

【表紙】

【提出書類】 有価証券報告書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 2022年4月15日

【計算期間】 第5期(自 2021年1月16日 至 2022年1月17日)

【ファンド名】 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)

【発行者名】 ブラックロック・ジャパン株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 有田 浩之

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目8番3号

【事務連絡者氏名】 猪浦 純子

【連絡場所】 東京都千代田区丸の内一丁目8番3号

【電話番号】 03-6703-7940

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

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

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

「ブラックロック・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す。

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・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の獲得を目指します。

◆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います。

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

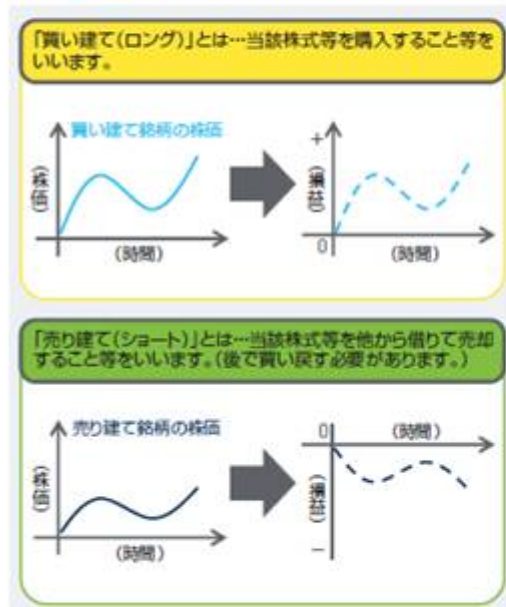
ファンド名	ブラックロック・ストラテジック・ファンズ ブラックロック・スタイル・アドバンテージ・ファンド クラスI投資証券(円建て円ヘッジ)
形態	ルクセンブルグ籍(オープン・エンド型)会社型外国投資証券(円建て円ヘッジ)
投資目的および投資態度	当ファンドは、長期的に市場動向に左右されない絶対収益の追求を目指して運用を行います。 当ファンドは機動的にエクスポージャーを調整することで様々なスタイルファクター戦略からプレミアムを獲得することを目指します。 独自の計量化モデルを用いて銘柄の選定を行い投資目的の達成を目指します。また、バリュー、モメンタム、キャリー、ディフェンシブといったスタイルファ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

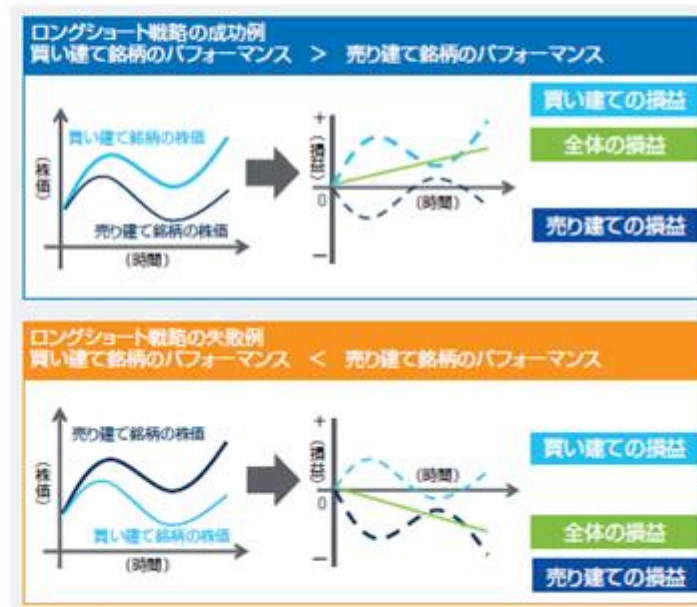
「買い建て」と「売り建て」について

[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。

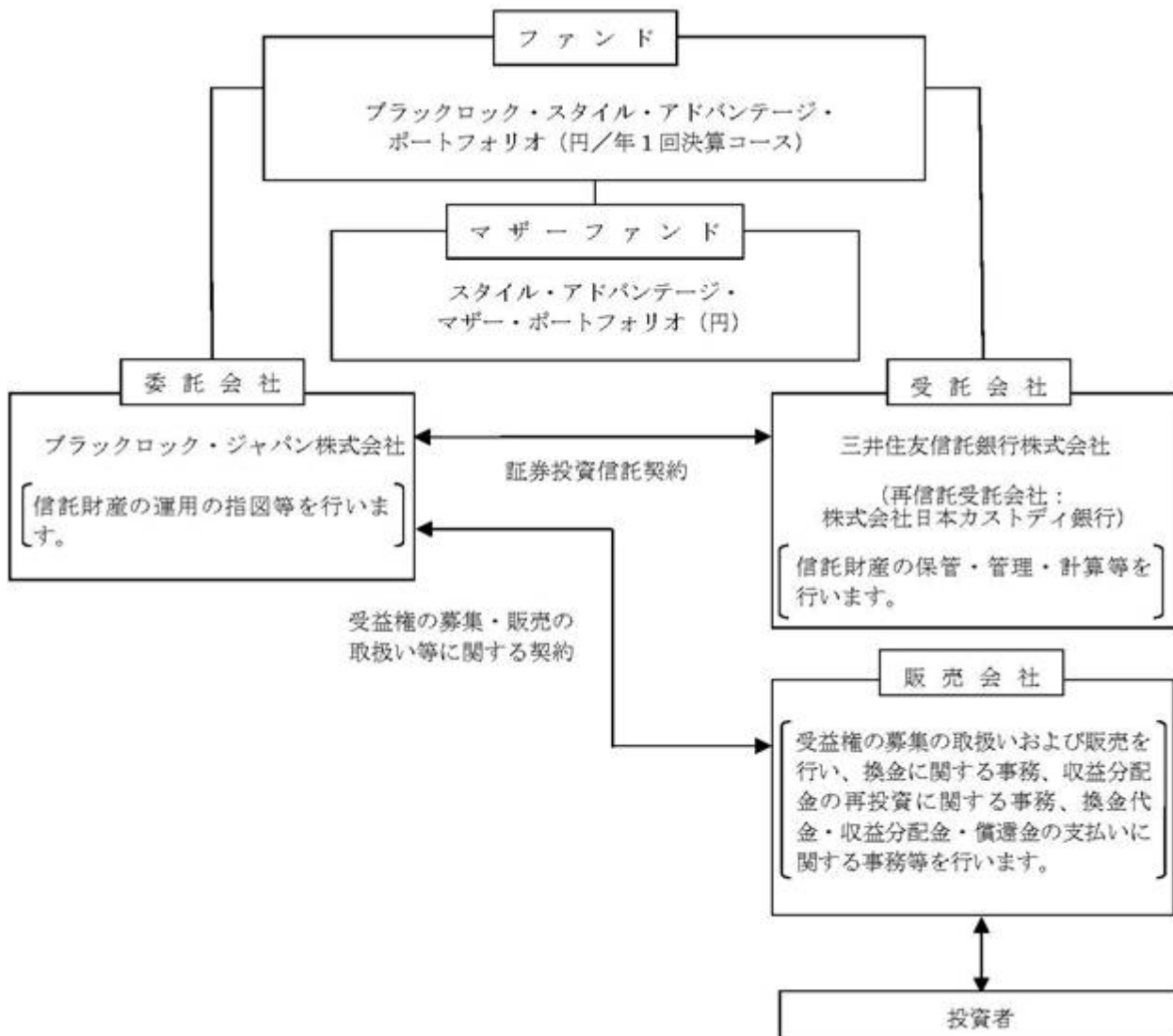
※ロングとショートの双方で損失した場合は、通常想定される以上に当ファンドの運用成果が影響を被る可能性があります。

(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」

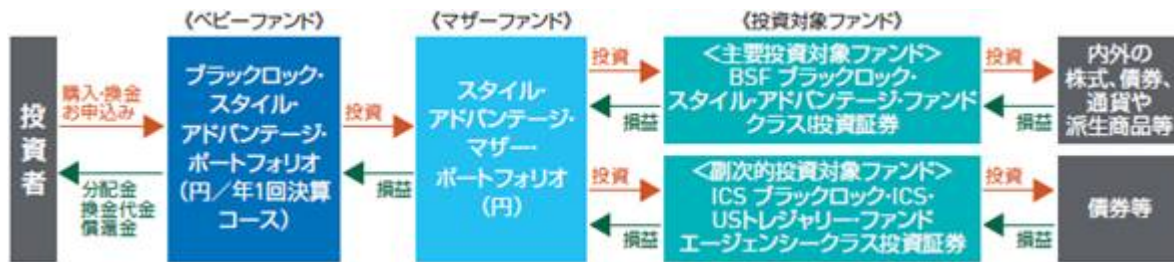
ファンドの設定・運営に関する事項、信託財産の運用・管理に関する事項、委託会社および受託会社の業務に関する事項、投資者に関する事項等について規定しています。

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>

2022年1月末現在の委託会社の概況は、以下のとおりです。

a．資本金 3,120百万円

b．沿革

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

c．大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

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す。

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いまたは行うことがある場合、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す。

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す。

(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す。

投資対象ファンドは、別に定めるブラックロック・グループの運用会社が運用する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す。

(2)【投資対象】

投資対象とする資産の種類

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

- a. 有価証券
- b. 金銭債権(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。独自の定量化モデルを用いて銘柄の選定を行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、キャリア、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す。
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す。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	<ul style="list-style-type: none"> 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）に決算を行います。
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	<ul style="list-style-type: none"> 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）に決算を行います。
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	JPMorgan Chase & Co.、ダブリン支店

(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10兆ドル^{*}（約1,153兆円）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っております。

* 2021年12月末現在。（円換算レートは1ドル=115.155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す。当該売り付けにより増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

b. 時効

投資者が、a.(a)に規定する支払開始日から5年間支払い請求を行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、借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

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

d．借入金の利息は信託財産中より支弁します。

信用リスク集中回避のための投資制限

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

3【投資リスク】

(1) 投資リスク

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

当ファンドにかかる主なリスクは以下の通りです。

基準価額の変動要因

a．ロングショート戦略によるリスク

当ファンドの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せん。

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、主要投資対象ファンドの取引停止、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

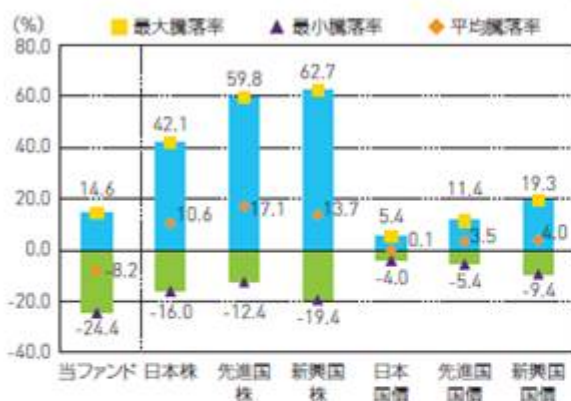
委託会社ではリスク管理を重視しており、独自開発のシステムを用いてリスク管理を行っております。具体的には、運用担当部門から独立したリスク管理担当部門においてファンドの投資リスクおよび流動性リスクの計測・分析、投資・流動性制限のモニタリングなどを行うことにより、ファンドの投資リスク（流動性リスクを含む）が運用方針に合致していることを確認し、その結果を運用担当部門にフィードバックするほか、社内関係者で共有しております。また、委託会社の業務に関するリスクについて社内規程を定めて管理を行っております。

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

(2017年2月～2022年1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

(2017年2月～2022年1月)



※上記グラフは、過去5年間に於ける年間騰落率(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・レディバース・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、日本の株式市場を広くに網羅するとともに、投資対象としての機能性を有する我が国を代表する指数です。東証株価指数(配当込み)の指数値および東証株価指数(配当込み)に係る商標又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数(配当込み)に関するすべての権利・ノウハウおよび東証株価指数(配当込み)に係る商標又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、東証株価指数(配当込み)の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

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・レディバース・ファイド(円ベース)は、J.P.モルガン・セキュリティティーズ・エルエルシーが発表しており、新興国の現地通貨建ての国債を対象として算出した指数です。同指数に関する著作権はJ.P.モルガン・セキュリティティーズ・エルエルシーに帰属しています。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

購入時の申込手数料（以下「購入時手数料」といいます。）は、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った場合はその都度、当該借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

下記の諸費用（以下「諸費用」といいます。）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われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを購入する場合は当該支店等毎に個別元本の算出が行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われます。原則として、申告は不要です。
- また、確定申告を行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)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2022年1月末現在のものですので、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2022年1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	7,564,208,477	100.03
内 日本	7,564,208,477	100.03
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,325,428	0.03
純資産総額	7,561,883,049	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	9,609,004,671	0.7766	7,463,251,071	0.7872	7,564,208,477	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】

2022年1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)
第5期(2022年1月17日)	7,463,918,044	(同左)	0.7495	(同左)
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	
2021年8月末現在	5,557,826,465		0.7108	
2021年9月末現在	5,478,219,489		0.7102	
2021年10月末現在	5,433,112,120		0.7134	
2021年11月末現在	5,427,360,983		0.7284	
2021年12月末現在	7,457,693,571		0.7547	
2022年1月末現在	7,561,883,049		0.7594	

【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	
第5期	

【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
第5期	12.8

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

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第1期	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
第5期	3,971,381,798	2,242,031,337	9,958,511,778

(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	7,470,332,385	98.76
内 ルクセンブルグ	7,395,909,656	97.78
内 アイルランド	74,422,729	0.98
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	93,796,630	1.24
純資産総額	7,564,129,015	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	851,332	8,569.39	7,295,409,839	8,687.44	7,395,909,656	97.78
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	アイルランド	投資証券	6,074	12,250.82	74,421,327	12,251.05	74,422,729	0.98

(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	98.76

(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。

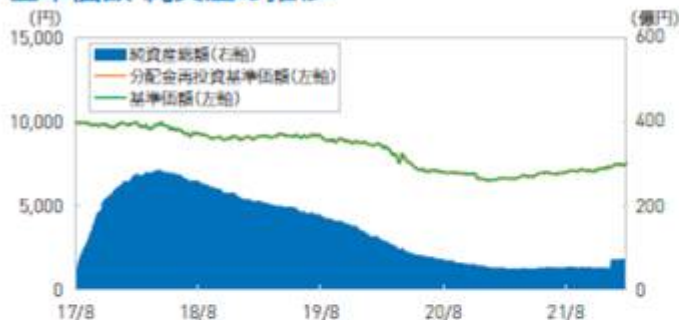
その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考情報)

運用実績

2022年1月末現在

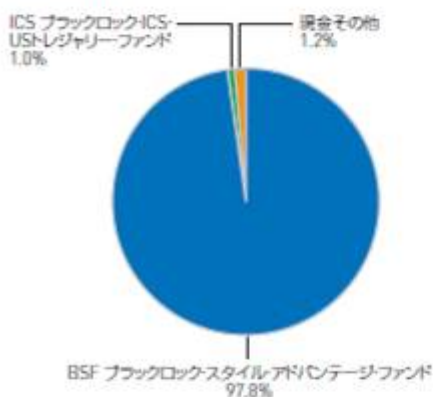
基準価額・純資産の推移

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

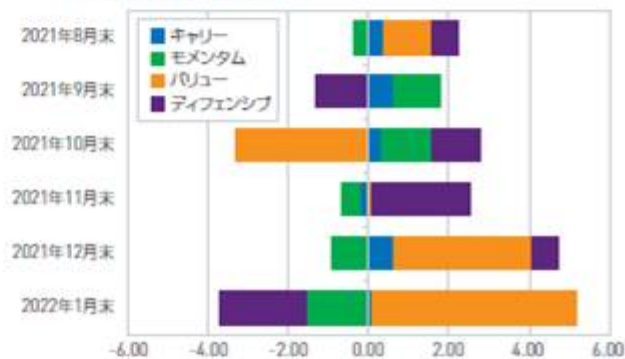
分配の推移

設定来累計		0円
第1期	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
第5期	2022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**

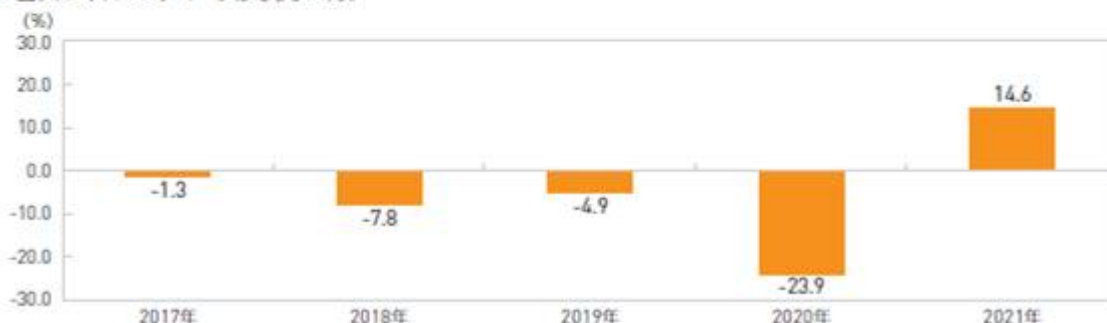
※ 比率はマザーファンドの純資産総額に対する割合です。
 四捨五入の関係で合計が100にならない場合があります。

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として算出しています。
 ※ 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付けません。詳細は販売会社にお問い合わせください。

(5) 購入単位

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、主要投資対象ファンドの取引停止、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、主要投資対象ファンドの取引停止、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。)を行います。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れている投資者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- d . c . の書面決議において、投資者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る投資者としての受託会社を除きます。以下 d . において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている投資者が議決権を行使しないときは、当該知れ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、
- b . 委託会社は、 a . の事項(a . の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあっ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れている投資者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

- c . b . の書面決議において、投資者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る投資者としての受託会社を除きます。以下c . において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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す。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われます。

償還金の支払いは、販売会社において行います。

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5期計算期間(2021年1月16日から2022年1月17日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

(3) 当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行っておりますので、参考情報として「スタイル・アドバンテージ・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。

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4期 (2021年1月15日現在)	第5期 (2022年1月17日現在)
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	5,494,180,747	7,488,651,625
未収入金	10,434,571	11,374
流動資産合計	5,504,615,318	7,488,662,999
資産合計	5,504,615,318	7,488,662,999
負債の部		
流動負債		
未払解約金	10,434,571	11,374
未払受託者報酬	672,786	620,789
未払委託者報酬	23,018,308	21,238,946
その他未払費用	3,059,097	2,873,846
流動負債合計	37,184,762	24,744,955
負債合計	37,184,762	24,744,955
純資産の部		
元本等		
元本	8,229,161,317	9,958,511,778
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2,761,730,761	2,494,593,734
(分配準備積立金)	-	-
元本等合計	5,467,430,556	7,463,918,044
純資産合計	5,467,430,556	7,463,918,044
負債純資産合計	5,504,615,318	7,488,662,999

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第4期 (自2020年1月16日 至2021年1月15日)	第5期 (自2021年1月16日 至2022年1月17日)
営業収益		
有価証券売買等損益	2,320,519,005	737,611,199
営業収益合計	2,320,519,005	737,611,199
営業費用		
受託者報酬	1,684,254	1,176,215
委託者報酬	57,622,381	40,241,738
その他費用	5,915,929	5,797,298
営業費用合計	65,222,564	47,215,251
営業利益又は営業損失()	2,385,741,569	690,395,948
経常利益又は経常損失()	2,385,741,569	690,395,948
当期純利益又は当期純損失()	2,385,741,569	690,395,948
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()	728,741,422	77,711,314
期首剰余金又は期首欠損金()	1,994,962,383	2,761,730,761
剰余金増加額又は欠損金減少額	890,287,199	743,971,598
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	890,287,199	743,971,598
剰余金減少額又は欠損金増加額	55,430	1,089,519,205
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	55,430	1,089,519,205
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金()	2,761,730,761	2,494,593,734

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法

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

2 収益及び費用の計上基準

有価証券売買等損益の計上基準

約定日基準で計上しております。

3 その他財務諸表作成のための基礎となる事項

計算期間末日の取扱い

第5期計算期間は当計算期間末が休業日であったため、2021年1月16日から2022年1月17日までとなっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	第4期 (2021年1月15日現在)	第5期 (2022年1月17日現在)
1 当該計算期間の末日における受益権総数	8,229,161,317口	9,958,511,778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 2,761,730,761円	元本の欠損 2,494,593,734円
3 1口当たり純資産額	0.6644円	0.7495円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第4期 (自 2020年1月16日 至 2021年1月15日)	第5期 (自 2021年1月16日 至 2022年1月17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4期 (2021年1月15日現在)	第5期 (2022年1月17日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左
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。	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
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。	3 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 同左
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。	4 金銭債権の計算期間末日後の償還予定額 同左

(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4期 (2021年1月15日現在)	第5期 (2022年1月17日現在)
期首元本額	14,860,885,292円	8,229,161,317円
期中追加設定元本額	186,127円	3,971,381,798円
期中一部解約元本額	6,631,910,102円	2,242,031,337円

2 有価証券関係

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

第5期(2022年1月17日現在)

売買目的有価証券

種類	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	654,421,335
合計	654,421,335

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)	9,641,626,916	7,488,651,625	
親投資信託受益証券 合計		9,641,626,916	7,488,651,625	
合計		9,641,626,916	7,488,651,625	

(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2022年1月17日現在(以下「計算日」という)の状況は次の通りであります。

なお、以下に記載した情報は監査意見の対象外であります。

「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	(2022年1月17日現在)
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	119,334,700
投資証券	7,369,122,023
派生商品評価勘定	558,477
流動資産合計	7,489,015,200
資産合計	7,489,015,200
負債の部	
流動負債	
未払解約金	11,374
流動負債合計	11,374
負債合計	11,374
純資産の部	
元本等	
元本	9,641,626,916
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,152,623,090
元本等合計	7,489,003,826
純資産合計	7,489,003,826
負債純資産合計	7,489,015,200

(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礎となる事項

外貨建資産等の会計処理

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年1月17日現在)
1 当該計算日における受益権総数	9,641,626,916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 2,152,623,090円
3 1口当たり純資産額	0.7767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

