Bank	62,805
214,687	Banco Santander SA	Deutsche Bank	1,185
105,371	Bankinter SA	Barclays Bank	(12,261)
(9,345)	Cellnex Telecom SA	Bank of America Merrill Lynch	(15,694)
(6,784)	Cellnex Telecom SA	Barclays Bank	(11,881)
(6,850)	Cellnex Telecom SA	Deutsche Bank	(11,504)
39,028	Endesa SA	Bank of America Merrill Lynch	(9,363)
93,347	Endesa SA	Deutsche Bank	(22,395)
3,050	Endesa SA	Goldman Sachs	(732)
(185)	Ferrovial SA	Bank of America Merrill Lynch	126
(23,372)	Ferrovial SA	Barclays Bank	(86,070)
(717)	Ferrovial SA	Barclays Bank	(20,220)
(37,895)	Ferrovial SA	Citibank	(4,091)
(490)	Ferrovial SA	Citibank	(13,819)
(153)	Ferrovial SA	Credit Suisse	(169)
(10,934)	Ferrovial SA	Deutsche Bank	4,197
(109)	Ferrovial SA	Deutsche Bank	74
(24,680)	Ferrovial SA	Goldman Sachs	9,474
(806)	Ferrovial SA	Goldman Sachs	474
(134)	Ferrovial SA	HSBC	(162)
(27,474)	Grifols SA	JP Morgan	63,606
48,948	Iberdrola SA	Credit Suisse	24,073
133,847	Iberdrola SA	Deutsche Bank	19,549
8,190	Iberdrola SA	HSBC	4,028
57,961	Iberdrola SA	JP Morgan	28,506
13,323	Industria de Diseno Textil SA	Barclays Bank	64,566
(66,534)	Naturgy Energy Group SA	Barclays Bank	(155,232)
75,109	Repsol SA	Deutsche Bank	41,805
(37,802)	Siemens Gamesa Renewable Energy SA	Barclays Bank	(222,646)
(43,084)	Siemens Gamesa Renewable Energy SA	JP Morgan	(243,936)
			<u>(228,469)</u>
	国際機関(Supranational)		
(728,500)	HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd (Unit)	Bank of America Merrill Lynch	7,519
(1,794,500)	HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd (Unit)	Barclays Bank	2,315
(308,000)	HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd (Unit)	HSBC	3,973
(681,000)	HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd (Unit)	JP Morgan	8,785
(842,000)	HKT Trust & HKT Ltd (Unit)	Bank of America Merrill Lynch	4,345
(26,000)	HKT Trust & HKT Ltd (Unit)	HSBC	(671)
(105,000)	HKT Trust & HKT Ltd (Unit)	JP Morgan	(2,709)
			<u>23,557</u>

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		
(4,988)	Atlas Copco AB 'A'	Deutsche Bank	529
2	Axfood AB	Credit Suisse	(1)
1	Axfood AB	Deutsche Bank	-
8,059	Boliden AB	Bank of America Merrill Lynch	16,055
4,336	Boliden AB	Deutsche Bank	8,698
2,389	Boliden AB	JP Morgan	8,702
5,632	Electrolux AB 'B'	Barclays Bank	332
21,997	Electrolux AB 'B'	Deutsche Bank	(4,927)
38	Electrolux AB 'B'	HSBC	25
(1,909)	EQT AB	Deutsche Bank	383
(38,417)	Essity AB 'B'	Deutsche Bank	(9,504)
9,947	Hennes & Mauritz AB 'B'	Deutsche Bank	8,794
5,728	Husqvarna AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	311
74,467	Husqvarna AB 'B'	Barclays Bank	5,794
79,033	Husqvarna AB 'B'	Deutsche Bank	4,286
(1,174)	ICA Gruppen AB	Bank of America Merrill Lynch	(789)
(44,228)	ICA Gruppen AB	Barclays Bank	(37,538)
(1,611)	ICA Gruppen AB	Goldman Sachs	(1,082)
(3)	Intrum AB	JP Morgan	9
(110,777)	Investment AB Latour 'B'	Goldman Sachs	62,680
16,536	Investor AB 'B'	JP Morgan	3,509
(2,575)	Kinnevik AB 'B'	Deutsche Bank	(9,880)
(19,231)	L E Lundbergforetagen AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	16,322
(11,596)	L E Lundbergforetagen AB 'B'	Barclays Bank	12,029
(1,429)	L E Lundbergforetagen AB 'B'	Citibank	1,482
(17,530)	L E Lundbergforetagen AB 'B'	Deutsche Bank	14,878
(6,885)	L E Lundbergforetagen AB 'B'	Goldman Sachs	5,844
(2,220)	L E Lundbergforetagen AB 'B'	HSBC	(209)
(5,170)	L E Lundbergforetagen AB 'B'	JP Morgan	(488)
62,380	Lundin Energy AB	Barclays Bank	(28,678)
28,193	Lundin Energy AB	Deutsche Bank	2,326
659	Lundin Energy AB	Goldman Sachs	54
(5)	Modern Times Group MTG AB 'B'	Citibank	3
(2)	NCC AB 'B'	Credit Suisse	-
48,150	Sandvik AB	Deutsche Bank	21,568
(12,286)	Securitas AB 'B'	Deutsche Bank	6,227
71,225	Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A'	Deutsche Bank	7,418
(79,137)	Svenska Cellulosa AB SCA 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(35,915)
(7,994)	Svenska Cellulosa AB SCA 'B'	Barclays Bank	424
(52,999)	Svenska Cellulosa AB SCA 'B'	Citibank	2,811
(69,536)	Svenska Cellulosa AB SCA 'B'	Deutsche Bank	(31,558)
(86,373)	Svenska Cellulosa AB SCA 'B'	Goldman Sachs	(39,199)
101,240	Svenska Handelsbanken AB 'A'	Deutsche Bank	30,678
23,423	Swedish Match AB	Bank of America Merrill Lynch	2,209
22,209	Swedish Match AB	Deutsche Bank	(10,921)

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)		
1,146	Swedish Match AB	HSBC	(179)
5,287	Tele2 AB 'B'	Deutsche Bank	1,888
86,071	Volvo AB 'B'	Deutsche Bank	(16,234)
2,387	Volvo AB 'B'	HSBC	(141)
			19,025
	スイス		
11,552	Adecco Group AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	19,426
6,880	Adecco Group AG RegS	Barclays Bank	20,551
7,780	Adecco Group AG RegS	Citibank	23,239
112	Adecco Group AG RegS	Credit Suisse	431
2,440	Adecco Group AG RegS	Goldman Sachs	4,103
2,990	Adecco Group AG RegS	HSBC	11,511
4,121	Adecco Group AG RegS	JP Morgan	15,866
(10,661)	Alcon Inc	Goldman Sachs	29,014
676	Baloise Holding AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	(696)
418	Baloise Holding AG RegS	Citibank	(1,434)
495	Baloise Holding AG RegS	Goldman Sachs	(733)
403	Baloise Holding AG RegS	HSBC	(73)
(12,858)	Banque Cantonale Vaudoise RegS	Bank of America Merrill Lynch	55,478
(13,044)	Banque Cantonale Vaudoise RegS	Barclays Bank	50,508
(4,101)	Banque Cantonale Vaudoise RegS	Citibank	15,880
(203)	Banque Cantonale Vaudoise RegS	Credit Suisse	382
230	Banque Cantonale Vaudoise RegS	Deutsche Bank	(992)
(8,507)	Banque Cantonale Vaudoise RegS	Goldman Sachs	36,705
(1,147)	Banque Cantonale Vaudoise RegS	HSBC	2,157
(3,323)	Banque Cantonale Vaudoise RegS	JP Morgan	6,250
(1,775)	Barry Callebaut AG RegS	Barclays Bank	68,730
(417)	Barry Callebaut AG RegS	Citibank	16,147
(881)	Barry Callebaut AG RegS	Goldman Sachs	69,201
1	Cembra Money Bank AG	JP Morgan	(9)
(143)	Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	Bank of America Merrill Lynch	26,895
(178)	Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	Barclays Bank	17,723
(85)	Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	Citibank	8,463
(25)	Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	Credit Suisse	(4,564)
(254)	Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	Goldman Sachs	47,771
(70)	Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	JP Morgan	(12,778)
(2,190)	Cie Financiere Richemont SA	Bank of America Merrill Lynch	(460)
(9,892)	Cie Financiere Richemont SA	Barclays Bank	(2,079)
(3,734)	Cie Financiere Richemont SA	Goldman Sachs	(785)
(4,844)	Cie Financiere Richemont SA	JP Morgan	(1,018)
(1,095)	Cie Financiere Richemont SA RegS	Bank of America Merrill Lynch	159
(4,946)	Cie Financiere Richemont SA RegS	Barclays Bank	1,204
(1,867)	Cie Financiere Richemont SA RegS	Goldman Sachs	(1,590)
(2,422)	Cie Financiere Richemont SA RegS	JP Morgan	(1,152)
(153,423)	Clariant AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	(61,104)

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)		
(2,545)	Clariant AG RegS	Citibank	(676)
(21,137)	Clariant AG RegS	Goldman Sachs	(8,418)
1,281	Coca-Cola HBC AG	Barclays Bank	(1,062)
25,402	Coca-Cola HBC AG	Deutsche Bank	(37,707)
30,920	Coca-Cola HBC AG	Goldman Sachs	(45,898)
779	EMS-Chemie Holding AG RegS	Barclays Bank	13,789
(14,729)	Garmin Ltd	Barclays Bank	(253,128)
(3,069)	Garmin Ltd	Goldman Sachs	3,867
3,749	Geberit AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	(48,112)
1,854	Geberit AG RegS	Barclays Bank	(13,537)
125	Geberit AG RegS	Credit Suisse	(1,455)
1,353	Geberit AG RegS	Goldman Sachs	(17,363)
150	Geberit AG RegS	HSBC	(631)
370	Givaudan SA RegS	Citibank	41,343
729	Kuehne + Nagel International AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	9,869
6,626	Kuehne + Nagel International AG RegS	Barclays Bank	68,173
1,107	Kuehne + Nagel International AG RegS	Citibank	11,390
903	Kuehne + Nagel International AG RegS	Credit Suisse	14,336
765	Kuehne + Nagel International AG RegS	Goldman Sachs	4,791
43,320	LafargeHolcim Ltd RegS	Bank of America Merrill Lynch	69,971
85,070	LafargeHolcim Ltd RegS	Barclays Bank	623,690
2,013	LafargeHolcim Ltd RegS	Citibank	3,118
12,258	LafargeHolcim Ltd RegS	Credit Suisse	56,143
16,677	LafargeHolcim Ltd RegS	Goldman Sachs	26,937
593	Logitech International SA RegS	Bank of America Merrill Lynch	4,103
238	Lonza Group AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	(10,953)
11,441	Nestle SA RegS	Bank of America Merrill Lynch	(38,225)
3,381	Nestle SA RegS	Credit Suisse	(13,446)
890	Nestle SA RegS	HSBC	(1,833)
2,576	Nestle SA RegS	JP Morgan	(8,921)
21,051	Novartis AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	61,250
14,480	Novartis AG RegS	Barclays Bank	32,680
7,979	Novartis AG RegS	Credit Suisse	40,429
9,314	Novartis AG RegS	Goldman Sachs	27,100
9,839	Novartis AG RegS	HSBC	49,854
6,616	Novartis AG RegS	JP Morgan	33,523
(1,684)	Partners Group Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	(99,773)
(378)	Partners Group Holding AG	Barclays Bank	(18,986)
(519)	Partners Group Holding AG	Citibank	(26,068)
(70)	Partners Group Holding AG	Credit Suisse	(2,029)
2,739	Roche Holding AG	Citibank	(2,273)
7,351	Roche Holding AG	Credit Suisse	(76,446)
396	Roche Holding AG	HSBC	(4,118)
1,382	Roche Holding AG	JP Morgan	(14,372)
(1,046)	Schindler Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	(3,240)

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)		
(4,129)	Schindler Holding AG	Barclays Bank	7,766
(951)	Schindler Holding AG	Citibank	1,789
(662)	Schindler Holding AG	JP Morgan	(1,831)
126	SGS SA RegS	Barclays Bank	(9,758)
599	SGS SA RegS	Goldman Sachs	(43,157)
8,347	Sonova Holding AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	(112,660)
1,669	Sonova Holding AG RegS	Barclays Bank	12,556
(1,076)	Swiss Prime Site AG RegS	Barclays Bank	(3,214)
(780)	Swiss Prime Site AG RegS	Citibank	1,769
(20,482)	Swiss Re AG	Barclays Bank	(364,819)
4,832	Swisscom AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	(21,383)
7,124	Swisscom AG RegS	Barclays Bank	31,526
1,135	Swisscom AG RegS	Goldman Sachs	(5,023)
365	Swisscom AG RegS	HSBC	1,413
(7,728)	Temenos AG RegS	Bank of America Merrill Lynch	(19,237)
(1,180)	Temenos AG RegS	Barclays Bank	(3,786)
(9,955)	Temenos AG RegS	Credit Suisse	(15,419)
(5,224)	Vifor Pharma AG	Bank of America Merrill Lynch	(52,593)
(3,357)	Vifor Pharma AG	Barclays Bank	(43,081)
2,895	Zurich Insurance Group AG	Barclays Bank	(7,687)
229	Zurich Insurance Group AG	Credit Suisse	3,351
215	Zurich Insurance Group AG	HSBC	9,372
216	Zurich Insurance Group AG	JP Morgan	1,334
			273,241
	台湾		
(36,973)	Advantech Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	677
(201,274)	Advantech Co Ltd	Citibank	90,692
(22,000)	Advantech Co Ltd	JP Morgan	(9,370)
452,000	ASE Technology Holding Co Ltd	Barclays Bank	43,393
37,000	ASE Technology Holding Co Ltd	Goldman Sachs	6,093
265,000	ASE Technology Holding Co Ltd	HSBC	59,481
236,000	ASE Technology Holding Co Ltd	JP Morgan	53,267
274,000	Asustek Computer Inc	Barclays Bank	(18,042)
8,000	Asustek Computer Inc	Goldman Sachs	(145)
(416,000)	Catcher Technology Co Ltd	Goldman Sachs	14,804
(17,000)	Catcher Technology Co Ltd	JP Morgan	(1,544)
2,349,000	China Development Financial Holding Corp	Citibank	20,130
998,000	Chunghwa Telecom Co Ltd	Barclays Bank	(68,129)
264,000	Chunghwa Telecom Co Ltd	Goldman Sachs	(9,323)
55,000	Chunghwa Telecom Co Ltd	JP Morgan	(2,794)
725,000	CTBC Financial Holding Co Ltd	Citibank	(12,473)
2,513,000	CTBC Financial Holding Co Ltd	HSBC	44,025
85,000	Delta Electronics Inc	Bank of America Merrill Lynch	67,057
203,000	Delta Electronics Inc	Barclays Bank	89,769
5,000	Delta Electronics Inc	Citibank	2,211

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	台湾(続き)		
38,000	Delta Electronics Inc	HSBC	35,988
11,000	Delta Electronics Inc	JP Morgan	10,456
374,000	Far EasTone Telecommunications Co Ltd	Barclays Bank	10,892
193,000	Far EasTone Telecommunications Co Ltd	Citibank	5,621
419,000	Far EasTone Telecommunications Co Ltd	Goldman Sachs	8,777
59,000	Far EasTone Telecommunications Co Ltd	HSBC	2,273
96,000	Far EasTone Telecommunications Co Ltd	JP Morgan	3,802
647,355	First Financial Holding Co Ltd	Citibank	(6,573)
803,752	First Financial Holding Co Ltd	HSBC	7,029
(3,000)	Formosa Chemicals & Fibre Corp	Bank of America Merrill Lynch	85
(748,000)	Formosa Chemicals & Fibre Corp	Barclays Bank	77,699
(522,000)	Formosa Chemicals & Fibre Corp	Goldman Sachs	14,764
(7,000)	Formosa Chemicals & Fibre Corp	JP Morgan	(1,261)
(74,000)	Formosa Petrochemical Corp	Bank of America Merrill Lynch	4,430
(361,000)	Formosa Petrochemical Corp	Barclays Bank	52,606
(378,000)	Formosa Petrochemical Corp	Goldman Sachs	22,619
(73,000)	Formosa Petrochemical Corp	HSBC	(22,019)
(159,374)	Formosa Plastics Corp	Bank of America Merrill Lynch	16,250
(217,000)	Formosa Plastics Corp	Barclays Bank	27,076
(91,000)	Formosa Plastics Corp	Citibank	11,355
(42,000)	Formosa Plastics Corp	Goldman Sachs	4,284
(35,000)	Formosa Plastics Corp	HSBC	(4,172)
(61,000)	Formosa Plastics Corp	JP Morgan	(7,359)
(258,000)	Fubon Financial Holding Co Ltd	Citibank	10,660
(81,510)	Hotai Motor Co Ltd	JP Morgan	21,999
1,489,805	Hua Nan Financial Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(18,363)
606	Hua Nan Financial Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(7)
(1,000)	Largan Precision Co Ltd	Barclays Bank	6,081
(8,000)	Largan Precision Co Ltd	Goldman Sachs	26,730
(118,000)	Mega Financial Holding Co Ltd	Barclays Bank	5,115
(100,000)	Mega Financial Holding Co Ltd	Citibank	4,334
(2,990,000)	Mega Financial Holding Co Ltd	Goldman Sachs	105,075
(333,000)	Mega Financial Holding Co Ltd	HSBC	3,517
(388,000)	Mega Financial Holding Co Ltd	JP Morgan	3,899
(411,000)	Nan Ya Plastics Corp	Goldman Sachs	4,384
(493,000)	Nanya Technology Corp	Goldman Sachs	(141,751)
(202,000)	Nanya Technology Corp	JP Morgan	(85,248)
11,000	President Chain Store Corp	Barclays Bank	(5,351)
74,000	President Chain Store Corp	Goldman Sachs	(28,607)
70,000	Quanta Computer Inc	Barclays Bank	(1,135)
123,000	Quanta Computer Inc	Citibank	(1,994)
92,000	Quanta Computer Inc	Goldman Sachs	1,129
(934,000)	Shanghai Commercial & Savings Bank Ltd	Goldman Sachs	49,221
(890,000)	Shanghai Commercial & Savings Bank Ltd	HSBC	(4,641)
(216,000)	Shanghai Commercial & Savings Bank Ltd	JP Morgan	(1,276)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	台湾(続き)		
(415)	Shin Kong Financial Holding Co Ltd (Pref)	Bank of America Merrill Lynch	-
(45,000)	Taiwan Cement Corp	Barclays Bank	125
1,762,453	Taiwan Cooperative Financial Holding Co Ltd	Goldman Sachs	(9,309)
6,028,329	Taiwan Cooperative Financial Holding Co Ltd	JP Morgan	65,452
(93,043)	Taiwan Mobile Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	7,857
(224,000)	Taiwan Mobile Co Ltd	Barclays Bank	18,478
(119,000)	Taiwan Mobile Co Ltd	Goldman Sachs	10,053
(390,000)	Taiwan Mobile Co Ltd	JP Morgan	45,871
111,000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	Goldman Sachs	(13,767)
6,000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	JP Morgan	4,677
709,000	Uni-President Enterprises Corp	Barclays Bank	(86,226)
756,000	Uni-President Enterprises Corp	Citibank	(91,942)
261,000	Uni-President Enterprises Corp	Goldman Sachs	(27,509)
145,000	Uni-President Enterprises Corp	HSBC	8,637
33,000	Uni-President Enterprises Corp	JP Morgan	2,003
297,000	United Microelectronics Corp	Goldman Sachs	86,465
(70,000)	Yageo Corp	Barclays Bank	(58,219)
(9,000)	Yageo Corp	Goldman Sachs	(11,536)
(26,000)	Yageo Corp	JP Morgan	(49,426)
1,132,560	Yuanta Financial Holding Co Ltd	Citibank	(11,542)
108,160	Yuanta Financial Holding Co Ltd	HSBC	2,844
			491,158
	英国		
(15,998)	Admiral Group Plc	Barclays Bank	(16,901)
5,705	Associated British Foods Plc	Deutsche Bank	5,264
(2,280)	AstraZeneca Plc	Deutsche Bank	14,976
(4,808)	Auto Trader Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(270)
(33,613)	Auto Trader Group Plc	Barclays Bank	(4,405)
(111,354)	Auto Trader Group Plc	Deutsche Bank	(6,254)
(2,783)	AVEVA Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	29,439
(2,164)	AVEVA Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(32,311)
(16,142)	AVEVA Group Plc	Barclays Bank	186,509
(12,554)	AVEVA Group Plc	Barclays Bank	(187,443)
(1,049)	AVEVA Group Plc	Citibank	12,120
(816)	AVEVA Group Plc	Citibank	(12,184)
(4,240)	AVEVA Group Plc	Credit Suisse	45,872
(3,297)	AVEVA Group Plc	Credit Suisse	(49,227)
(9,252)	AVEVA Group Plc	Deutsche Bank	98,907
(7,196)	AVEVA Group Plc	Deutsche Bank	(107,443)
(4,475)	AVEVA Group Plc	Goldman Sachs	47,337
(3,480)	AVEVA Group Plc	Goldman Sachs	(51,960)
(1,561)	AVEVA Group Plc	HSBC	16,888
(1,214)	AVEVA Group Plc	HSBC	(18,126)
614,318	Aviva Plc	Barclays Bank	430,481
40,379	Aviva Plc	Citibank	594