(2022年1月17日現在)

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

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

(2022年1月17日現在)	
同計算期間の期首元本額	8,045,366,448円
同計算期間中の追加設定元本額	3,838,206,156円
同計算期間中の一部解約元本額	2,241,945,688円
同計算期間末日の元本額	9,641,626,916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）	9,641,626,916円
合計	9,641,626,916円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	(2022年1月17日現在)
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	693,962,237
合計	693,962,237

(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	(2022年1月17日現在)			
		契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 アメリカドル	74,175,340	-	73,616,863	558,477
合計		74,175,340	-	73,616,863	558,477

(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	851,332	7,295,409,839	
	日本円	小計	851,332	7,295,409,839	
	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・USト レジャーリー・ファンド エージェンシークラ ス投資証券	6,074.800	644,675.390	
	アメリカドル	小計	6,074.800	644,675.390 (73,712,184)	
投資証券	合計		7,369,122,023 (73,712,184)		
合計			7,369,122,023 (73,712,184)		

(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

該当事項はデリバティブ取引関係の注記事項として記載しております。

(参考情報)

当ファンドは、「ブラックロック・ストラテジック・ファンズ ブラックロック・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、2021年5月31日に終了する計算期間(2020年6月1日から2021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2021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、2021年3月31日に終了する中間計算期間(2020年10月1日から2021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2021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 2021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		130,934,980
未実現評価益		7,375
投資有価証券 - 時価	2 (a)	130,942,355
銀行預金	2 (a)	22,798,017
ブローカーに対する債権	15	19,391,364
未収利息および未収配当金	2 (a)、2 (d)	872,445
売却投資有価証券未収金	2 (a)、2 (d)	7,540,074
販売投資証券未収金	2 (a)	18,226
以下に係る未実現純評価益：		
先物取引	2 (d)	2,532,175
未決済先渡為替予約	2 (d)	13,318,070
差金決済契約	2 (d)	5,388,111
スワップの時価	2 (d)	4,054,732
資産合計		206,855,569
負債		
ブローカーに対する債務	15	5,675,884
未払利息および未払配当金	2 (a)、2 (d)	105,862
購入投資有価証券未払金	2 (a)、2 (d)	5,685,432
買戻し投資証券未払金	2 (a)	9,581
以下に係る未実現純評価損：		
先物取引	2 (d)	2,405,667
未決済先渡為替予約	2 (d)	8,968,163
差金決済契約	2 (d)	5,984,881
スワップの時価	2 (d)	949,211
未払費用およびその他の負債	2 (a)、4、5、 6、7、8	920,277
負債合計		30,704,958
純資産合計		176,150,611

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 2021年5月31日現在

	通貨	ブラックロック・スタイル・アドバンテージ・ファンド		
		2021年 5月31日現在	2020年 5月31日現在	2019年 5月31日現在
純資産合計	米ドル	176,150,611	2,150,166,004	3,245,426,903
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	83.40	86.16	106.29
クラスAユーロ・ヘッジ分配型投資証券	ユーロ	75.62	78.78	99.40
クラスA無分配投資証券	米ドル	82.07	84.79	104.62
クラスAユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	66.82	69.57	87.87
クラスAスウェーデン・クロースウェーデン・ナ・ヘッジ無分配投資証券	クローナ	68.74	71.25	89.53
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	68.93	71.55	89.83
クラスD無分配投資証券(ユーロ)	ユーロ	77.56	87.23	106.55
クラスD無分配英国報告型投資証券	米ドル	85.52	87.73	107.43
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	77.10	79.82	100.01
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	74.14	76.20	94.37
クラスE無分配投資証券(ユーロ)	ユーロ	73.07	83.25	102.91
クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	72.91	76.34	96.82
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	71.19	73.69	92.11
クラスIユーロ・ヘッジPF無分配投資証券	ユーロ	78.66	81.13	101.38
クラスIブラジル・リアル・ヘッジ無分配投資証券	米ドル	52.21	50.61	83.34
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	69.47	71.90	90.29
クラスI無分配英国報告型投資証券	米ドル	76.09	77.97	95.35
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	77.84	80.42	100.61
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	74.20	76.24	94.73
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	7,918.17	8,162.20	10,175.36
クラスX無分配投資証券	米ドル	89.48	91.12	110.60
クラスX豪ドル・ヘッジ無分配投資証券 ⁽¹⁾	豪ドル	89.80	91.81	111.75
クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	73.46	75.30	93.42
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	90.03	91.00	110.98
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	87.26	86.47	106.63
クラスZ無分配投資証券	米ドル	86.16	88.28	107.92
クラスZユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	77.84	80.39	100.55

(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 2021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		2,150,166,004
収益		
預金利息	2 (c)	14,194
債券利息	2 (c)	3,720,014
差金決済契約に係る受取利息	2 (c)、2 (d)	35,715
スワップに係る受取利息および受取配当金	2 (c)	375,886
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)	21,156,332
収益合計		25,302,141
費用		
銀行利息	2 (c)	641,001
差金決済契約に係る支払利息	2 (c)、2 (d)	6,472,457
スワップに係る支払利息および支払配当金	2 (c)	122,550
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)	21,166,966
年間サービス費用	5	455,300
預託報酬	2 (i)、6	637,429
税金	8	66,972
販売報酬	4	3,125
ローン・コミットメント・フィー	14	1,730
投資運用報酬および投資運用再委託報酬	4	1,861,029
費用合計		31,428,559
投資純損失		(6,126,418)
以下に係る実現純利益 / (損失) :		
投資有価証券	2 (a)、2 (b)	1,840,542
差金決済契約	2 (d)	(89,258,511)
先物取引	2 (d)	(65,503,041)
外貨および先渡為替予約	2 (d)、2 (e)、2 (j)	153,213,696
スワップ取引	2 (d)	39,702,418
当期実現純利益		39,995,104
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)	(1,094,930)
差金決済契約	2 (d)	(5,165,707)
先物取引	2 (d)	25,494,397
外貨および先渡為替予約	2 (d)、2 (e)、2 (j)	(26,468,905)
スワップ取引	2 (d)	6,827,999
当期末実現評価益 / (損) の純変動		(407,146)
運用成績による純資産の増加		33,461,540
資本の変動		
投資証券発行による正味受取額		14,633,315
投資証券買戻しによる正味支払額		(2,022,110,248)
資本の変動による純資産の減少		(2,007,476,933)
期末純資産		176,150,611

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 2021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	152	360	49	463
クラスAユーロ・ヘッジ分配型投資証券	1,857	216	304	1,769
クラスA無分配投資証券	8,637	2,220	5,998	4,859
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・クローナ・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	13,114	55,907	11,477
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	9,225	1,008,859	29,800
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	317	1,355	2,680
クラスE無分配投資証券(ユーロ)	6,901	3,607	6,944	3,564
クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券	3,165	207	1,497	1,875
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	12,665	2,601
クラスIブラジル・リアル・ヘッジ無分配投資証 券	50,186	-	50,136	50
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	390,376	467,037
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	32,452	1,991,189	145,625
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	26,950	1,543,371	161,198
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	-	726,593	1,135,933
クラスX無分配投資証券	571,186	346	570,873	659
クラスX豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	17,141,879	97,839	16,891,579	348,139
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	-	3,038,555	35
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 2021年5月31日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
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			
債券			
ドイツ			
USD 9,000,000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2.50% 15/2/2022	9,150,595	5.20
		9,150,595	5.20
国際機関 (Supranational)			
USD 16,000,000	African Development Bank 1.25% 26/7/2021	16,028,226	9.10
USD 15,000,000	Asian Development Bank 1.75% 8/6/2021	15,003,787	8.52
USD 16,000,000	European Investment Bank 2.25% 15/3/2022	16,274,263	9.24
USD 8,000,000	Inter-American Development Bank 1.75% 14/4/2022	8,113,627	4.60
USD 16,500,000	International Bank for Reconstruction & Development 2.125% 1/7/2022	16,855,322	9.57
		72,275,225	41.03
米国			
USD 5,000,000	United States Treasury Bill 17/6/2021 (Zero Coupon)	4,999,766	2.84
USD 34,000	United States Treasury Bill 15/7/2021 (Zero Coupon)	33,997	0.02
USD 9,000,000	United States Treasury Bill 7/10/2021 (Zero Coupon)	8,996,672	5.11
USD 10,000,000	United States Treasury Bill 2/12/2021 (Zero Coupon)	9,996,243	5.67
USD 14,500,000	United States Treasury Bill 24/2/2022 (Zero Coupon)	14,494,132	8.23
USD 5,000,000	United States Treasury Bill 24/3/2022 (Zero Coupon)	4,998,047	2.84
USD 6,000,000	United States Treasury Bill 21/4/2022 (Zero Coupon)	5,997,678	3.40
		49,516,535	28.11
債券合計		130,942,355	74.34
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		130,942,355	74.34
投資有価証券(時価)合計		130,942,355	74.34
その他の純資産		45,208,256	25.66
純資産合計(米ドル)		176,150,611	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。

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
金融デリバティブ商品			
差金決済契約			
	オーストラリア		
(160)	Afterpay Ltd	Barclays Bank	(110)
(843)	Afterpay Ltd	Deutsche Bank	(4,123)
(2,380)	Afterpay Ltd	Goldman Sachs	(11,641)
(136)	Afterpay Ltd	HSBC	497
(160,490)	AMP Ltd	HSBC	-
1,445	Ampol Ltd	Deutsche Bank	1,163
(5,603)	APA Group (Unit)	Deutsche Bank	338
837	Aristocrat Leisure Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,380
2,303	Aristocrat Leisure Ltd	Citibank	624
1,227	Aristocrat Leisure Ltd	Credit Suisse	2,896
3,641	Aristocrat Leisure Ltd	Deutsche Bank	6,002
7,949	Aristocrat Leisure Ltd	Goldman Sachs	13,104
844	Aristocrat Leisure Ltd	HSBC	1,992
581	ASX Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,079
150	ASX Ltd	Barclays Bank	224
384	ASX Ltd	Credit Suisse	1,290
650	ASX Ltd	Goldman Sachs	1,207
34,293	Aurizon Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	-
23,419	Aurizon Holdings Ltd	Barclays Bank	1,269
27,555	Aurizon Holdings Ltd	Credit Suisse	(1,706)
24,796	Aurizon Holdings Ltd	Deutsche Bank	-
38,593	Aurizon Holdings Ltd	Goldman Sachs	-
13,941	Aurizon Holdings Ltd	HSBC	(863)
22,402	Aurizon Holdings Ltd	JP Morgan	(1,387)
(32,257)	AusNet Services Ltd	Deutsche Bank	405
(13,502)	AusNet Services Ltd	Goldman Sachs	366
(527)	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	Barclays Bank	(224)
(2,713)	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	Deutsche Bank	(2,940)
(2,373)	BlueScope Steel Ltd	Barclays Bank	(2,498)
(1,675)	BlueScope Steel Ltd	Goldman Sachs	389
5,781	Brambles Ltd	Bank of America Merrill Lynch	805
6,423	Brambles Ltd	Barclays Bank	693
4,733	Brambles Ltd	Citibank	608
9,367	Brambles Ltd	Credit Suisse	1,667
43,710	Brambles Ltd	Deutsche Bank	6,268
29,135	Brambles Ltd	Goldman Sachs	4,059
5,284	Brambles Ltd	HSBC	941
(13,476)	CIMIC Group Ltd	Barclays Bank	1,356
(3,914)	CIMIC Group Ltd	Goldman Sachs	(1,333)
(2,709)	CIMIC Group Ltd	HSBC	(3,711)
607	Cochlear Ltd	Barclays Bank	2,978
(2,624)	Coles Group Ltd	Deutsche Bank	(487)
(1,598)	Commonwealth Bank of Australia	Deutsche Bank	(2,387)

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)		
(1,192)	Computershare Ltd	Deutsche Bank	(747)
(11,195)	Crown Resorts Ltd	Barclays Bank	227
(20,903)	Crown Resorts Ltd	Deutsche Bank	4,165
(1,314)	Crown Resorts Ltd	JP Morgan	122
(48)	CSL Ltd	Barclays Bank	(35)
(449)	CSL Ltd	Deutsche Bank	(4,740)
(209)	CSL Ltd	Goldman Sachs	(2,206)
(1)	Deterra Royalties Ltd	Bank of America Merrill Lynch	-
(31,315)	Evolution Mining Ltd	Deutsche Bank	(5,439)
(2,520)	Evolution Mining Ltd	Goldman Sachs	(129)
(885)	Fortescue Metals Group Ltd	Barclays Bank	(712)
(3,149)	Fortescue Metals Group Ltd	Deutsche Bank	(1,736)
(7,474)	Fortescue Metals Group Ltd	Goldman Sachs	3,876
(972)	Fortescue Metals Group Ltd	HSBC	(415)
(2)	Iluka Resources Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1
(99,359)	Insurance Australia Group Ltd	Barclays Bank	(10,766)
6,565	James Hardie Industries Plc - CDI	Barclays Bank	2,620
299	James Hardie Industries Plc - CDI	Citibank	391
5,491	James Hardie Industries Plc - CDI	Deutsche Bank	6,961
4,965	James Hardie Industries Plc - CDI	Goldman Sachs	3,420
(13,997)	Lendlease Corp Ltd (Unit)	Goldman Sachs	(3,683)
(173)	Macquarie Group Ltd	Deutsche Bank	(179)
(878)	Magellan Financial Group Ltd	Deutsche Bank	(1,223)
(319)	Magellan Financial Group Ltd	HSBC	(220)
(70,739)	Medibank Pvt Ltd	Goldman Sachs	(8,212)
(1,012)	National Australia Bank Ltd	Barclays Bank	(235)
(7,627)	National Australia Bank Ltd	Deutsche Bank	(5,313)
(1,355)	Newcrest Mining Ltd	Deutsche Bank	(237)
(9,291)	Newcrest Mining Ltd	Goldman Sachs	216
(16,722)	Northern Star Resources Ltd	Deutsche Bank	(5,302)
(7,716)	Northern Star Resources Ltd	Goldman Sachs	(2,866)
(3,204)	Northern Star Resources Ltd	JP Morgan	(893)
(28,642)	Oil Search Ltd	Goldman Sachs	4,655
(6,662)	Orica Ltd	Credit Suisse	1,959
(27,071)	Orica Ltd	Deutsche Bank	12,361
(6,055)	Orica Ltd	Goldman Sachs	2,765
(6,853)	Qantas Airways Ltd	Deutsche Bank	(849)
(5,100)	QBE Insurance Group Ltd	HSBC	(1,066)
(5,172)	Ramsay Health Care Ltd	Barclays Bank	2,682
199	REA Group Ltd	Barclays Bank	1,305
3,257	REA Group Ltd	Goldman Sachs	35,215
992	Rio Tinto Ltd	Barclays Bank	3,248
(3,018)	Santos Ltd	Barclays Bank	(70)
(9,578)	Santos Ltd	Deutsche Bank	2,298
(2,646)	Santos Ltd	Goldman Sachs	635

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)		
(6,177)	SEEK Ltd	Barclays Bank	(8,127)
3,841	Sonic Healthcare Ltd	Barclays Bank	1,486
354	Sonic Healthcare Ltd	Deutsche Bank	(85)
594	Sonic Healthcare Ltd	Goldman Sachs	(143)
22,960	Suncorp Group Ltd	Barclays Bank	7,996
(21,723)	Sydney Airport (Unit)	Bank of America Merrill Lynch	(1,681)
(40,765)	Sydney Airport (Unit)	Barclays Bank	(3,430)
(6,489)	Sydney Airport (Unit)	Deutsche Bank	(453)
(3,090)	Sydney Airport (Unit)	Goldman Sachs	(226)
11,548	Tabcorp Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	268
11,536	Tabcorp Holdings Ltd	Barclays Bank	982
61,214	Tabcorp Holdings Ltd	Citibank	5,211
21,476	Tabcorp Holdings Ltd	Credit Suisse	(665)
16,046	Tabcorp Holdings Ltd	Deutsche Bank	373
27,840	Tabcorp Holdings Ltd	HSBC	(862)
24,299	Tabcorp Holdings Ltd	JP Morgan	(752)
23,066	Telstra Corp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,607
4,817	Telstra Corp Ltd	Credit Suisse	112
43,339	Telstra Corp Ltd	Deutsche Bank	3,019
13,146	Telstra Corp Ltd	Goldman Sachs	916
19,678	Telstra Corp Ltd	HSBC	457
(16,585)	TPG Telecom Ltd	Barclays Bank	(3,851)
(38,853)	TPG Telecom Ltd	Deutsche Bank	(4,596)
(14,684)	TPG Telecom Ltd	Goldman Sachs	(320)
(45,731)	Transurban Group (Unit)	Bank of America Merrill Lynch	7,787
(1,358)	Transurban Group (Unit)	Barclays Bank	(192)
(14,498)	Transurban Group (Unit)	Deutsche Bank	2,058
(1,720)	Transurban Group (Unit)	Goldman Sachs	293
(8,886)	Treasury Wine Estates Ltd	Goldman Sachs	(3,783)
243	Wesfarmers Ltd	Deutsche Bank	246
14,138	Wesfarmers Ltd	Goldman Sachs	14,334
(9,996)	Westpac Banking Corp	Credit Suisse	-
(10,428)	Westpac Banking Corp	Deutsche Bank	(8,797)
(3,037)	Westpac Banking Corp	Goldman Sachs	(2,562)
(4,297)	WiseTech Global Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(8,314)
(1,497)	Woodside Petroleum Ltd	Deutsche Bank	823
(971)	Woolworths Group Ltd	Barclays Bank	(15)
(927)	Woolworths Group Ltd	Deutsche Bank	(839)
(857)	Xero Ltd	Deutsche Bank	(3,131)
(208)	Xero Ltd	Goldman Sachs	(651)
(189)	Xero Ltd	JP Morgan	(460)
			46,072
	オーストリア		
(281)	Erste Group Bank AG	Bank of America Merrill Lynch	(34)
(429)	Erste Group Bank AG	Goldman Sachs	(52)

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)		
(316)	Erste Group Bank AG	JP Morgan	(891)
3,064	OMV AG	Citibank	2,917
724	OMV AG	Deutsche Bank	733
14,503	Raiffeisen Bank International AG	Deutsche Bank	(2,832)
(1,262)	Verbund AG	Barclays Bank	462
(113)	Verbund AG	Deutsche Bank	37
1,300	voestalpine AG	Barclays Bank	1,713
2,199	voestalpine AG	Deutsche Bank	(319)
			<u>1,734</u>
	ベルギー		
416	Ageas SA	Deutsche Bank	457
214	Anheuser-Busch InBev SA	Barclays Bank	(127)
(897)	Argenx SE	Barclays Bank	(8,210)
(5,795)	Elia Group SA	Deutsche Bank	12,436
727	Etablissements Franz Colruyt NV	Bank of America Merrill Lynch	(896)
740	Etablissements Franz Colruyt NV	Barclays Bank	(587)
584	Etablissements Franz Colruyt NV	Deutsche Bank	(720)
(156)	Groupe Bruxelles Lambert SA	Bank of America Merrill Lynch	(430)
(1)	Groupe Bruxelles Lambert SA	Credit Suisse	(2)
(1,089)	Groupe Bruxelles Lambert SA	Deutsche Bank	(3,004)
558	KBC Group NV	Deutsche Bank	(667)
24,610	Proximus SADP	Deutsche Bank	(17,119)
(235)	Solvay SA	Deutsche Bank	215
107	UCB SA	Barclays Bank	(118)
1,538	UCB SA	Deutsche Bank	(4,918)
167	UCB SA	Goldman Sachs	(534)
238	UCB SA	HSBC	163
(272)	Umicore SA	Barclays Bank	428
(4,509)	Umicore SA	Deutsche Bank	4,512
			<u>(19,121)</u>
	カナダ		
(2,994)	Agnico Eagle Mines Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3,940
(708)	Agnico Eagle Mines Ltd	Citibank	404
(2,570)	Air Canada	Bank of America Merrill Lynch	(3,744)
(911)	Air Canada	Goldman Sachs	(1,327)
(1,206)	Air Canada	JP Morgan	(2,286)
(17,041)	Algonquin Power & Utilities Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,268)
(1,243)	Algonquin Power & Utilities Corp	Citibank	93
(2,615)	Algonquin Power & Utilities Corp	Goldman Sachs	(411)
(6,410)	Algonquin Power & Utilities Corp	HSBC	3,449
4,532	AltaGas Ltd	Goldman Sachs	1,425
4,220	AltaGas Ltd	HSBC	(768)
1,543	Atco Ltd ' I '	Bank of America Merrill Lynch	(64)
586	Atco Ltd ' I '	Citibank	-
3,935	Atco Ltd ' I '	Goldman Sachs	(163)

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)		
602	Atco Ltd 'I'	JP Morgan	623
179,439	B2Gold Corp	Goldman Sachs	(35,646)
(7,732)	Ballard Power Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(19,089)
(718)	Ballard Power Systems Inc	Credit Suisse	(2,199)
(934)	Ballard Power Systems Inc	HSBC	(2,860)
3,240	Bank of Montreal	Bank of America Merrill Lynch	13,988
519	Bank of Montreal	Citibank	1,491
163	Bank of Montreal	Goldman Sachs	749
529	Bank of Montreal	JP Morgan	3,289
2,210	Bank of Nova Scotia	Bank of America Merrill Lynch	3,783
318	Bank of Nova Scotia	Goldman Sachs	405
227	Bank of Nova Scotia	JP Morgan	289
(5,890)	Bausch Health Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	(15,162)
(431)	Bausch Health Cos Inc	Citibank	(314)
(525)	BCE Inc	Bank of America Merrill Lynch	(435)
2,696	BlackBerry Ltd	Citibank	4,642
(2,991)	Brookfield Asset Management Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(5,273)
(288)	Brookfield Asset Management Inc 'A'	Citibank	(346)
(2,358)	Brookfield Asset Management Inc 'A'	Credit Suisse	(10,286)
(327)	Brookfield Asset Management Inc 'A'	HSBC	(1,426)
(2,290)	Brookfield Renewable Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(2,866)
(630)	Brookfield Renewable Corp 'A'	Credit Suisse	(1,355)
(532)	Brookfield Renewable Corp 'A'	Goldman Sachs	(1,488)
(2,049)	Brookfield Renewable Corp 'A'	JP Morgan	(6,852)
(2,380)	CAE Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,093)
(5,990)	Cameco Corp	Bank of America Merrill Lynch	446
(1,342)	Cameco Corp	Citibank	(1,266)
(3,223)	Cameco Corp	Goldman Sachs	240
(1,382)	Cameco Corp	HSBC	(755)
(404)	Canadian Apartment Properties REIT (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	836
438	Canadian Imperial Bank of Commerce	Bank of America Merrill Lynch	3,444
298	Canadian Imperial Bank of Commerce	Citibank	1,766
518	Canadian Imperial Bank of Commerce	Credit Suisse	5,136
3,259	Canadian Imperial Bank of Commerce	Goldman Sachs	25,626
470	Canadian Imperial Bank of Commerce	HSBC	4,661
1,110	Canadian National Railway Co	Bank of America Merrill Lynch	4,998
904	Canadian National Railway Co	Citibank	6,869
38	Canadian National Railway Co	Goldman Sachs	171
137	Canadian National Railway Co	JP Morgan	(45)
(466)	Canadian Pacific Railway Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(197)
(172)	Canadian Pacific Railway Ltd	Citibank	38
433	Canadian Tire Corp Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,989)
1,009	Canadian Tire Corp Ltd 'A'	Citibank	67
497	Canadian Tire Corp Ltd 'A'	Credit Suisse	3,332
293	Canadian Tire Corp Ltd 'A'	Goldman Sachs	(1,346)

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)		
382	Canadian Tire Corp Ltd 'A'	HSBC	2,561
200	Canadian Tire Corp Ltd 'A'	JP Morgan	1,341
(15,296)	Canadian Utilities Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	3,798
(906)	Canadian Utilities Ltd 'A'	Goldman Sachs	225
353	CCL Industries Inc 'B'	Credit Suisse	(622)
578	CGI Inc	Bank of America Merrill Lynch	(256)
274	CGI Inc	Goldman Sachs	(90)
263	CGI Inc	HSBC	(62)
125	CGI Inc	JP Morgan	(85)
33	Constellation Software Inc	Bank of America Merrill Lynch	(327)
34	Constellation Software Inc	Credit Suisse	(852)
373	Constellation Software Inc	Goldman Sachs	4,671
16	Constellation Software Inc	JP Morgan	(140)
(7,121)	Dollarama Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,799
(277)	Dollarama Inc	Citibank	177
(1,431)	Dollarama Inc	Credit Suisse	1,139
(1,052)	Dollarama Inc	Goldman Sachs	409
400	Empire Co Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	377
10,811	Empire Co Ltd 'A'	Goldman Sachs	10,201
(2,291)	Enbridge Inc	Bank of America Merrill Lynch	910
(1,617)	Enbridge Inc	Credit Suisse	2,797
(2,420)	Enbridge Inc	Goldman Sachs	961
(148)	Fairfax Financial Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	728
(1,520)	First Quantum Minerals Ltd	Bank of America Merrill Lynch	881
(1,216)	First Quantum Minerals Ltd	Citibank	(2,416)
(4,097)	First Quantum Minerals Ltd	Credit Suisse	7,393
(788)	FirstService Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4,050)
(157)	FirstService Corp	Citibank	(220)
(319)	FirstService Corp	HSBC	(40)
(9,887)	Fortis Inc	Bank of America Merrill Lynch	(492)
(1,209)	Fortis Inc	Citibank	115
(362)	Fortis Inc	Credit Suisse	55
(9,826)	Fortis Inc	Goldman Sachs	(2,074)
(7,386)	Fortis Inc	JP Morgan	(80)
(144)	Franco-Nevada Corp	Bank of America Merrill Lynch	39
5,004	George Weston Ltd	Bank of America Merrill Lynch	13,668
739	George Weston Ltd	HSBC	2,275
(3,999)	GFL Environmental Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,803)
(1,413)	GFL Environmental Inc	Citibank	(199)
(1,599)	GFL Environmental Inc	Goldman Sachs	(1,407)
(8,258)	GFL Environmental Inc	HSBC	(5,058)
(206)	GFL Environmental Inc	JP Morgan	(126)
1,365	Gildan Activewear Inc	Bank of America Merrill Lynch	816
596	Gildan Activewear Inc	Citibank	577
2,362	Gildan Activewear Inc	Goldman Sachs	(137)

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)		
651	Gildan Activewear Inc	HSBC	(38)
842	Gildan Activewear Inc	JP Morgan	56
(328)	Great-West Lifeco Inc	Bank of America Merrill Lynch	(170)
20,302	Hydro One Ltd	Goldman Sachs	14,284
19,743	Hydro One Ltd	HSBC	7,844
2,792	iA Financial Corp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,668)
693	iA Financial Corp Inc	Citibank	(459)
(5,748)	IGM Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,522
1,601	Intact Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	6,467
(16,464)	Inter Pipeline Ltd	Goldman Sachs	4,770
(1,037)	Keyera Corp	Bank of America Merrill Lynch	386
37,556	Kinross Gold Corp	Bank of America Merrill Lynch	(6,839)
(4,385)	Kirkland Lake Gold Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,003
(2,195)	Kirkland Lake Gold Ltd	Goldman Sachs	601
(709)	Kirkland Lake Gold Ltd	HSBC	(1,678)
4,743	Loblaw Cos Ltd	Bank of America Merrill Lynch	7,420
(1,948)	Lundin Mining Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,032
798	Magna International Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,730
678	Magna International Inc	Goldman Sachs	(308)
8,855	Manulife Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,932)
5,863	Manulife Financial Corp	Citibank	2,329
(11,669)	Metro Inc	Goldman Sachs	(4,733)
1,138	National Bank of Canada	Bank of America Merrill Lynch	1,403
254	National Bank of Canada	Citibank	(10)
2,345	National Bank of Canada	Goldman Sachs	2,892
682	National Bank of Canada	HSBC	2,004
(3,313)	Northland Power Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,410)
(530)	Northland Power Inc	Citibank	(254)
(1,729)	Northland Power Inc	Credit Suisse	(2,247)
(3,502)	Northland Power Inc	Goldman Sachs	(6,870)
(379)	Northland Power Inc	HSBC	(492)
(1,053)	Northland Power Inc	JP Morgan	(1,368)
193	Nutrien Ltd	Bank of America Merrill Lynch	192
477	Nutrien Ltd	Credit Suisse	118
1,951	Nutrien Ltd	Goldman Sachs	1,938
718	Nutrien Ltd	HSBC	178
168	Onex Corp	Bank of America Merrill Lynch	217
157	Onex Corp	Citibank	234
1,822	Onex Corp	Goldman Sachs	2,353
786	Onex Corp	HSBC	3,032
5,902	Open Text Corp	Bank of America Merrill Lynch	6,790
1,496	Open Text Corp	HSBC	(74)
3,358	Open Text Corp	JP Morgan	(167)
(6,244)	Pan American Silver Corp	Bank of America Merrill Lynch	932
(862)	Pan American Silver Corp	Citibank	342

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)		
(628)	Pan American Silver Corp	Goldman Sachs	94
(743)	Pan American Silver Corp	HSBC	726
(573)	Pan American Silver Corp	JP Morgan	560
6,535	Parkland Corp	Goldman Sachs	(5,680)
(2,424)	Pembina Pipeline Corp	Bank of America Merrill Lynch	40
(1,839)	Pembina Pipeline Corp	Citibank	(1,324)
(367)	Pembina Pipeline Corp	Credit Suisse	(349)
3,828	Power Corp of Canada	Bank of America Merrill Lynch	4,975
814	Power Corp of Canada	Credit Suisse	1,759
1,408	Power Corp of Canada	Goldman Sachs	1,830
556	Power Corp of Canada	HSBC	1,201
744	Power Corp of Canada	JP Morgan	1,607
1,045	Quebecor Inc 'B'	Credit Suisse	(1,622)
6,274	Quebecor Inc 'B'	HSBC	(9,737)
11,619	Quebecor Inc 'B'	JP Morgan	(18,032)
(284)	Restaurant Brands International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(156)
(147)	Restaurant Brands International Inc	Citibank	(251)
(163)	Restaurant Brands International Inc	Goldman Sachs	(366)
(174)	Restaurant Brands International Inc	HSBC	(203)
(783)	Restaurant Brands International Inc	JP Morgan	(408)
471	Ritchie Bros Auctioneers Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,442)
377	Ritchie Bros Auctioneers Inc	Goldman Sachs	(1,155)
(36)	Rogers Communications Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(32)
(1,401)	Rogers Communications Inc 'B'	Goldman Sachs	(1,241)
1,661	Royal Bank of Canada	Bank of America Merrill Lynch	3,328
271	Royal Bank of Canada	Citibank	460
760	Royal Bank of Canada	Credit Suisse	2,784
(7,600)	Saputo Inc	Bank of America Merrill Lynch	(16,167)
(733)	Saputo Inc	Citibank	(959)
(983)	Saputo Inc	HSBC	(1,766)
2,249	Shaw Communications Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	261
742	Shaw Communications Inc 'B'	Goldman Sachs	86
(161)	Shopify Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(22,324)
(36)	Shopify Inc 'A'	Citibank	3
(16)	Shopify Inc 'A'	HSBC	(2,577)
(15,173)	SSR Mining Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,885)
(1,975)	SSR Mining Inc	Citibank	82
(1,548)	SSR Mining Inc	Goldman Sachs	(192)
(3,385)	SSR Mining Inc	HSBC	(5,884)
(7,278)	SSR Mining Inc	JP Morgan	(12,651)
483	Sun Life Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(236)
358	Sun Life Financial Inc	Citibank	308
1,068	Sun Life Financial Inc	Credit Suisse	(583)
3,062	Sun Life Financial Inc	Goldman Sachs	(1,495)
663	Sun Life Financial Inc	HSBC	(362)

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)			
249	Sun Life Financial Inc	JP Morgan	(136)
(5,099)	TC Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	872
(2,048)	TC Energy Corp	Citibank	(763)
(473)	TC Energy Corp	Credit Suisse	294
(227)	TC Energy Corp	Goldman Sachs	34
(1,841)	TC Energy Corp	HSBC	1,143
(1,227)	TC Energy Corp	JP Morgan	762
(1,297)	TELUS Corp	Bank of America Merrill Lynch	(78)
(2,019)	TELUS Corp	HSBC	(1,571)
(182)	Thomson Reuters Corp	Bank of America Merrill Lynch	(575)
(171)	Thomson Reuters Corp	Goldman Sachs	(541)
(770)	Thomson Reuters Corp	HSBC	(1,115)
418	TMX Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	301
282	TMX Group Ltd	HSBC	(324)
197	Toromont Industries Ltd	Citibank	215
118	Toromont Industries Ltd	Goldman Sachs	260
(2,794)	Toronto-Dominion Bank	Citibank	2,382
1,565	West Fraser Timber Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,150
1,492	West Fraser Timber Co Ltd	Goldman Sachs	2,050
2,857	Wheaton Precious Metals Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,111
2,931	Wheaton Precious Metals Corp	Goldman Sachs	1,140
37	Wheaton Precious Metals Corp	JP Morgan	159
(810)	WSP Global Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,629)
(232)	WSP Global Inc	Goldman Sachs	(467)
			(38,691)
デンマーク			
(3,714)	Ambu A/S ' B '	Deutsche Bank	2,194
(499)	Ambu A/S ' B '	Goldman Sachs	295
9	AP Moller - Maersk A/S ' B '	Barclays Bank	(332)
10	AP Moller - Maersk A/S ' B '	Citibank	(369)
82	AP Moller - Maersk A/S ' B '	Deutsche Bank	16,619
21	AP Moller - Maersk A/S ' B '	Goldman Sachs	4,256
6	AP Moller - Maersk A/S ' B '	HSBC	350
24	AP Moller - Maersk A/S ' B '	JP Morgan	1,398
194	Carlsberg A/S ' B '	Barclays Bank	96
1,313	Carlsberg A/S ' B '	Deutsche Bank	(147)
(276)	Chr Hansen Holding A/S	Bank of America Merrill Lynch	199
(218)	Chr Hansen Holding A/S	Barclays Bank	429
(319)	Chr Hansen Holding A/S	Credit Suisse	366
(5,473)	Chr Hansen Holding A/S	Deutsche Bank	3,332
(543)	Chr Hansen Holding A/S	Goldman Sachs	392
2,521	Coloplast A/S ' B '	Deutsche Bank	(5,889)
294	Coloplast A/S ' B '	Goldman Sachs	(685)
1,671	Danske Bank A/S	Bank of America Merrill Lynch	(644)
(237)	Demant A/S	Credit Suisse	(685)

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)			
(1,290)	Demant A/S	Deutsche Bank	(7,473)
(1,015)	DSV PANALPINA A/S	Deutsche Bank	(17,740)
1,092	Genmab A/S	Deutsche Bank	20,788
583	GN Store Nord AS	Bank of America Merrill Lynch	2,535
190	GN Store Nord AS	Barclays Bank	56
118	GN Store Nord AS	Citibank	35
494	GN Store Nord AS	Deutsche Bank	1,563
(1,651)	H Lundbeck A/S	Barclays Bank	1,707
(510)	H Lundbeck A/S	Credit Suisse	404
(6,988)	H Lundbeck A/S	Deutsche Bank	9,498
(522)	H Lundbeck A/S	Goldman Sachs	42
1,952	Novo Nordisk A/S 'B'	Barclays Bank	(2,338)
13,307	Novo Nordisk A/S 'B'	Deutsche Bank	(25,004)
274	Novozymes A/S 'B'	Credit Suisse	(279)
7,415	Novozymes A/S 'B'	Deutsche Bank	(4,502)
182	Novozymes A/S 'B'	Goldman Sachs	(110)
475	Novozymes A/S 'B'	HSBC	(483)
(306)	Orsted A/S	Barclays Bank	783
(92)	Orsted A/S	Credit Suisse	(812)
(210)	Orsted A/S	Deutsche Bank	(794)
(452)	Orsted A/S	HSBC	(3,991)
100	Pandora A/S	Bank of America Merrill Lynch	1,106
181	Pandora A/S	Barclays Bank	867
1,541	Pandora A/S	Deutsche Bank	17,045
(374)	ROCKWOOL International A/S 'B'	Barclays Bank	(3,744)
(298)	ROCKWOOL International A/S 'B'	Deutsche Bank	(8,558)
(2,975)	Tryg A/S	Barclays Bank	2,295
(2,791)	Tryg A/S	Citibank	2,153
(1,021)	Tryg A/S	Credit Suisse	251
(16,184)	Tryg A/S	Deutsche Bank	10,225
(780)	Vestas Wind Systems A/S	Bank of America Merrill Lynch	(1,293)
(2,764)	Vestas Wind Systems A/S	Barclays Bank	(953)
(45)	Vestas Wind Systems A/S	Citibank	(15)
(3,730)	Vestas Wind Systems A/S	Credit Suisse	(796)
(5,857)	Vestas Wind Systems A/S	Deutsche Bank	(7,129)
(975)	Vestas Wind Systems A/S	Goldman Sachs	(1,616)
(2,199)	Vestas Wind Systems A/S	HSBC	(1,586)
			<u>3,312</u>
フィンランド			
679	Elisa Oyj	Deutsche Bank	(174)
(1,306)	Fortum Oyj	Deutsche Bank	307
(1,311)	Fortum Oyj	Goldman Sachs	(921)
1,281	Kesko Oyj 'B'	Barclays Bank	795
6,909	Kesko Oyj 'B'	Deutsche Bank	10,437
969	Kesko Oyj 'B'	Goldman Sachs	552

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)			
(400)	Kone Oyj 'B'	Barclays Bank	644
(871)	Kone Oyj 'B'	Deutsche Bank	468
195	Neste Oyj	Citibank	395
4,740	Neste Oyj	Deutsche Bank	16,081
751	Neste Oyj	HSBC	3,171
1,191	Neste Oyj	JP Morgan	5,029
(6,004)	Nokia Oyj	Barclays Bank	(571)
(1,536)	Nokia Oyj	Goldman Sachs	(277)
1,513	Orion Oyj 'B'	Deutsche Bank	(2,825)
(563)	Sampo Oyj 'A'	Deutsche Bank	1,635
575	Stora Enso Oyj 'R'	Barclays Bank	(432)
2,618	Stora Enso Oyj 'R'	Deutsche Bank	(3,722)
2,152	UPM-Kymmene Oyj	Barclays Bank	(2,075)
(13,926)	Wartsila Oyj Abp	Deutsche Bank	(9,177)
			<u>19,340</u>
フランス			
(578)	Accor SA	Bank of America Merrill Lynch	(839)
(355)	Accor SA	Barclays Bank	(425)
(1,018)	Accor SA	Deutsche Bank	(1,478)
(334)	Aeroports de Paris	Bank of America Merrill Lynch	(1,060)
(1,846)	Aeroports de Paris	Barclays Bank	(10,025)
(425)	Aeroports de Paris	Deutsche Bank	(1,349)
(106)	Aeroports de Paris	Goldman Sachs	(336)
(144)	Aeroports de Paris	HSBC	18
(115)	Aeroports de Paris	JP Morgan	14
(1,434)	Air Liquide SA	Barclays Bank	2,765
(872)	Air Liquide SA	Deutsche Bank	163
(1,205)	Air Liquide SA	Goldman Sachs	29
(2,874)	Alstom SA	Bank of America Merrill Lynch	(7,190)
(2,034)	Alstom SA	Barclays Bank	(2,433)
(763)	Alstom SA	Citibank	(913)
(3,606)	Alstom SA	Deutsche Bank	(9,022)
(177)	Alstom SA	Goldman Sachs	(443)
(419)	Alstom SA	HSBC	276
(700)	Alstom SA	JP Morgan	461
286	Amundi SA	Bank of America Merrill Lynch	87
274	Amundi SA	Barclays Bank	251
725	Amundi SA	Deutsche Bank	347
145	Amundi SA	Goldman Sachs	44
471	Arkema SA	Bank of America Merrill Lynch	402
118	Arkema SA	Citibank	44
203	Arkema SA	Credit Suisse	(446)
923	Arkema SA	Deutsche Bank	515
161	Atos SE	Deutsche Bank	90
(6,520)	AXA SA	Goldman Sachs	1,233

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)		
979	BioMerieux	Deutsche Bank	(573)
6,220	BNP Paribas SA	Deutsche Bank	(6,604)
33,951	Bollere SA	Deutsche Bank	4,972
(3,562)	Bouygues SA	Deutsche Bank	3,217
730	Bureau Veritas SA	Deutsche Bank	294
87	Capgemini SE	Citibank	(154)
468	Capgemini SE	Deutsche Bank	(257)
438	Capgemini SE	Goldman Sachs	(241)
25	Carrefour SA	Bank of America Merrill Lynch	(17)
8,508	Carrefour SA	Goldman Sachs	(5,711)
524	Cie de Saint-Gobain	Barclays Bank	(51)
5,392	Cie de Saint-Gobain	Deutsche Bank	2,369
775	Cie de Saint-Gobain	Goldman Sachs	340
249	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	Barclays Bank	229
174	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	Deutsche Bank	14
9,981	CNP Assurances	Deutsche Bank	(3,411)
11,006	Credit Agricole SA	Deutsche Bank	(14,238)
(6,247)	Danone SA	Deutsche Bank	(1,144)
(508)	Dassault Systemes SE	Deutsche Bank	(3,286)
(99)	Dassault Systemes SE	HSBC	(399)
468	Edenred	Deutsche Bank	(354)
(2,176)	Eiffage SA	Deutsche Bank	(1,062)
(4,799)	Electricite de France SA	Deutsche Bank	1,941
5,787	Engie SA	Barclays Bank	(3,093)
5,000	Engie SA	Deutsche Bank	(3,124)
12,916	Engie SA	Goldman Sachs	(8,070)
1,557	Engie SA	JP Morgan	(847)
(749)	EssilorLuxottica SA	Bank of America Merrill Lynch	(1,974)
(268)	EssilorLuxottica SA	Barclays Bank	111
(1,963)	EssilorLuxottica SA	Deutsche Bank	(5,175)
28	Eurazeo SE	Barclays Bank	65
4,478	Eurazeo SE	Deutsche Bank	7,924
(1,589)	Eurofins Scientific SE	HSBC	(13,128)
(640)	Faurecia SE	Bank of America Merrill Lynch	(8)
(1,193)	Faurecia SE	Barclays Bank	(510)
(500)	Faurecia SE	Citibank	(214)
(4,546)	Faurecia SE	Deutsche Bank	(55)
(18,917)	Getlink SE	Deutsche Bank	3,463
91	Hermes International	Bank of America Merrill Lynch	10,106
20	Hermes International	Barclays Bank	1,464
105	Hermes International	Deutsche Bank	11,661
14	Hermes International	JP Morgan	1,657
(123)	Iliad SA	Bank of America Merrill Lynch	2,342
(294)	Iliad SA	Barclays Bank	(843)
(55)	Iliad SA	Credit Suisse	735