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	英国(続き)		
300,520	Barclays Plc	Bank of America Merrill Lynch	(7,797)
1,132,044	Barclays Plc	Deutsche Bank	(29,369)
117,279	Barclays Plc	Goldman Sachs	(3,043)
(78,717)	Barratt Developments Plc	Deutsche Bank	9,264
1,473	Berkeley Group Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1,852)
7,055	Berkeley Group Holdings Plc	Deutsche Bank	(8,869)
885,935	BP Plc	Deutsche Bank	56,868
(134,813)	British American Tobacco Plc	Deutsche Bank	339,838
(172,579)	BT Group Plc	Deutsche Bank	16,448
2,378	Bunzl Plc	Barclays Bank	(700)
8,089	Bunzl Plc	Deutsche Bank	(3,353)
19,533	Bunzl Plc	Goldman Sachs	(8,098)
13,093	Burberry Group Plc	Deutsche Bank	20,582
7,441	Burberry Group Plc	Goldman Sachs	10,747
10,370	Compass Group Plc	Barclays Bank	31,688
14,327	Compass Group Plc	Deutsche Bank	(8,143)
3,567	Croda International Plc	Deutsche Bank	(7,329)
1,112	Croda International Plc	HSBC	(3,130)
4,517	GlaxoSmithKline Plc	Bank of America Merrill Lynch	(3,455)
50,702	GlaxoSmithKline Plc	Goldman Sachs	(38,784)
(18,580)	Hargreaves Lansdown Plc	HSBC	33,047
(72,449)	HSBC Holdings Plc	Deutsche Bank	(12,193)
(22,871)	Imperial Brands Plc	Bank of America Merrill Lynch	4,282
(19,508)	Imperial Brands Plc	Citibank	23,349
(54,434)	Imperial Brands Plc	Deutsche Bank	10,191
(26,715)	Imperial Brands Plc	Goldman Sachs	5,002
(5,872)	Imperial Brands Plc	HSBC	(10,012)
(58,141)	Informa Plc	Deutsche Bank	30,790
(11,075)	Intertek Group Plc	Deutsche Bank	91,160
13,592	JD Sports Fashion Plc	Bank of America Merrill Lynch	(6,562)
90,869	JD Sports Fashion Plc	Barclays Bank	(45,327)
25,305	JD Sports Fashion Plc	Deutsche Bank	(12,216)
11,950	JD Sports Fashion Plc	Goldman Sachs	(5,769)
(5,280)	Johnson Matthey Plc	Deutsche Bank	14,516
83,876	Kingfisher Plc	Bank of America Merrill Lynch	(16,601)
184,440	Kingfisher Plc	Barclays Bank	(5,673)
294,360	Kingfisher Plc	Deutsche Bank	(58,260)
(68,636)	Liberty Global Plc 'A'	Barclays Bank	(138,459)
(13,016)	Liberty Global Plc 'A'	Citibank	4,946
(68,128)	Liberty Global Plc 'C'	Barclays Bank	30,658
(6,014)	Liberty Global Plc 'C'	Credit Suisse	(13,471)
(12,411)	Liberty Global Plc 'C'	Goldman Sachs	3,971
(114,141)	M&G Plc	Barclays Bank	(35,260)
(398,254)	Melrose Industries Plc	Deutsche Bank	19,972
(14,952)	Mondi Plc	Deutsche Bank	8,298

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	英国(続き)		
(8,025)	Mondi Plc	Goldman Sachs	4,454
7	National Express Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2)
37	National Express Group Plc	Credit Suisse	9
2	National Express Group Plc	JP Morgan	-
(66,224)	National Grid Plc	Deutsche Bank	71,203
173,227	Natwest Group Plc	Deutsche Bank	12,509
25,424	Natwest Group Plc	HSBC	452
(7,811)	Nielsen Holdings Plc	Goldman Sachs	(6)
(7,332)	Ocado Group Plc	Deutsche Bank	(2,874)
(2,198)	Reckitt Benckiser Group Plc	Deutsche Bank	(589)
(13,418)	RELX Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1,525)
(119,873)	RELX Plc	Deutsche Bank	(13,626)
(15,988)	RELX Plc	JP Morgan	15,501
(43,616)	Rentokil Initial Plc	Deutsche Bank	8,332
24,930	Rio Tinto Plc	Deutsche Bank	50,970
26,662	Royal Dutch Shell Plc 'A'	Deutsche Bank	27,169
20,772	Sage Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(20,334)
28,440	Schroders Plc	Deutsche Bank	75,875
851	Sensata Technologies Holding Plc	Bank of America Merrill Lynch	2,400
1,561	Sensata Technologies Holding Plc	Barclays Bank	796
41,665	Smith & Nephew Plc	Bank of America Merrill Lynch	(18,666)
(29,126)	Smiths Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	42,456
(20,559)	Smiths Group Plc	Deutsche Bank	29,968
(12,747)	Spirax-Sarco Engineering Plc	Barclays Bank	21,308
(2,002)	Spirax-Sarco Engineering Plc	Deutsche Bank	19,276
22,115	SSE Plc	Deutsche Bank	(5,795)
15,247	SSE Plc	Goldman Sachs	(6,029)
(584,759)	Taylor Wimpey Plc	Deutsche Bank	(42,619)
(28,570)	Tesco Plc	Bank of America Merrill Lynch	(993)
(207,772)	Tesco Plc	Barclays Bank	(51,125)
(750,205)	Tesco Plc	Deutsche Bank	(26,085)
(25,746)	Unilever Plc	Deutsche Bank	(12,319)
(37,275)	United Utilities Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	9,970
(44,247)	United Utilities Group Plc	Barclays Bank	5,444
(12,067)	United Utilities Group Plc	Deutsche Bank	3,227
9,200	Vodafone Group Plc	Barclays Bank	340
771,314	Vodafone Group Plc	Deutsche Bank	(23,797)
(5,827)	Whitbread Plc	Barclays Bank	(499)
(24,833)	Wm Morrison Supermarkets Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2,122)
(541,863)	Wm Morrison Supermarkets Plc	Barclays Bank	(87,608)
(16,777)	Wm Morrison Supermarkets Plc	Citibank	(121)
(1,266,095)	Wm Morrison Supermarkets Plc	Deutsche Bank	(108,192)
(283,300)	Wm Morrison Supermarkets Plc	HSBC	(70,619)
			<u>589,869</u>

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国		
950	Abbott Laboratories - CDI	Barclays Bank	(2,624)
1,173	ABIOMED Inc	Barclays Bank	(7,976)
9,932	Adobe Inc	Bank of America Merrill Lynch	146,497
1,967	Adobe Inc	Credit Suisse	10,016
1,052	Adobe Inc	HSBC	4,797
40,235	Aflac Inc	Bank of America Merrill Lynch	60,755
12,842	Aflac Inc	Barclays Bank	92,848
31,552	Aflac Inc	Citibank	9,150
1,333	Aflac Inc	Credit Suisse	4,332
18,496	Aflac Inc	Goldman Sachs	27,929
13,746	Aflac Inc	JP Morgan	44,674
1,323	Agilent Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	5,848
2,156	Agilent Technologies Inc	Barclays Bank	5,347
(6,165)	Air Products and Chemicals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(69,503)
(1,792)	Air Products and Chemicals Inc	Barclays Bank	(4,301)
(69)	Air Products and Chemicals Inc	Credit Suisse	2,416
(2,773)	Air Products and Chemicals Inc	Goldman Sachs	(31,113)
(6,570)	Albemarle Corp	Barclays Bank	(276,236)
(316)	Albemarle Corp	Citibank	(743)
(4,354)	Albemarle Corp	Goldman Sachs	(32,611)
(2,362)	Albemarle Corp	JP Morgan	(46,484)
1,930	Align Technology Inc	Goldman Sachs	44,834
40,593	Alliant Energy Corp	Barclays Bank	(149,788)
19,346	Allstate Corp	Bank of America Merrill Lynch	106,016
2,286	Allstate Corp	JP Morgan	22,060
10,705	Ally Financial Inc	Barclays Bank	34,957
(498)	Alnylam Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	(4,054)
(422)	Alnylam Pharmaceuticals Inc	Citibank	(3,435)
(1,553)	Alnylam Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(171)
737	Alphabet Inc 'A'	Goldman Sachs	(5,270)
246	Amazon.com Inc - CDI	Citibank	19,338
59	Amazon.com Inc - CDI	Credit Suisse	1,962
147	Amazon.com Inc - CDI	JP Morgan	4,889
(6,533)	AMERCO	Bank of America Merrill Lynch	6,664
(335)	AMERCO	Credit Suisse	(6,710)
(249)	AMERCO	Goldman Sachs	254
388	American Express Co	Bank of America Merrill Lynch	310
834	American Express Co	Barclays Bank	4,020
109	American Express Co	Credit Suisse	805
3,916	American Express Co	HSBC	16,589
(1,002)	American Financial Group Inc	Barclays Bank	(862)
(1,351)	American Financial Group Inc	JP Morgan	(5,364)
(23,582)	American International Group Inc	Barclays Bank	(183,012)
2,153	American Water Works Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,033)
5,589	American Water Works Co Inc	Barclays Bank	(3,689)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
1,432	American Water Works Co Inc	Credit Suisse	(2,376)
1,925	American Water Works Co Inc	Goldman Sachs	(15,337)
4,003	American Water Works Co Inc	HSBC	(33,500)
4,803	American Water Works Co Inc	JP Morgan	(37,319)
(1,481)	AmerisourceBergen Corp	Bank of America Merrill Lynch	6,798
(18,954)	AmerisourceBergen Corp	Barclays Bank	(113,098)
25,567	AMETEK Inc	Barclays Bank	321,889
(84)	Amneal Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	11
(618)	Analog Devices Inc	Bank of America Merrill Lynch	(575)
(8,083)	Analog Devices Inc	Barclays Bank	(148,128)
(271)	Anthem Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,371)
(1,620)	Anthem Inc	Citibank	(7,225)
(2,964)	Anthem Inc	Goldman Sachs	53,441
(1,416)	Anthem Inc	HSBC	12,661
(660)	Anthem Inc	JP Morgan	4,811
1	Apartment Investment and Management Co 'A' (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(1)
(48,107)	Apollo Global Management Inc	Barclays Bank	(158,095)
(9,978)	Apollo Global Management Inc	Credit Suisse	1,197
19,191	Applied Materials Inc	Barclays Bank	358,640
4,414	Applied Materials Inc	Credit Suisse	28,163
4,333	Applied Materials Inc	HSBC	33,946
(3,066)	Aramark	Bank of America Merrill Lynch	(638)
(11,311)	Aramark	Barclays Bank	2,262
(263)	Arista Networks Inc	Bank of America Merrill Lynch	(323)
(1,435)	Arista Networks Inc	Barclays Bank	(1,263)
9,975	Arrow Electronics Inc	Barclays Bank	85,685
2,354	Arthur J Gallagher & Co	Bank of America Merrill Lynch	(3,908)
196	Arthur J Gallagher & Co	HSBC	1,135
(12,986)	AT&T Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,193)
(117,613)	AT&T Inc	Barclays Bank	(26,714)
(4,613)	AT&T Inc	Goldman Sachs	738
6,331	Atmos Energy Corp	Barclays Bank	(5,870)
1,290	Atmos Energy Corp	Goldman Sachs	(2,049)
2,752	Atmos Energy Corp	HSBC	(2,386)
9,927	Autodesk Inc	Barclays Bank	266,053
(691)	Autoliv Inc	Bank of America Merrill Lynch	(846)
(5,292)	Autoliv Inc	Barclays Bank	(5,636)
(3,722)	Autoliv Inc	Citibank	(3,964)
(8,882)	Autoliv Inc	Credit Suisse	(62,218)
(2,443)	Autoliv Inc	Goldman Sachs	(2,993)
(603)	Autoliv Inc	JP Morgan	(4,224)
(494)	Automatic Data Processing Inc	Bank of America Merrill Lynch	(490)
(4,839)	Automatic Data Processing Inc	Barclays Bank	(2,903)
(349)	Automatic Data Processing Inc	Credit Suisse	1,126
(1,195)	Automatic Data Processing Inc	Goldman Sachs	5,246

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(1,557)	Automatic Data Processing Inc	HSBC	1,080
61	AutoZone Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,313)
767	AutoZone Inc	Barclays Bank	(52,416)
103	AutoZone Inc	Citibank	(547)
43	AutoZone Inc	HSBC	(1,861)
(1,704)	Avantor Inc	Bank of America Merrill Lynch	(542)
(13,221)	Avantor Inc	Barclays Bank	(12,957)
1,990	Avery Dennison Corp	Barclays Bank	21,788
(6)	Avista Corp	Bank of America Merrill Lynch	5
(48,573)	Baker Hughes Co	Barclays Bank	(252,580)
(1,039)	Ball Corp	Bank of America Merrill Lynch	(496)
(11,705)	Ball Corp	Barclays Bank	(14,865)
10,091	Bank of America Corp	HSBC	17,429
(17,184)	Bank OZK	JP Morgan	(17,184)
(2,886)	Baxter International Inc	Bank of America Merrill Lynch	13,362
(4,177)	Baxter International Inc	Barclays Bank	10,412
(10,914)	Baxter International Inc	Citibank	(6,330)
(3,697)	Becton Dickinson and Co	Bank of America Merrill Lynch	35,879
(451)	Becton Dickinson and Co	Barclays Bank	(264)
(4,437)	Becton Dickinson and Co	Citibank	(19,456)
(1,419)	Becton Dickinson and Co	Credit Suisse	10,564
(2,176)	Becton Dickinson and Co	Goldman Sachs	7,246
(630)	Becton Dickinson and Co	JP Morgan	4,690
14,273	Best Buy Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(120,607)
477	Biogen Inc	Goldman Sachs	(4,875)
(5,646)	BioMarin Pharmaceutical Inc	Barclays Bank	(4,065)
(8,102)	BioMarin Pharmaceutical Inc	Goldman Sachs	(22,524)
(194)	Bio-Rad Laboratories Inc 'A'	Goldman Sachs	(2,754)
(1,787)	Black Knight Inc	Barclays Bank	(7,223)
(16,420)	Black Knight Inc	Goldman Sachs	52,544
(5,777)	Blackstone Group Inc 'A'	Citibank	(5,430)
(21,716)	Blackstone Group Inc 'A'	Credit Suisse	(87,081)
(4,802)	Boeing Co	Barclays Bank	(267,490)
(563)	Booking Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	45,175
(305)	Booking Holdings Inc	Barclays Bank	(2,907)
(22)	Booking Holdings Inc	Citibank	(210)
7,159	Booz Allen Hamilton Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	(13,888)
733	Booz Allen Hamilton Holding Corp	Barclays Bank	(308)
692	Booz Allen Hamilton Holding Corp	Citibank	(291)
1,562	Booz Allen Hamilton Holding Corp	HSBC	(481)
4,444	Booz Allen Hamilton Holding Corp	JP Morgan	2,623
(19,191)	Boston Scientific Corp	Bank of America Merrill Lynch	92,309
(34,107)	Boston Scientific Corp	Barclays Bank	3,752
(7,115)	Boston Scientific Corp	Goldman Sachs	7,111
(1,593)	Bristol-Myers Squibb Co	Barclays Bank	(161)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(1,532)	Bristol-Myers Squibb Co	JP Morgan	(1,803)
(4,181)	Broadcom Inc	Barclays Bank	(33,699)
(949)	Broadcom Inc	Citibank	(7,649)
(300)	Broadcom Inc	Credit Suisse	(5,856)
(1,978)	Broadcom Inc	Goldman Sachs	(28,187)
(665)	Broadcom Inc	HSBC	(12,981)
(245)	Broadcom Inc	JP Morgan	(4,782)
(2,596)	Broadridge Financial Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,066
(2,448)	Broadridge Financial Solutions Inc	Barclays Bank	1,175
(5,473)	Broadridge Financial Solutions Inc	Goldman Sachs	7,717
(537)	Broadridge Financial Solutions Inc	HSBC	(118)
15,307	Brown & Brown Inc	Goldman Sachs	(37,349)
(655)	Brown-Forman Corp ' B '	Goldman Sachs	(951)
(3,877)	Burlington Stores Inc	Barclays Bank	37,684
(869)	Burlington Stores Inc	Credit Suisse	14,008
(3,055)	Burlington Stores Inc	Goldman Sachs	32,658
(93)	Cable One Inc	Bank of America Merrill Lynch	5,104
(11,010)	Cabot Oil & Gas Corp	Bank of America Merrill Lynch	(8,037)
(14,922)	Cabot Oil & Gas Corp	Barclays Bank	(2,238)
(5,560)	Cabot Oil & Gas Corp	Citibank	(834)
(14,174)	Cabot Oil & Gas Corp	Goldman Sachs	(10,347)
235	Cadence Design Systems Inc	Barclays Bank	762
41,823	Cadence Design Systems Inc	Citibank	238,809
24,609	Cadence Design Systems Inc	Credit Suisse	(39,620)
7,414	Capital One Financial Corp	Barclays Bank	115,715
(51,518)	Carlyle Group Inc	HSBC	(48,427)
(69,289)	Carlyle Group Inc	JP Morgan	(65,132)
(10,807)	CarMax Inc	Bank of America Merrill Lynch	35,643
(9,959)	CarMax Inc	Barclays Bank	22,109
(15,447)	CarMax Inc	Goldman Sachs	48,206
(6,966)	Catalent Inc	Bank of America Merrill Lynch	50,852
(2,033)	Catalent Inc	Barclays Bank	3,537
(12,016)	Catalent Inc	JP Morgan	46,262
(5,846)	Caterpillar Inc	Barclays Bank	3,098
(70)	Caterpillar Inc	Credit Suisse	(240)
(10,102)	Caterpillar Inc	Goldman Sachs	(9,975)
(76)	Caterpillar Inc	JP Morgan	(261)
11,825	CDK Global Inc	Barclays Bank	7,923
1,980	CDK Global Inc	Citibank	1,327
5,740	CDK Global Inc	Goldman Sachs	3,272
6,290	CDK Global Inc	HSBC	(818)
(8,363)	Centene Corp	Barclays Bank	6,607
(32,298)	Centene Corp	Credit Suisse	183,776
(1,930)	Centene Corp	Goldman Sachs	(303)
(2,526)	CenterPoint Energy Inc	Barclays Bank	(101)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(22,575)	CenterPoint Energy Inc	Goldman Sachs	24,155
(1,479)	CenterPoint Energy Inc	HSBC	(429)
(110,917)	CenturyLink Inc	Bank of America Merrill Lynch	(51,022)
(63,449)	CenturyLink Inc	Barclays Bank	(3,807)
19,016	Cerner Corp	Bank of America Merrill Lynch	(23,009)
32,041	Cerner Corp	Barclays Bank	14,098
764	Cerner Corp	Citibank	336
1,437	Cerner Corp	HSBC	259
3,049	Cerner Corp	JP Morgan	549
(1,875)	CF Industries Holdings Inc	Barclays Bank	(18,694)
(5,297)	CF Industries Holdings Inc	Citibank	(10,965)
(888)	CF Industries Holdings Inc	Credit Suisse	(7,930)
(11,723)	CF Industries Holdings Inc	Goldman Sachs	(64,359)
(2,830)	CF Industries Holdings Inc	HSBC	(25,272)
(5,180)	CF Industries Holdings Inc	JP Morgan	(46,257)
(3,921)	Charles Schwab Corp	Goldman Sachs	(9,831)
958	Charter Communications Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	5,194
2,170	Charter Communications Inc 'A'	Barclays Bank	5,583
273	Charter Communications Inc 'A'	Credit Suisse	(419)
(413)	Cheniere Energy Inc	Barclays Bank	(1,813)
(11,973)	Cheniere Energy Inc	Goldman Sachs	(72,796)
(6,905)	Cheniere Energy Inc	JP Morgan	(47,585)
8,311	Chevron Corp	Barclays Bank	(3,574)
5,209	Chevron Corp	Goldman Sachs	24,294
3,472	Chevron Corp	HSBC	19,345
1,289	Chipotle Mexican Grill Inc	Barclays Bank	3,532
108	Chipotle Mexican Grill Inc	Citibank	296
86	Chipotle Mexican Grill Inc	Credit Suisse	(539)
57	Chipotle Mexican Grill Inc	Goldman Sachs	992
85	Chipotle Mexican Grill Inc	JP Morgan	(1,108)
(1,044)	Church & Dwight Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,775
(495)	Church & Dwight Co Inc	Barclays Bank	(495)
(1,733)	Church & Dwight Co Inc	Citibank	(1,733)
(4,050)	Church & Dwight Co Inc	Goldman Sachs	5,505
(3,478)	Church & Dwight Co Inc	JP Morgan	(5,008)
(1,835)	Cincinnati Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	3,633
(2,375)	Cincinnati Financial Corp	Credit Suisse	18,691
(5,605)	Cincinnati Financial Corp	Goldman Sachs	11,098
(7,063)	Cincinnati Financial Corp	HSBC	55,586
87,125	Citizens Financial Group Inc	Barclays Bank	432,140
3,592	Citrix Systems Inc	Barclays Bank	5,171
3,420	Clorox Co	Bank of America Merrill Lynch	(16,450)
2,211	Clorox Co	Barclays Bank	1,216
715	Clorox Co	Citibank	393
942	Clorox Co	Credit Suisse	5,010