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)		
(629)	Iliad SA	Deutsche Bank	10,892
2,316	Ipsen SA	Deutsche Bank	(2,770)
124	Ipsen SA	HSBC	448
(46)	Kering SA	Bank of America Merrill Lynch	(2,397)
(124)	Kering SA	Barclays Bank	(4,222)
(236)	Kering SA	Deutsche Bank	(12,298)
(43)	Kering SA	Goldman Sachs	(2,241)
1,017	La Francaise des Jeux SAEM	Bank of America Merrill Lynch	3,637
483	La Francaise des Jeux SAEM	Barclays Bank	914
43	La Francaise des Jeux SAEM	Credit Suisse	143
6,745	La Francaise des Jeux SAEM	Deutsche Bank	24,119
1,863	La Francaise des Jeux SAEM	JP Morgan	6,207
(644)	Legrand SA	Barclays Bank	1,399
(526)	Legrand SA	Deutsche Bank	231
101	L' Oreal SA	Barclays Bank	530
(843)	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	Deutsche Bank	(32,407)
6,784	Natixis SA	Deutsche Bank	(166)
18,973	Orange SA	Bank of America Merrill Lynch	(5,835)
30,997	Orange SA	Barclays Bank	(3,934)
1,695	Orange SA	Citibank	(215)
865	Orange SA	Credit Suisse	(177)
20,560	Orange SA	Deutsche Bank	(6,323)
12,465	Orange SA	Goldman Sachs	(3,833)
1,173	Orange SA	JP Morgan	(240)
(334)	Orpea SA	Bank of America Merrill Lynch	1,916
(3,388)	Orpea SA	Deutsche Bank	19,433
(166)	Pernod Ricard SA	Barclays Bank	(122)
(182)	Pernod Ricard SA	Deutsche Bank	(911)
(8)	Pernod Ricard SA	Goldman Sachs	(40)
596	Publicis Groupe SA	Bank of America Merrill Lynch	407
1,059	Publicis Groupe SA	Barclays Bank	595
1,008	Publicis Groupe SA	Citibank	566
4,468	Publicis Groupe SA	Deutsche Bank	3,054
296	Publicis Groupe SA	HSBC	(246)
863	Publicis Groupe SA	JP Morgan	(716)
(1,606)	Remy Cointreau SA	Deutsche Bank	(7,644)
(2,164)	Renault SA	Bank of America Merrill Lynch	(977)
(971)	Renault SA	Barclays Bank	(1,238)
(585)	Renault SA	Credit Suisse	921
(5,570)	Renault SA	Deutsche Bank	(2,515)
(995)	Renault SA	Goldman Sachs	(449)
(567)	Sanofi	Barclays Bank	477
(131)	Sanofi	Deutsche Bank	(54)
(86)	Sartorius Stedim Biotech	Goldman Sachs	(52)
2,030	Schneider Electric SE	Citibank	1,486

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)			
(804)	SCOR SE	Barclays Bank	608
(301)	SCOR SE	Deutsche Bank	334
207	SEB SA	Bank of America Merrill Lynch	(606)
108	SEB SA	Barclays Bank	(79)
99	SEB SA	Credit Suisse	(290)
302	SEB SA	Deutsche Bank	(885)
45	SEB SA	HSBC	(132)
4,461	SES SA	Barclays Bank	5,499
14,941	SES SA	Deutsche Bank	10,539
1,199	SES SA	HSBC	1,168
1,218	SES SA	JP Morgan	1,186
3,553	Societe Generale SA	Deutsche Bank	564
(324)	Sodexo SA	Barclays Bank	(593)
(252)	Sodexo SA	Deutsche Bank	554
946	STMicroelectronics NV	Deutsche Bank	2,015
857	Suez SA	Barclays Bank	5
2,265	Suez SA	Deutsche Bank	(41)
463	Teleperformance	Deutsche Bank	1,695
45	Teleperformance	HSBC	(104)
(1,237)	TOTAL SE	Bank of America Merrill Lynch	2,861
(3,056)	TOTAL SE	Deutsche Bank	7,067
(134)	TOTAL SE	Goldman Sachs	310
(1,156)	Ubisoft Entertainment SA	Deutsche Bank	(7,703)
(823)	Valeo SA	Deutsche Bank	(1,105)
(1,000)	Valeo SA	Goldman Sachs	(1,342)
(69)	Valeo SA	HSBC	(3)
(2,761)	Veolia Environnement SA	Bank of America Merrill Lynch	(231)
(780)	Veolia Environnement SA	Deutsche Bank	126
(855)	Veolia Environnement SA	JP Morgan	123
159	Vinci SA	Bank of America Merrill Lynch	(91)
630	Vinci SA	Barclays Bank	(477)
120	Vinci SA	Citibank	(91)
114	Vinci SA	Deutsche Bank	(85)
3,981	Vivendi SE	Barclays Bank	1,846
1,094	Vivendi SE	Deutsche Bank	908
3,400	Wendel SE	Barclays Bank	2,075
(2,259)	Worldline SA	Bank of America Merrill Lynch	(8,629)
(445)	Worldline SA	Barclays Bank	(695)
(3,833)	Worldline SA	Deutsche Bank	(14,641)
(373)	Worldline SA	Goldman Sachs	(1,425)
(185)	Worldline SA	JP Morgan	(352)
			<u>(65,623)</u>
ドイツ			
(17)	adidas AG	Bank of America Merrill Lynch	(73)
(41)	adidas AG	Credit Suisse	(693)

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)		
(562)	adidas AG	Deutsche Bank	(2,401)
(53)	adidas AG	JP Morgan	(896)
221	Allianz SE Reg	Barclays Bank	217
729	Allianz SE Reg	Deutsche Bank	(1,690)
302	Allianz SE Reg	Goldman Sachs	(700)
71	Allianz SE Reg	JP Morgan	48
686	BASF SE	Bank of America Merrill Lynch	(1,892)
1,375	BASF SE	Barclays Bank	(1,577)
130	BASF SE	Credit Suisse	(60)
3,855	BASF SE	Deutsche Bank	(10,632)
1,665	BASF SE	Goldman Sachs	(4,592)
(513)	Bayerische Motoren Werke AG (Pref)	Bank of America Merrill Lynch	(2,254)
(1,371)	Bayerische Motoren Werke AG (Pref)	Deutsche Bank	(6,023)
848	Bechtle AG	Barclays Bank	3,984
299	Bechtle AG	Deutsche Bank	2,317
(218)	Beiersdorf AG	Bank of America Merrill Lynch	16
(99)	Beiersdorf AG	Barclays Bank	106
(186)	Beiersdorf AG	Credit Suisse	32
(1,425)	Beiersdorf AG	Deutsche Bank	104
3,824	Brenntag SE	Deutsche Bank	6,440
(352)	Carl Zeiss Meditec AG	Deutsche Bank	(5,155)
(2,823)	Commerzbank AG	Bank of America Merrill Lynch	(493)
(2,906)	Commerzbank AG	Barclays Bank	(418)
(21,999)	Commerzbank AG	Deutsche Bank	(3,839)
(730)	Continental AG	Bank of America Merrill Lynch	(6,147)
(809)	Continental AG	Deutsche Bank	(6,812)
(503)	Continental AG	Goldman Sachs	(4,236)
(344)	Covestro AG	Citibank	(714)
753	Daimler AG	Barclays Bank	358
(101)	Delivery Hero SE	Bank of America Merrill Lynch	(1,116)
(510)	Delivery Hero SE	Barclays Bank	(5,104)
(384)	Delivery Hero SE	Citibank	(1,382)
(3,166)	Delivery Hero SE	Deutsche Bank	(34,333)
(317)	Delivery Hero SE	Goldman Sachs	(3,501)
(1,306)	Deutsche Bank AG	Barclays Bank	(252)
(9,835)	Deutsche Bank AG	Goldman Sachs	(5,905)
148	Deutsche Boerse AG	Barclays Bank	(424)
905	Deutsche Boerse AG	Deutsche Bank	(5,357)
93	Deutsche Boerse AG	HSBC	(760)
121	Deutsche Boerse AG	JP Morgan	(989)
(7,486)	Deutsche Lufthansa AG Reg	Barclays Bank	(4,605)
(2,043)	Deutsche Lufthansa AG Reg	HSBC	1,780
1,679	Deutsche Post AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	9,835
7,879	Deutsche Post AG Reg	Barclays Bank	35,097
199	Deutsche Post AG Reg	Credit Suisse	1,047

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)		
17,230	Deutsche Post AG Reg	Deutsche Bank	99,475
823	Deutsche Post AG Reg	Goldman Sachs	4,821
3,113	Deutsche Post AG Reg	HSBC	16,374
(9,192)	Deutsche Telekom AG Reg	Barclays Bank	1,638
(2,152)	Deutsche Telekom AG Reg	Citibank	383
(735)	Deutsche Telekom AG Reg	Credit Suisse	(337)
(5,942)	Deutsche Telekom AG Reg	Deutsche Bank	1,798
(1,665)	Deutsche Wohnen SE	Deutsche Bank	(14,881)
(215)	Deutsche Wohnen SE	Goldman Sachs	(2,241)
3,345	E.ON SE	Barclays Bank	(1,200)
17,784	E.ON SE	Deutsche Bank	(12,552)
8,465	E.ON SE	Goldman Sachs	(6,154)
539	E.ON SE	HSBC	(507)
(873)	Evonik Industries AG	Barclays Bank	(330)
(1,489)	Evonik Industries AG	Deutsche Bank	(145)
(797)	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	Deutsche Bank	1,595
(966)	Fresenius SE & Co KGaA	Barclays Bank	2,487
(1,618)	Fresenius SE & Co KGaA	Deutsche Bank	2,024
185	FUCHS PETROLUB SE (Pref)	Goldman Sachs	(181)
307	FUCHS PETROLUB SE (Pref)	JP Morgan	(824)
9,570	GEA Group AG	Deutsche Bank	7,942
256	Hannover Rueck SE	Deutsche Bank	(750)
1,183	HeidelbergCement AG	Barclays Bank	2,021
2,234	HeidelbergCement AG	Deutsche Bank	(818)
362	HeidelbergCement AG	Goldman Sachs	(133)
178	HeidelbergCement AG	JP Morgan	(152)
(435)	HelloFresh SE	Bank of America Merrill Lynch	(2,920)
(129)	HelloFresh SE	Goldman Sachs	(866)
51	Henkel AG & Co KGaA (Pref)	Bank of America Merrill Lynch	(98)
2,152	Henkel AG & Co KGaA (Pref)	Barclays Bank	(1,366)
522	Henkel AG & Co KGaA (Pref)	Deutsche Bank	(1,007)
(527)	HOCHTIEF AG	Deutsche Bank	1,659
(3,332)	Infineon Technologies AG	Bank of America Merrill Lynch	(8,397)
(5,616)	Infineon Technologies AG	Barclays Bank	(10,658)
(11,152)	Infineon Technologies AG	Deutsche Bank	(28,104)
(4,633)	Infineon Technologies AG	Goldman Sachs	(11,676)
(898)	Infineon Technologies AG	JP Morgan	(2,038)
(494)	KION Group AG	Barclays Bank	(1,242)
(315)	KION Group AG	Credit Suisse	(1,192)
(236)	KION Group AG	Deutsche Bank	(651)
(1,788)	KION Group AG	HSBC	(6,764)
(150)	KION Group AG	JP Morgan	(567)
(226)	Knorr-Bremse AG	Barclays Bank	290
(1,966)	Knorr-Bremse AG	Deutsche Bank	3,239
(185)	Knorr-Bremse AG	Goldman Sachs	305

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)		
(179)	Knorr-Bremse AG	JP Morgan	546
174	LANXESS AG	Citibank	153
245	LANXESS AG	Deutsche Bank	(413)
1,255	LEG Immobilien SE	Barclays Bank	3,216
240	Merck KGaA	Barclays Bank	491
162	Merck KGaA	Deutsche Bank	887
(55)	MTU Aero Engines AG	Bank of America Merrill Lynch	(242)
(59)	MTU Aero Engines AG	Barclays Bank	(439)
(77)	MTU Aero Engines AG	Credit Suisse	(94)
(339)	MTU Aero Engines AG	Deutsche Bank	(1,651)
(96)	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen Reg	JP Morgan	1,259
(34)	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen Reg	Bank of America Merrill Lynch	212
(34)	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen Reg	Barclays Bank	131
(212)	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen Reg	Credit Suisse	2,781
(133)	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen Reg	Deutsche Bank	828
1,323	Nemetschek SE	Bank of America Merrill Lynch	6,749
2,043	Nemetschek SE	Deutsche Bank	10,422
(565)	Porsche Automobil Holding SE (Pref)	Barclays Bank	(4,634)
(930)	Porsche Automobil Holding SE (Pref)	Credit Suisse	(5,652)
(1,934)	Porsche Automobil Holding SE (Pref)	Deutsche Bank	(16,427)
(176)	Porsche Automobil Holding SE (Pref)	Goldman Sachs	(1,495)
(264)	Porsche Automobil Holding SE (Pref)	HSBC	(1,604)
(93)	Puma SE	Barclays Bank	(238)
(194)	Puma SE	Citibank	(275)
(548)	Puma SE	Deutsche Bank	(2,488)
(3,147)	QIAGEN NV	Goldman Sachs	(6,836)
(24)	Rational AG	Citibank	392
(66)	Rational AG	Deutsche Bank	2,330
98	SAP SE	Bank of America Merrill Lynch	115
580	SAP SE	Deutsche Bank	680
(74)	Sartorius AG (Pref)	Bank of America Merrill Lynch	(9)
(594)	Sartorius AG (Pref)	Deutsche Bank	(72)
(20)	Sartorius AG (Pref)	Goldman Sachs	(2)
(20)	Sartorius AG (Pref)	HSBC	447
1,540	Scout24 AG	Deutsche Bank	5,901
632	Scout24 AG	Goldman Sachs	2,422
775	Siemens AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(8,153)
169	Siemens AG Reg	Citibank	(532)
272	Siemens AG Reg	Credit Suisse	(3,651)
1,839	Siemens AG Reg	Deutsche Bank	(18,247)
421	Siemens AG Reg	Goldman Sachs	(4,429)
(691)	Siemens Energy AG	Citibank	(177)

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)		
(676)	Siemens Energy AG	Deutsche Bank	(411)
(744)	Siemens Energy AG	Goldman Sachs	(1,289)
(549)	Siemens Healthineers AG	Barclays Bank	74
(445)	Siemens Healthineers AG	Citibank	22
(11,950)	Siemens Healthineers AG	Deutsche Bank	10,114
(735)	Siemens Healthineers AG	Goldman Sachs	655
(179)	Siemens Healthineers AG	HSBC	221
442	Symrise AG	Barclays Bank	539
451	Symrise AG	Deutsche Bank	1,509
(1,024)	TeamViewer AG	Barclays Bank	(1,950)
(5,332)	TeamViewer AG	Deutsche Bank	(9,221)
(562)	TeamViewer AG	Goldman Sachs	(448)
9,317	Telefonica Deutschland Holding AG	Goldman Sachs	(4,264)
526	Uniper SE	Barclays Bank	353
611	Uniper SE	Citibank	507
2,129	Uniper SE	Deutsche Bank	(3,352)
428	Uniper SE	Goldman Sachs	(674)
270	Uniper SE	HSBC	(260)
256	United Internet AG Reg	Barclays Bank	(172)
244	United Internet AG Reg	Deutsche Bank	12
93	Volkswagen AG	Deutsche Bank	2,792
(1,505)	Vonovia SE	Bank of America Merrill Lynch	(8,377)
(10)	Vonovia SE	Barclays Bank	(625)
(928)	Zalando SE	Bank of America Merrill Lynch	(2,152)
(201)	Zalando SE	Barclays Bank	(235)
(1,105)	Zalando SE	Deutsche Bank	(2,562)
			<u>(93,336)</u>
	香港		
11,800	AIA Group Ltd	Barclays Bank	(3,497)
(5,500)	ASM Pacific Technology Ltd	HSBC	6,945
(257,000)	Bank of East Asia Ltd	Citibank	10,596
192,000	BOC Hong Kong Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(25,976)
31,500	BOC Hong Kong Holdings Ltd	Barclays Bank	1,218
(16,100)	Budweiser Brewing Co APAC Ltd	Bank of America Merrill Lynch	726
(65,600)	Budweiser Brewing Co APAC Ltd	Citibank	845
(29,400)	Budweiser Brewing Co APAC Ltd	Goldman Sachs	1,326
109,500	CK Asset Holdings Ltd	HSBC	12,698
(4,000)	CK Hutchison Holdings Ltd	Goldman Sachs	465
(9,600)	ESR Cayman Ltd	Goldman Sachs	(1,237)
(5,000)	Galaxy Entertainment Group Ltd	Goldman Sachs	960
(13,000)	Hang Lung Properties Ltd	Goldman Sachs	(201)
4,000	Henderson Land Development Co Ltd	Barclays Bank	696
200,000	Henderson Land Development Co Ltd	Goldman Sachs	57,982
(357,500)	HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd (Unit)	Barclays Bank	(3,225)
(141,000)	HKT Trust & HKT Ltd (Unit)	Bank of America Merrill Lynch	(727)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	香港(続き)		
(258,000)	Hong Kong & China Gas Co Ltd	Barclays Bank	(2,660)
(900)	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	Goldman Sachs	(4,731)
(177,952)	MTR Corp Ltd	Barclays Bank	20,636
13,000	New World Development Co Ltd	Barclays Bank	1,759
28,000	New World Development Co Ltd	Goldman Sachs	5,051
15,000	New World Development Co Ltd	HSBC	(966)
2,000	New World Development Co Ltd	JP Morgan	(129)
(13,600)	Sands China Ltd	Goldman Sachs	(2,453)
(1)	Sisram Medical Ltd	JP Morgan	(1)
(128,000)	SJM Holdings Ltd	Goldman Sachs	(961)
38,500	Sun Hung Kai Properties Ltd	Bank of America Merrill Lynch	22,819
6,000	Sun Hung Kai Properties Ltd	Goldman Sachs	3,556
7,000	Sun Hung Kai Properties Ltd	HSBC	(541)
87,000	Swire Pacific Ltd 'A'	HSBC	(57,170)
(108,400)	Swire Properties Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(698)
(51,400)	Swire Properties Ltd	Barclays Bank	993
7,500	Techtronic Industries Co Ltd	Credit Suisse	(6,571)
1,500	Techtronic Industries Co Ltd	HSBC	(1,314)
2,000	Techtronic Industries Co Ltd	JP Morgan	(1,752)
(81,000)	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	Citibank	(6,784)
(7,200)	Wynn Macau Ltd	Goldman Sachs	(241)
(8,000)	Xinyi Glass Holdings Ltd	HSBC	(2,938)
			<u>24,498</u>
	アイルランド		
2,032	CRH Plc	Bank of America Merrill Lynch	2,579
4,264	CRH Plc	Barclays Bank	4,892
844	CRH Plc	Citibank	968
1,535	CRH Plc	Goldman Sachs	1,948
328	CRH Plc	JP Morgan	280
(151)	Flutter Entertainment Plc	Barclays Bank	(175)
(103)	Flutter Entertainment Plc	Credit Suisse	1,232
(105)	Kerry Group Plc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(167)
(366)	Kerry Group Plc 'A'	Barclays Bank	(447)
(1,515)	Kerry Group Plc 'A'	Citibank	(1,849)
(484)	Kingspan Group Plc	Barclays Bank	461
(26)	Kingspan Group Plc	JP Morgan	(19)
1,654	Smurfit Kappa Group Plc	Barclays Bank	162
366	Smurfit Kappa Group Plc	Citibank	36
336	Smurfit Kappa Group Plc	Goldman Sachs	(66)
512	Smurfit Kappa Group Plc	JP Morgan	(450)
			<u>9,385</u>
	イスラエル		
2,406	Bank Hapoalim BM	Bank of America Merrill Lynch	67
4,066	Bank Hapoalim BM	Barclays Bank	(263)
52,664	Israel Discount Bank Ltd 'A'	Goldman Sachs	2,595

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	イスラエル(続き)		
476	Mizrahi Tefahot Bank Ltd	Goldman Sachs	155
146	Nice Ltd	Barclays Bank	(728)
			<u>1,826</u>
	イタリア		
(1,319)	Amplifon SpA	Deutsche Bank	(8,725)
(9,406)	Atlantia SpA	Barclays Bank	(7,289)
2,987	CNH Industrial NV	Bank of America Merrill Lynch	(91)
804	CNH Industrial NV	Deutsche Bank	(25)
(2,959)	Davide Campari-Milano NV	Barclays Bank	(253)
(28,691)	Davide Campari-Milano NV	Citibank	(2,451)
(96)	DiaSorin SpA	Deutsche Bank	(492)
27,408	Enel SpA	Deutsche Bank	(2,408)
20,611	Enel SpA	Goldman Sachs	(1,811)
36,947	Eni SpA	Deutsche Bank	(17,405)
1,924	EXOR NV	Barclays Bank	3,146
1,355	EXOR NV	Deutsche Bank	3,473
(188)	Ferrari NV	Bank of America Merrill Lynch	(1,916)
(168)	Ferrari NV	Barclays Bank	92
(100)	Ferrari NV	Citibank	55
(77)	Ferrari NV	Credit Suisse	(785)
(865)	Ferrari NV	Deutsche Bank	(8,815)
(89)	Ferrari NV	Goldman Sachs	(907)
(133)	Ferrari NV	HSBC	(554)
1,138	FinecoBank Banca Fineco SpA	Deutsche Bank	277
(886)	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	Bank of America Merrill Lynch	318
(48,586)	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	Deutsche Bank	17,433
(2,263)	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	JP Morgan	895
266,098	Intesa Sanpaolo SpA	Goldman Sachs	4,546
(9,136)	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	Deutsche Bank	(290)
(1,809)	Moncler SpA	Bank of America Merrill Lynch	(14,527)
(3,217)	Moncler SpA	Deutsche Bank	(24,651)
(265)	Moncler SpA	HSBC	(2,199)
(10,340)	Nexi SpA	Barclays Bank	(2,965)
12,181	Poste Italiane SpA	Deutsche Bank	4,190
(627)	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	Bank of America Merrill Lynch	(497)
(355)	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	Barclays Bank	182
(299)	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	Deutsche Bank	(237)
(222)	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	Goldman Sachs	(176)
10,367	Snam SpA	Deutsche Bank	(25)
(3,239)	Stellantis NV	Deutsche Bank	(4,957)
(14,036)	Tenaris SA	Bank of America Merrill Lynch	7,057
(21,795)	Tenaris SA	Barclays Bank	(187)
(22,318)	Tenaris SA	Deutsche Bank	9,914

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)		
22,601	Terna SpA	Deutsche Bank	166
24,332	Terna SpA	Goldman Sachs	178
(2,312)	UniCredit SpA	Deutsche Bank	(762)
			<u>(53,478)</u>
	日本		
200	ABC-Mart Inc	Bank of America Merrill Lynch	584
1,700	ABC-Mart Inc	Barclays Bank	3,411
(91,600)	Acom Co Ltd	Barclays Bank	(2,506)
(900)	Advantest Corp	Citibank	(4,269)
(6,500)	Aeon Co Ltd	Barclays Bank	1,364
(600)	Aeon Co Ltd	HSBC	854
(9,400)	Aeon Mall Co Ltd	Goldman Sachs	(7,287)
(2,900)	Aeon Mall Co Ltd	JP Morgan	(582)
5,500	AGC Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,026)
(12,400)	Air Water Inc	Goldman Sachs	2,601
100	Aisin Corp	Bank of America Merrill Lynch	474
1,200	Aisin Corp	Barclays Bank	2,572
500	Ajinomoto Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	142
3,000	Ajinomoto Co Inc	Barclays Bank	339
800	Ajinomoto Co Inc	Goldman Sachs	341
1,600	Ajinomoto Co Inc	HSBC	2,226
100	Ajinomoto Co Inc	JP Morgan	176
31,900	Amada Co Ltd	JP Morgan	(20,658)
(4,900)	ANA Holdings Inc	Goldman Sachs	(7,553)
(3,800)	Asahi Group Holdings Ltd	Barclays Bank	(381)
(200)	Asahi Group Holdings Ltd	Citibank	(20)
(2,500)	Asahi Group Holdings Ltd	Credit Suisse	(10,899)
(2,000)	Asahi Intecc Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,809
(2,400)	Asahi Intecc Co Ltd	Barclays Bank	3,568
4,200	Asahi Kasei Corp	Barclays Bank	(1,762)
1,400	Asahi Kasei Corp	Goldman Sachs	(268)
3,200	Asahi Kasei Corp	HSBC	(73)
21,300	Astellas Pharma Inc	Credit Suisse	14,668
400	Azbil Corp	Barclays Bank	328
(900)	Bandai Namco Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,453)
(800)	Bandai Namco Holdings Inc	Barclays Bank	(44)
(1,300)	Bandai Namco Holdings Inc	Credit Suisse	2,964
(300)	Bandai Namco Holdings Inc	Goldman Sachs	(484)
(1,300)	Bank of Kyoto Ltd	Barclays Bank	(3,557)
(3,100)	Bank of Kyoto Ltd	Citibank	(8,482)
(1,100)	Bank of Kyoto Ltd	Credit Suisse	6,120
(1,800)	Bank of Kyoto Ltd	JP Morgan	10,015
2,200	Bridgestone Corp	Barclays Bank	742
6,200	Brother Industries Ltd	Credit Suisse	6,729
27,300	Brother Industries Ltd	JP Morgan	29,631

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
16,800	Calbee Inc	Goldman Sachs	(13,024)
(2,400)	Canon Inc	Barclays Bank	1,029
(1,100)	Canon Inc	Citibank	472
800	Capcom Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,934
1,200	Capcom Co Ltd	Barclays Bank	3,885
400	Capcom Co Ltd	Citibank	1,295
600	Capcom Co Ltd	HSBC	1,313
1,300	Casio Computer Co Ltd	Citibank	1,020
(300)	Central Japan Railway Co	Bank of America Merrill Lynch	(1,122)
(900)	Central Japan Railway Co	Barclays Bank	(3,160)
(1,200)	Central Japan Railway Co	Goldman Sachs	(4,487)
(100)	Chiba Bank Ltd	Barclays Bank	34
(19,600)	Chiba Bank Ltd	Goldman Sachs	4,648
2,500	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	Barclays Bank	1,072
400	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	Goldman Sachs	438
2,400	Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,138)
9,900	Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc	HSBC	(2,438)
(100)	Cosmos Pharmaceutical Corp	Barclays Bank	182
(1,600)	CyberAgent Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,101)
1,300	Dai Nippon Printing Co Ltd	Barclays Bank	391
1,200	Dai Nippon Printing Co Ltd	HSBC	679
(200)	Daifuku Co Ltd	Barclays Bank	1,131
(100)	Daifuku Co Ltd	Citibank	565
(3,100)	Daifuku Co Ltd	Credit Suisse	57,680
(6,000)	Dai-ichi Life Holdings Inc	Goldman Sachs	(10,398)
(400)	Daiichi Sankyo Co Ltd	Barclays Bank	166
(1,100)	Daiichi Sankyo Co Ltd	Goldman Sachs	1,033
(400)	Daiichi Sankyo Co Ltd	HSBC	1,432
(600)	Daikin Industries Ltd	Barclays Bank	(2,271)
(1,200)	Daikin Industries Ltd	Credit Suisse	16,527
(5,000)	Daiwa House Industry Co Ltd	Barclays Bank	(1,368)
(11,000)	Daiwa Securities Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,525)
(24,100)	Daiwa Securities Group Inc	Barclays Bank	1,231
(300)	Denso Corp	Barclays Bank	(317)
(2,800)	Denso Corp	Goldman Sachs	(8,708)
2,400	Dentsu Group Inc	Barclays Bank	3,065
100	Disco Corp	HSBC	(1,368)
(1,900)	East Japan Railway Co	Barclays Bank	(2,045)
(3,200)	East Japan Railway Co	Goldman Sachs	(3,123)
(300)	East Japan Railway Co	HSBC	90
(700)	East Japan Railway Co	JP Morgan	211
(500)	Eisai Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,166)
(300)	Eisai Co Ltd	Goldman Sachs	(1,300)
17,900	ENEOS Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,551)
141,000	ENEOS Holdings Inc	Barclays Bank	(4,887)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
2,300	ENEOS Holdings Inc	Goldman Sachs	(199)
2,400	ENEOS Holdings Inc	HSBC	35
2,900	ENEOS Holdings Inc	JP Morgan	(1,455)
(800)	FANUC Corp	Bank of America Merrill Lynch	(12,587)
(200)	FANUC Corp	Barclays Bank	(1,478)
(200)	FANUC Corp	Credit Suisse	511
(100)	FANUC Corp	Goldman Sachs	(1,573)
(100)	Fast Retailing Co Ltd	Barclays Bank	(2,198)
(100)	Fast Retailing Co Ltd	Citibank	(2,198)
9,300	Fuji Electric Co Ltd	Barclays Bank	6,786
400	FUJIFILM Holdings Corp	Barclays Bank	989
2,100	FUJIFILM Holdings Corp	Goldman Sachs	9,251
100	Fujitsu Ltd	Bank of America Merrill Lynch	876
100	Fujitsu Ltd	Barclays Bank	(214)
3,500	Fujitsu Ltd	Goldman Sachs	30,646
(21,400)	Fukuoka Financial Group Inc	Barclays Bank	5,465
(1,900)	Fukuoka Financial Group Inc	HSBC	(520)
(1,500)	GMO Payment Gateway Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10,808)
22,400	Hakuhodo DY Holdings Inc	Barclays Bank	(5,108)
(300)	Hamamatsu Photonics KK	Bank of America Merrill Lynch	(520)
(600)	Hamamatsu Photonics KK	Barclays Bank	766
(200)	Hamamatsu Photonics KK	Goldman Sachs	(347)
1,700	Hankyu Hanshin Holdings Inc	Barclays Bank	1,395
(800)	Harmonic Drive Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	876
(1,800)	Harmonic Drive Systems Inc	Credit Suisse	24,954
(300)	Harmonic Drive Systems Inc	HSBC	4,159
(700)	Hikari Tsushin Inc	Barclays Bank	4,597
(400)	Hikari Tsushin Inc	Goldman Sachs	255
17,300	Hino Motors Ltd	Bank of America Merrill Lynch	8,205
3,500	Hisamitsu Pharmaceutical Co Inc	Barclays Bank	(7,661)
(10,600)	Hitachi Construction Machinery Co Ltd	HSBC	1,934
400	Hitachi Ltd	Barclays Bank	376
500	Hitachi Ltd	Citibank	470
1,200	Hitachi Ltd	Goldman Sachs	3,853
(2,200)	Hitachi Metals Ltd	Barclays Bank	-
(1,800)	Hitachi Metals Ltd	Credit Suisse	148
(1,700)	Hitachi Metals Ltd	Goldman Sachs	31
4,700	Honda Motor Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4,930
5,000	Honda Motor Co Ltd	Barclays Bank	(274)
400	Honda Motor Co Ltd	Citibank	(22)
1,200	Honda Motor Co Ltd	Credit Suisse	(854)
6,100	Honda Motor Co Ltd	Goldman Sachs	6,398
1,900	Honda Motor Co Ltd	JP Morgan	(1,352)
(100)	Hoshizaki Corp	Barclays Bank	9
1,800	Hoya Corp	Bank of America Merrill Lynch	17,238

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(12,400)	Hulic Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3,845)
(17,800)	Hulic Co Ltd	Barclays Bank	649
(4,500)	Idemitsu Kosan Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4,515
1,200	Iida Group Holdings Co Ltd	Barclays Bank	(491)
2,000	Iida Group Holdings Co Ltd	Credit Suisse	(498)
(5,200)	Inpex Corp	Goldman Sachs	2,182
3,400	Isuzu Motors Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,853
3,800	Isuzu Motors Ltd	Goldman Sachs	3,189
1,400	Ito En Ltd	Citibank	(511)
(7,100)	ITOCHU Corp	Citibank	2,590
(200)	Japan Airlines Co Ltd	Credit Suisse	(332)
(5,700)	Japan Airlines Co Ltd	Goldman Sachs	(12,009)
(3,800)	Japan Airport Terminal Co Ltd	Goldman Sachs	(11,957)
(3,800)	Japan Airport Terminal Co Ltd	HSBC	(173)
(3,600)	Japan Exchange Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,100)
(2,200)	Japan Exchange Group Inc	Goldman Sachs	(672)
(2,600)	Japan Exchange Group Inc	HSBC	2,786
(42,900)	Japan Post Bank Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	11,738
(2,900)	Japan Post Bank Co Ltd	Goldman Sachs	794
(5,700)	Japan Post Bank Co Ltd	HSBC	5,771
9,200	Japan Post Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(1,233)
(7,900)	Japan Post Insurance Co Ltd	Barclays Bank	12,537
(1,000)	JFE Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	684
(7,700)	JFE Holdings Inc	Goldman Sachs	5,267
(600)	JFE Holdings Inc	HSBC	1,461
2,000	JSR Corp	Barclays Bank	(757)
900	JSR Corp	Citibank	(299)
600	JSR Corp	Goldman Sachs	(328)
700	JSR Corp	HSBC	(894)
21,700	Kajima Corp	Bank of America Merrill Lynch	13,261
10,600	Kajima Corp	Barclays Bank	(2,030)
2,500	Kajima Corp	Credit Suisse	(1,551)
7,600	Kajima Corp	Goldman Sachs	4,644
1,700	Kajima Corp	HSBC	(1,054)
3,500	Kajima Corp	JP Morgan	(2,038)
(1,800)	Kakaku.com Inc	Goldman Sachs	(6,321)
(400)	Kao Corp	Barclays Bank	592
(1,400)	Kao Corp	HSBC	3,282
(1)	Kawasaki Kisen Kaisha Ltd	Credit Suisse	2
4,500	KDDI Corp	Bank of America Merrill Lynch	7,593
9,200	KDDI Corp	Barclays Bank	3,132
400	KDDI Corp	HSBC	51
(14,600)	Keihan Holdings Co Ltd	Credit Suisse	51,268
(7,500)	Keikyu Corp	Barclays Bank	(3,899)
(10,400)	Keikyu Corp	Goldman Sachs	1,897

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)	Keio Corp	JP Morgan	22,063
(600)	Keisei Electric Railway Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(930)
(200)	Keyence Corp	Barclays Bank	(2,098)
(1,000)	Keyence Corp	HSBC	(3,466)
800	Kikkoman Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,262
1,000	Kikkoman Corp	Barclays Bank	3,466
300	Kikkoman Corp	Citibank	1,040
400	Kikkoman Corp	Credit Suisse	1,099
(6,600)	Kintetsu Group Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	5,418
(3,600)	Kintetsu Group Holdings Co Ltd	Barclays Bank	(4,104)
(2,200)	Kintetsu Group Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	1,806
(4,900)	Kirin Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(3,084)
(4,100)	Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd	Goldman Sachs	-
(8,700)	Kobe Bussan Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	6,269
(1,300)	Kobe Bussan Co Ltd	Barclays Bank	540
(1,100)	Kobe Bussan Co Ltd	Goldman Sachs	793
(4,810)	Koei Tecmo Holdings Co Ltd	Barclays Bank	(12,284)
(300)	Koito Manufacturing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(985)
(1,000)	Koito Manufacturing Co Ltd	Barclays Bank	(1,551)
(300)	Koito Manufacturing Co Ltd	Credit Suisse	(328)
(900)	Koito Manufacturing Co Ltd	Goldman Sachs	(2,812)
(800)	Komatsu Ltd	Bank of America Merrill Lynch	350
(700)	Komatsu Ltd	Goldman Sachs	306
(3,100)	Komatsu Ltd	HSBC	6,588
(1,400)	Konami Holdings Corp	Goldman Sachs	(9,960)
(700)	Kose Corp	Barclays Bank	(3,320)
(300)	Kose Corp	Citibank	(1,423)
(600)	Kose Corp	Credit Suisse	(4,792)
(200)	Kose Corp	Goldman Sachs	(2,390)
(7,900)	Kubota Corp	Bank of America Merrill Lynch	5,080
(500)	Kubota Corp	Barclays Bank	344
10,800	Kuraray Co Ltd	Barclays Bank	(788)
9,400	Kuraray Co Ltd	HSBC	(9,945)
3,800	Kurita Water Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	11,784
6,600	Kurita Water Industries Ltd	Goldman Sachs	20,467
2,200	Kyocera Corp	Barclays Bank	1,505
(800)	Kyowa Kirin Co Ltd	Barclays Bank	292
(400)	Kyowa Kirin Co Ltd	Citibank	146
(800)	Kyowa Kirin Co Ltd	Goldman Sachs	182
(400)	Kyowa Kirin Co Ltd	JP Morgan	237
(600)	Kyushu Railway Co	Bank of America Merrill Lynch	(71)
(1,500)	Kyushu Railway Co	Barclays Bank	(1,560)
(600)	Kyushu Railway Co	HSBC	181
(300)	Lasertec Corp	Bank of America Merrill Lynch	(7,437)
(1,400)	Lasertec Corp	Barclays Bank	(34,434)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(100)	Lasertec Corp	Goldman Sachs	(3,055)
(100)	Lasertec Corp	HSBC	(2,311)
(1,200)	Lion Corp	Bank of America Merrill Lynch	539
(600)	Lion Corp	Barclays Bank	443
(800)	Lion Corp	Credit Suisse	218
(3,000)	Lion Corp	Goldman Sachs	3,658
(600)	Lion Corp	JP Morgan	446
9,700	Lixil Corp	Bank of America Merrill Lynch	(7,432)
(1,100)	M3 Inc	Barclays Bank	(2,548)
(1,400)	Makita Corp	Goldman Sachs	(4,725)
3,000	Marubeni Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,240
(15,700)	Marui Group Co Ltd	Barclays Bank	(14,320)
15,500	Mazda Motor Corp	Barclays Bank	6,644
3,300	McDonald's Holdings Co Japan Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,257)
100	McDonald's Holdings Co Japan Ltd	Barclays Bank	(23)
500	McDonald's Holdings Co Japan Ltd	Citibank	(114)
1,500	McDonald's Holdings Co Japan Ltd	Goldman Sachs	(1,026)
800	McDonald's Holdings Co Japan Ltd	HSBC	(328)
5,500	MEIJI Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	2,508
(500)	Mercari Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,779)
(300)	Mercari Inc	Barclays Bank	(438)
(2,100)	Mercari Inc	Credit Suisse	(2,107)
(300)	Mercari Inc	Goldman Sachs	(1,067)
4,100	MINEBEA MITSUMI Inc	Barclays Bank	4,263
(1,200)	MISUMI Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(711)
(1,400)	MISUMI Group Inc	Barclays Bank	64
(700)	MISUMI Group Inc	Goldman Sachs	(415)
4,600	Mitsubishi Chemical Holdings Corp	Barclays Bank	(800)
(16,300)	Mitsubishi Corp	Barclays Bank	(5,724)
39,400	Mitsubishi Electric Corp	Bank of America Merrill Lynch	19,046
4,700	Mitsubishi Electric Corp	Barclays Bank	86
30,800	Mitsubishi Electric Corp	Citibank	562
11,900	Mitsubishi Electric Corp	Credit Suisse	(434)
700	Mitsubishi Electric Corp	Goldman Sachs	338
3,200	Mitsubishi Electric Corp	HSBC	(117)
2,100	Mitsubishi Estate Co Ltd	Barclays Bank	(383)
2,300	Mitsubishi Estate Co Ltd	Citibank	(420)
1,200	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	843
4,800	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	Barclays Bank	2,977
800	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	Credit Suisse	(452)
2,800	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	HSBC	(1,583)
900	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	JP Morgan	(509)
(20,000)	Mitsubishi HC Capital Inc	HSBC	5,655
(2,500)	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,095)
(6,500)	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Barclays Bank	1,773

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(600)	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Citibank	170
(900)	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Credit Suisse	45
(2,000)	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	HSBC	(1,046)
40,700	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	Barclays Bank	(3,786)
2,100	Mitsui & Co Ltd	Barclays Bank	(402)
500	Mitsui & Co Ltd	Citibank	(96)
800	Mitsui & Co Ltd	Goldman Sachs	128
3,500	Mitsui Chemicals Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,596
2,000	Mitsui Chemicals Inc	Barclays Bank	2,371
3,900	Mitsui Chemicals Inc	Goldman Sachs	1,779
3,300	Mitsui Chemicals Inc	HSBC	301
2,500	Mitsui Chemicals Inc	JP Morgan	228
(6,100)	Mitsui Fudosan Co Ltd	HSBC	(1,919)
(3,400)	Miura Co Ltd	HSBC	27,289
19,590	Mizuho Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,323
(500)	MonotaRO Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	133
(8,200)	MonotaRO Co Ltd	Barclays Bank	(3,515)
(2,000)	MonotaRO Co Ltd	Goldman Sachs	(2,791)
(600)	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(115)
(1,200)	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	Barclays Bank	(219)
(400)	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	Goldman Sachs	(77)
(800)	Murata Manufacturing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(839)
(1,800)	Murata Manufacturing Co Ltd	Barclays Bank	(887)
(400)	Murata Manufacturing Co Ltd	Citibank	(197)
(1,300)	Murata Manufacturing Co Ltd	Credit Suisse	4,980
(600)	Murata Manufacturing Co Ltd	Goldman Sachs	(629)
(900)	Murata Manufacturing Co Ltd	HSBC	3,448
(1,100)	Murata Manufacturing Co Ltd	JP Morgan	4,214
(600)	Nagoya Railroad Co Ltd	Barclays Bank	(1,029)
(1,600)	Nagoya Railroad Co Ltd	Goldman Sachs	(102)
300	NEC Corp	Credit Suisse	(3,393)
2,400	NEC Corp	Goldman Sachs	(876)
1,300	NEC Corp	HSBC	(14,703)
900	NEC Corp	JP Morgan	(10,179)
(1,100)	Nexon Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	328
(2,300)	Nexon Co Ltd	Barclays Bank	462
(500)	Nexon Co Ltd	HSBC	550
(700)	Nexon Co Ltd	JP Morgan	(231)
5,100	NGK Insulators Ltd	Barclays Bank	(837)
23,600	NGK Insulators Ltd	Goldman Sachs	(13,130)
2,300	NGK Spark Plug Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,972
3,900	NGK Spark Plug Co Ltd	Barclays Bank	1,636
900	NGK Spark Plug Co Ltd	Credit Suisse	131
3,600	NGK Spark Plug Co Ltd	Goldman Sachs	3,086
1,500	NGK Spark Plug Co Ltd	HSBC	219