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
4,477	Clorox Co	Goldman Sachs	(21,534)
2,306	Clorox Co	HSBC	18,333
(4,508)	CME Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(24,872)
(4,500)	CME Group Inc	Citibank	(21,960)
(3,825)	CME Group Inc	Goldman Sachs	(18,704)
(10,519)	Coca-Cola Co	Barclays Bank	(3,628)
57,628	Colgate-Palmolive Co	Bank of America Merrill Lynch	(64,843)
29,182	Colgate-Palmolive Co	Goldman Sachs	(32,976)
6,964	Colgate-Palmolive Co	HSBC	21,031
(7,665)	Comcast Corp 'A'	Barclays Bank	(15,007)
(13,719)	Comcast Corp 'A'	Goldman Sachs	(24,429)
(3,918)	Comcast Corp 'A'	HSBC	(6,696)
4,661	Concho Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	26,241
(4,978)	Concho Resources Inc	JP Morgan	(2,000)
(39,627)	Consolidated Edison Inc	Barclays Bank	127,652
(4,288)	Consolidated Edison Inc	Credit Suisse	17,525
(4,849)	Consolidated Edison Inc	HSBC	12,582
(2,075)	Cooper Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	8,673
(1,353)	Cooper Cos Inc	Barclays Bank	(8,970)
(4,554)	Cooper Cos Inc	Goldman Sachs	19,036
(2,240)	Copart Inc	Citibank	(3,987)
(1,872)	Copart Inc	Goldman Sachs	2,097
(4,743)	Copart Inc	HSBC	30,355
(14,997)	Corteva Inc	Bank of America Merrill Lynch	(15,897)
(13,596)	Corteva Inc	Barclays Bank	(9,517)
(2,165)	CoStar Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	48,756
120	Costco Wholesale Corp	Bank of America Merrill Lynch	226
169	Costco Wholesale Corp	Barclays Bank	345
140	Costco Wholesale Corp	Citibank	736
422	Costco Wholesale Corp	HSBC	1,831
(818)	Coupa Software Inc	Barclays Bank	(15,501)
2,635	CrowdStrike Holdings Inc 'A'	Barclays Bank	15,178
(1,865)	Crown Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,408
(6,401)	Crown Holdings Inc	Barclays Bank	3,008
(2,348)	Crown Holdings Inc	Goldman Sachs	126
5,705	CSX Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,385)
7,090	CSX Corp	Barclays Bank	(2,694)
3,321	CSX Corp	Goldman Sachs	(2,501)
14,357	Cummins Inc	Bank of America Merrill Lynch	(55,418)
3,499	Cummins Inc	Citibank	(25,263)
588	Cummins Inc	HSBC	(570)
2,027	Darden Restaurants Inc	Barclays Bank	(3,922)
3,995	Darden Restaurants Inc	Goldman Sachs	(9,728)
(1,339)	Datadog Inc 'A'	Barclays Bank	(429)
(417)	DaVita Inc	Bank of America Merrill Lynch	(132)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(621)	Deere & Co	Barclays Bank	(1,335)
(434)	Deere & Co	Citibank	(933)
(10,745)	Dell Technologies Inc 'C'	Bank of America Merrill Lynch	(11,067)
1,287	DENTSPLY SIRONA Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,728
24,700	DENTSPLY SIRONA Inc	Goldman Sachs	52,364
451	DENTSPLY SIRONA Inc	HSBC	180
3,340	DexCom Inc	Barclays Bank	(125,857)
(2,081)	Discover Financial Services	Barclays Bank	(375)
(534)	Discover Financial Services	Citibank	(96)
(2,265)	Discover Financial Services	Credit Suisse	(4,779)
(2,264)	Discover Financial Services	Goldman Sachs	(1,200)
(2,046)	Discovery Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(6,220)
(15,495)	Discovery Inc 'A'	Barclays Bank	(9,452)
(3,222)	Discovery Inc 'A'	Citibank	(1,965)
(5,770)	Discovery Inc 'A'	Goldman Sachs	(17,541)
(38,332)	Discovery Inc 'C'	Goldman Sachs	(92,763)
4,768	DISH Network Corp 'A'	Barclays Bank	2,527
4,298	DISH Network Corp 'A'	HSBC	32,729
471	DocuSign Inc	Barclays Bank	5,600
258	DocuSign Inc	Credit Suisse	4,240
228	DocuSign Inc	HSBC	1,435
226	DocuSign Inc	JP Morgan	1,857
(10,484)	Dollar Tree Inc	Barclays Bank	(117,001)
(771)	Dollar Tree Inc	Credit Suisse	(10,321)
(1,392)	Dollar Tree Inc	Goldman Sachs	(18,474)
22	Domino's Pizza Inc	Bank of America Merrill Lynch	56
1,095	Domino's Pizza Inc	Barclays Bank	164
249	Domino's Pizza Inc	Goldman Sachs	632
1,071	Domino's Pizza Inc	HSBC	11,578
21,668	Dover Corp	Bank of America Merrill Lynch	(72,371)
2,558	Dover Corp	Barclays Bank	(2,481)
(15,748)	Dow Inc	Goldman Sachs	(9,606)
(2,457)	Dow Inc	JP Morgan	(5,946)
(2,606)	DR Horton Inc	Barclays Bank	(8,687)
25,899	Dropbox Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	31,467
18,275	Dropbox Inc 'A'	Barclays Bank	14,346
62,561	Dropbox Inc 'A'	Goldman Sachs	76,012
14,164	DTE Energy Co	Bank of America Merrill Lynch	(98,298)
(2,824)	Duke Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	3,586
(7,272)	Duke Energy Corp	Barclays Bank	(2,982)
(1,038)	Duke Energy Corp	HSBC	(2,585)
(477)	DuPont de Nemours Inc	Barclays Bank	(788)
(2,826)	DuPont de Nemours Inc	Goldman Sachs	(2,785)
(12,165)	East West Bancorp Inc	Barclays Bank	(61,068)
(3,985)	Eastman Chemical Co	Goldman Sachs	(5,061)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
20,173	eBay Inc	Credit Suisse	38,430
686	eBay Inc	HSBC	1,307
(4,370)	Edison International	Bank of America Merrill Lynch	12,629
(17,552)	Edison International	Barclays Bank	32,822
(3,719)	Edison International	Goldman Sachs	10,748
(10,600)	Edison International	HSBC	(16,112)
17,035	Edwards Lifesciences Corp	Barclays Bank	(9,199)
(73,647)	Elanco Animal Health Inc	Barclays Bank	(5,155)
(5,111)	Elanco Animal Health Inc	Goldman Sachs	(4,804)
(1,349)	Elanco Animal Health Inc	JP Morgan	(2,386)
8,215	Electronic Arts Inc	Credit Suisse	67,938
(753)	Eli Lilly and Co	Bank of America Merrill Lynch	(2,167)
5,084	Emerson Electric Co	Bank of America Merrill Lynch	(3,355)
45,951	Emerson Electric Co	Barclays Bank	347,849
1,242	Entergy Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3,080)
840	Entergy Corp	Barclays Bank	479
22,528	EOG Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	114,442
17,349	EOG Resources Inc	Barclays Bank	867
6,988	EOG Resources Inc	Goldman Sachs	35,499
214	EPAM Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,970)
133	EPAM Systems Inc	Goldman Sachs	(2,808)
(4,260)	Erie Indemnity Co 'A'	Bank of America Merrill Lynch	73,485
(3,103)	Erie Indemnity Co 'A'	Barclays Bank	30,565
(117)	Erie Indemnity Co 'A'	Goldman Sachs	2,018
(815)	Erie Indemnity Co 'A'	JP Morgan	3,056
(6,922)	Essential Utilities Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,731
(6,599)	Essential Utilities Inc	JP Morgan	(4,091)
(1,739)	Eversource Energy	Bank of America Merrill Lynch	9,248
(5,539)	Eversource Energy	Barclays Bank	26,864
(5,098)	Exact Sciences Corp	Goldman Sachs	10,043
18,819	Exelon Corp	Bank of America Merrill Lynch	(35,944)
26,214	Exelon Corp	Barclays Bank	(31,666)
17,057	Exelon Corp	Credit Suisse	(32,238)
2,820	Exelon Corp	HSBC	(5,330)
321	Exelon Corp	JP Morgan	(607)
(4,885)	Expedia Group Inc	Barclays Bank	(122,386)
(618)	Expedia Group Inc	Citibank	(1,038)
(8,672)	Expedia Group Inc	Credit Suisse	36,076
48,264	Expeditors International of Washington Inc	JP Morgan	76,740
3,304	Exxon Mobil Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4,831)
21,778	Exxon Mobil Corp	Barclays Bank	2,831
1,135	Exxon Mobil Corp	Goldman Sachs	2,600
4,458	F5 Networks Inc	Barclays Bank	1,382
3,471	Facebook Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(15,446)
2,805	Facebook Inc 'A'	HSBC	(11,949)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
9,021	FactSet Research Systems Inc	Barclays Bank	170,136
632	FactSet Research Systems Inc	Citibank	11,920
200	FactSet Research Systems Inc	Goldman Sachs	2,994
849	Fair Isaac Corp	Bank of America Merrill Lynch	(943)
3,159	Fair Isaac Corp	Barclays Bank	(39,172)
1,974	Fair Isaac Corp	Goldman Sachs	1,026
1,026	Fastenal Co	JP Morgan	1,095
715	FedEx Corp	Bank of America Merrill Lynch	5,927
2,548	FedEx Corp	Barclays Bank	4,510
(25,200)	Fidelity National Information Services Inc	Barclays Bank	(124,797)
(2,167)	First Republic Bank	Barclays Bank	(579)
(6,138)	FirstEnergy Corp	Bank of America Merrill Lynch	10,926
(44,558)	FirstEnergy Corp	Barclays Bank	44,112
(4,927)	FirstEnergy Corp	Citibank	4,878
(15,054)	FirstEnergy Corp	Goldman Sachs	26,796
(3,217)	FirstEnergy Corp	HSBC	9,008
(4,602)	Fiserv Inc	Bank of America Merrill Lynch	(20,912)
(15,915)	Fiserv Inc	Barclays Bank	(36,445)
(3,965)	FleetCor Technologies Inc	Barclays Bank	(52,219)
(393)	FleetCor Technologies Inc	Goldman Sachs	(4,910)
(409)	FleetCor Technologies Inc	HSBC	(3,484)
(246)	FleetCor Technologies Inc	JP Morgan	317
825	FMC Corp	Bank of America Merrill Lynch	(199)
11,747	FMC Corp	Barclays Bank	(3,642)
2,903	FMC Corp	Citibank	(900)
978	FMC Corp	Goldman Sachs	3,677
833	FMC Corp	HSBC	5,771
(20,614)	Ford Motor Co	Barclays Bank	(4,741)
(12,330)	Ford Motor Co	Goldman Sachs	(1,772)
9,201	Fortinet Inc	Bank of America Merrill Lynch	53,458
5,062	Fortinet Inc	Barclays Bank	27,588
324	Fortinet Inc	HSBC	1,756
2,967	Fortinet Inc	JP Morgan	16,081
(602)	Fortive Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,173
(1,880)	Fortive Corp	Barclays Bank	3,064
6,214	Fortune Brands Home & Security Inc	Barclays Bank	(9,321)
2,640	Fortune Brands Home & Security Inc	Credit Suisse	12,012
15,115	Fortune Brands Home & Security Inc	Goldman Sachs	30,230
1,318	Fortune Brands Home & Security Inc	HSBC	5,997
(5,772)	Fox Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(10,909)
(22,331)	Fox Corp 'A'	Credit Suisse	(62,973)
(5,689)	Franklin Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,102)
(25,485)	Franklin Resources Inc	Barclays Bank	(23,701)
(3,139)	Franklin Resources Inc	Goldman Sachs	(4,712)
(7,489)	Franklin Resources Inc	HSBC	(13,256)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(51,304)	Freeport-McMoRan Inc	Bank of America Merrill Lynch	(127,747)
(1,503)	Gartner Inc	Goldman Sachs	10,070
(21,941)	General Electric Co	Barclays Bank	(2,414)
(3,549)	General Mills Inc	Barclays Bank	3,400
(2,202)	General Mills Inc	Citibank	2,400
(3,478)	General Mills Inc	Goldman Sachs	5,394
(10,228)	Global Payments Inc	Barclays Bank	(236,390)
16,215	GoDaddy Inc 'A'	Barclays Bank	65,509
44	GoDaddy Inc 'A'	HSBC	377
(31,355)	Guidewire Software Inc	Barclays Bank	(181,545)
(7,926)	Halliburton Co	Barclays Bank	(35,033)
(15,225)	Hasbro Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,329)
(5,902)	Hasbro Inc	Barclays Bank	(8,381)
(3,805)	Hasbro Inc	JP Morgan	(22,221)
8,893	HCA Healthcare Inc	Citibank	18,942
4,827	HCA Healthcare Inc	JP Morgan	20,322
(14,853)	HD Supply Holdings Inc	Barclays Bank	(446)
(3,116)	HD Supply Holdings Inc	JP Morgan	(37,485)
(1,894)	HEICO Corp	Bank of America Merrill Lynch	18,656
(1,679)	HEICO Corp	Barclays Bank	(25,900)
(2,110)	HEICO Corp	Citibank	5,570
(2,687)	HEICO Corp	Credit Suisse	484
(9,295)	HEICO Corp	Goldman Sachs	91,556
(4,482)	HEICO Corp	HSBC	807
(1,524)	HEICO Corp	JP Morgan	274
841	Henry Schein Inc	HSBC	40
711	Hershey Co	Bank of America Merrill Lynch	(52)
3,765	Hershey Co	Barclays Bank	188
2,757	Hershey Co	Goldman Sachs	(12,164)
1,317	Hershey Co	HSBC	(9,163)
5,776	Hershey Co	JP Morgan	(34,498)
(35,950)	Hess Corp	Barclays Bank	(413,446)
(5)	Hess Corp	Credit Suisse	(35)
(6,055)	Hewlett Packard Enterprise Co	Bank of America Merrill Lynch	(4,408)
(14,298)	Hewlett Packard Enterprise Co	JP Morgan	(7,155)
8,936	Home Depot Inc	Bank of America Merrill Lynch	(49,279)
10,453	Home Depot Inc	Barclays Bank	6,754
3,285	Home Depot Inc	Goldman Sachs	8,090
2,710	Home Depot Inc	HSBC	(9,588)
(2,046)	Honeywell International Inc	Barclays Bank	(2,762)
(2,138)	Honeywell International Inc	Goldman Sachs	5,687
(2,567)	Honeywell International Inc	HSBC	(22,949)
(92,911)	Hormel Foods Corp	Barclays Bank	232,358
(15,972)	Howmet Aerospace Inc	Bank of America Merrill Lynch	(17,250)
(2,120)	HP Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,791)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(7,166)	HP Inc	Barclays Bank	(5,016)
(3,821)	HP Inc	Citibank	(2,675)
(24,279)	HP Inc	Goldman Sachs	(37,404)
(1,496)	Humana Inc	Bank of America Merrill Lynch	29,219
(696)	Humana Inc	Barclays Bank	2,916
(264)	Humana Inc	Citibank	1,106
(350)	Humana Inc	Credit Suisse	5,221
(367)	Humana Inc	Goldman Sachs	8,602
(596)	Humana Inc	HSBC	10,662
(58,994)	Huntington Bancshares Inc	Barclays Bank	(120,938)
(3,092)	Huntington Ingalls Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,085)
(11,715)	Huntington Ingalls Industries Inc	Barclays Bank	(110,353)
1,399	IDEX Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,382)
223	IDEX Corp	JP Morgan	(1,455)
830	IDEXX Laboratories Inc	Bank of America Merrill Lynch	332
617	IDEXX Laboratories Inc	Barclays Bank	(2,480)
377	IDEXX Laboratories Inc	Citibank	(1,516)
1,723	IDEXX Laboratories Inc	Goldman Sachs	903
559	IDEXX Laboratories Inc	HSBC	6,258
488	IDEXX Laboratories Inc	JP Morgan	9,428
7,741	Illinois Tool Works Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11,302)
3,248	Illinois Tool Works Inc	Citibank	5,294
7,854	Illinois Tool Works Inc	Credit Suisse	(26,580)
7,660	Illinois Tool Works Inc	HSBC	(23,382)
279	Illinois Tool Works Inc	JP Morgan	1,299
(1,927)	Illumina Inc	Barclays Bank	2,277
(862)	Illumina Inc	Goldman Sachs	(14,326)
9,835	Incyte Corp	Barclays Bank	18,096
13,821	Incyte Corp	Goldman Sachs	(15,480)
(30,086)	Ingersoll Rand Inc	Bank of America Merrill Lynch	15,645
(4,145)	Ingredion Inc	Barclays Bank	(3,979)
(466)	Insulet Corp	Bank of America Merrill Lynch	4,788
(6,819)	Intel Corp	Citibank	(10,979)
(2,359)	Intel Corp	Goldman Sachs	(5,023)
6,215	Intercontinental Exchange Inc	Barclays Bank	35,425
(6,061)	International Business Machines Corp	Bank of America Merrill Lynch	(30,864)
(36,630)	International Business Machines Corp	Barclays Bank	(128,205)
(2,141)	International Business Machines Corp	HSBC	(14,207)
(1,142)	International Flavors & Fragrances Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,557
(6,174)	International Flavors & Fragrances Inc	Credit Suisse	9,940
(11,159)	International Flavors & Fragrances Inc	HSBC	17,966
(3,370)	International Paper Co	Barclays Bank	(674)
(2,324)	International Paper Co	Goldman Sachs	(2,147)
18,487	Interpublic Group of Cos Inc	Barclays Bank	9,613
2,955	Interpublic Group of Cos Inc	Goldman Sachs	2,866