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
300	NH Foods Ltd	Barclays Bank	(107)
800	NH Foods Ltd	Goldman Sachs	(1,042)
(700)	Nidec Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3,324)
(600)	Nidec Corp	Barclays Bank	(23)
(100)	Nidec Corp	Citibank	(187)
(100)	Nidec Corp	Credit Suisse	(221)
(400)	Nidec Corp	HSBC	(146)
(300)	Nidec Corp	JP Morgan	(372)
(1,500)	Nihon M&A Center Inc	Bank of America Merrill Lynch	82
(1,300)	Nihon M&A Center Inc	Barclays Bank	949
(5,500)	Nihon M&A Center Inc	HSBC	7,575
(400)	Nihon M&A Center Inc	JP Morgan	551
(100)	Nintendo Co Ltd	Citibank	(2,463)
1,200	Nippon Express Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,423
2,500	Nippon Express Co Ltd	Barclays Bank	(5,480)
200	Nippon Express Co Ltd	Citibank	(529)
1,300	Nippon Express Co Ltd	Goldman Sachs	1,254
400	Nippon Express Co Ltd	HSBC	(447)
300	Nippon Express Co Ltd	JP Morgan	(465)
(13,000)	Nippon Paint Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	12,568
(6,500)	Nippon Paint Holdings Co Ltd	Barclays Bank	(3,735)
(6,300)	Nippon Paint Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	6,091
(6,600)	Nippon Sanso Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	3,853
(3,100)	Nippon Sanso Holdings Corp	Citibank	1,810
(2,600)	Nippon Sanso Holdings Corp	Credit Suisse	(617)
(2,300)	Nippon Sanso Holdings Corp	Goldman Sachs	1,343
(2,400)	Nippon Sanso Holdings Corp	HSBC	(569)
(1,100)	Nippon Shinyaku Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(6,822)
(600)	Nippon Shinyaku Co Ltd	Barclays Bank	(328)
(900)	Nippon Shinyaku Co Ltd	Credit Suisse	(3,530)
(3,100)	Nippon Steel Corp	Barclays Bank	1,711
(3,900)	Nippon Steel Corp	Goldman Sachs	3,699
1,400	Nippon Telegraph & Telephone Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,028
16,100	Nippon Telegraph & Telephone Corp	Barclays Bank	1,434
900	Nippon Telegraph & Telephone Corp	Citibank	94
3,200	Nippon Telegraph & Telephone Corp	Credit Suisse	1,787
11,100	Nippon Telegraph & Telephone Corp	Goldman Sachs	8,150
3,800	Nippon Telegraph & Telephone Corp	HSBC	2,686
1,900	Nippon Telegraph & Telephone Corp	JP Morgan	1,343
5,800	Nippon Yusen KK	Bank of America Merrill Lynch	12,696
800	Nippon Yusen KK	Citibank	(620)
900	Nippon Yusen KK	HSBC	821
1,900	Nippon Yusen KK	JP Morgan	1,733
500	Nissan Chemical Corp	Goldman Sachs	547
(37,600)	Nissan Motor Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(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)		
(1,900)	Nissan Motor Co Ltd	Barclays Bank	(109)
(28,300)	Nissan Motor Co Ltd	Credit Suisse	11,176
(18,200)	Nissan Motor Co Ltd	Goldman Sachs	(216)
700	Nisshin Seifun Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,124)
700	Nisshin Seifun Group Inc	HSBC	(1,277)
1,100	Nisshin Seifun Group Inc	JP Morgan	(2,007)
4,800	Nissin Foods Holdings Co Ltd	Credit Suisse	1,313
1,200	Nitori Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(3,831)
1,500	Nitto Denko Corp	Bank of America Merrill Lynch	(547)
1,200	Nitto Denko Corp	Barclays Bank	150
300	Nitto Denko Corp	Citibank	246
500	Nitto Denko Corp	Credit Suisse	(2,463)
2,300	Nitto Denko Corp	Goldman Sachs	(67)
300	Nitto Denko Corp	HSBC	(1,478)
8,400	Nitto Denko Corp	JP Morgan	(41,372)
2,900	Nomura Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	23
15,700	Nomura Holdings Inc	Barclays Bank	358
3,700	Nomura Holdings Inc	Goldman Sachs	655
(2,300)	Nomura Real Estate Holdings Inc	Barclays Bank	2,601
(100)	Nomura Real Estate Holdings Inc	Goldman Sachs	25
1,000	Nomura Research Institute Ltd	Credit Suisse	2,119
35,500	NSK Ltd	Barclays Bank	324
3,200	NTT Data Corp	Bank of America Merrill Lynch	3,619
(3,100)	Obayashi Corp	HSBC	3,365
(4,000)	Obayashi Corp	JP Morgan	4,341
(800)	Obic Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,824)
(17,100)	Odakyu Electric Railway Co Ltd	Barclays Bank	(6,862)
(2,000)	Oji Holdings Corp	Barclays Bank	657
(29,700)	Oji Holdings Corp	Goldman Sachs	14,899
6,500	Olympus Corp	Goldman Sachs	15,859
(200)	Omron Corp	Credit Suisse	(164)
10,900	Ono Pharmaceutical Co Ltd	Barclays Bank	(4,474)
(1,200)	Oracle Corp Japan	Goldman Sachs	3,065
(1,700)	Oriental Land Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(15,970)
(300)	Oriental Land Co Ltd	Barclays Bank	(2,890)
(700)	Oriental Land Co Ltd	Goldman Sachs	(7,037)
(300)	Oriental Land Co Ltd	HSBC	(2,058)
2,000	ORIX Corp	Barclays Bank	192
28,400	Osaka Gas Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(40,409)
9,800	Osaka Gas Co Ltd	Barclays Bank	(7,687)
600	Osaka Gas Co Ltd	Goldman Sachs	(10)
7,200	Osaka Gas Co Ltd	HSBC	(5,617)
600	Osaka Gas Co Ltd	JP Morgan	(493)
(3,600)	Otsuka Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3,283)
(4,100)	Otsuka Corp	Goldman Sachs	(3,740)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
2,800	Otsuka Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,579
400	Otsuka Holdings Co Ltd	Barclays Bank	168
1,400	Otsuka Holdings Co Ltd	HSBC	1,686
(8,900)	Pan Pacific International Holdings Corp	Barclays Bank	7,306
(2,800)	Pan Pacific International Holdings Corp	Goldman Sachs	26
19,000	Panasonic Corp	Bank of America Merrill Lynch	6,585
5,500	Panasonic Corp	Barclays Bank	3,236
1,000	Panasonic Corp	Citibank	588
900	Panasonic Corp	Credit Suisse	(357)
6,600	Panasonic Corp	Goldman Sachs	2,287
6,800	Panasonic Corp	HSBC	(2,698)
3,100	Panasonic Corp	JP Morgan	(1,230)
(5,700)	PeptiDream Inc	Barclays Bank	(10,658)
(800)	PeptiDream Inc	Goldman Sachs	(2,007)
(300)	PeptiDream Inc	HSBC	(711)
800	Persol Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	628
1,400	Persol Holdings Co Ltd	Citibank	38
200	Persol Holdings Co Ltd	JP Morgan	(78)
(400)	Pigeon Corp	Barclays Bank	353
(10,300)	Pigeon Corp	Goldman Sachs	34,289
3,000	Pola Orbis Holdings Inc	Barclays Bank	(383)
(2,200)	Rakuten Group Inc	Barclays Bank	482
(1,200)	Rakuten Group Inc	Credit Suisse	865
(23,800)	Rakuten Group Inc	Goldman Sachs	15,846
600	Recruit Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	4,203
(2,700)	Renesas Electronics Corp	Goldman Sachs	1,330
(7,600)	Resona Holdings Inc	Goldman Sachs	354
11,600	Ricoh Co Ltd	Barclays Bank	1,693
100	Rinnai Corp	Credit Suisse	(20)
400	Rohm Co Ltd	Citibank	1,678
(600)	Ryohin Keikaku Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	684
(1,900)	Ryohin Keikaku Co Ltd	Barclays Bank	1,646
(7,000)	Ryohin Keikaku Co Ltd	Goldman Sachs	7,981
16,000	Santen Pharmaceutical Co Ltd	Barclays Bank	2,335
(1,900)	SBI Holdings Inc	Goldman Sachs	(399)
(5,700)	SBI Holdings Inc	HSBC	13,881
(2,100)	SCSK Corp	Barclays Bank	(2,298)
1,300	Secom Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(344)
300	Secom Co Ltd	Citibank	47
300	Secom Co Ltd	Credit Suisse	(2,044)
700	Secom Co Ltd	Goldman Sachs	(185)
200	Secom Co Ltd	HSBC	(1,363)
300	Secom Co Ltd	JP Morgan	(2,044)
9,200	Sega Sammy Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	503
4,000	Sega Sammy Holdings Inc	Barclays Bank	(876)

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	Sega Sammy Holdings Inc	Goldman Sachs	421
(1,000)	Seibu Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(921)
(10,400)	Seibu Holdings Inc	Barclays Bank	(9,391)
(2,500)	Seibu Holdings Inc	Citibank	(2,257)
(3,800)	Seibu Holdings Inc	Credit Suisse	(3,431)
(3,100)	Seibu Holdings Inc	Goldman Sachs	(2,856)
13,800	Seiko Epson Corp	Barclays Bank	629
35,800	Sekisui Chemical Co Ltd	Credit Suisse	(45,387)
28,500	Sekisui House Ltd	HSBC	(10,398)
(2,300)	SG Holdings Co Ltd	HSBC	1,217
(8,900)	Sharp Corp	Goldman Sachs	(13,800)
900	Shimadzu Corp	Barclays Bank	47
600	Shimadzu Corp	Goldman Sachs	-
100	Shimadzu Corp	JP Morgan	(137)
300	Shimamura Co Ltd	Credit Suisse	(1,560)
(500)	Shimano Inc	Barclays Bank	(2,645)
10,500	Shimizu Corp	Bank of America Merrill Lynch	766
5,900	Shimizu Corp	Credit Suisse	(2,045)
12,600	Shimizu Corp	Goldman Sachs	919
(500)	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3,420)
(700)	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	Barclays Bank	(2,681)
(200)	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	Citibank	(766)
(500)	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	Credit Suisse	(1,277)
(1,000)	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	Goldman Sachs	(6,841)
(7,500)	Shinsei Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,736)
(700)	Shionogi & Co Ltd	Barclays Bank	467
(2,000)	Shiseido Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4,232)
(3,600)	Shiseido Co Ltd	Barclays Bank	(9,982)
(1,700)	Shiseido Co Ltd	Credit Suisse	(140)
(300)	Shiseido Co Ltd	Goldman Sachs	(635)
(1,200)	Shiseido Co Ltd	HSBC	(99)
2,500	Shizuoka Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(958)
2,500	Shizuoka Bank Ltd	Barclays Bank	(980)
1,400	Shizuoka Bank Ltd	Citibank	(549)
5,900	Shizuoka Bank Ltd	HSBC	-
(400)	SMC Corp	Bank of America Merrill Lynch	(15,432)
(100)	SMC Corp	JP Morgan	(264)
(4,800)	SoftBank Corp	Barclays Bank	285
(4,700)	SoftBank Corp	Goldman Sachs	943
(1,100)	SoftBank Group Corp	Barclays Bank	592
(1,800)	SoftBank Group Corp	HSBC	31,423
400	Sohgo Security Services Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(146)
300	Sohgo Security Services Co Ltd	Goldman Sachs	(25)
(3,600)	Sompo Holdings Inc	Goldman Sachs	(1,740)
(800)	Sompo Holdings Inc	HSBC	(1,087)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
600	Sony Group Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,490
4,200	Sony Group Corp	Barclays Bank	10,534
200	Sony Group Corp	Citibank	502
300	Sony Group Corp	Credit Suisse	14
200	Sony Group Corp	Goldman Sachs	830
1,200	Sony Group Corp	HSBC	55
(1,400)	Square Enix Holdings Co Ltd	Barclays Bank	1,149
(200)	Square Enix Holdings Co Ltd	Credit Suisse	235
(400)	Square Enix Holdings Co Ltd	HSBC	1,022
5,600	Stanley Electric Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	12,769
100	Stanley Electric Co Ltd	JP Morgan	59
600	Subaru Corp	Bank of America Merrill Lynch	351
4,500	Subaru Corp	Barclays Bank	2,770
8,900	Subaru Corp	Goldman Sachs	6,413
(1,900)	SUMCO Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,594)
(700)	SUMCO Corp	Barclays Bank	(830)
(5,800)	SUMCO Corp	Citibank	(6,877)
(4,900)	SUMCO Corp	Credit Suisse	4,827
(1,800)	SUMCO Corp	Goldman Sachs	(1,510)
(17,500)	Sumitomo Chemical Co Ltd	Barclays Bank	(479)
(24,600)	Sumitomo Chemical Co Ltd	Goldman Sachs	(4,487)
(18,300)	Sumitomo Corp	Goldman Sachs	(3,505)
(1,300)	Sumitomo Dainippon Pharma Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(688)
(1,400)	Sumitomo Dainippon Pharma Co Ltd	Citibank	702
(1,400)	Sumitomo Dainippon Pharma Co Ltd	Credit Suisse	(1,686)
(4,200)	Sumitomo Electric Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,950)
(4,900)	Sumitomo Electric Industries Ltd	Barclays Bank	(2,302)
(2,000)	Sumitomo Electric Industries Ltd	Credit Suisse	(784)
(500)	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	Barclays Bank	(141)
(300)	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	Credit Suisse	(692)
(800)	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	Goldman Sachs	(1,561)
10,600	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	Credit Suisse	(1,837)
700	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(645)
500	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	Barclays Bank	(305)
300	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	Credit Suisse	23
600	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	Goldman Sachs	(236)
(1,000)	Sumitomo Realty & Development Co Ltd	Barclays Bank	(55)
12,700	Suntory Beverage & Food Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(6,371)
(3,400)	Suzuken Co Ltd	Goldman Sachs	3,411
700	Suzuki Motor Corp	Barclays Bank	990
700	Systemex Corp	Bank of America Merrill Lynch	3,895
600	Systemex Corp	Citibank	2,599
100	Systemex Corp	Credit Suisse	-
200	Systemex Corp	HSBC	-
1,900	T&D Holdings Inc	Goldman Sachs	1,456

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
15,300	Taiheiyo Cement Corp	Goldman Sachs	(9,768)
5,600	Taisei Corp	Barclays Bank	(6,895)
800	Taisei Corp	Credit Suisse	(2,992)
1,500	Taisei Corp	Goldman Sachs	(752)
5,800	Taisho Pharmaceutical Holdings Co Ltd	Barclays Bank	(4,761)
(600)	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	268
(5,200)	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	Barclays Bank	2,039
(4,700)	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	Citibank	1,843
(27,800)	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	Goldman Sachs	12,424
(1,200)	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	HSBC	120
400	TDK Corp	Citibank	219
700	TDK Corp	Goldman Sachs	3,192
1,000	TDK Corp	HSBC	(8,026)
18,100	Teijin Ltd	Credit Suisse	(17,994)
8,200	Teijin Ltd	HSBC	(8,152)
29,100	Teijin Ltd	JP Morgan	(28,930)
4,300	Terumo Corp	Barclays Bank	3,216
(1,400)	THK Co Ltd	Credit Suisse	4,022
(1,700)	TIS Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,031)
(8,000)	TIS Inc	HSBC	(9,777)
(3,500)	Tobu Railway Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3,192
(14,700)	Tobu Railway Co Ltd	Barclays Bank	(2,950)
(200)	Tobu Railway Co Ltd	Goldman Sachs	182
(12,100)	Toho Co Ltd	HSBC	(13,795)
(1,000)	Tokio Marine Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,426
(500)	Tokio Marine Holdings Inc	Citibank	451
(2,500)	Tokio Marine Holdings Inc	Goldman Sachs	6,065
(300)	Tokio Marine Holdings Inc	HSBC	802
(2,100)	Tokio Marine Holdings Inc	JP Morgan	5,612
(3,200)	Tokyo Century Corp	Goldman Sachs	876
200	Tokyo Electron Ltd	Barclays Bank	4,743
3,400	Tokyo Gas Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4,869)
14,700	Tokyo Gas Co Ltd	Barclays Bank	(7,843)
900	Tokyo Gas Co Ltd	Citibank	(480)
900	Tokyo Gas Co Ltd	Credit Suisse	(1,379)
3,600	Tokyo Gas Co Ltd	HSBC	(5,516)
1,100	Tokyo Gas Co Ltd	JP Morgan	(1,686)
(7,900)	Tokyu Corp	Bank of America Merrill Lynch	(648)
(7,500)	Tokyu Corp	Barclays Bank	(2,736)
(3,900)	Tokyu Corp	Credit Suisse	(213)
(2,300)	Tokyu Corp	Goldman Sachs	(189)
(1,400)	Tokyu Corp	JP Morgan	(77)
(28,400)	Tokyu Fudosan Holdings Corp	HSBC	(1,813)
11,900	Toppan Printing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	9,551
2,800	Toppan Printing Co Ltd	Barclays Bank	409

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
1,300	Toppan Printing Co Ltd	Goldman Sachs	1,043
1,400	Toppan Printing Co Ltd	JP Morgan	(447)
2,100	Toray Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	500
2,100	Toray Industries Inc	Barclays Bank	86
69,800	Toray Industries Inc	Goldman Sachs	16,616
(1,400)	Toshiba Corp	HSBC	(1,022)
2,500	Tosoh Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3,147)
2,400	Tosoh Corp	Goldman Sachs	(3,021)
2,100	Tosoh Corp	HSBC	(2,394)
4,500	TOTO Ltd	Barclays Bank	9,440
8,900	Toyo Suisan Kaisha Ltd	Bank of America Merrill Lynch	-
19,600	Toyoda Gosei Co Ltd	Goldman Sachs	19,843
(600)	Toyota Industries Corp	Goldman Sachs	(284)
(1,100)	Toyota Motor Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3,250)
(400)	Toyota Motor Corp	Credit Suisse	(2,222)
(600)	Toyota Motor Corp	Goldman Sachs	(2,556)
400	Toyota Tsusho Corp	Bank of America Merrill Lynch	91
600	Toyota Tsusho Corp	Citibank	(575)
300	Toyota Tsusho Corp	Credit Suisse	(561)
800	Trend Micro Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,532
200	Trend Micro Inc	Barclays Bank	-
500	Tsuruha Holdings Inc	Barclays Bank	775
(3,300)	Unicharm Corp	Barclays Bank	8,698
(1,100)	Unicharm Corp	HSBC	(692)
(3,000)	USS Co Ltd	Barclays Bank	(1,067)
(3,300)	USS Co Ltd	Credit Suisse	2,619
(300)	Welcia Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	123
(1,200)	Welcia Holdings Co Ltd	Barclays Bank	219
(1,900)	West Japan Railway Co	Bank of America Merrill Lynch	(2,409)
(900)	West Japan Railway Co	Barclays Bank	(804)
(300)	West Japan Railway Co	Credit Suisse	(25)
(1,900)	West Japan Railway Co	Goldman Sachs	(2,409)
1,700	Yakult Honsha Co Ltd	Barclays Bank	1,240
5,900	Yamada Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(1,130)
200	Yamaha Corp	Bank of America Merrill Lynch	711
600	Yamaha Corp	Barclays Bank	1,204
500	Yamaha Corp	Goldman Sachs	1,779
16,300	Yamaha Motor Co Ltd	Barclays Bank	11,893
800	Yamato Holdings Co Ltd	Barclays Bank	(219)
2,400	Yamato Holdings Co Ltd	Citibank	(657)
100	Yamato Holdings Co Ltd	Credit Suisse	(87)
600	Yamato Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	120
(1,500)	Yamazaki Baking Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	903
(1,500)	Yamazaki Baking Co Ltd	Citibank	192
(1,100)	Yamazaki Baking Co Ltd	Credit Suisse	1,174

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)	Yamazaki Baking Co Ltd	Goldman Sachs	963
(400)	Yaskawa Electric Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,134)
(900)	Yaskawa Electric Corp	Barclays Bank	(3,530)
(300)	Yaskawa Electric Corp	Citibank	(1,177)
(500)	Yaskawa Electric Corp	Credit Suisse	(638)
(300)	Yaskawa Electric Corp	Goldman Sachs	(1,601)
8,600	Yokogawa Electric Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3,687)
(5,600)	Z Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,232)
(6,900)	Z Holdings Corp	Barclays Bank	(2,782)
(4,800)	Z Holdings Corp	Goldman Sachs	(1,913)
(36,100)	Z Holdings Corp	HSBC	(12,973)
(4,000)	Z Holdings Corp	JP Morgan	(1,437)
2,000	ZOZO Inc	Barclays Bank	(730)
			<u>77,007</u>
	オランダ		
(4,604)	ABN AMRO Bank NV - CVA	Barclays Bank	(1,113)
(18,262)	ABN AMRO Bank NV - CVA	Deutsche Bank	(7,488)
7	Adyen NV	Bank of America Merrill Lynch	1,720
19	Adyen NV	Barclays Bank	605
107	Adyen NV	Deutsche Bank	23,989
7	Adyen NV	JP Morgan	516
(33,821)	Aegon NV	Deutsche Bank	5,944
2,337	Akzo Nobel NV	Deutsche Bank	7,199
95	Akzo Nobel NV	Goldman Sachs	330
(11,863)	ArcelorMittal SA	Barclays Bank	(19,834)
(904)	ArcelorMittal SA	Credit Suisse	(1,612)
(5,145)	ArcelorMittal SA	Deutsche Bank	(3,973)
(137)	ASM International NV	Credit Suisse	(635)
73	ASML Holding NV	Barclays Bank	1,310
39	ASML Holding NV	Deutsche Bank	1,537
40	ASML Holding NV	Goldman Sachs	1,577
(1,552)	Galapagos NV	Deutsche Bank	4,186
(4,119)	Heineken NV	Deutsche Bank	3,619
(1,393)	ING Groep NV	Barclays Bank	(469)
(3,033)	ING Groep NV	Deutsche Bank	(1,732)
(474)	JDE Peet 's NV	Barclays Bank	29
(5,330)	JDE Peet 's NV	Deutsche Bank	715
(438)	Just Eat Takeaway.com NV	Bank of America Merrill Lynch	(413)
(348)	Just Eat Takeaway.com NV	Barclays Bank	(451)
(389)	Just Eat Takeaway.com NV	Citibank	(1,154)
(6,486)	Just Eat Takeaway.com NV	Deutsche Bank	(20,933)
(240)	Just Eat Takeaway.com NV	JP Morgan	1,693
2,859	Koninklijke Ahold Delhaize NV	Bank of America Merrill Lynch	(925)
2,139	Koninklijke Ahold Delhaize NV	Barclays Bank	(796)
21,739	Koninklijke Ahold Delhaize NV	Deutsche Bank	(6,902)

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)			
(198)	Koninklijke DSM NV	Bank of America Merrill Lynch	(495)
50,785	Koninklijke KPN NV	Bank of America Merrill Lynch	(6,082)
8,149	Koninklijke KPN NV	Barclays Bank	(885)
17,674	Koninklijke KPN NV	Deutsche Bank	(1,964)
83	Koninklijke Philips NV	Barclays Bank	(73)
12,793	Koninklijke Philips NV	Deutsche Bank	(7,260)
252	Koninklijke Vopak NV	Deutsche Bank	22
290	Koninklijke Vopak NV	Goldman Sachs	25
334	NN Group NV	Barclays Bank	(241)
601	NN Group NV	Citibank	(433)
247	NN Group NV	Credit Suisse	(531)
4,321	NN Group NV	Deutsche Bank	(10,230)
7,438	NN Group NV	Goldman Sachs	(17,610)
(5,974)	Prosus NV	Deutsche Bank	(5,778)
(850)	Prosus NV	Goldman Sachs	(695)
(372)	Prosus NV	HSBC	626
(135)	Prosus NV	JP Morgan	(55)
2,123	Randstad NV	Bank of America Merrill Lynch	6,218
4,881	Randstad NV	Barclays Bank	12,867
10,264	Randstad NV	Deutsche Bank	30,063
747	Randstad NV	Goldman Sachs	2,188
143	Randstad NV	JP Morgan	227
46	Wolters Kluwer NV	Credit Suisse	22
1,923	Wolters Kluwer NV	Deutsche Bank	1,549
857	Wolters Kluwer NV	HSBC	418
			(11,568)
ニュージーランド			
(7,015)	a2 Milk Co Ltd	Deutsche Bank	(510)
(85,037)	Auckland International Airport Ltd	HSBC	14,216
19,708	Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd	Goldman Sachs	(52,858)
(54,097)	Mercury NZ Ltd	HSBC	10,420
22,661	Meridian Energy Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(165)
14,116	Meridian Energy Ltd	Deutsche Bank	(103)
(52,599)	Ryman Healthcare Ltd	HSBC	43,584
10,732	Spark New Zealand Ltd	Barclays Bank	(117)
4,884	Spark New Zealand Ltd	Credit Suisse	(35)
24,739	Spark New Zealand Ltd	Deutsche Bank	821
8,034	Spark New Zealand Ltd	Goldman Sachs	350
			15,603
ノルウェー			
(1,316)	Adevinta ASA	Bank of America Merrill Lynch	(2,689)
(11,988)	Adevinta ASA	Deutsche Bank	(24,492)
(1,067)	DNB ASA	Barclays Bank	38
3,685	Equinor ASA	Barclays Bank	1,669
523	Equinor ASA	Citibank	237

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)			
4,083	Equinor ASA	Deutsche Bank	(127)
(2,513)	Gjensidige Forsikring ASA	Deutsche Bank	934
(9,968)	Mowi ASA	Bank of America Merrill Lynch	(9,078)
(1,437)	Mowi ASA	Citibank	(430)
(1,016)	Mowi ASA	Credit Suisse	377
(6,200)	Mowi ASA	Deutsche Bank	(5,646)
(986)	Mowi ASA	Goldman Sachs	(898)
21,385	Norsk Hydro ASA	Barclays Bank	11,531
23,398	Norsk Hydro ASA	Deutsche Bank	2,355
1,472	Orkla ASA	Barclays Bank	282
22,571	Orkla ASA	Deutsche Bank	9,250
(811)	Schibsted ASA 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(2,099)
(2,115)	Schibsted ASA 'A'	Deutsche Bank	(5,474)
(380)	Schibsted ASA 'B'	Citibank	(391)
2,751	Telenor ASA	Barclays Bank	(1,961)
1,897	Telenor ASA	Deutsche Bank	(1,080)
298	Yara International ASA	Deutsche Bank	(268)
			<u>(27,960)</u>
ポルトガル			
816	Galp Energia SGPS SA	Credit Suisse	(45)
10,248	Galp Energia SGPS SA	Deutsche Bank	(2,439)
(8,878)	Jeronimo Martins SGPS SA	Deutsche Bank	650
			<u>(1,834)</u>
シンガポール			
(28,000)	CapitaLand Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,907)
(10,600)	CapitaLand Ltd	Citibank	(401)
(48,900)	CapitaLand Ltd	Deutsche Bank	(3,330)
(31,200)	CapitaLand Ltd	Goldman Sachs	(2,124)
(3,700)	CapitaLand Ltd	JP Morgan	(112)
10,200	City Developments Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,701
(60,200)	Keppel Corp Ltd	Goldman Sachs	(8,198)
(16,200)	Singapore Airlines Ltd	Barclays Bank	(1,965)
(23,199)	Singapore Airlines Ltd	Barclays Bank	-
(42,900)	Singapore Airlines Ltd	Goldman Sachs	(10,198)
(82,137)	Singapore Airlines Ltd	Goldman Sachs	-
(3,000)	Singapore Airlines Ltd	HSBC	(250)
(6,270)	Singapore Airlines Ltd	HSBC	-
35,400	Singapore Technologies Engineering Ltd	Barclays Bank	1,875
6,500	Singapore Technologies Engineering Ltd	Citibank	344
14,400	Singapore Technologies Engineering Ltd	Credit Suisse	1,307
10,600	Singapore Technologies Engineering Ltd	Deutsche Bank	962
3,900	Singapore Technologies Engineering Ltd	Goldman Sachs	354
7,200	Singapore Technologies Engineering Ltd	HSBC	654
26,400	Singapore Technologies Engineering Ltd	JP Morgan	2,397
49,200	Singapore Telecommunications Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,489

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)			
54,100	Singapore Telecommunications Ltd	Barclays Bank	(1,228)
87,800	Singapore Telecommunications Ltd	Deutsche Bank	1,773
29,300	United Overseas Bank Ltd	Barclays Bank	8,424
(36,100)	UOL Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3,824)
(13,900)	Venture Corp Ltd	Goldman Sachs	(7,256)
4,700	Wilmar International Ltd	Deutsche Bank	(134)
			<u>(18,647)</u>
韓国			
1	Doosan Co Ltd	Citibank	9
1	HDC Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	2
1	HDC Holdings Co Ltd	JP Morgan	-
(1)	Lotte Shopping Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(6)
			<u>5</u>
スペイン			
(290)	Aena SME SA	Bank of America Merrill Lynch	(248)
(310)	Aena SME SA	Barclays Bank	(208)
(2,259)	Aena SME SA	Deutsche Bank	(2,020)
(174)	Aena SME SA	Goldman Sachs	(149)
(119)	Aena SME SA	JP Morgan	36
(221)	Amadeus IT Group SA	Barclays Bank	(291)
(3,847)	Amadeus IT Group SA	Deutsche Bank	(8,826)
14,809	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Deutsche Bank	2,333
(10,864)	Banco Santander SA	Deutsche Bank	(1,538)
(5,567)	CaixaBank SA	Barclays Bank	(245)
(16,927)	CaixaBank SA	Credit Suisse	(785)
(14,212)	CaixaBank SA	Deutsche Bank	468
(9,890)	CaixaBank SA	Goldman Sachs	326
(1,651)	Cellnex Telecom SA	Bank of America Merrill Lynch	(7,112)
(8,760)	Cellnex Telecom SA	Barclays Bank	(3,421)
(234)	Cellnex Telecom SA	Citibank	(91)
(7,815)	Cellnex Telecom SA	Deutsche Bank	(33,667)
(1,043)	Cellnex Telecom SA	Goldman Sachs	(4,493)
44	Endesa SA	Credit Suisse	3
25,830	Endesa SA	Deutsche Bank	(21,751)
882	Endesa SA	HSBC	65
(471)	Ferrovial SA	Barclays Bank	150
(471)	Ferrovial SA	Barclays Bank	3
(16,238)	Ferrovial SA	Citibank	5,152
(16,238)	Ferrovial SA	Citibank	84
(3,118)	Ferrovial SA	Deutsche Bank	1,674
(3,118)	Ferrovial SA	Deutsche Bank	14
(884)	Ferrovial SA	HSBC	561
(884)	Ferrovial SA	HSBC	(215)
(462)	Grifols SA	Bank of America Merrill Lynch	609
(2,543)	Grifols SA	Barclays Bank	1,185

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)			
(1,153)	Grifols SA	Citibank	580
(705)	Grifols SA	Credit Suisse	533
(5,059)	Grifols SA	Deutsche Bank	6,029
(5,475)	Grifols SA	JP Morgan	4,143
983	Iberdrola SA	Barclays Bank	(498)
10,142	Iberdrola SA	Credit Suisse	(5,198)
14,113	Iberdrola SA	Deutsche Bank	(4,650)
1,940	Industria de Diseno Textil SA	Bank of America Merrill Lynch	(1,373)
1,472	Industria de Diseno Textil SA	Deutsche Bank	(1,042)
(2,672)	Naturgy Energy Group SA	Deutsche Bank	63
1,922	Repsol SA	Barclays Bank	(108)
3,386	Repsol SA	Citibank	(190)
24,258	Repsol SA	Deutsche Bank	(5,684)
3,662	Repsol SA	Goldman Sachs	(858)
629	Repsol SA	JP Morgan	61
(602)	Siemens Gamesa Renewable Energy SA	Bank of America Merrill Lynch	(221)
(4,450)	Siemens Gamesa Renewable Energy SA	Barclays Bank	(5,105)
(2,805)	Siemens Gamesa Renewable Energy SA	Deutsche Bank	(3,471)
(1,099)	Siemens Gamesa Renewable Energy SA	Goldman Sachs	(966)
2,619	Telefonica SA	Deutsche Bank	(342)
2,143	Telefonica SA	HSBC	(64)
			<u>(90,758)</u>
スウェーデン			
1,073	Alfa Laval AB	Deutsche Bank	1,799
(3,021)	Assa Abloy AB ' B '	Barclays Bank	182
(1,197)	Atlas Copco AB ' A '	Credit Suisse	2,483
(1,184)	Atlas Copco AB ' A '	Deutsche Bank	1,314
4,798	Boliden AB	Bank of America Merrill Lynch	(9,432)
4,798	Boliden AB	Bank of America Merrill Lynch	12
1,049	Boliden AB	Credit Suisse	(3,473)
1,049	Boliden AB	Credit Suisse	759
5,222	Boliden AB	Deutsche Bank	(10,265)
5,222	Boliden AB	Deutsche Bank	13
968	Electrolux AB ' B '	Bank of America Merrill Lynch	(549)
338	Electrolux AB ' B '	Citibank	147
13,499	Electrolux AB ' B '	Deutsche Bank	(7,651)
3,257	Electrolux AB ' B '	Goldman Sachs	(1,846)
1,447	Electrolux AB ' B '	HSBC	(297)
1,438	Electrolux AB ' B '	JP Morgan	(295)
(2,814)	EQT AB	Deutsche Bank	(12,217)
(3,292)	Essity AB ' B '	Bank of America Merrill Lynch	2,025
(1,216)	Essity AB ' B '	Barclays Bank	1,874
(1,961)	Essity AB ' B '	Credit Suisse	1,508
(8,727)	Essity AB ' B '	Deutsche Bank	4,797
(333)	Essity AB ' B '	Goldman Sachs	205

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)		
(304)	Essity AB 'B'	HSBC	70
(123)	Evolution AB	Barclays Bank	(1,602)
(91)	Evolution AB	Credit Suisse	(11)
(157)	Evolution AB	Deutsche Bank	(3,683)
(736)	Fastighets AB Balder	Bank of America Merrill Lynch	(2,024)
(1,618)	Fastighets AB Balder	Deutsche Bank	(4,449)
(745)	Fastighets AB Balder	Goldman Sachs	(2,049)
(172)	Fastighets AB Balder	JP Morgan	(452)
(9,070)	H & M Hennes & Mauritz AB 'B'	Deutsche Bank	(1,149)
(20,055)	Hexagon AB 'B'	Credit Suisse	(10,348)
(1,697)	Hexagon AB 'B'	Deutsche Bank	(1,024)
(4,788)	Hexagon AB 'B'	Goldman Sachs	1,274
(10,486)	Hexagon AB 'B'	HSBC	(5,411)
27,533	Husqvarna AB 'B'	Barclays Bank	12,120
5,765	Husqvarna AB 'B'	Deutsche Bank	1,182
(8,681)	ICA Gruppen AB	Barclays Bank	2,199
(768)	Investment AB Latour 'B'	Deutsche Bank	(2,084)
(23,944)	Investment AB Latour 'B'	Goldman Sachs	(64,971)
1,550	Investor AB 'B'	Deutsche Bank	1,149
26,160	Investor AB 'B'	JP Morgan	25,239
496	Kinnevik AB	Bank of America Merrill Lynch	9,451
686	Kinnevik AB	Citibank	(331)
1,331	Kinnevik AB	Deutsche Bank	25,362
496	Kinnevik AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	3,670
686	Kinnevik AB 'B'	Citibank	3,342
1,331	Kinnevik AB 'B'	Deutsche Bank	9,848
(1,724)	L E Lundbergforetagen AB 'B'	Barclays Bank	(6,487)
(2,653)	L E Lundbergforetagen AB 'B'	Deutsche Bank	(12,318)
299	Lundin Energy AB	Bank of America Merrill Lynch	79
11,555	Lundin Energy AB	Barclays Bank	9,894
444	Lundin Energy AB	Credit Suisse	359
2,955	Lundin Energy AB	Deutsche Bank	784
(2)	NCC AB 'B'	Credit Suisse	1
40,989	Nordea Bank Abp	Deutsche Bank	12,259
(2,040)	Sandvik AB	Barclays Bank	(369)
(761)	Sandvik AB	Citibank	(138)
(4,459)	Sandvik AB	Deutsche Bank	4,463
(564)	Sandvik AB	Goldman Sachs	565
(4,653)	Securitas AB 'B'	Deutsche Bank	4,601
1,813	Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A'	Deutsche Bank	(590)
912	Skanska AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(473)
6,876	Skanska AB 'B'	Barclays Bank	(3,317)
1,251	Skanska AB 'B'	Credit Suisse	(830)
5,577	Skanska AB 'B'	Deutsche Bank	(2,892)
613	Skanska AB 'B'	HSBC	(407)

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)		
(663)	SKF AB 'B'	Barclays Bank	(480)
(983)	SKF AB 'B'	Deutsche Bank	76
(1,179)	Svenska Cellulosa AB SCA 'B'	Bank of America Merrill Lynch	322
(2,576)	Svenska Cellulosa AB SCA 'B'	Credit Suisse	1,663
(24,539)	Svenska Cellulosa AB SCA 'B'	Deutsche Bank	23,572
(13,641)	Svenska Cellulosa AB SCA 'B'	Goldman Sachs	14,724
(3,659)	Svenska Handelsbanken AB 'A'	Barclays Bank	1,995
1,554	Swedbank AB 'A'	Goldman Sachs	(457)
6,499	Tele2 AB 'B'	Deutsche Bank	1,058
10,853	Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B'	Barclays Bank	(2,120)
15,312	Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B'	Deutsche Bank	(28)
14,867	Telia Co AB	Barclays Bank	(1,981)
5,806	Telia Co AB	Credit Suisse	(484)
67,948	Telia Co AB	Deutsche Bank	(3,655)
14,980	Telia Co AB	Goldman Sachs	(587)
4,934	Telia Co AB	HSBC	62
7,887	Telia Co AB	JP Morgan	100
(1,143)	Volvo AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	62
(471)	Volvo AB 'B'	Deutsche Bank	26
			5,463
	スイス		
(12,418)	ABB Ltd Reg	Barclays Bank	(8,137)
(1,130)	ABB Ltd Reg	Citibank	(740)
(994)	ABB Ltd Reg	HSBC	(431)
3,082	Adecco Group AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	5,390
820	Adecco Group AG Reg	Barclays Bank	903
405	Adecco Group AG Reg	Citibank	504
1,082	Adecco Group AG Reg	Goldman Sachs	1,789
2,670	Adecco Group AG Reg	JP Morgan	2,847
(1,711)	Alcon Inc	Goldman Sachs	(1,558)
374	Baloise Holding AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(665)
527	Baloise Holding AG Reg	Barclays Bank	1,756
418	Baloise Holding AG Reg	Citibank	1,393
403	Baloise Holding AG Reg	HSBC	(1,164)
(1,187)	Banque Cantonale Vaudoise Reg	Bank of America Merrill Lynch	4,482
(4,777)	Banque Cantonale Vaudoise Reg	Barclays Bank	3,714
230	Banque Cantonale Vaudoise Reg	Deutsche Bank	(868)
(146)	Barry Callebaut AG Reg	Barclays Bank	(6,161)
(24)	Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	Citibank	(2,665)
(16,806)	Clariant AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(2,520)
2,040	Credit Suisse Group AG	Barclays Bank	-
(913)	Credit Suisse Group AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(9)
(7,489)	Credit Suisse Group AG Reg	Barclays Bank	(1,697)
(3,764)	Credit Suisse Group AG Reg	Citibank	(853)
(3,759)	Credit Suisse Group AG Reg	Goldman Sachs	(1,456)

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)		
(6,542)	Credit Suisse Group AG Reg	HSBC	(4,882)
(1,154)	Credit Suisse Group AG Reg	JP Morgan	(494)
(265)	EMS-Chemie Holding AG Reg	Barclays Bank	(5,445)
(87)	EMS-Chemie Holding AG Reg	Citibank	(1,787)
(170)	EMS-Chemie Holding AG Reg	Credit Suisse	1,510
(4)	EMS-Chemie Holding AG Reg	Goldman Sachs	(169)
242	Geberit AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	7,090
45	Geberit AG Reg	Barclays Bank	470
16	Geberit AG Reg	Citibank	147
7	Givaudan SA Reg	JP Morgan	(118)
760	Holcim Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(304)
5,454	Holcim Ltd	Barclays Bank	1,211
4,003	Holcim Ltd	Credit Suisse	(6,846)
392	Holcim Ltd	Goldman Sachs	(157)
462	Holcim Ltd	HSBC	(790)
170	Holcim Ltd	JP Morgan	(291)
201	Julius Baer Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	464
205	Julius Baer Group Ltd	Barclays Bank	310
157	Julius Baer Group Ltd	Credit Suisse	729
580	Julius Baer Group Ltd	Goldman Sachs	1,225
1,740	Kuehne + Nagel International AG Reg	Barclays Bank	13,527
1,918	Logitech International SA Reg	Barclays Bank	17,999
164	Logitech International SA Reg	Citibank	1,539
297	Logitech International SA Reg	Credit Suisse	4,542
308	Logitech International SA Reg	Goldman Sachs	5,764
1,159	Logitech International SA Reg	HSBC	17,724
(329)	Lonza Group AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(5,408)
(17)	Lonza Group AG Reg	Barclays Bank	(102)
(33)	Lonza Group AG Reg	Citibank	(198)
(390)	Lonza Group AG Reg	Goldman Sachs	(6,410)
(22)	Lonza Group AG Reg	HSBC	(411)
1,526	Nestle SA Reg	Bank of America Merrill Lynch	1,546
146	Nestle SA Reg	HSBC	321
161	Nestle SA Reg	JP Morgan	354
3,716	Novartis AG Reg	Credit Suisse	(1,527)
3,511	Novartis AG Reg	JP Morgan	(1,443)
(103)	Partners Group Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	(10,123)
97	Roche Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	937
102	Roche Holding AG	Barclays Bank	125
1,270	Roche Holding AG	Credit Suisse	16,431
(616)	Schindler Holding AG	Barclays Bank	(2,668)
51	SGS SA Reg	Goldman Sachs	4,644
(1,053)	Sika AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(17,424)
(63)	Sika AG Reg	Barclays Bank	(231)
662	Sonova Holding AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	45,655

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)		
25	Straumann Holding AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	2,224
52	Straumann Holding AG Reg	Barclays Bank	1,863
10	Straumann Holding AG Reg	Citibank	383
9	Straumann Holding AG Reg	Goldman Sachs	855
45	Straumann Holding AG Reg	HSBC	2,524
262	Swiss Life Holding AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	1,804
508	Swiss Life Holding AG Reg	Goldman Sachs	3,498
69	Swiss Life Holding AG Reg	JP Morgan	452
521	Swiss Re AG	Bank of America Merrill Lynch	(694)
546	Swiss Re AG	Goldman Sachs	(728)
878	Swisscom AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	1,365
(1,104)	Temenos AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(8,031)
(85)	Temenos AG Reg	Barclays Bank	(217)
(69)	Temenos AG Reg	Goldman Sachs	(502)
5,736	UBS Group AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	4,236
14,739	UBS Group AG Reg	Barclays Bank	3,928
1,244	UBS Group AG Reg	Credit Suisse	774
5,286	UBS Group AG Reg	Goldman Sachs	3,904
2,314	UBS Group AG Reg	HSBC	1,439
(2,782)	Vifor Pharma AG	Bank of America Merrill Lynch	(16,335)
(2,419)	Vifor Pharma AG	Barclays Bank	(12,098)
(150)	Vifor Pharma AG	Citibank	(808)
(168)	Vifor Pharma AG	Credit Suisse	(699)
(902)	Vifor Pharma AG	Goldman Sachs	(5,434)
622	Zurich Insurance Group AG	Barclays Bank	1,658
			<u>56,251</u>
	台湾		
(415)	Shin Kong Financial Holding Co Ltd (Pref)	Bank of America Merrill Lynch	(22)
			<u>(22)</u>
	英国		
2,349	3i Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	699
8,501	3i Group Plc	Barclays Bank	(1,205)
4,995	3i Group Plc	Citibank	(708)
12,367	3i Group Plc	Deutsche Bank	3,680
1,210	3i Group Plc	Goldman Sachs	360
6,043	3i Group Plc	HSBC	814
(1,250)	Admiral Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	159
(6,572)	Admiral Group Plc	Barclays Bank	(2,887)
(3,326)	Admiral Group Plc	Deutsche Bank	424
(4,619)	Antofagasta Plc	Bank of America Merrill Lynch	10,309
(238)	Antofagasta Plc	Barclays Bank	(66)
(10,811)	Antofagasta Plc	Deutsche Bank	18,538
(638)	Antofagasta Plc	Goldman Sachs	1,424
236	Ashtead Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	575
184	Ashtead Group Plc	Citibank	130