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
6,146	Intuit Inc	Bank of America Merrill Lynch	(17,024)
12,130	Intuit Inc	Barclays Bank	132,945
1,329	Intuit Inc	Citibank	14,566
438	Intuit Inc	Goldman Sachs	2,819
200	Intuit Inc	JP Morgan	(1,170)
(8,867)	IPG Photonics Corp	Bank of America Merrill Lynch	(21,813)
(1,956)	IPG Photonics Corp	Goldman Sachs	(4,812)
(8,558)	Jacobs Engineering Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,284)
(4,617)	Jacobs Engineering Group Inc	Barclays Bank	(13,158)
(23,883)	Jacobs Engineering Group Inc	Goldman Sachs	(3,582)
(4,693)	Jacobs Engineering Group Inc	JP Morgan	(33,930)
8,674	JB Hunt Transport Services Inc	Barclays Bank	73,642
(3,701)	JM Smucker Co	Bank of America Merrill Lynch	12,845
(2,051)	JM Smucker Co	Barclays Bank	390
(367)	JM Smucker Co	Citibank	70
(2,936)	JM Smucker Co	Goldman Sachs	3,313
(1,847)	JM Smucker Co	JP Morgan	1,497
(2,350)	Jones Lang LaSalle Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,067
(734)	Jones Lang LaSalle Inc	Barclays Bank	264
(1,065)	Jones Lang LaSalle Inc	Goldman Sachs	175
(1,656)	Jones Lang LaSalle Inc	HSBC	2,501
(15,326)	Juniper Networks Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,024
(28,146)	Juniper Networks Inc	Barclays Bank	1,689
(4,306)	Juniper Networks Inc	JP Morgan	(1,852)
(1,202)	Kellogg Co	Barclays Bank	1,226
(2,068)	Kellogg Co	Goldman Sachs	6,285
(49,840)	Keurig Dr Pepper Inc	Bank of America Merrill Lynch	(48,345)
(5,483)	Keurig Dr Pepper Inc	Barclays Bank	(3,235)
35,950	KeyCorp	Bank of America Merrill Lynch	8,628
74,880	KeyCorp	Barclays Bank	28,454
11,967	KeyCorp	Credit Suisse	10,052
7,070	Kinder Morgan Inc	Barclays Bank	(2,081)
(49,294)	KKR & Co Inc	Goldman Sachs	(39,928)
6,776	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,946)
41,044	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	Barclays Bank	2,052
(44,727)	Kraft Heinz Co	Barclays Bank	4,920
(10,120)	Kraft Heinz Co	Goldman Sachs	(6,461)
(3,814)	L3Harris Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	23,418
(992)	L3Harris Technologies Inc	Barclays Bank	238
(6,512)	Laboratory Corp of America Holdings	Barclays Bank	32,898
(3,573)	Lamb Weston Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,483
(13,830)	Las Vegas Sands Corp	Bank of America Merrill Lynch	34,852
(15,040)	Las Vegas Sands Corp	Barclays Bank	12,483
553	Lennox International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,724)
(1,112)	Liberty Broadband Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(5,994)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(10,776)	Liberty Broadband Corp 'A'	Barclays Bank	15,410
(859)	Liberty Broadband Corp 'A'	Citibank	1,228
(5,332)	Liberty Broadband Corp 'A'	Goldman Sachs	(28,739)
(5,186)	Lincoln National Corp	Goldman Sachs	(30,591)
(10,200)	Live Nation Entertainment Inc	Bank of America Merrill Lynch	18,258
(3,490)	Live Nation Entertainment Inc	Barclays Bank	6,177
3,685	Loews Corp	Bank of America Merrill Lynch	(553)
4,499	Loews Corp	Barclays Bank	(225)
1,615	Lowe's Cos Inc	Barclays Bank	(24,214)
1,003	Lowe's Cos Inc	Citibank	(1,349)
667	Lowe's Cos Inc	Credit Suisse	1,705
1,652	Lowe's Cos Inc	Goldman Sachs	4,886
1,220	Lowe's Cos Inc	HSBC	(1,373)
865	Lululemon Athletica Inc	Bank of America Merrill Lynch	22,850
150	Lululemon Athletica Inc	Citibank	2,341
133	Lululemon Athletica Inc	HSBC	2,836
(8)	Mack-Cali Realty Corp (REIT)	Citibank	3
(2,317)	Marathon Petroleum Corp	Barclays Bank	(26,437)
27	MarketAxess Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	158
970	MarketAxess Holdings Inc	Barclays Bank	7,682
1,139	MarketAxess Holdings Inc	Citibank	9,021
235	MarketAxess Holdings Inc	Credit Suisse	(1,647)
354	MarketAxess Holdings Inc	HSBC	(2,482)
(718)	Marriott International Inc 'A'	Goldman Sachs	(3,845)
(978)	Marriott International Inc 'A'	JP Morgan	(7,331)
2,358	Marsh & McLennan Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,867)
83	Marsh & McLennan Cos Inc	Barclays Bank	27
571	Marsh & McLennan Cos Inc	Citibank	423
(7,579)	Martin Marietta Materials Inc	Barclays Bank	(65,535)
63,698	Masco Corp	Bank of America Merrill Lynch	(97,458)
3,498	Masco Corp	Barclays Bank	(5,037)
234	Masco Corp	Goldman Sachs	(358)
5,551	Masco Corp	HSBC	111
(2,547)	Match Group Inc	Barclays Bank	204
(407)	Match Group Inc	Credit Suisse	(676)
(285)	Match Group Inc	Goldman Sachs	(1,895)
2,543	Maxim Integrated Products Inc	HSBC	6,056
2,074	Maxim Integrated Products Inc	JP Morgan	6,270
(2,162)	McCormick & Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,611)
(3,162)	McCormick & Co Inc	Barclays Bank	(9,012)
2,606	McDonald's Corp	Barclays Bank	(2,919)
1,506	McDonald's Corp	Goldman Sachs	(965)
545	McDonald's Corp	HSBC	1,450
2,203	McDonald's Corp	JP Morgan	5,188
(793)	McKesson Corp	Goldman Sachs	(1,752)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
99,622	MetLife Inc	Barclays Bank	619,649
8,881	MetLife Inc	HSBC	16,785
429	Mettler-Toledo International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(22,819)
620	Mettler-Toledo International Inc	Goldman Sachs	(35,917)
70	Mettler-Toledo International Inc	HSBC	(1,705)
(2,658)	MGM Resorts International	Bank of America Merrill Lynch	(3,326)
(5,586)	MGM Resorts International	Barclays Bank	(13,462)
(1,694)	MGM Resorts International	HSBC	(2,540)
(4,567)	Microchip Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(16,350)
(1,716)	Microchip Technology Inc	Barclays Bank	(47,000)
(1,502)	Microchip Technology Inc	Credit Suisse	(10,093)
(15,381)	Micron Technology Inc	Barclays Bank	(5,845)
(1,108)	Micron Technology Inc	Citibank	(421)
(7,305)	Micron Technology Inc	HSBC	(49,383)
(4,733)	Micron Technology Inc	JP Morgan	(40,704)
2,321	Microsoft Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,092)
4,636	Microsoft Corp	Barclays Bank	8,347
16,028	Microsoft Corp	Goldman Sachs	(47,924)
4,819	Microsoft Corp	JP Morgan	(20,577)
(510)	Moderna Inc	Goldman Sachs	(20,594)
(1,101)	Mohawk Industries Inc	Barclays Bank	3,435
(55)	Mohawk Industries Inc	Credit Suisse	(283)
(293)	Molina Healthcare Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,612
(407)	Molina Healthcare Inc	Goldman Sachs	4,851
(4,671)	Molson Coors Beverage Co ' B '	Bank of America Merrill Lynch	(8,856)
(2,566)	Molson Coors Beverage Co ' B '	Barclays Bank	(5,748)
4,153	Monster Beverage Corp	Barclays Bank	(166)
5,869	Monster Beverage Corp	Credit Suisse	2,357
2,224	Monster Beverage Corp	Goldman Sachs	604
5,876	Monster Beverage Corp	HSBC	(5,024)
416	Moody ' s Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,837
7,112	Moody ' s Corp	Barclays Bank	68,560
4,468	Moody ' s Corp	Goldman Sachs	30,472
2,935	MSCI Inc	Bank of America Merrill Lynch	36,277
764	MSCI Inc	Barclays Bank	6,104
947	Nasdaq Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,624
26,059	Nasdaq Inc	Barclays Bank	(38,333)
594	Netflix Inc	Barclays Bank	7,568
29	Netflix Inc	Citibank	369
2,364	Neurocrine Biosciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	8,061
12,086	Neurocrine Biosciences Inc	Goldman Sachs	41,213
(27,176)	Newell Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	(23,371)
(10,951)	Newmont Corp	Bank of America Merrill Lynch	70,560
(16,181)	Newmont Corp	Barclays Bank	3,883
(4,228)	Newmont Corp	HSBC	20,950

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
4,631	News Corp 'A'	Goldman Sachs	1,852
13,888	NextEra Energy Inc	Barclays Bank	3,333
4,324	NextEra Energy Inc	Goldman Sachs	(6,666)
5,263	NIKE Inc 'B'	Barclays Bank	44,370
2,232	NIKE Inc 'B'	JP Morgan	11,272
(6,021)	NiSource Inc	Barclays Bank	(421)
(3,041)	NiSource Inc	Goldman Sachs	(1,715)
(237)	Norfolk Southern Corp	Goldman Sachs	(500)
(11,175)	Northern Trust Corp	Bank of America Merrill Lynch	(28,496)
(3,329)	Northern Trust Corp	Barclays Bank	(33,057)
(3,112)	Northern Trust Corp	HSBC	(15,218)
(10,562)	NortonLifeLock Inc	Barclays Bank	27,197
2,361	NRG Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	850
33,516	NRG Energy Inc	Credit Suisse	36,532
291	NVIDIA Corp	Barclays Bank	1,023
25	NVR Inc	Goldman Sachs	(6,848)
(26,463)	Occidental Petroleum Corp	Goldman Sachs	(95,399)
2,231	Old Dominion Freight Line Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9,928)
10,057	Old Dominion Freight Line Inc	Barclays Bank	(5,833)
169	Old Dominion Freight Line Inc	Citibank	(98)
4,352	Old Dominion Freight Line Inc	Goldman Sachs	(18,891)
2,120	Old Dominion Freight Line Inc	HSBC	5,024
589	Old Dominion Freight Line Inc	JP Morgan	(1,807)
884	Omnicom Group Inc	Barclays Bank	2,157
1,242	Omnicom Group Inc	HSBC	5,068
3,128	Omnicom Group Inc	JP Morgan	8,947
(31,668)	ON Semiconductor Corp	Bank of America Merrill Lynch	(12,667)
(14,331)	ON Semiconductor Corp	Barclays Bank	(57,253)
(6,520)	ON Semiconductor Corp	Credit Suisse	(9,454)
(2,431)	ONEOK Inc	Citibank	(4,765)
(2,860)	ONEOK Inc	HSBC	(16,559)
2,380	O'Reilly Automotive Inc	Barclays Bank	(44,506)
3,840	Owens Corning	Bank of America Merrill Lynch	10,598
6,773	Owens Corning	Barclays Bank	2,167
11,565	Owens Corning	Credit Suisse	90,901
6,445	Owens Corning	Goldman Sachs	17,788
11,818	Owens Corning	HSBC	92,889
(7,319)	Packaging Corp of America	Barclays Bank	(98,880)
(2,695)	Packaging Corp of America	HSBC	(13,232)
901	Parker-Hannifin Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,043
4,801	Parker-Hannifin Corp	Barclays Bank	(15,939)
713	Parker-Hannifin Corp	Credit Suisse	11,265
407	Parker-Hannifin Corp	HSBC	6,431
14,851	Paychex Inc	HSBC	35,345
(1,512)	Paycom Software Inc	Goldman Sachs	(50,879)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(478)	Paycom Software Inc	JP Morgan	(3,791)
1	Pebblebrook Hotel Trust (REIT)	Credit Suisse	3
1,163	Peloton Interactive Inc 'A'	Goldman Sachs	(84)
(1,160)	People's United Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	603
(23,570)	People's United Financial Inc	Barclays Bank	4,950
(42,320)	People's United Financial Inc	Credit Suisse	(423)
(10,520)	People's United Financial Inc	JP Morgan	(105)
8,943	PepsiCo Inc	Bank of America Merrill Lynch	(14,488)
13,193	PepsiCo Inc	Barclays Bank	(7,222)
1,216	PepsiCo Inc	Citibank	1,362
1,698	PepsiCo Inc	HSBC	1,583
(35,289)	Pfizer Inc	Bank of America Merrill Lynch	(38,949)
(19,559)	Pfizer Inc	Barclays Bank	(30,512)
(21,338)	Pfizer Inc	Credit Suisse	12,066
(7,688)	PG&E Corp	HSBC	(10,962)
8,106	Philip Morris International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,291)
5,214	Philip Morris International Inc	Barclays Bank	(5,318)
6,085	Philip Morris International Inc	Goldman Sachs	(13,620)
3,188	Philip Morris International Inc	JP Morgan	177
3,940	Phillips 66	Barclays Bank	(7,210)
312	Phillips 66	Goldman Sachs	434
3,140	Pioneer Natural Resources Co	Barclays Bank	8,604
2,287	Pioneer Natural Resources Co	Citibank	6,266
549	Pioneer Natural Resources Co	Goldman Sachs	5,955
1,307	Pioneer Natural Resources Co	HSBC	24,663
857	PNC Financial Services Group Inc	Credit Suisse	7,816
1,365	PPG Industries Inc	Citibank	1,720
2,001	PPG Industries Inc	Credit Suisse	8,344
3,152	PPG Industries Inc	HSBC	13,144
321	PPG Industries Inc	JP Morgan	1,339
(9,784)	Principal Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(28,863)
(4,278)	Principal Financial Group Inc	Citibank	(2,695)
(3,725)	Principal Financial Group Inc	HSBC	(13,522)
(6,448)	Progressive Corp	Bank of America Merrill Lynch	52,680
219	Prudential Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	348
26,014	Prudential Financial Inc	Barclays Bank	8,585
586	Prudential Financial Inc	HSBC	350
1,044	Prudential Financial Inc	JP Morgan	1,689
(1,033)	PTC Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10,766)
(521)	PTC Inc	Goldman Sachs	(4,157)
8,777	PulteGroup Inc	Barclays Bank	17,210
2,105	QUALCOMM Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,389)
74	QUALCOMM Inc	Barclays Bank	1,448
595	QUALCOMM Inc	Citibank	1,035
871	QUALCOMM Inc	JP Morgan	(1,248)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(3,223)	Quest Diagnostics Inc	Citibank	967
579	Regeneron Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(26,761)
8,775	Regions Financial Corp	HSBC	3,449
(1,641)	Reinsurance Group of America Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,693)
(2,914)	Reinsurance Group of America Inc	Barclays Bank	2,331
(1,389)	Reinsurance Group of America Inc	Citibank	1,111
(1,241)	Reinsurance Group of America Inc	Goldman Sachs	(3,549)
966	Republic Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,617)
5,426	Republic Services Inc	Barclays Bank	(4,395)
(239)	RingCentral Inc 'A'	Goldman Sachs	(2,432)
(2)	RLI Corp	Bank of America Merrill Lynch	14
36,465	Robert Half International Inc	Barclays Bank	(21,514)
3,786	Rockwell Automation Inc	Bank of America Merrill Lynch	43,236
369	Rockwell Automation Inc	Barclays Bank	317
234	Rockwell Automation Inc	Credit Suisse	(491)
3,269	Rockwell Automation Inc	HSBC	(6,865)
(8,740)	Rollins Inc	Bank of America Merrill Lynch	19,752
(5,447)	Roper Technologies Inc	JP Morgan	(182,475)
(1,503)	Ross Stores Inc	Bank of America Merrill Lynch	5,065
(5,372)	Ross Stores Inc	Barclays Bank	(81,329)
39,068	RPM International Inc	Barclays Bank	(92,325)
1,800	RPM International Inc	Credit Suisse	(5,742)
2,301	RPM International Inc	HSBC	(7,340)
16,557	RPM International Inc	JP Morgan	(52,817)
14,805	S&P Global Inc	Goldman Sachs	140,499
2,303	S&P Global Inc	JP Morgan	6,218
(351)	salesforce.com Inc	Bank of America Merrill Lynch	7,595
(1,550)	salesforce.com Inc	Barclays Bank	27,822
(272)	salesforce.com Inc	Citibank	4,882
(1,633)	salesforce.com Inc	Goldman Sachs	19,922
(711)	salesforce.com Inc	HSBC	13,788
(411)	salesforce.com Inc	JP Morgan	8,051
(1,201)	Sarepta Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,853)
(1,761)	Sarepta Therapeutics Inc	Barclays Bank	(8,576)
(3,670)	Sarepta Therapeutics Inc	Goldman Sachs	1,248
(772)	Sarepta Therapeutics Inc	JP Morgan	(5,217)
(1,886)	Seagen Inc	Barclays Bank	(1,150)
(60)	Seagen Inc	Goldman Sachs	344
8,253	Sealed Air Corp	Bank of America Merrill Lynch	743
1,356	Sealed Air Corp	Barclays Bank	(217)
13,632	Sealed Air Corp	Goldman Sachs	1,227
175	SEI Investments Co	Bank of America Merrill Lynch	(189)
13,655	SEI Investments Co	Barclays Bank	(1,502)
13,696	SEI Investments Co	Goldman Sachs	(14,792)
2,062	Sempra Energy	Barclays Bank	(2,495)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
1,387	Sempra Energy	Credit Suisse	(777)
756	Sempra Energy	HSBC	(423)
5,509	ServiceNow Inc	Barclays Bank	146,591
176	ServiceNow Inc	Citibank	1,913
107	ServiceNow Inc	Credit Suisse	1,895
169	ServiceNow Inc	HSBC	5,242
244	ServiceNow Inc	JP Morgan	6,499
2,210	Sherwin-Williams Co	Bank of America Merrill Lynch	13,061
1,206	Sherwin-Williams Co	Barclays Bank	71,439
286	Sherwin-Williams Co	Credit Suisse	13,399
1,453	Sherwin-Williams Co	HSBC	68,073
272	Sherwin-Williams Co	JP Morgan	12,743
195,524	Sirius XM Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	22,485
362,377	Sirius XM Holdings Inc	Barclays Bank	(27,178)
6,838	Skyworks Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	(34,224)
9,047	Skyworks Solutions Inc	Barclays Bank	5,629
2,838	Skyworks Solutions Inc	Credit Suisse	(17,525)
40	Skyworks Solutions Inc	JP Morgan	(247)
(13,388)	Snap Inc 'A'	Goldman Sachs	(86,620)
(1,473)	Snap-on Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,131)
(1,124)	Snap-on Inc	Barclays Bank	472
(648)	Snap-on Inc	Goldman Sachs	(3,062)
1,653	Southwest Airlines Co	Bank of America Merrill Lynch	2,809
8,302	Southwest Airlines Co	Barclays Bank	3,238
(38,622)	Spectrum Brands Holdings Inc	JP Morgan	(246,408)
(3,847)	Splunk Inc	Bank of America Merrill Lynch	(32,993)
(713)	Splunk Inc	Goldman Sachs	(1,382)
(488)	Splunk Inc	HSBC	(2,776)
(1,142)	Square Inc 'A'	Barclays Bank	(719)
2,039	Starbucks Corp	Barclays Bank	1,346
18,268	Starbucks Corp	Citibank	12,057
2,997	Starbucks Corp	Credit Suisse	7,769
543	Starbucks Corp	HSBC	(591)
3,051	Steel Dynamics Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,129
13,779	Steel Dynamics Inc	Barclays Bank	14,055
(2,607)	Sunrun Inc	Bank of America Merrill Lynch	(29,433)
(1,755)	Sunrun Inc	Barclays Bank	(19,702)
(13,604)	Sunrun Inc	JP Morgan	(154,133)
(343)	SVB Financial Group	Barclays Bank	(333)
(3,489)	Synchrony Financial	Bank of America Merrill Lynch	(1,361)
(811)	Synchrony Financial	JP Morgan	(1,338)
1,504	Synopsys Inc	Bank of America Merrill Lynch	7,009
11,439	Synopsys Inc	Citibank	125,829
19	Synopsys Inc	HSBC	(129)
1,274	Sysco Corp	Goldman Sachs	(517)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(3,382)	T Rowe Price Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(338)
(1,515)	T Rowe Price Group Inc	Barclays Bank	(6,939)
373	Take-Two Interactive Software Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,794
1,880	Take-Two Interactive Software Inc	Barclays Bank	11,205
571	Take-Two Interactive Software Inc	Goldman Sachs	6,793
271	Take-Two Interactive Software Inc	HSBC	4,650
(467)	Teladoc Health Inc	Barclays Bank	(9,353)
(1,084)	Teladoc Health Inc	Goldman Sachs	(18,541)
(912)	Teledyne Technologies Inc	Barclays Bank	1,487
(705)	Teledyne Technologies Inc	Citibank	1,149
(892)	Teleflex Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,255
(498)	Teleflex Inc	Barclays Bank	901
(262)	Teleflex Inc	HSBC	(1,931)
(96)	Teleflex Inc	JP Morgan	(708)
18,234	Teradyne Inc	Barclays Bank	11,305
102	Teradyne Inc	HSBC	756
(363)	Tesla Inc	Bank of America Merrill Lynch	(66,552)
(448)	Tesla Inc	Goldman Sachs	(82,136)
(745)	Tesla Inc	HSBC	(126,777)
5,503	Texas Instruments Inc	Bank of America Merrill Lynch	26,603
5,824	Texas Instruments Inc	Barclays Bank	14,538
3,810	Texas Instruments Inc	Citibank	9,639
5,207	Texas Instruments Inc	Credit Suisse	19,422
1,891	Texas Instruments Inc	Goldman Sachs	6,395
3,917	Texas Instruments Inc	HSBC	14,610
(5,812)	Tiffany & Co	Bank of America Merrill Lynch	1,221
(6,946)	Tiffany & Co	Barclays Bank	1,389
(4,408)	Tiffany & Co	Credit Suisse	(529)
(10,207)	Tiffany & Co	HSBC	(1,225)
(1,553)	TJX Cos Inc	Barclays Bank	(13,610)
(328)	TJX Cos Inc	JP Morgan	(554)
11,218	Tractor Supply Co	Barclays Bank	33,328
(60)	Trade Desk Inc 'A'	Barclays Bank	(3,217)
(1,346)	Trade Desk Inc 'A'	Goldman Sachs	(198,050)
(1,039)	Travelers Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,819
(2,775)	Travelers Cos Inc	Barclays Bank	4,828
(6,959)	Travelers Cos Inc	Goldman Sachs	18,930
(4,734)	Travelers Cos Inc	HSBC	5,813
(2,215)	Truist Financial Corp	Barclays Bank	(2,082)
(1,634)	Twilio Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(66,929)
(9,666)	Twitter Inc	Citibank	(11,590)
(6,892)	Twitter Inc	Goldman Sachs	(15,887)
(4,785)	Twitter Inc	JP Morgan	(13,558)
(1,362)	Tyler Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(16,694)
(2,980)	Tyler Technologies Inc	Barclays Bank	(37,518)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(716)	Tyler Technologies Inc	JP Morgan	(4,074)
(11,607)	Tyson Foods Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(6,508)
(13,433)	Tyson Foods Inc 'A'	Barclays Bank	(29,065)
(1,284)	Tyson Foods Inc 'A'	Credit Suisse	(4,187)
(2,342)	Uber Technologies Inc	Barclays Bank	(586)
(2,274)	Uber Technologies Inc	Goldman Sachs	(2,922)
13,106	UGI Corp	Bank of America Merrill Lynch	(262)
7,263	UGI Corp	Barclays Bank	1,670
2,682	UGI Corp	Goldman Sachs	(54)
(889)	Ulta Beauty Inc	Barclays Bank	(39,232)
586	United Parcel Service Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	1,090
(1,540)	UnitedHealth Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	29,491
(965)	UnitedHealth Group Inc	Barclays Bank	(2,519)
(2,983)	UnitedHealth Group Inc	Citibank	(7,786)
157	Universal Health Services Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(240)
4,459	Universal Health Services Inc 'B'	Barclays Bank	669
22,673	US Bancorp	Barclays Bank	85,250
1,094	US Bancorp	Credit Suisse	88
1,991	US Bancorp	HSBC	159
(3,409)	Vail Resorts Inc	Bank of America Merrill Lynch	(41,283)
(4,936)	Vail Resorts Inc	Barclays Bank	(180,993)
(4,118)	Varian Medical Systems Inc	Barclays Bank	(9,430)
(1,481)	Varian Medical Systems Inc	Citibank	(770)
761	Veeva Systems Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	5,993
1,302	Veeva Systems Inc 'A'	Barclays Bank	8,502
217	Veeva Systems Inc 'A'	Citibank	1,417
16,657	VeriSign Inc	Barclays Bank	30,982
307	VeriSign Inc	Goldman Sachs	(7)
297	VeriSign Inc	HSBC	1,125
2,187	VeriSign Inc	JP Morgan	(11,001)
5,118	Verizon Communications Inc	Goldman Sachs	(3,071)
5,633	Vertex Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	20,504
(275)	VF Corp	Bank of America Merrill Lynch	(564)
(1,639)	VF Corp	Barclays Bank	3,639
(12,564)	VF Corp	Goldman Sachs	(25,756)
(2,047)	Viatis Inc	Bank of America Merrill Lynch	(34,645)
(50,393)	Viatis Inc	Barclays Bank	(7,811)
(2,959)	Viatis Inc	Credit Suisse	(50,081)
(67,228)	Viatis Inc	Goldman Sachs	(71,934)
(21,445)	Visa Inc 'A'	Barclays Bank	(21,874)
(3,282)	Visa Inc 'A'	Credit Suisse	11,487
(2,339)	Visa Inc 'A'	Goldman Sachs	8,233
49,041	Vistra Energy Corp	Barclays Bank	33,838
(3,347)	VMware Inc 'A'	Barclays Bank	24,134
(4,361)	Voya Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,800)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(16,190)	Voya Financial Inc	Barclays Bank	(6,152)
(1,789)	Voya Financial Inc	Citibank	(680)
(5,613)	Voya Financial Inc	Credit Suisse	(12,070)
(9,988)	Voya Financial Inc	Goldman Sachs	(25,253)
(4,870)	Vulcan Materials Co	Bank of America Merrill Lynch	5,747
(8,360)	Vulcan Materials Co	Barclays Bank	(12,038)
(484)	Vulcan Materials Co	Citibank	(697)
(317)	Vulcan Materials Co	Credit Suisse	(1,461)
(2,760)	Vulcan Materials Co	Goldman Sachs	3,257
(29,586)	Walgreens Boots Alliance Inc	Barclays Bank	(21,006)
(1,155)	Walgreens Boots Alliance Inc	Goldman Sachs	6,249
(19,108)	Walgreens Boots Alliance Inc	HSBC	36,188
(19,116)	Walgreens Boots Alliance Inc	JP Morgan	66,103
7,065	Walmart Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,268)
1,865	Walmart Inc	Barclays Bank	380
(28,155)	Walt Disney Co	Barclays Bank	(566,268)
344	Wayfair Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	7,964
205	Wayfair Inc 'A'	Citibank	445
468	Wayfair Inc 'A'	Credit Suisse	10,872
814	Wayfair Inc 'A'	HSBC	18,909
741	Wayfair Inc 'A'	JP Morgan	17,213
(19,136)	Wells Fargo & Co	Barclays Bank	(31,766)
(1,941)	Wells Fargo & Co	Credit Suisse	(4,113)
9,193	West Pharmaceutical Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(144,882)
1,623	West Pharmaceutical Services Inc	Barclays Bank	860
3,093	West Pharmaceutical Services Inc	Goldman Sachs	(48,746)
(3,810)	Western Digital Corp	Bank of America Merrill Lynch	(7,315)
(36,269)	Western Digital Corp	JP Morgan	(145,801)
(3,969)	Western Union Co	Barclays Bank	(4,584)
(48,607)	Western Union Co	Citibank	(56,141)
(559)	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	Barclays Bank	196
(1,820)	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	Goldman Sachs	(3,078)
(1,517)	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	HSBC	(6,963)
(861)	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	JP Morgan	(3,952)
(5,250)	Westrock Co	Bank of America Merrill Lynch	(4,306)
(25,738)	Westrock Co	Barclays Bank	(2,960)
(3,359)	Westrock Co	Credit Suisse	(10,008)
(5,623)	Westrock Co	Goldman Sachs	(3,852)
4,219	Workday Inc 'A'	Barclays Bank	18,156
(2,796)	WR Berkley Corp	Barclays Bank	4,613
4,759	WW Grainger Inc	Barclays Bank	(857)
384	WW Grainger Inc	Citibank	(69)
212	WW Grainger Inc	Credit Suisse	(1,201)
104	WW Grainger Inc	Goldman Sachs	172
3,122	WW Grainger Inc	HSBC	82,577

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
3,316	WW Grainger Inc	JP Morgan	77,310
(1,593)	Wynn Resorts Ltd	Barclays Bank	(44,802)
(2,321)	Xcel Energy Inc	Barclays Bank	7,568
(915)	Xcel Energy Inc	HSBC	5,243
1,103	XPO Logistics Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,114
(25,244)	Xylem Inc	Bank of America Merrill Lynch	19,943
551	Yum! Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	693
13,092	Yum! Brands Inc	Barclays Bank	9,819
3,349	Yum! Brands Inc	Goldman Sachs	3,316
207	Zebra Technologies Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	4,591
197	Zebra Technologies Corp 'A'	HSBC	6,585
(631)	Zillow Group Inc 'C'	Bank of America Merrill Lynch	(196)
(538)	Zillow Group Inc 'C'	Credit Suisse	2,012
(1,211)	Zillow Group Inc 'C'	Goldman Sachs	(375)
(879)	Zillow Group Inc 'C'	JP Morgan	(3,071)
3,683	Zoetis Inc	Bank of America Merrill Lynch	(13,822)
164	Zoom Video Communications Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	6,417
(1,254)	Zscaler Inc	Barclays Bank	(19,031)
(1,779)	Zscaler Inc	Credit Suisse	(46,432)
(465)	Zscaler Inc	JP Morgan	(12,137)
			<u>(2,034,727)</u>
	合計		<u>(3,725,876)</u>

0.5米ドル未満の投資は端数切捨てにより0と表示されている。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

金融デリバティブ商品
スワップ

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現純評 価益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CCCDS	USD 1,053,000	ファンドはMarkit CDX.NA.HY.25 Version 8に係るデフォルト・プロテクションを受け取り、5.000%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/12/2025	(12,527)	(93,364)
CCCDS	USD 7,625,000	ファンドは1.000%の固定金利を受け取り、Markit CDX.NA.IG.30に係るデフォルト・プロテクションを提供する	Bank of America Merrill Lynch	20/12/2025	4,534	187,567
CCCDS	EUR 8,034,000	ファンドは1.000%の固定金利を受け取り、Markit iTraxx Europe Series 23 Version 1に係るデフォルト・プロテクションを提供する	Bank of America Merrill Lynch	20/12/2025	9,895	251,890
CCCDS	EUR 1,114,000	ファンドは5.000%の固定金利を受け取り、Markit iTraxx Europe Crossover Series 30 Version 1に係るデフォルト・プロテクションを提供する	Bank of America Merrill Lynch	20/12/2025	34,606	146,138
CCIRS	GBP 4,162,000	ファンドは0.162%の固定金利を受け取り、GBP 6ヶ月LIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	17/3/2026	(31,209)	(30,778)
CCIRS	GBP 110,839,000	ファンドは0.241%の固定金利を受け取り、GBP 6ヶ月LIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	17/3/2026	(283,754)	(237,144)
CCIRS	SEK 333,856,000	ファンドは0.340%の固定金利を受け取り、SEK 3ヶ月STIBOの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	17/3/2031	(143,409)	(128,868)
CCIRS	HKD 103,565,000	ファンドは0.555%の固定金利を受け取り、HKD 3ヶ月HIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	17/3/2026	(12,065)	(11,873)
CCIRS	SGD 25,893,656	ファンドは0.638%の固定金利を受け取り、SGD 6ヶ月SORF6の変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	17/3/2026	95,355	95,627
CCIRS	USD 50,316,000	ファンドは0.682%の固定金利を受け取り、USD 3ヶ月LIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	17/3/2031	(1,025,972)	(1,030,513)
CCIRS	HKD 145,593,000	ファンドは0.728%の固定金利を受け取り、HKD 3ヶ月HIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	17/3/2026	145,049	145,320
CCIRS	HKD 48,604,000	ファンドは0.740%の固定金利を受け取り、HKD 3ヶ月HIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	17/3/2026	52,007	52,098
CCIRS	CAD 23,315,000	ファンドは0.790%の固定金利を受け取り、CAD 3ヶ月CDORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	17/3/2026	(93,017)	(99,083)
CCIRS	CAD 794,000	ファンドは0.836%の固定金利を受け取り、CAD 3ヶ月CDORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	17/3/2026	(2,003)	(1,980)
CCIRS	AUD 45,865,400	ファンドは0.882%の固定金利を受け取り、AUD 6ヶ月BBSWの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	17/3/2031	(217,952)	(217,284)
CCIRS	ZAR 214,801,224	ファンドは5.502%の固定金利を受け取り、ZAR 3ヶ月JIBARの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	17/3/2026	57,140	57,325
CCIRS	ZAR 542,115,000	ファンドは5.571%の固定金利を受け取り、ZAR 3ヶ月JIBARの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	17/3/2026	251,177	251,644
CCIRS	AUD 87,991,943	ファンドはAUD 6ヶ月BBSWの変動金利を受け取り、0.418%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	17/3/2026	(98,534)	(97,617)
CCIRS	CAD 11,764,000	ファンドはCAD 3ヶ月CDORの変動金利を受け取り、1.094%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	17/3/2031	131,671	138,170
CCIRS	CAD 453,000	ファンドはCAD 3ヶ月CDORの変動金利を受け取り、1.176%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	17/3/2031	2,552	2,558
CCIRS	GBP 5,549,000	ファンドはGBP 6ヶ月LIBORの変動金利を受け取り、0.372%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	17/3/2031	82,989	84,328
CCIRS	GBP 53,179,500	ファンドはGBP 6ヶ月LIBORの変動金利を受け取り、0.445%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	17/3/2031	345,486	297,653
CCIRS	MXN 558,521,000	ファンドはMXN 1ヶ月TIEEの変動金利を受け取り、5.170%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	11/3/2026	(173,636)	(173,263)
CCIRS	PLN 13,368,000	ファンドはPLN 6ヶ月WIBORの変動金利を受け取り、0.573%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	17/3/2026	21,300	21,350
CCIRS	PLN 304,154,196	ファンドはPLN 6ヶ月WIBORの変動金利を受け取り、0.720%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	17/3/2026	(111,502)	(110,343)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現純評 価益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CCIRS	PLN 119,495,000	ファンドはPLN 6ヶ月WIBORの変動金利を受け取り、0.773%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	17/3/2026	(127,962)	(127,503)
CCIRS	SEK 657,107,000	ファンドはSEK 3ヶ月STIBOの変動金利を受け取り、0.087%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	17/3/2026	123,696	125,771
CCIRS	USD 97,634,000	ファンドはUSD 3ヶ月LIBORの変動金利を受け取り、0.347%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	17/3/2026	572,872	577,433
IRS	EUR 56,886,000	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月LIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	17/3/2026	192,685	203,260
IRS	USD 1,250,000	ファンドは0.537%の固定金利を受け取り、USD 6ヶ月LIBOR FEDL SOFRの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/10/2030	(10,834)	(10,834)
IRSKRW	13,997,563,000	ファンドは0.985%の固定金利を受け取り、KRW 3ヶ月KSDAの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	17/3/2026	(95,834)	(95,834)
IRSKRW	19,821,604,000	ファンドは0.998%の固定金利を受け取り、KRW 3ヶ月KSDAの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	17/3/2026	(124,102)	(124,102)
IRSKRW	13,393,056,000	ファンドは1.021%の固定金利を受け取り、KRW 3ヶ月KSDAの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	17/3/2026	(69,979)	(69,979)
IRSKRW	15,928,050,745	ファンドは1.052%の固定金利を受け取り、KRW 3ヶ月KSDAの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	17/3/2026	(60,985)	(60,985)
IRS	CNY 80,920,000	ファンドは2.635%の固定金利を受け取り、CNY 3ヶ月KSDA CNRRの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	17/3/2026	(110,961)	(110,961)
IRS	EUR 28,578,000	ファンドはEUR 6ヶ月LIBORの変動金利を受け取り、0.000%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	17/3/2031	(226,315)	(202,209)
IRS	INR 1,602,931,760	ファンドはINR 3ヶ月KSDA CNRR MIBORの変動金利を受け取り、4.578%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	17/3/2026	(108,836)	(108,836)
IRS	THB 206,349,000	ファンドはTHB 6ヶ月THBSRの変動金利を受け取り、0.825%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	17/3/2026	5,604	5,604
IRS	USD 1,250,000	ファンドはUSD 6ヶ月LIBOR FEDLの変動金利を受け取り、0.554%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/10/2030	12,360	12,360
IRS	CNY 17,701,000	ファンドは2.920%の固定金利を受け取り、CNY 3ヶ月KSDA CNRRの変動金利を支払う	BNP Paribas	17/3/2026	12,728	12,728
IRS	CNY 123,631,000	ファンドは2.860%の固定金利を受け取り、CNY 6ヶ月BBSW CNRRの変動金利を支払う	Citibank	17/3/2026	34,492	34,492
IRSKRW	11,016,896,000	ファンドは1.036%の固定金利を受け取り、KRW 3ヶ月KSDAの変動金利を支払う	HSBC	17/3/2026	(50,120)	(50,120)
IRS	CNY 72,950,000	ファンドは2.650%の固定金利を受け取り、CNY 3ヶ月CDOR CNRRの変動金利を支払う	HSBC	17/3/2026	(92,006)	(92,006)
IRS	INR 555,467,000	ファンドはINR 6ヶ月MIBORの変動金利を受け取り、4.426%の固定金利を支払う	JP Morgan	17/3/2026	11,994	11,994
IRS	THB 165,055,000	ファンドはTHB 6ヶ月THBSRの変動金利を受け取り、0.792%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	17/3/2026	13,339	13,339
TRS	BRL 458	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、Ibovespa Indexを支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/12/2020	(1,098,825)	(1,098,825)
TRS	BRL 143	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、Ibovespa Indexを支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/12/2020	(274,833)	(274,833)
TRS	BRL 137	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、Ibovespa Indexを支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/12/2020	(249,358)	(249,358)
TRS	BRL 149	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、Ibovespa Indexを支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/12/2020	(400,698)	(400,698)
TRS	BRL 230	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、Ibovespa Indexを支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/12/2020	(623,430)	(623,430)
TRS	KRW 10,250,000	ファンドはKOPSI 200 Indexを受け取り、0.000%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	10/12/2020	190,509	190,509
TRS	KRW 48,250,000	ファンドはKOPSI 200 Indexを受け取り、0.000%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	10/12/2020	(234,904)	(234,903)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現純評 価益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
TRS	KRW 6,500,000	ファンドはKOPSI 200 Indexを受け取り、0.000%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	10/12/2020	(6,389)	(6,389)
TRS	TWD 103,200	ファンドはTAIEX Indexを受け取り、0.000%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/12/2020	982,809	982,809
TRS	THB 53,000	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、SET50 Futures Indexを支払う	Credit Suisse	29/12/2020	(221,259)	(221,259)
TRS	THB 176,400	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、SET50 Futures Indexを支払う	Credit Suisse	29/12/2020	(681,506)	(681,506)
TRS	PLN 24,700	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、WIG20 Indexを支払う	JP Morgan	18/12/2020	(605,752)	(605,752)
合計					(4,293,619)	(3,780,465)

CCCDs : 中央決済機関で決済されるクレジット・デフォルト・スワップ

CCIRS : 中央決済機関で決済される金利スワップ

IRS : 金利スワップ

TRS : トータル・リターン・スワップ

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

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)
431	EUR	Amsterdam Index Futures March 2021	2020年12月	1,349,110
3,595	AUD	Australian 10 Year Bond Futures March 2021	2020年12月	1,773,204
(1,125)	EUR	CAC40 Index Futures March 2021	2020年12月	(1,237,073)
(2,587)	CAD	Canadian 10 Year Bond Futures March 2021	2021年3月	740,318
(18)	EUR	DAX Index Futures March 2021	2020年12月	(159,465)
77	USD	E-Mini S&P 500 Index Futures December 2020	2020年12月	318,849
(1,888)	EUR	Euro Bund Futures March 2021	2020年12月	(5,679,749)
(213)	GBP	FTSE 100 Index Futures March 2021	2020年12月	(1,058,070)
1,331	USD	FTSE China A50 Futures March 2021	2020年12月	45,986
229	EUR	FTSE MIB Index Futures December 2020	2020年12月	3,197,406
(587)	ZAR	FTSE/JSE Top 40 Index Futures March 2021	2020年12月	(726,268)
55	HKD	Hang Seng Index Futures March 2021	2020年12月	(12,912)
(87)	EUR	IBEX 35 Index Futures March 2021	2020年12月	(54,987)
55	JPY	Japan 10 Year Bond Futures December 2020	2020年12月	(52,468)
1,673	SGD	MSCI Singapore Index Futures March 2021	2020年12月	(635,249)
(2,550)	SEK	OMX Stockholm 30 Index Futures March 2021	2020年12月	(330,579)
64	CAD	S&P/TSX 60 Index Futures December 2020	2020年12月	(3,701)
(1,561)	USD	SGX NIFTY 50 Futures March 2021	2020年12月	143,637
(476)	AUD	SPI 200 Index Futures March 2021	2020年12月	(3,275,003)
334	CHF	Swiss Market Index Futures December 2020	2020年12月	1,342,513
83	JPY	Topix Index Futures December 2020	2020年12月	(217,820)
(175)	GBP	UK Long Gilt Bond Futures March 2021	2021年3月	(67,868)
2,022	USD	US Treasury 10 Year Note Futures March 2021	2021年3月	359,764
合計				(4,240,425)

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

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	16,474,000	USD	11,987,773	Bank of America Merrill Lynch	16/12/2020	169,366
AUD	12,305,000	USD	8,945,231	Barclays Bank	16/12/2020	135,358
AUD	16,826,000	USD	12,065,933	BNP Paribas	16/12/2020	350,969
AUD	3,502,000	USD	2,457,623	Deutsche Bank	16/12/2020	126,710
AUD	10,483,000	USD	7,345,029	Goldman Sachs	16/12/2020	390,997
AUD	2,018,000	USD	1,467,417	JP Morgan	16/12/2020	21,785
AUD	23,988,000	USD	17,168,578	Morgan Stanley	16/12/2020	533,588
AUD	12,299,000	USD	8,943,365	Barclays Bank	20/1/2021	135,790
AUD	13,480,000	USD	9,685,954	BNP Paribas	20/1/2021	265,020
AUD	10,478,000	USD	7,342,909	Goldman Sachs	20/1/2021	391,979
AUD	2,017,000	USD	1,467,121	JP Morgan	20/1/2021	21,834
AUD	5,959,000	USD	4,385,889	Morgan Stanley	20/1/2021	13,061
AUD	12,297,000	USD	8,943,387	Barclays Bank	17/2/2021	135,844
AUD	8,693,000	USD	6,318,107	BNP Paribas	17/2/2021	100,186
AUD	2,017,000	USD	1,467,390	JP Morgan	17/2/2021	21,820
AUD	5,958,000	USD	4,385,885	Morgan Stanley	17/2/2021	13,079
BRL	9,884,000	USD	1,707,851	BNP Paribas	16/12/2020	154,145
BRL	20,730,000	USD	3,879,362	Deutsche Bank	16/12/2020	25,855
BRL	18,815,000	USD	3,369,868	Citibank	20/1/2021	172,663
BRL	2,223,000	USD	410,341	Deutsche Bank	20/1/2021	8,211
BRL	2,361,000	USD	441,696	UBS	20/1/2021	2,839
BRL	11,155,000	USD	2,072,862	Citibank	17/2/2021	25,824
BRL	2,363,000	USD	441,691	Goldman Sachs	17/2/2021	2,881
CAD	1,677,000	USD	1,276,712	Bank of America Merrill Lynch	16/12/2020	20,057
CAD	96,720,350	USD	73,819,875	Barclays Bank	16/12/2020	970,840
CAD	3,254,000	USD	2,448,063	BNP Paribas	16/12/2020	68,150
CAD	15,588,000	USD	11,849,399	Morgan Stanley	16/12/2020	204,296
CAD	11,242,000	USD	8,589,095	Standard Chartered Bank	16/12/2020	103,980
CAD	53,393,210	USD	40,684,353	Morgan Stanley	20/1/2021	612,437
CAD	2,241,000	USD	1,684,477	Standard Chartered Bank	20/1/2021	48,816
CAD	10,252,030	USD	7,878,022	HSBC	17/2/2021	51,935
CAD	9,407,000	USD	7,183,359	Morgan Stanley	17/2/2021	92,967
CHF	4,443,000	EUR	4,157,823	Goldman Sachs	16/12/2020	(71,633)
CLP	1,946,604,000	USD	2,526,449	Barclays Bank	16/12/2020	17,309
CLP	760,308,000	USD	983,059	BNP Paribas	16/12/2020	10,486
CLP	2,605,711,000	USD	3,406,603	Citibank	16/12/2020	(1,545)
CLP	3,888,899,000	USD	5,110,817	Credit Suisse	16/12/2020	(28,930)
CLP	2,005,114,000	USD	2,621,064	Deutsche Bank	16/12/2020	(846)
CLP	1,122,450,000	USD	1,489,016	Goldman Sachs	16/12/2020	(22,235)
CLP	1,499,685,000	USD	1,985,680	JP Morgan	16/12/2020	(25,941)
CLP	464,735,000	USD	612,493	Morgan Stanley	16/12/2020	(5,192)
CLP	2,604,466,000	USD	3,406,312	Citibank	20/1/2021	(624)

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)
CLP	3,886,658,000	USD	5,110,423	Credit Suisse	20/1/2021	(28,097)
CLP	2,003,712,000	USD	2,620,944	Deutsche Bank	20/1/2021	(823)
CLP	1,121,956,000	USD	1,488,736	Goldman Sachs	20/1/2021	(21,628)
CLP	2,409,960,000	USD	3,137,872	HSBC	20/1/2021	13,475
CLP	1,499,101,000	USD	1,985,564	JP Morgan	20/1/2021	(25,289)
CLP	759,848,000	USD	982,414	Morgan Stanley	20/1/2021	11,189
CLP	2,603,658,000	USD	3,406,057	Citibank	17/2/2021	156
CLP	3,110,357,000	USD	4,083,441	Credit Suisse	17/2/2021	(14,344)
CLP	2,003,029,000	USD	2,621,080	Deutsche Bank	17/2/2021	(634)
CLP	464,400,000	USD	612,449	HSBC	17/2/2021	(4,902)
CLP	1,498,686,000	USD	1,985,409	JP Morgan	17/2/2021	(24,766)
EUR	3,681,684	CHF	3,943,000	Morgan Stanley	16/12/2020	53,693
EUR	1,275,622	CHF	1,365,000	UBS	16/12/2020	19,890
EUR	9,218,000	USD	10,871,775	Bank of America Merrill Lynch	16/12/2020	190,329
EUR	4,068,000	USD	4,803,949	BNP Paribas	16/12/2020	77,874
EUR	654,994	USD	776,172	Deutsche Bank	16/12/2020	9,856
EUR	11,900,006	USD	14,005,748	Goldman Sachs	16/12/2020	274,911
EUR	960,000	USD	1,135,753	HSBC	16/12/2020	16,300
EUR	14,271,000	USD	16,886,099	JP Morgan	16/12/2020	239,882
EUR	3,854,000	USD	4,530,726	Morgan Stanley	16/12/2020	94,284
EUR	7,340,000	USD	8,676,674	Bank of America Merrill Lynch	20/1/2021	141,243
EUR	3,149,000	USD	3,727,345	BNP Paribas	20/1/2021	55,710
EUR	5,817,000	USD	6,803,659	Goldman Sachs	20/1/2021	184,601
EUR	4,826,000	USD	5,719,466	JP Morgan	20/1/2021	78,254
EUR	506,000	USD	595,041	Morgan Stanley	20/1/2021	12,843
EUR	3,147,000	USD	3,727,244	BNP Paribas	17/2/2021	55,768
EUR	959,000	USD	1,136,339	Deutsche Bank	17/2/2021	16,476
EUR	4,823,000	USD	5,719,393	JP Morgan	17/2/2021	78,339
GBP	3,856,000	USD	5,098,276	Barclays Bank	16/12/2020	59,327
GBP	5,214,000	USD	6,771,318	BNP Paribas	16/12/2020	202,681
GBP	10,690,630	USD	14,096,825	Citibank	16/12/2020	202,454
GBP	1,677,000	USD	2,141,856	Goldman Sachs	16/12/2020	101,220
GBP	3,499,000	USD	4,541,858	JP Morgan	16/12/2020	138,239
GBP	1,237,000	USD	1,620,607	Barclays Bank	20/1/2021	34,760
GBP	13,281,050	USD	17,138,000	Deutsche Bank	20/1/2021	634,847
GBP	1,590,000	USD	2,060,828	JP Morgan	20/1/2021	66,928
GBP	17,646,270	USD	23,286,974	Morgan Stanley	17/2/2021	330,742
HKD	3,042,598	USD	392,343	Deutsche Bank	16/12/2020	173
HKD	66,522,000	USD	8,578,907	Goldman Sachs	16/12/2020	2,873
HKD	35,818,402	USD	4,619,424	Morgan Stanley	16/12/2020	1,388
HKD	67,856,000	USD	8,752,155	UBS	16/12/2020	1,720
HUF	1,089,320,000	USD	3,628,441	BNP Paribas	16/12/2020	9,341
HUF	244,670,000	USD	799,616	Citibank	16/12/2020	17,459
HUF	904,435,000	USD	2,908,805	Credit Suisse	16/12/2020	111,553
HUF	802,102,000	USD	2,548,013	Goldman Sachs	16/12/2020	130,605

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)
HUF	1,701,397,000	USD	5,555,529	Morgan Stanley	16/12/2020	126,283
HUF	503,175,000	USD	1,668,938	Societe Generale	16/12/2020	11,413
HUF	524,014,000	USD	1,737,817	UBS	16/12/2020	12,126
HUF	358,491,000	USD	1,194,694	BNP Paribas	20/1/2021	2,397
HUF	904,438,000	USD	2,908,007	Credit Suisse	20/1/2021	112,138
HUF	502,416,000	USD	1,591,793	Goldman Sachs	20/1/2021	85,900
HUF	926,155,000	USD	2,997,803	Morgan Stanley	20/1/2021	94,861
HUF	503,182,000	USD	1,668,574	Societe Generale	20/1/2021	11,677
HUF	165,518,000	USD	542,938	UBS	20/1/2021	9,768
HUF	854,029,000	USD	2,819,606	Morgan Stanley	17/2/2021	31,626
HUF	503,362,000	USD	1,668,673	Societe Generale	17/2/2021	11,834
INR	4,144,418,350	USD	55,926,960	Deutsche Bank	16/12/2020	9,064
INR	48,674,000	USD	656,090	JP Morgan	16/12/2020	849
INR	40,130,000	USD	540,617	Societe Generale	16/12/2020	1,006
INR	1,625,239,000	USD	21,858,114	Standard Chartered Bank	16/12/2020	77,271
INR	184,624,000	USD	2,492,914	UBS	16/12/2020	(1,096)
INR	89,244,000	USD	1,193,134	Barclays Bank	20/1/2021	7,284
INR	105,349,000	USD	1,414,797	Deutsche Bank	20/1/2021	2,248
INR	5,136,025,570	USD	69,260,678	JP Morgan	20/1/2021	(176,205)
INR	4,612,242,740	USD	61,563,469	Morgan Stanley	17/2/2021	298,084
JPY	266,019,000	USD	2,519,797	Bank of America Merrill Lynch	16/12/2020	32,525
JPY	1,009,580,000	USD	9,591,434	BNP Paribas	16/12/2020	94,990
JPY	1,321,421,000	USD	12,595,469	Morgan Stanley	16/12/2020	82,918
JPY	1,008,625,000	USD	9,588,921	BNP Paribas	20/1/2021	95,594
JPY	1,192,719,850	USD	11,320,920	JP Morgan	20/1/2021	131,219
JPY	718,861,000	USD	6,892,676	Morgan Stanley	20/1/2021	9,612
JPY	1,008,288,000	USD	9,588,999	BNP Paribas	17/2/2021	95,576
JPY	718,550,000	USD	6,892,112	Morgan Stanley	17/2/2021	9,538
KRW	3,174,319,000	USD	2,729,760	BNP Paribas	16/12/2020	138,669
KRW	3,469,021,000	USD	3,011,701	Deutsche Bank	16/12/2020	123,032
KRW	569,328,000	USD	478,182	Goldman Sachs	16/12/2020	36,283
KRW	19,506,414,000	USD	17,251,815	HSBC	16/12/2020	374,881
KRW	3,898,902,000	USD	3,366,075	JP Morgan	16/12/2020	157,112
KRW	4,278,511,527	USD	3,760,220	Morgan Stanley	16/12/2020	105,997
KRW	3,380,280,473	USD	2,984,241	UBS	16/12/2020	70,302
KRW	5,736,154,000	USD	5,051,787	BNP Paribas	20/1/2021	130,797
KRW	805,392,000	USD	727,446	Deutsche Bank	20/1/2021	221
KRW	12,977,179,000	USD	11,544,074	HSBC	20/1/2021	180,737
KRW	1,519,632,000	USD	1,358,792	JP Morgan	20/1/2021	14,188
KRW	1,918,927,000	USD	1,689,228	UBS	20/1/2021	44,512
KRW	901,595,000	USD	810,255	BNP Paribas	17/2/2021	4,260
KRW	4,461,589,000	USD	4,033,986	HSBC	17/2/2021	(3,318)
KRW	1,519,218,000	USD	1,358,385	JP Morgan	17/2/2021	14,100
KRW	805,468,000	USD	727,470	Morgan Stanley	17/2/2021	202
MXN	130,006,431	USD	6,102,807	Bank of America Merrill Lynch	16/12/2020	362,754

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)
MXN	384,321,740	USD	17,484,646	Barclays Bank	16/12/2020	1,628,684
MXN	451,921	USD	21,324	Deutsche Bank	16/12/2020	1,151
MXN	77,561,000	USD	3,580,397	Goldman Sachs	16/12/2020	276,916
MXN	95,207,648	USD	4,226,839	JP Morgan	16/12/2020	508,087
MXN	79,766,000	USD	3,757,006	Morgan Stanley	16/12/2020	209,967
MXN	10,555,000	USD	524,159	Bank of America Merrill Lynch	20/1/2021	(1,122)
MXN	11,564,000	USD	541,653	Citibank	20/1/2021	31,383
MXN	9,948,000	USD	482,117	Goldman Sachs	20/1/2021	10,841
MXN	12,885,000	USD	604,997	JP Morgan	20/1/2021	33,499
MXN	47,182,000	USD	2,210,872	Morgan Stanley	20/1/2021	127,159
MXN	16,354,000	USD	803,122	Standard Chartered Bank	20/1/2021	7,276
MXN	9,979,000	USD	482,062	Goldman Sachs	17/2/2021	10,911
MXN	10,587,000	USD	524,131	HSBC	17/2/2021	(1,122)
MXN	16,406,000	USD	802,781	JP Morgan	17/2/2021	7,693
NOK	216,891,709	USD	23,279,474	Credit Suisse	16/12/2020	1,364,429
NOK	100,597,291	USD	10,980,709	Deutsche Bank	16/12/2020	449,464
NOK	10,575,000	USD	1,172,596	Goldman Sachs	16/12/2020	28,968
NOK	111,581,000	USD	11,889,604	JP Morgan	16/12/2020	788,572
NOK	17,737,000	USD	1,948,969	Morgan Stanley	16/12/2020	66,363
NOK	10,412,000	USD	1,165,831	UBS	16/12/2020	17,213
NOK	83,648,000	USD	8,959,519	Credit Suisse	20/1/2021	546,340
NOK	1,957,770	USD	211,582	HSBC	20/1/2021	10,902
NOK	111,550,000	USD	11,886,342	JP Morgan	20/1/2021	790,334
NOK	17,733,000	USD	1,948,528	Morgan Stanley	20/1/2021	66,671
NOK	113,853,110	USD	12,618,084	Bank of America Merrill Lynch	17/2/2021	320,404
NOK	17,734,000	USD	1,948,609	Morgan Stanley	17/2/2021	66,718
NZD	5,800,125	USD	3,893,324	BNP Paribas	16/12/2020	193,256
NZD	100,557,040	USD	67,419,976	Deutsche Bank	16/12/2020	3,429,259
NZD	10,839,875	USD	7,235,745	Goldman Sachs	16/12/2020	401,680
NZD	3,044,000	USD	2,059,768	BNP Paribas	20/1/2021	85,020
NZD	2,767,000	USD	1,853,916	Goldman Sachs	20/1/2021	95,699
NZD	70,200,840	USD	46,688,683	JP Morgan	20/1/2021	2,774,492
NZD	42,299,600	USD	28,883,394	Morgan Stanley	17/2/2021	920,898
PLN	69,738,220	USD	18,473,461	Citibank	16/12/2020	226,095
PLN	17,582,000	USD	4,663,225	Credit Suisse	16/12/2020	51,200
PLN	6,607,000	USD	1,757,372	Morgan Stanley	16/12/2020	14,224
PLN	5,902,000	USD	1,564,256	UBS	16/12/2020	18,302
PLN	6,862,440	USD	1,792,528	Morgan Stanley	20/1/2021	48,134
PLN	5,899,000	USD	1,563,810	UBS	20/1/2021	18,435
PLN	5,898,000	USD	1,563,749	UBS	17/2/2021	18,412
RUB	1,683,974,600	USD	21,986,549	Bank of America Merrill Lynch	16/12/2020	111,913
RUB	30,384,000	USD	393,749	Goldman Sachs	16/12/2020	4,975
RUB	322,826,000	USD	4,045,946	JP Morgan	16/12/2020	190,435
RUB	1,167,194,490	USD	14,937,684	Bank of America Merrill Lynch	20/1/2021	326,802

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)
RUB	30,471,000	USD	393,610		UBS 20/1/2021	4,888
RUB	823,337,600	USD	10,681,390		JP Morgan 17/2/2021	55,652
RUB	30,550,000	USD	393,591		UBS 17/2/2021	4,807
SEK	12,320,000	USD	1,411,906		Barclays Bank 16/12/2020	40,814
SEK	86,052,000	USD	9,434,745		Credit Suisse 16/12/2020	712,122
SEK	70,957,000	USD	8,232,126		Deutsche Bank 16/12/2020	134,806
SEK	80,426,000	USD	9,088,218		Goldman Sachs 16/12/2020	395,254
SEK	51,110,000	USD	5,931,291		Deutsche Bank 20/1/2021	100,203
SEK	83,824,000	USD	9,527,234		Goldman Sachs 20/1/2021	364,840
SEK	51,094,000	USD	5,931,200		Deutsche Bank 17/2/2021	100,430
SEK	30,668,000	USD	3,578,719		Goldman Sachs 17/2/2021	41,628
SGD	65,116,700	USD	47,670,457	Bank of America Merrill Lynch	16/12/2020	1,016,774
SGD	17,495,000	USD	12,857,993		BNP Paribas 16/12/2020	222,876
SGD	7,366,000	USD	5,469,265		Goldman Sachs 16/12/2020	38,234
SGD	3,253,000	USD	2,407,810		HSBC 16/12/2020	24,431
SGD	5,764,000	USD	4,250,082	Standard Chartered Bank	16/12/2020	59,615
SGD	6,014,000	USD	4,422,616		BNP Paribas 20/1/2021	74,139
SGD	43,437,990	USD	31,963,046		Goldman Sachs 20/1/2021	516,167
SGD	3,252,000	USD	2,407,141		HSBC 20/1/2021	24,426
SGD	886,000	USD	658,349		Morgan Stanley 20/1/2021	4,126
SGD	847,000	USD	623,036		Standard Chartered Bank 20/1/2021	10,279
SGD	37,710,560	USD	28,000,574		BNP Paribas 17/2/2021	197,588
SGD	886,000	USD	658,392	Standard Chartered Bank	17/2/2021	4,117
SGD	1,382,000	USD	1,029,233		UBS 17/2/2021	4,161
THB	18,011,174	USD	593,625	Bank of America Merrill Lynch	16/12/2020	1,723
THB	20,035,000	USD	639,934		Barclays Bank 16/12/2020	22,310
THB	87,701,000	USD	2,852,480		BNP Paribas 16/12/2020	46,423
THB	89,519,000	USD	2,822,697		Deutsche Bank 16/12/2020	136,299
THB	331,132,000	USD	10,659,842		Goldman Sachs 16/12/2020	285,522
THB	75,192,000	USD	2,460,737		HSBC 16/12/2020	24,688
THB	101,429,826	USD	3,313,481		Morgan Stanley 16/12/2020	39,220
THB	28,890,000	USD	922,414	Standard Chartered Bank	16/12/2020	32,527
THB	18,007,762	USD	593,444	Bank of America Merrill Lynch	20/1/2021	1,728
THB	139,989,000	USD	4,471,163		Goldman Sachs 20/1/2021	155,597
THB	193,765,000	USD	6,399,421		HSBC 20/1/2021	4,683
THB	101,419,238	USD	3,312,887		Morgan Stanley 20/1/2021	39,108
THB	28,904,000	USD	922,316	Standard Chartered Bank	20/1/2021	32,987
THB	18,008,786	USD	593,382	Bank of America Merrill Lynch	17/2/2021	1,771
THB	47,462,000	USD	1,571,173		Goldman Sachs 17/2/2021	(2,654)
THB	146,331,000	USD	4,828,065		HSBC 17/2/2021	7,868
THB	34,768,214	USD	1,145,274		Morgan Stanley 17/2/2021	3,743
TWD	1,572,000	USD	55,454		HSBC 16/12/2020	(334)
TWD	31,436,000	USD	1,105,928		JP Morgan 16/12/2020	(3,667)

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)
TWD	281,967,000	USD	9,747,504	Standard Chartered Bank	16/12/2020	139,283
TWD	1,560,000	USD	55,463	HSBC	20/1/2021	(475)
TWD	31,180,000	USD	1,105,388	UBS	20/1/2021	(6,346)
TWD	31,028,000	USD	1,105,340	Deutsche Bank	17/2/2021	(5,446)
USD	3,097,250	AUD	4,255,000	Bank of America Merrill Lynch	16/12/2020	(42,767)
USD	11,230,767	AUD	15,592,000	BNP Paribas	16/12/2020	(275,494)
USD	1,047,434	AUD	1,484,000	Deutsche Bank	16/12/2020	(47,698)
USD	109,677,766	AUD	150,558,450	JP Morgan	16/12/2020	(1,428,231)
USD	10,157,121	AUD	13,950,000	Morgan Stanley	16/12/2020	(137,411)
USD	2,078,347	AUD	2,859,000	Bank of America Merrill Lynch	20/1/2021	(32,174)
USD	2,649,456	AUD	3,707,000	BNP Paribas	20/1/2021	(87,062)
USD	1,046,934	AUD	1,483,000	Deutsche Bank	20/1/2021	(47,820)
USD	72,328,466	AUD	100,921,620	Morgan Stanley	20/1/2021	(2,172,152)
USD	58,738,980	AUD	80,623,150	JP Morgan	17/2/2021	(787,425)
USD	1,553,342	BRL	8,910,000	Bank of America Merrill Lynch	16/12/2020	(125,167)
USD	1,094,705	BRL	5,768,000	Citibank	16/12/2020	8,101
USD	2,119,114	BRL	11,456,604	Deutsche Bank	16/12/2020	(39,138)
USD	4,981,586	BRL	26,930,950	Goldman Sachs	16/12/2020	(91,797)
USD	5,964,624	BRL	33,788,000	JP Morgan	16/12/2020	(400,523)
USD	884,674	BRL	4,712,396	Morgan Stanley	16/12/2020	(3,069)
USD	814,821	BRL	4,335,000	Standard Chartered Bank	16/12/2020	(1,828)
USD	19,358,661	BRL	107,801,430	HSBC	20/1/2021	(938,438)
USD	1,537,750	BRL	8,461,000	UBS	20/1/2021	(55,307)
USD	19,539,267	BRL	105,367,450	Bank of America Merrill Lynch	17/2/2021	(284,418)
USD	815,089	BRL	4,341,000	Citibank	17/2/2021	(1,621)
USD	18,056,684	CAD	23,660,000	Bank of America Merrill Lynch	16/12/2020	(238,829)
USD	4,802,036	CAD	6,351,000	BNP Paribas	16/12/2020	(108,987)
USD	1,933,927	CAD	2,551,000	Citibank	16/12/2020	(38,679)
USD	8,150,216	CAD	10,783,000	JP Morgan	16/12/2020	(187,928)
USD	2,380,604	CAD	3,109,000	Morgan Stanley	16/12/2020	(23,485)
USD	5,659,446	CAD	7,394,000	UBS	16/12/2020	(58,095)
USD	13,527,187	CAD	17,702,000	Bank of America Merrill Lynch	20/1/2021	(164,363)
USD	1,317,143	CAD	1,712,000	Morgan Stanley	20/1/2021	(6,997)
USD	2,925,509	CAD	3,823,000	UBS	20/1/2021	(31,376)
USD	3,622,768	CAD	4,717,000	Bank of America Merrill Lynch	17/2/2021	(25,837)
USD	1,317,230	CAD	1,712,000	Morgan Stanley	17/2/2021	(7,004)
USD	1,638,926	CAD	2,146,000	UBS	17/2/2021	(21,007)
USD	5,848,550	CHF	5,329,500	Morgan Stanley	16/12/2020	(50,704)
USD	3,950,082	CHF	3,594,000	Societe Generale	16/12/2020	(28,138)
USD	1,280,968	CLP	991,469,000	BNP Paribas	16/12/2020	(14,652)
USD	3,839,779	CLP	2,936,087,000	Credit Suisse	16/12/2020	2,996
USD	8,575,255	CLP	6,731,381,000	Deutsche Bank	16/12/2020	(221,094)
USD	8,968,984	CLP	6,993,630,000	JP Morgan	16/12/2020	(170,064)

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)
USD	2,417,883	CLP	1,905,292,000	Morgan Stanley	16/12/2020	(71,890)
USD	20,445,878	CLP	16,287,595,500	Deutsche Bank	20/1/2021	(852,335)
USD	2,451,796	CLP	1,926,989,000	JP Morgan	20/1/2021	(68,000)
USD	16,157,872	CLP	12,274,812,500	HSBC	17/2/2021	99,456
USD	8,071,720	EUR	6,816,000	Bank of America Merrill Lynch	16/12/2020	(107,854)
USD	29,294,094	EUR	24,717,073	Barclays Bank	16/12/2020	(367,746)
USD	2,496,677	EUR	2,093,000	BNP Paribas	16/12/2020	(15,038)
USD	9,437,677	EUR	8,038,000	Deutsche Bank	16/12/2020	(208,363)
USD	4,304,247	EUR	3,622,000	Deutsche Bank	20/1/2021	(47,047)
USD	5,450,179	EUR	4,629,931	Morgan Stanley	20/1/2021	(111,994)
USD	4,304,470	EUR	3,620,000	Deutsche Bank	17/2/2021	(47,136)
USD	34,624,872	EUR	29,224,937	Morgan Stanley	17/2/2021	(506,450)
USD	12,227,713	GBP	9,390,000	Bank of America Merrill Lynch	16/12/2020	(331,905)
USD	4,898,858	GBP	3,729,000	Deutsche Bank	16/12/2020	(88,875)
USD	6,031,257	GBP	4,678,000	Goldman Sachs	16/12/2020	(225,814)
USD	10,184,688	GBP	7,734,000	JP Morgan	16/12/2020	(159,943)
USD	720,900	GBP	544,000	UBS	16/12/2020	(6,728)
USD	4,792,373	GBP	3,594,000	Bank of America Merrill Lynch	20/1/2021	(17,157)
USD	4,896,922	GBP	3,726,000	Deutsche Bank	20/1/2021	(89,253)
USD	6,029,581	GBP	4,675,000	Goldman Sachs	20/1/2021	(226,555)
USD	9,721,496	GBP	7,373,000	JP Morgan	20/1/2021	(145,134)
USD	721,218	GBP	544,000	UBS	20/1/2021	(6,769)
USD	4,150,540	GBP	3,100,000	Bank of America Merrill Lynch	17/2/2021	1,509
USD	4,897,603	GBP	3,726,000	Deutsche Bank	17/2/2021	(89,264)
USD	7,176,221	GBP	5,422,000	JP Morgan	17/2/2021	(80,568)
USD	721,314	GBP	544,000	UBS	17/2/2021	(6,774)
USD	5,142,532	HKD	39,874,000	BNP Paribas	16/12/2020	(1,479)
USD	13,285,561	HKD	103,008,000	Goldman Sachs	16/12/2020	(3,156)
USD	10,282,660	HKD	79,736,000	HSBC	16/12/2020	(3,813)
USD	3,660,695	HKD	28,378,000	Standard Chartered Bank	16/12/2020	(256)
USD	2,884,075	HUF	881,085,000	Bank of America Merrill Lynch	16/12/2020	(58,306)
USD	4,483,832	HUF	1,397,978,000	Barclays Bank	16/12/2020	(184,713)
USD	596,517	HUF	181,166,000	Citibank	16/12/2020	(8,486)
USD	14,091,858	HUF	4,289,171,650	Goldman Sachs	16/12/2020	(231,820)
USD	1,342,268	HUF	414,680,000	Societe Generale	16/12/2020	(42,555)
USD	14,672,539	HUF	4,541,258,000	Barclays Bank	20/1/2021	(491,860)
USD	8,280,786	HUF	2,510,385,790	Barclays Bank	17/2/2021	(100,303)
USD	1,836,013	INR	135,439,000	Bank of America Merrill Lynch	16/12/2020	8,032
USD	1,613,146	INR	118,500,098	Barclays Bank	16/12/2020	13,784
USD	6,778,122	INR	503,185,000	BNP Paribas	16/12/2020	(13,220)
USD	616,648	INR	45,728,000	Citibank	16/12/2020	(529)
USD	7,518,883	INR	559,628,000	Deutsche Bank	16/12/2020	(34,256)
USD	699,120	INR	51,939,000	Goldman Sachs	16/12/2020	(1,886)

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)
USD	6,266,143	INR	467,120,902	JP Morgan	16/12/2020	(38,454)
USD	9,929,581	INR	742,683,000	Standard Chartered Bank	16/12/2020	(94,198)
USD	242,145	INR	18,126,000	UBS	16/12/2020	(2,496)
USD	2,577,192	INR	191,122,000	Barclays Bank	20/1/2021	6,418
USD	4,940,792	INR	370,364,000	Deutsche Bank	20/1/2021	(40,958)
USD	1,835,404	INR	135,908,000	HSBC	20/1/2021	7,311
USD	5,830,465	INR	436,626,000	Morgan Stanley	20/1/2021	(42,574)
USD	9,927,923	INR	745,041,000	Standard Chartered Bank	20/1/2021	(93,593)
USD	242,070	INR	18,186,000	UBS	20/1/2021	(2,549)
USD	2,793,383	INR	210,432,000	BNP Paribas	17/2/2021	(29,029)
USD	2,146,872	INR	160,985,000	Deutsche Bank	17/2/2021	(12,334)
USD	5,829,963	INR	437,851,000	HSBC	17/2/2021	(42,699)
USD	2,577,681	INR	191,689,000	UBS	17/2/2021	6,659
USD	9,342,341	JPY	984,426,000	Bank of America Merrill Lynch	16/12/2020	(102,744)
USD	34,081,945	JPY	3,611,802,130	BNP Paribas	16/12/2020	(571,525)
USD	1,816,142	JPY	190,050,000	Goldman Sachs	16/12/2020	(7,294)
USD	12,197,717	JPY	1,278,214,000	JP Morgan	16/12/2020	(66,118)
USD	357,031	JPY	37,520,000	Morgan Stanley	16/12/2020	(2,955)
USD	3,388,547	JPY	352,735,000	Bank of America Merrill Lynch	20/1/2021	1,691
USD	2,082,890	JPY	216,907,000	BNP Paribas	20/1/2021	214
USD	1,815,768	JPY	189,873,000	Goldman Sachs	20/1/2021	(7,336)
USD	356,924	JPY	37,482,000	Morgan Stanley	20/1/2021	(2,967)
USD	2,082,900	JPY	216,833,000	BNP Paribas	17/2/2021	226
USD	1,803,208	JPY	187,140,000	JP Morgan	17/2/2021	5,734
USD	2,161,643	JPY	226,750,350	Morgan Stanley	17/2/2021	(16,287)
USD	994,769	KRW	1,179,358,600	BNP Paribas	16/12/2020	(70,942)
USD	15,212,621	KRW	17,767,773,000	HSBC	16/12/2020	(842,977)
USD	42,351,234	KRW	50,228,666,680	JP Morgan	16/12/2020	(3,037,193)
USD	116,728	KRW	138,372,400	Morgan Stanley	16/12/2020	(8,310)
USD	41,174,093	KRW	47,153,394,540	Citibank	20/1/2021	(1,428,746)
USD	323,190	KRW	360,554,000	HSBC	20/1/2021	(2,569)
USD	761,380	KRW	855,895,000	UBS	20/1/2021	(11,917)
USD	323,224	KRW	360,582,000	Goldman Sachs	17/2/2021	(2,532)
USD	33,894,474	KRW	37,778,780,230	HSBC	17/2/2021	(235,457)
USD	477,787	MXN	9,798,000	Bank of America Merrill Lynch	16/12/2020	(9,493)
USD	412,955	MXN	8,873,000	Goldman Sachs	16/12/2020	(28,323)
USD	890,494	MXN	18,734,000	Goldman Sachs	20/1/2021	(37,841)
USD	6,202,698	MXN	133,457,800	JP Morgan	20/1/2021	(410,598)
USD	477,677	MXN	9,861,000	Barclays Bank	17/2/2021	(9,466)
USD	8,918,371	MXN	183,275,360	Goldman Sachs	17/2/2021	(135,621)
USD	3,790,923	NOK	34,136,000	Barclays Bank	16/12/2020	(87,714)
USD	2,853,119	NOK	26,284,000	Credit Suisse	16/12/2020	(133,350)
USD	1,792,511	NOK	16,538,000	Goldman Sachs	16/12/2020	(86,588)
USD	11,572,012	NOK	106,886,000	JP Morgan	16/12/2020	(572,704)

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)
USD	16,270,595	NOK	146,023,280	Morgan Stanley	16/12/2020	(321,019)
USD	9,456,503	NOK	86,114,000	UBS	16/12/2020	(328,034)
USD	1,792,139	NOK	16,534,000	Goldman Sachs	20/1/2021	(86,804)
USD	7,549,558	NOK	69,354,000	JP Morgan	20/1/2021	(331,913)
USD	7,283,559	NOK	65,627,000	UBS	20/1/2021	(174,372)
USD	1,180,285	NOK	10,667,000	Goldman Sachs	17/2/2021	(31,934)
USD	7,283,429	NOK	65,631,000	UBS	17/2/2021	(175,005)
USD	4,169,323	NZD	6,199,000	Bank of America Merrill Lynch	16/12/2020	(198,291)
USD	10,446,308	NZD	15,644,000	BNP Paribas	16/12/2020	(575,947)
USD	1,596,249	NZD	2,385,636	Deutsche Bank	16/12/2020	(84,592)
USD	28,337,586	NZD	42,087,364	Goldman Sachs	16/12/2020	(1,315,807)
USD	7,418,233	NZD	11,210,000	JP Morgan	16/12/2020	(479,970)
USD	2,809,446	NZD	4,224,000	Standard Chartered Bank	16/12/2020	(166,648)
USD	4,425,803	NZD	6,495,000	BNP Paribas	20/1/2021	(150,542)
USD	17,536,430	NZD	25,994,000	Goldman Sachs	20/1/2021	(778,819)
USD	7,416,288	NZD	11,207,000	JP Morgan	20/1/2021	(480,110)
USD	2,808,111	NZD	4,222,000	Standard Chartered Bank	20/1/2021	(166,690)
USD	4,425,771	NZD	6,495,000	BNP Paribas	17/2/2021	(150,605)
USD	8,933,520	NZD	12,959,000	Goldman Sachs	17/2/2021	(197,390)
USD	1,259,519	NZD	1,827,000	JP Morgan	17/2/2021	(27,785)
USD	2,579,755	PLN	9,655,000	BNP Paribas	16/12/2020	(9,129)
USD	5,831,726	PLN	22,552,000	Citibank	16/12/2020	(215,350)
USD	3,135,531	PLN	11,845,000	Deutsche Bank	16/12/2020	(40,579)
USD	939,132	PLN	3,676,000	Goldman Sachs	16/12/2020	(46,548)
USD	1,504,518	PLN	5,739,000	HSBC	16/12/2020	(34,333)
USD	2,729,456	PLN	10,638,000	Societe Generale	16/12/2020	(123,010)
USD	2,165,600	PLN	8,436,000	UBS	16/12/2020	(96,423)
USD	4,950,685	PLN	19,180,000	Citibank	20/1/2021	(193,824)
USD	938,775	PLN	3,674,000	Goldman Sachs	20/1/2021	(46,675)
USD	2,728,490	PLN	10,634,000	Societe Generale	20/1/2021	(123,789)
USD	364,890	PLN	1,382,000	UBS	20/1/2021	(5,794)
USD	1,688,902	PLN	6,408,000	Goldman Sachs	17/2/2021	(30,068)
USD	6,704,834	PLN	25,452,690	HSBC	17/2/2021	(122,948)
USD	364,663	PLN	1,381,000	UBS	17/2/2021	(5,795)
USD	6,381,678	RUB	490,383,000	Bank of America Merrill Lynch	16/12/2020	(53,520)
USD	3,613,954	RUB	276,986,346	Barclays Bank	16/12/2020	(20,882)
USD	8,870,585	RUB	686,367,654	Goldman Sachs	16/12/2020	(136,483)
USD	2,640,142	RUB	204,263,000	Bank of America Merrill Lynch	20/1/2021	(31,195)
USD	411,525	RUB	31,608,500	BNP Paribas	20/1/2021	(1,848)
USD	2,985,527	RUB	233,431,500	Goldman Sachs	20/1/2021	(67,274)
USD	942,955	RUB	72,782,000	Bank of America Merrill Lynch	17/2/2021	(6,186)
USD	753,996	RUB	57,870,418	Goldman Sachs	17/2/2021	(685)
USD	1,000,000	RUB	77,041,582	UBS	17/2/2021	(4,690)

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)
USD	4,284,105	SEK	37,006,000	Bank of America Merrill Lynch	16/12/2020	(79,478)
USD	16,220,171	SEK	142,970,000	Credit Suisse	16/12/2020	(638,213)
USD	1,393,042	SEK	12,268,000	Deutsche Bank	16/12/2020	(53,546)
USD	11,649,700	SEK	103,375,500	Morgan Stanley	16/12/2020	(539,877)
USD	1,559,460	SEK	13,705,000	UBS	16/12/2020	(56,572)
USD	454,751	SEK	4,022,000	Bank of America Merrill Lynch	20/1/2021	(19,885)
USD	10,939,176	SEK	96,683,000	Credit Suisse	20/1/2021	(470,388)
USD	19,026,341	SEK	167,871,140	Goldman Sachs	20/1/2021	(784,140)
USD	1,038,928	SEK	8,971,000	Morgan Stanley	20/1/2021	(19,740)
USD	30,319,400	SEK	260,891,140	Bank of America Merrill Lynch	17/2/2021	(478,716)
USD	4,063,944	SGD	5,509,181	Bank of America Merrill Lynch	16/12/2020	(55,227)
USD	35,035,454	SGD	47,598,819	BNP Paribas	16/12/2020	(553,801)
USD	680,894	SGD	932,000	Citibank	16/12/2020	(15,955)
USD	5,148,826	SGD	7,045,000	Goldman Sachs	16/12/2020	(118,663)
USD	13,791,103	SGD	18,629,000	BNP Paribas	20/1/2021	(138,069)
USD	5,147,609	SGD	7,043,000	Goldman Sachs	20/1/2021	(118,544)
USD	7,673,511	SGD	10,326,000	BNP Paribas	17/2/2021	(47,781)
USD	1,928,165	THB	59,883,000	Goldman Sachs	16/12/2020	(51,231)
USD	1,254,290	THB	39,321,000	HSBC	16/12/2020	(45,441)
USD	6,024,008	THB	191,202,000	Morgan Stanley	16/12/2020	(296,057)
USD	27,706,357	THB	871,919,070	Standard Chartered Bank	16/12/2020	(1,114,390)
USD	27,764,837	THB	867,397,530	HSBC	20/1/2021	(903,416)
USD	19,873,016	THB	605,510,930	Citibank	17/2/2021	(137,850)
USD	1,059,725	TWD	30,008,979	Bank of America Merrill Lynch	16/12/2020	7,501
USD	3,976,960	TWD	112,627,162	Barclays Bank	16/12/2020	27,842
USD	1,278,369	TWD	36,306,000	BNP Paribas	16/12/2020	5,348
USD	2,616,058	TWD	75,264,000	Credit Suisse	16/12/2020	(22,971)
USD	1,685,729	TWD	48,018,000	Deutsche Bank	16/12/2020	2,044
USD	1,995,198	TWD	56,502,021	HSBC	16/12/2020	14,032
USD	8,393,351	TWD	242,466,880	JP Morgan	16/12/2020	(108,420)
USD	8,498,315	TWD	244,079,838	Standard Chartered Bank	16/12/2020	(60,012)
USD	8,009,413	TWD	225,207,830	Barclays Bank	20/1/2021	71,223
USD	3,056,594	TWD	85,820,000	Goldman Sachs	20/1/2021	31,586
USD	2,014,565	TWD	56,849,000	Standard Chartered Bank	20/1/2021	10,735
USD	2,961,630	TWD	83,696,000	UBS	20/1/2021	11,489
USD	10,899,256	TWD	305,233,660	Bank of America Merrill Lynch	17/2/2021	79,204
USD	1,683,151	TWD	47,411,000	Societe Generale	17/2/2021	2,506
USD	2,013,994	TWD	56,561,000	Standard Chartered Bank	17/2/2021	8,996
USD	8,286,257	ZAR	131,769,782	Bank of America Merrill Lynch	17/12/2020	(282,707)
USD	737,404	ZAR	12,214,513	BNP Paribas	17/12/2020	(56,903)
USD	3,185,351	ZAR	49,876,779	Deutsche Bank	17/12/2020	(58,126)
USD	4,784,069	ZAR	79,001,000	Goldman Sachs	17/12/2020	(353,351)

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)
USD	949,051	ZAR	15,595,705	Morgan Stanley	17/12/2020	(65,135)
USD	365,401	ZAR	6,151,221	Standard Chartered Bank	17/12/2020	(34,612)
USD	6,072,403	ZAR	95,656,982	Bank of America Merrill Lynch	20/1/2021	(120,771)
USD	2,370,160	ZAR	36,341,000	Deutsche Bank	20/1/2021	17,314
USD	4,782,695	ZAR	79,282,000	Goldman Sachs	20/1/2021	(350,304)
USD	424,010	ZAR	6,777,018	Morgan Stanley	20/1/2021	(14,759)
USD	4,768,834	ZAR	74,612,358	Bank of America Merrill Lynch	17/2/2021	(45,298)
USD	2,370,183	ZAR	36,461,000	Deutsche Bank	17/2/2021	17,650
USD	210,961	ZAR	3,342,642	Morgan Stanley	17/2/2021	(4,713)
ZAR	236,476,967	USD	13,941,696	Bank of America Merrill Lynch	17/12/2020	1,436,357
ZAR	119,528,763	USD	7,084,917	Barclays Bank	17/12/2020	688,017
ZAR	10,288,000	USD	617,531	Citibank	17/12/2020	51,496
ZAR	9,257,000	USD	547,557	Deutsche Bank	17/12/2020	54,424
ZAR	10,287,000	USD	660,714	Goldman Sachs	17/12/2020	8,248
ZAR	5,589,000	USD	358,057	Morgan Stanley	17/12/2020	5,394
ZAR	11,298,000	USD	708,609	Bank of America Merrill Lynch	20/1/2021	22,864
ZAR	535,365,190	USD	32,068,939	BNP Paribas	20/1/2021	2,592,509
ZAR	10,328,000	USD	660,354	HSBC	20/1/2021	8,317
ZAR	5,611,000	USD	357,899	Morgan Stanley	20/1/2021	5,377
ZAR	517,170,750	USD	33,016,437	Bank of America Merrill Lynch	17/2/2021	352,409
ZAR	10,363,000	USD	660,380	HSBC	17/2/2021	8,261
ZAR	5,630,000	USD	357,930	Morgan Stanley	17/2/2021	5,328
						1,229,902
ヘッジを使用した豪ドル建投資証券クラス						
AUD	741,429,171	USD	542,751,192	State Street Bank & Trust Company	15/12/2020	4,387,033
USD	85,159,788	AUD	117,346,534	State Street Bank & Trust Company	15/12/2020	(1,436,177)
						2,950,856

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)
ヘッジを使用したブラジル・レアル建投資証券クラス						
BRL	13,341,959	USD	2,479,097	State Street Bank & Trust Company	2/12/2020	34,744
BRL	12,773,272	USD	2,376,662	State Street Bank & Trust Company	5/1/2021	29,221
USD	2,482,961	BRL	13,341,959	State Street Bank & Trust Company	2/12/2020	(30,879)
						33,086
ヘッジを使用したスイス・フラン建投資証券クラス						
CHF	379,991	USD	421,961	State Street Bank & Trust Company	15/12/2020	(1,366)
USD	23,652	CHF	21,576	State Street Bank & Trust Company	15/12/2020	(229)
						(1,595)
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	25,881,952	USD	30,788,778	State Street Bank & Trust Company	15/12/2020	269,815
USD	2,876,894	EUR	2,424,984	State Street Bank & Trust Company	15/12/2020	(33,110)
						236,705
ヘッジを使用した英ポンド建投資証券クラス						
GBP	122,325,875	USD	161,118,505	State Street Bank & Trust Company	15/12/2020	2,495,249
USD	23,757,738	GBP	18,025,524	State Street Bank & Trust Company	15/12/2020	(351,829)
						2,143,420
ヘッジを使用した日本円建投資証券クラス						
JPY	12,899,366,254	USD	123,840,796	State Street Bank & Trust Company	15/12/2020	(81,263)
USD	6,515,603	JPY	685,546,588	State Street Bank & Trust Company	15/12/2020	(61,690)
						(142,953)
ヘッジを使用したニュージーランド・ドル建投資証券クラス						
NZD	181	USD	124	State Street Bank & Trust Company	15/12/2020	4
USD	6	NZD	8	State Street Bank & Trust Company	15/12/2020	-
						4
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	30,189	USD	3,512	State Street Bank & Trust Company	15/12/2020	47
USD	164	SEK	1,410	State Street Bank & Trust Company	15/12/2020	(3)
						44
合計						6,449,469

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

業種別内訳 2020年11月30日現在

	純資産比率 (%)
政府	86.41
金融	3.41
投資有価証券 - 時価	89.82
その他の純資産	10.18
	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。

ブラックロック・ICS・USTレジャーリー・ファンド
損益計算書

2020年9月30日に終了した会計年度

		2020年	2019年
	注記	千米ドル	千米ドル
営業収益	5	138,139	272,710
金融商品に係る純利益	7	1,450	367
投資収益合計		139,589	273,077
営業費用	6	(26,654)	(18,810)
純営業利益		112,935	254,267
財務費用：			
償還可能投資証券保有者への分配金	8	(109,243)	(238,800)
財務費用合計		(109,243)	(238,800)
純利益		3,692	15,467
償還可能投資証券保有者に帰属する純資産の増加		3,692	15,467

本損益計算書に計上された損益以外で当会計年度に認識された損益はない。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ブラックロック・ICS・USTレジャーリー・ファンド
償還可能投資証券保有者に帰属する純資産変動計算書

2020年9月30日に終了した会計年度

		2020年	2019年
		千米ドル	千米ドル
期首純資産		14,146,140	11,308,849
償還可能投資証券保有者に帰属する純資産の増加		3,692	15,467
投資証券取引：			
償還可能投資証券の発行		153,905,900	83,809,795
償還可能投資証券の買戻		(146,833,759)	(81,072,165)
分配金再投資額		59,337	84,194
投資証券取引による純資産の増加		7,131,478	2,821,824
期末純資産		21,281,310	14,146,140

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・ICS・USTレジャー・ファンド

貸借対照表

2020年9月30日現在

		2020年	2019年
	注記	千米ドル	千米ドル
流動資産			
現金		791,865	377,875
未収金	10	6,207	11,789
損益を通じて公正価値で測定する金融資産	4	20,519,603	13,842,168
流動資産合計		21,317,675	14,231,832
流動負債			
未払金	11	36,365	85,692
流動負債合計		36,365	85,692
償還可能投資証券保有者に帰属する純資産	13	21,281,310	14,146,140

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・ICS・USTレジャー・ファンド

投資有価証券明細表 2020年9月30日現在

保有高	通貨	銘柄	公正価値 (千米ドル)	純資産比率 (%)
債券				
国債(2019年9月30日:38.78%)				
米国(2019年9月30日:38.78%)				
22,760,000	USD	United States of America Bill, 0.00%, 01/12/2020	22,754	0.11
35,570,000	USD	United States of America Bill, 0.00%, 22/12/2020	35,558	0.17
74,655,000	USD	United States of America Bill, 0.00%, 05/01/2021	74,635	0.35
400,000,000	USD	United States of America Bill, 0.00%, 12/01/2021	399,897	1.88
154,315,000	USD	United States of America Bill, 0.00%, 19/01/2021	154,258	0.72
11,460,000	USD	United States of America Bill, 0.00%, 26/01/2021	11,456	0.05
468,535,000	USD	United States of America Bill, 0.00%, 02/02/2021	468,358	2.20
400,000,000	USD	United States of America Bill, 0.00%, 16/02/2021	399,816	1.88
721,940,000	USD	United States of America Bill, 0.00%, 23/02/2021	721,642	3.39
13,405,000	USD	US Treasury, 1.75%, 16/11/2020	13,407	0.06
25,685,000	USD	US Treasury, 2.63%, 16/11/2020	25,716	0.12
114,510,000	USD	US Treasury, 1.63%, 30/11/2020	114,511	0.54
89,655,000	USD	US Treasury, 2.00%, 30/11/2020	89,710	0.42
150,255,000	USD	US Treasury, 2.75%, 30/11/2020	150,722	0.71
23,160,000	USD	US Treasury, 1.75%, 31/12/2020	23,165	0.11
18,070,000	USD	US Treasury, 2.38%, 31/12/2020	18,125	0.09
213,115,000	USD	US Treasury, 2.50%, 31/12/2020	213,571	1.00
11,530,000	USD	US Treasury, 3.63%, 15/02/2021	11,661	0.05
110,000,000	USD	US Treasury, 2.50%, 28/02/2021	110,786	0.52
2,171,000,000	USD	US Treasury, FRN, 0.15%, 31/10/2020	2,170,766	10.20
1,930,000,000	USD	US Treasury, FRN, 0.22%, 31/01/2021	1,929,951	9.07
220,849,700	USD	US Treasury, FRN, 0.24%, 30/04/2021	220,980	1.04
69,865,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 06/10/2020	69,864	0.33
73,220,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 08/10/2020	73,218	0.34
208,360,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 13/10/2020	208,353	0.98
801,190,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 15/10/2020	801,142	3.76
63,540,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 22/10/2020	63,536	0.30
400,000,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 27/10/2020	399,974	1.88
611,120,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 29/10/2020	611,070	2.87
1,585,075,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 03/11/2020	1,584,930	7.45
110,285,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 10/11/2020	110,263	0.52
225,000,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 17/11/2020	224,944	1.06
65,095,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 19/11/2020	65,086	0.31
252,635,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 24/11/2020	252,568	1.19
35,250,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 27/11/2020	35,241	0.17
43,365,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 03/12/2020	43,352	0.20
514,045,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 24/12/2020	513,919	2.41
76,025,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 31/12/2020	75,994	0.36
300,000,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 07/01/2021	299,902	1.41
74,300,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 14/01/2021	74,276	0.35
950,000,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 21/01/2021	949,692	4.46

保有高	通貨	銘柄	公正価値 (千米ドル)	純資産比率 (%)
米国(2019年9月30日:38.78%)(続き)				
94,155,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 28/01/2021	94,109	0.44
250,000,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 04/02/2021	249,908	1.17
160,060,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 11/02/2021	159,989	0.75
150,000,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 25/02/2021	149,890	0.70
125,000,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 18/03/2021	124,936	0.59
176,205,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 25/03/2021	176,052	0.83
144,235,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 20/05/2021	144,087	0.68
54,555,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 15/07/2021	54,488	0.26
74,575,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 12/08/2021	74,484	0.35
47,955,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 09/09/2021	47,891	0.23
米国合計			15,114,603	71.03
国債に対する投資合計			15,114,603	71.03
債券に対する投資合計			15,114,603	71.03

保有高	通貨	取引相手	金利	期日	公正価値 (千米ドル)	純資産比率 (%)
リバースレポ取引 ¹ (2019年9月30日:59.07%)						
フランス(2019年9月30日:0.78%)					-	-
米国(2019年9月30日:58.29%)						
400,000,000	USD	Bank of Nova Scotia	0.07%	01/10/2020	400,000	1.88
1,300,000,000	USD	Barclays	0.06%	01/10/2020	1,300,000	6.11
850,000,000	USD	BNP Paribas	0.06%	01/10/2020	850,000	3.99
325,000,000	USD	BofA Securities	0.06%	01/10/2020	325,000	1.53
150,000,000	USD	BofA Securities	0.06%	01/10/2020	150,000	0.70
70,000,000	USD	Citigroup	0.06%	01/10/2020	70,000	0.33
185,000,000	USD	Credit Agricole	0.06%	01/10/2020	185,000	0.87
500,000,000	USD	Credit Suisse	0.06%	01/10/2020	500,000	2.35
196,078,431	USD	J.P. Morgan	0.08%	01/10/2020	196,078	0.92
148,427,801	USD	J.P. Morgan	0.08%	01/10/2020	148,428	0.70
104,485,294	USD	J.P. Morgan	0.08%	01/10/2020	104,485	0.49
51,009,436	USD	J.P. Morgan	0.08%	01/10/2020	51,009	0.24
500,000,000	USD	Societe Generale	0.06%	01/10/2020	500,000	2.35
540,000,000	USD	TD Securities (USA)	0.06%	01/10/2020	540,000	2.54
84,000,000	USD	Wells Fargo	0.06%	01/10/2020	84,000	0.39
1,000,000	USD	Wells Fargo	0.06%	01/10/2020	1,000	-
米国合計					5,405,000	25.39
リバースレポ取引に対する投資合計					5,405,000	25.39
損益を通じて公正価値で測定する金融資産合計					20,519,603	96.42
現金					791,865	3.72
その他の資産および負債					(30,158)	(0.14)
償還可能投資証券保有者に帰属する純資産					21,281,310	100.00

資産合計額の内訳

	資産合計に 対する割合 (%)
公認の証券取引所に上場されている譲渡可能な有価証券合計	23.89
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	72.37
その他の資産	3.74
資産合計	100.00

¹ 担保として保有する有価証券は5,481,565,000米ドルであった。

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・スタイル・アドバンテージ・ポートフォリオ(円/年1回決算コース)」

資産総額	5,492,237,506円
負債総額	1,908,971円
純資産総額(-)	5,490,328,535円
発行済数量	7,839,959,396口
1 単位当たり純資産額(/)	0.7003円

(参考情報)

「スタイル・アドバンテージ・マザー・ポートフォリオ(円)」

資産総額	5,492,510,340円
負債総額	0円
純資産総額(-)	5,492,510,340円
発行済数量	7,596,455,749口
1 単位当たり純資産額(/)	0.7230円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

1 受益証券の名義書換え等
該当事項はありません。

2 受益者名簿の閉鎖の時期
受益者名簿は作成していません。

3 投資者に対する特典
該当事項はありません。

4 内国投資信託受益証券の譲渡制限の内容
ファンド受益証券の譲渡制限は設けておりません。

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

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

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

の振替について、委託会社は、当該投資者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認め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がって取り扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額等

資本金 3,120百万円

発行する株式の総数 36,000株

発行済株式の総数 15,000株

直近5カ年における主な資本金の額の増減

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

(2) 委託会社の機構

経営の意思決定機構

<株主総会>

株主により構成される会社における最高の意思決定機関として、取締役の選任、利益処分の承認、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)
負債の部		
流動負債		
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
固定負債		
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
純資産の部		
株主資本		
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
評価・換算差額等		
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 繰越利益 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 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>(3) 賞与引当金の計上方法 従業員へ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 役員へ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>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、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> <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) 自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (2) 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして金融商品取引業等に関する内閣府令で定めるものを除きます。)
- (3) 通常の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。)又は子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の委託会社と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引又は金融デリバティブ取引を行なうこと。
- (4) 委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。
- (5) 上記に掲げるもののほか、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして金融商品取引業等に関する内閣府令で定める行為。

5【その他】

定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

変更年月日	変更事項
2007年9月18日	証券業登録に伴う商号変更(「パークレイズ・グローバル・インベスターズ証券投信投資顧問株式会社」に変更)のため、定款変更を行ないました。
2007年9月30日	商号変更(「パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社」に変更)のため、定款変更を行ないました。
2007年9月30日	公告の方法を変更するため、定款変更を行ないました。
2007年12月27日	事業を営むことの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 三井住友信託銀行株式会社
- ・資本金の額 342,037百万円（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
野村證券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500	

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

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

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【その他】

1 交付目論見書の表紙等に、以下の事項を記載します。

(1) 委託会社等の情報

委託会社名

金融商品取引業者登録番号

設立年月日

資本金

当該委託会社が運用する投資信託財産の合計純資産総額

「ファンドの運用の指図を行なう者である。」旨

(2) 受託会社に関する情報

受託会社名および「ファンドの財産の保管および管理を行なう者である。」旨

(3) 詳細情報の入手方法

詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載します。

委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間等

請求目論見書の入手方法および投資信託約款が請求目論見書に添付されている旨

(4) 交付目論見書の使用開始日

(5) 届出の効力に関する事項

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

届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法

届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日

(6) その他の記載事項

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

投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨

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

「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載

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

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

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

独立監査人の監査報告書

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3月3日

ブラックロック・ジャパン株式会社
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

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・スタイル・アドバンテージ・ポートフォリオ（円/年1回決算コース）の2020年1月16日から2021年1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・スタイル・アドバンテージ・ポートフォリオ（円/年1回決算コース）の2021年1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、すべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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に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。

独立監査人の中間監査報告書

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

PwC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

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、「ファンドの経理状況」に掲げられているブラックロック・スタイル・アドバンテージ・ポートフォリオ(円/年1回決算コース)の2021年1月16日から2021年7月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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・スタイル・アドバンテージ・ポートフォリオ(円/年1回決算コース)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中間計算期間(2021年1月16日から2021年7月15日まで)の損益の状況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、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、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。

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、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、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。
- ・ 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、経営者に対して、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

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. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。