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	英国(続き)		
910	Ashtead Group Plc	Deutsche Bank	2,218
337	Ashtead Group Plc	Goldman Sachs	821
(1,452)	Associated British Foods Plc	Barclays Bank	185
(972)	Associated British Foods Plc	Deutsche Bank	(606)
(1,043)	Associated British Foods Plc	Goldman Sachs	(650)
(289)	AstraZeneca Plc	Barclays Bank	426
(2,303)	AstraZeneca Plc	Deutsche Bank	(4,928)
(147)	AstraZeneca Plc	JP Morgan	(685)
27,801	Auto Trader Group Plc	Barclays Bank	(2,442)
2,023	Auto Trader Group Plc	Citibank	(178)
8,633	Auto Trader Group Plc	Goldman Sachs	1,713
(834)	AVEVA Group Plc	Barclays Bank	(2,647)
(9,038)	AVEVA Group Plc	Deutsche Bank	(32,092)
(643)	AVEVA Group Plc	Goldman Sachs	(2,824)
(354)	AVEVA Group Plc	JP Morgan	(1,244)
43,143	Aviva Plc	Barclays Bank	3,362
2,737	Aviva Plc	Credit Suisse	(78)
30,378	Aviva Plc	Deutsche Bank	1,937
8,551	Aviva Plc	Goldman Sachs	545
(53,727)	Barclays Plc	Deutsche Bank	(2,954)
937	Barratt Developments Plc	Bank of America Merrill Lynch	98
15,614	Barratt Developments Plc	Barclays Bank	1,253
2,480	Barratt Developments Plc	Citibank	155
11,693	Barratt Developments Plc	Deutsche Bank	(497)
1,289	Barratt Developments Plc	HSBC	(453)
925	Barratt Developments Plc	JP Morgan	(325)
(85,926)	Barrick Gold Corp	HSBC	71,715
310	Berkeley Group Holdings Plc	Barclays Bank	206
1,016	Berkeley Group Holdings Plc	Deutsche Bank	144
233	Berkeley Group Holdings Plc	Goldman Sachs	33
5,184	BP Plc	Barclays Bank	(753)
2,396	BP Plc	Credit Suisse	(324)
15,946	BP Plc	Deutsche Bank	(2,090)
(24,684)	BT Group Plc	Deutsche Bank	(3,026)
561	Bunzl Plc	Barclays Bank	(24)
3,469	Bunzl Plc	Goldman Sachs	(1,720)
1,747	Burberry Group Plc	Barclays Bank	593
476	Burberry Group Plc	Deutsche Bank	(46)
1,066	Coca-Cola HBC AG	Barclays Bank	277
8,672	Coca-Cola HBC AG	Deutsche Bank	7,990
(781)	Compass Group Plc	Barclays Bank	(288)
(568)	Compass Group Plc	Deutsche Bank	(749)
(3,097)	Compass Group Plc	Goldman Sachs	(4,081)
(1,041)	Croda International Plc	Barclays Bank	(1,918)
(1,118)	Croda International Plc	Deutsche Bank	(5,565)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	英国(続き)		
505	DCC Plc	Deutsche Bank	(773)
(207)	Diageo Plc	Barclays Bank	(41)
(242)	Diageo Plc	Deutsche Bank	(147)
(4,063)	Direct Line Insurance Group Plc	Barclays Bank	(288)
(5,746)	Direct Line Insurance Group Plc	Credit Suisse	(277)
(4,005)	Direct Line Insurance Group Plc	Deutsche Bank	(250)
2,642	Entain Plc	Barclays Bank	1,310
1,073	Entain Plc	Deutsche Bank	1,513
9,336	Evraz Plc	Bank of America Merrill Lynch	(5,053)
3,899	Evraz Plc	Barclays Bank	(1,558)
3,757	Evraz Plc	Deutsche Bank	(2,034)
(128)	Experian Plc	Barclays Bank	51
(1,935)	Experian Plc	Deutsche Bank	(1,837)
644	Ferguson Plc	Bank of America Merrill Lynch	3,541
365	Ferguson Plc	Barclays Bank	(724)
579	Ferguson Plc	Deutsche Bank	1,331
3,591	Ferguson Plc	HSBC	7,429
135	Ferguson Plc	JP Morgan	(109)
(1,053)	Fresnillo Plc	Credit Suisse	337
(6,392)	Fresnillo Plc	Deutsche Bank	1,648
(6,299)	Fresnillo Plc	Goldman Sachs	1,624
(4,859)	GlaxoSmithKline Plc	Credit Suisse	523
(2,917)	GlaxoSmithKline Plc	Deutsche Bank	1,463
(37,435)	Glencore Plc	Barclays Bank	(3,230)
(5,430)	Glencore Plc	Credit Suisse	(836)
(15,029)	Glencore Plc	Deutsche Bank	(1,720)
(2,457)	Glencore Plc	Goldman Sachs	(530)
(5,090)	Halma Plc	Bank of America Merrill Lynch	(8,944)
(2,586)	Halma Plc	Barclays Bank	(1,283)
(399)	Halma Plc	Credit Suisse	(243)
(3,880)	Halma Plc	Deutsche Bank	(6,817)
(736)	Halma Plc	Goldman Sachs	(1,293)
(1,438)	Hargreaves Lansdown Plc	Deutsche Bank	289
(8,044)	Hargreaves Lansdown Plc	HSBC	13,108
(439)	Hikma Pharmaceuticals Plc	Bank of America Merrill Lynch	(373)
(3,194)	Hikma Pharmaceuticals Plc	Barclays Bank	2,082
(42,418)	HSBC Holdings Plc	Deutsche Bank	(7,153)
(1,789)	Informa Plc	Bank of America Merrill Lynch	117
(4,506)	Informa Plc	Citibank	(359)
(15,677)	Informa Plc	Deutsche Bank	1,022
(1,263)	Informa Plc	Goldman Sachs	82
(5,463)	InterContinental Hotels Group Plc	Deutsche Bank	(3,483)
(1,197)	InterContinental Hotels Group Plc	Goldman Sachs	(763)
3,719	Intertek Group Plc	Deutsche Bank	(19,831)
484	Intertek Group Plc	Goldman Sachs	(2,316)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	英国(続き)		
293	Intertek Group Plc	HSBC	(2,308)
493	Intertek Group Plc	JP Morgan	(3,884)
9,065	J Sainsbury Plc	Deutsche Bank	105
6,366	J Sainsbury Plc	Goldman Sachs	99
8,630	JD Sports Fashion Plc	Barclays Bank	3,889
533	Johnson Matthey Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1,201)
1,092	Johnson Matthey Plc	Barclays Bank	(2,383)
55,501	Kingfisher Plc	Deutsche Bank	(6,097)
3,449	Legal & General Group Plc	Barclays Bank	48
3,710	Legal & General Group Plc	Citibank	311
52,390	Legal & General Group Plc	Deutsche Bank	3,188
(1,529)	London Stock Exchange Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(8,580)
(478)	London Stock Exchange Group Plc	Barclays Bank	(230)
(932)	London Stock Exchange Group Plc	Citibank	(449)
(1,164)	London Stock Exchange Group Plc	Deutsche Bank	(6,532)
(206)	London Stock Exchange Group Plc	HSBC	(1,454)
3,339	M&G Plc	Citibank	284
3,413	M&G Plc	Credit Suisse	1,108
24,511	M&G Plc	Deutsche Bank	2,779
8,880	M&G Plc	Goldman Sachs	1,007
3,754	M&G Plc	JP Morgan	1,218
(32,246)	Melrose Industries Plc	Barclays Bank	(4,272)
(10,279)	Melrose Industries Plc	Deutsche Bank	(1,612)
(4,322)	Melrose Industries Plc	Goldman Sachs	(594)
365	Mondi Plc	Bank of America Merrill Lynch	(153)
876	Mondi Plc	Barclays Bank	(168)
5,876	Mondi Plc	Deutsche Bank	(2,456)
1,345	Mondi Plc	Goldman Sachs	(562)
(5,793)	National Grid Plc	Bank of America Merrill Lynch	455
(1,934)	National Grid Plc	Deutsche Bank	(222)
(25,680)	Natwest Group Plc	Barclays Bank	(1,492)
318	Next Plc	Barclays Bank	324
80	Next Plc	Deutsche Bank	86
1,219	Next Plc	HSBC	(2,798)
(2,783)	Ocado Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	3,037
(3,043)	Ocado Group Plc	Barclays Bank	3,169
(771)	Ocado Group Plc	Credit Suisse	901
(8,462)	Ocado Group Plc	Deutsche Bank	9,233
(725)	Ocado Group Plc	HSBC	848
(1,657)	Pearson Plc	Barclays Bank	657
2,496	Persimmon Plc	Bank of America Merrill Lynch	1,839
641	Persimmon Plc	Barclays Bank	817
553	Persimmon Plc	Citibank	705
512	Persimmon Plc	Credit Suisse	(152)
3,290	Persimmon Plc	Deutsche Bank	2,424

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	英国(続き)		
347	Persimmon Plc	HSBC	(103)
227	Persimmon Plc	JP Morgan	(68)
4,031	Phoenix Group Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	343
1,004	Phoenix Group Holdings Plc	Credit Suisse	51
11,670	Phoenix Group Holdings Plc	Deutsche Bank	992
1,640	Phoenix Group Holdings Plc	JP Morgan	84
(2,734)	Prudential Plc	Bank of America Merrill Lynch	(213)
(1,884)	Prudential Plc	Barclays Bank	133
(417)	Prudential Plc	Deutsche Bank	(32)
(1,366)	Reckitt Benckiser Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(116)
(1,644)	Reckitt Benckiser Group Plc	Barclays Bank	2,749
(2,453)	Reed Elsevier Plc	Barclays Bank	1,564
4,483	Rentokil Initial Plc	Deutsche Bank	337
933	Rentokil Initial Plc	Goldman Sachs	70
1,819	Rio Tinto Plc	Barclays Bank	1,856
(75,710)	Rolls-Royce Holdings Plc	Deutsche Bank	(3,669)
(29,568)	Rolls-Royce Holdings Plc	Goldman Sachs	(1,693)
(35,470)	Rolls-Royce Holdings Plc	HSBC	1,337
(12,714)	Rolls-Royce Holdings Plc	JP Morgan	479
2,067	RSA Insurance Group LTD	Deutsche Bank	(5)
3,979	Sage Group Plc	Citibank	(823)
1,169	Sage Group Plc	Deutsche Bank	(236)
1,720	Sage Group Plc	JP Morgan	609
4,595	Schroders Plc	Deutsche Bank	1,432
299	Severn Trent Plc	Deutsche Bank	(201)
423	Severn Trent Plc	JP Morgan	(270)
(2,227)	Smith & Nephew Plc	Deutsche Bank	(757)
(1,302)	Smiths Group Plc	Deutsche Bank	(175)
(959)	Spirax-Sarco Engineering Plc	Barclays Bank	(3,737)
1,468	SSE Plc	Barclays Bank	146
6,736	SSE Plc	Deutsche Bank	2,100
(1,548)	St James 's Place Plc	Deutsche Bank	(855)
(580)	St James 's Place Plc	Goldman Sachs	(321)
(2,093)	Standard Chartered Plc	Barclays Bank	(53)
(13,028)	Standard Chartered Plc	Deutsche Bank	(1,772)
4,874	Standard Life Aberdeen Plc	Bank of America Merrill Lynch	490
3,673	Standard Life Aberdeen Plc	Barclays Bank	312
1,867	Standard Life Aberdeen Plc	Credit Suisse	(40)
118	Standard Life Aberdeen Plc	JP Morgan	(3)
(26,397)	Taylor Wimpey Plc	Deutsche Bank	1,590
(446)	Unilever Plc	Bank of America Merrill Lynch	531
(11,717)	Unilever Plc	Deutsche Bank	13,947
(1,508)	Unilever Plc	Goldman Sachs	1,795
3,686	United Utilities Group Plc	Barclays Bank	(525)
868	United Utilities Group Plc	Citibank	(74)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	英国(続き)		
9,014	United Utilities Group Plc	Deutsche Bank	8
1,573	United Utilities Group Plc	HSBC	(98)
26,592	Vodafone Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(5,049)
142,513	Vodafone Group Plc	Deutsche Bank	(27,060)
19,676	Vodafone Group Plc	Goldman Sachs	(3,736)
8,193	Vodafone Group Plc	HSBC	(1,639)
(2,060)	Whitbread Plc	Barclays Bank	(934)
(1,610)	Whitbread Plc	Deutsche Bank	(2,213)
(23,406)	Wm Morrison Supermarkets Plc	Bank of America Merrill Lynch	2,288
(8,042)	Wm Morrison Supermarkets Plc	Barclays Bank	285
(5,415)	Wm Morrison Supermarkets Plc	Citibank	192
(20,594)	Wm Morrison Supermarkets Plc	Credit Suisse	1,809
(227,574)	Wm Morrison Supermarkets Plc	Deutsche Bank	21,273
(15,002)	Wm Morrison Supermarkets Plc	Goldman Sachs	1,467
(4,564)	Wm Morrison Supermarkets Plc	HSBC	401
1,428	WPP Plc	Bank of America Merrill Lynch	49
6,482	WPP Plc	Barclays Bank	(1,056)
3,251	WPP Plc	Citibank	(645)
4,392	WPP Plc	Credit Suisse	(1,083)
41,964	WPP Plc	Deutsche Bank	1,402
3,777	WPP Plc	Goldman Sachs	128
5,184	WPP Plc	HSBC	(1,278)
2,687	WPP Plc	JP Morgan	(662)
			9,922
	米国		
(116)	10X Genomics Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(4,196)
(451)	10X Genomics Inc 'A'	Barclays Bank	(6,237)
(243)	3M Co	Bank of America Merrill Lynch	503
(392)	3M Co	Barclays Bank	(42)
(97)	3M Co	Goldman Sachs	201
(108)	3M Co	HSBC	463
335	A O Smith Corp	Bank of America Merrill Lynch	67
359	A O Smith Corp	Barclays Bank	679
1,416	A O Smith Corp	Credit Suisse	(1,671)
747	A O Smith Corp	Goldman Sachs	149
(276)	Abbott Laboratories	Bank of America Merrill Lynch	25
(921)	Abbott Laboratories	Barclays Bank	589
(350)	Abbott Laboratories	Citibank	224
(103)	Abbott Laboratories	Credit Suisse	236
(514)	Abbott Laboratories	Goldman Sachs	46
(75)	Abbott Laboratories	HSBC	172
(335)	AbbVie Inc	Bank of America Merrill Lynch	943
(460)	AbbVie Inc	Barclays Bank	931
(198)	AbbVie Inc	Credit Suisse	365

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(481)	AbbVie Inc	Goldman Sachs	1,775
(178)	AbbVie Inc	HSBC	209
464	ABIOMED Inc	Barclays Bank	2,320
235	ABIOMED Inc	Goldman Sachs	3,908
378	Accenture Plc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,830)
2,691	Accenture Plc 'A'	Barclays Bank	(7,239)
61	Accenture Plc 'A'	Citibank	(164)
382	Accenture Plc 'A'	Goldman Sachs	(1,849)
30	Accenture Plc 'A'	HSBC	(254)
81	Accenture Plc 'A'	JP Morgan	(684)
577	Activision Blizzard Inc	Goldman Sachs	2,856
461	Adobe Inc	Bank of America Merrill Lynch	10,068
647	Adobe Inc	Barclays Bank	4,367
64	Adobe Inc	Citibank	315
762	Adobe Inc	Credit Suisse	18,759
156	Adobe Inc	Goldman Sachs	3,407
61	Adobe Inc	HSBC	1,537
47	Adobe Inc	JP Morgan	1,184
92	Advance Auto Parts Inc	Barclays Bank	(85)
81	Advance Auto Parts Inc	Citibank	(75)
23	Advance Auto Parts Inc	HSBC	(434)
(125)	Advanced Micro Devices Inc	Barclays Bank	(330)
(531)	Advanced Micro Devices Inc	Goldman Sachs	(2,883)
(282)	Advanced Micro Devices Inc	HSBC	(1,153)
116	Aflac Inc	Bank of America Merrill Lynch	30
8,425	Aflac Inc	Citibank	2,612
115	Aflac Inc	Goldman Sachs	30
1,375	Agilent Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	10,801
824	Agilent Technologies Inc	Barclays Bank	3,032
148	Agilent Technologies Inc	Citibank	592
323	Agilent Technologies Inc	Credit Suisse	2,378
1,014	Agilent Technologies Inc	Goldman Sachs	8,132
924	Agilent Technologies Inc	HSBC	5,602
628	Agilent Technologies Inc	JP Morgan	3,572
(1,383)	Air Products and Chemicals Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,752
(348)	Air Products and Chemicals Inc	Barclays Bank	(95)
(78)	Air Products and Chemicals Inc	Citibank	(7)
(142)	Air Products and Chemicals Inc	Credit Suisse	(870)
(304)	Air Products and Chemicals Inc	Goldman Sachs	605
(144)	Air Products and Chemicals Inc	HSBC	(883)
(35)	Air Products and Chemicals Inc	JP Morgan	(215)
61	Airbnb Inc	Bank of America Merrill Lynch	482
171	Airbnb Inc	Barclays Bank	768
127	Airbnb Inc	HSBC	(804)
4	Airbnb Inc	JP Morgan	(25)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(449)	Akamai Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(323)
(776)	Akamai Technologies Inc	Barclays Bank	124
(158)	Akamai Technologies Inc	Credit Suisse	(471)
(152)	Akamai Technologies Inc	Goldman Sachs	(109)
(536)	Akamai Technologies Inc	HSBC	(1,597)
(727)	Albemarle Corp	Barclays Bank	(5,445)
(73)	Albemarle Corp	Goldman Sachs	(678)
(378)	Alexion Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(680)
(96)	Alexion Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(173)
17	Align Technology Inc	Barclays Bank	(243)
19	Align Technology Inc	Credit Suisse	677
262	Align Technology Inc	Goldman Sachs	7,417
(15)	Alleghany Corp	Barclays Bank	(32)
(24)	Alleghany Corp	Goldman Sachs	(37)
(23)	Alleghany Corp	HSBC	156
144	Allegion Plc	Bank of America Merrill Lynch	223
1,110	Allegion Plc	Barclays Bank	1,911
196	Allegion Plc	Citibank	264
125	Allegion Plc	Credit Suisse	(259)
73	Allegion Plc	Goldman Sachs	203
216	Allegion Plc	HSBC	(447)
1,865	Allstate Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4,495)
27	Allstate Corp	Barclays Bank	(17)
354	Ally Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	188
4,409	Ally Financial Inc	Barclays Bank	5,291
202	Ally Financial Inc	Citibank	242
294	Ally Financial Inc	Credit Suisse	306
188	Ally Financial Inc	Goldman Sachs	251
1,170	Ally Financial Inc	HSBC	1,229
230	Ally Financial Inc	JP Morgan	286
(289)	Alnylam Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(1,763)
74	Alphabet Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	5,027
188	Alphabet Inc 'A'	Barclays Bank	(788)
6	Alphabet Inc 'A'	Citibank	(25)
14	Alphabet Inc 'A'	Credit Suisse	911
41	Alphabet Inc 'A'	Goldman Sachs	1,609
19	Alphabet Inc 'A'	HSBC	1,237
6	Alphabet Inc 'C'	Barclays Bank	29
7	Alphabet Inc 'C'	Credit Suisse	489
19	Alphabet Inc 'C'	Goldman Sachs	1,713
610	Altice USA Inc 'A'	Barclays Bank	(702)
13	Amazon.com Inc	Bank of America Merrill Lynch	(173)
11	Amazon.com Inc	Barclays Bank	(185)
7	Amazon.com Inc	Goldman Sachs	(172)
6	Amazon.com Inc	HSBC	195

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
32	Amazon.com Inc	JP Morgan	1,043
122	AMERCO	Bank of America Merrill Lynch	(5,281)
212	AMERCO	Barclays Bank	(655)
74	AMERCO	Citibank	(229)
128	AMERCO	Credit Suisse	(7,291)
191	AMERCO	Goldman Sachs	(8,268)
5	AMERCO	HSBC	(285)
79	AMERCO	JP Morgan	(4,500)
(538)	American Express Co	Bank of America Merrill Lynch	(1,759)
(589)	American Financial Group Inc	Barclays Bank	(777)
(585)	American Financial Group Inc	JP Morgan	(3,060)
(511)	American International Group Inc	Barclays Bank	(491)
(1,405)	American Water Works Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,582)
(708)	American Water Works Co Inc	Barclays Bank	(101)
(126)	American Water Works Co Inc	Citibank	(23)
(358)	American Water Works Co Inc	HSBC	351
307	Ameriprise Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	826
78	Ameriprise Financial Inc	Barclays Bank	334
54	Ameriprise Financial Inc	Citibank	227
41	Ameriprise Financial Inc	Credit Suisse	(175)
202	Ameriprise Financial Inc	Goldman Sachs	543
93	Ameriprise Financial Inc	HSBC	(396)
562	Ameriprise Financial Inc	JP Morgan	(1,666)
1,624	AmerisourceBergen Corp	Barclays Bank	(6,139)
144	AmerisourceBergen Corp	Citibank	(544)
608	AmerisourceBergen Corp	Goldman Sachs	(2,049)
186	AmerisourceBergen Corp	HSBC	(1,583)
72	AmerisourceBergen Corp	JP Morgan	(613)
(423)	AMETEK Inc	Bank of America Merrill Lynch	(247)
(453)	AMETEK Inc	Barclays Bank	(432)
(319)	AMETEK Inc	Goldman Sachs	(995)
1,120	Amgen Inc	Bank of America Merrill Lynch	(16,173)
191	Amgen Inc	Goldman Sachs	(2,758)
31	Amgen Inc	HSBC	(455)
59	Amgen Inc	JP Morgan	(866)
(764)	Amphenol Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(95)
(3,176)	Amphenol Corp 'A'	Barclays Bank	(585)
(681)	Amphenol Corp 'A'	Citibank	(129)
(456)	Amphenol Corp 'A'	Credit Suisse	(378)
(420)	Amphenol Corp 'A'	Goldman Sachs	(319)
(174)	Amphenol Corp 'A'	JP Morgan	(31)
(2,068)	Analog Devices Inc	Bank of America Merrill Lynch	(34,122)
(2,158)	Analog Devices Inc	Barclays Bank	(4,510)
(143)	Analog Devices Inc	Citibank	(299)
(258)	Analog Devices Inc	Credit Suisse	(3,563)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(581)	Analog Devices Inc	Goldman Sachs	(9,586)
(100)	Analog Devices Inc	HSBC	(1,381)
(245)	ANSYS Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,094)
(294)	ANSYS Inc	Barclays Bank	244
(175)	ANSYS Inc	Credit Suisse	(2,585)
(234)	ANSYS Inc	Goldman Sachs	(3,910)
(210)	ANSYS Inc	HSBC	(3,102)
(81)	ANSYS Inc	JP Morgan	(1,196)
(30)	Anthem Inc	Credit Suisse	(86)
(250)	Anthem Inc	Goldman Sachs	(1,140)
(1,024)	Aon Plc 'A'	Barclays Bank	(195)
(431)	Aon Plc 'A'	Goldman Sachs	789
1	Apartment Income Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	2
1	Apartment Investment and Management Co 'A' (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	-
(1,913)	Apollo Global Management Inc	Bank of America Merrill Lynch	77
(3,322)	Apollo Global Management Inc	Barclays Bank	332
(991)	Apollo Global Management Inc	Citibank	99
2,025	Apple Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,361)
409	Apple Inc	Barclays Bank	(1,018)
567	Apple Inc	Citibank	(1,390)
97	Apple Inc	Credit Suisse	(217)
2,397	Apple Inc	Goldman Sachs	(3,979)
185	Apple Inc	HSBC	(414)
87	Applied Materials Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,267
727	Applied Materials Inc	Barclays Bank	2,581
97	Applied Materials Inc	Credit Suisse	1,304
3,539	Applied Materials Inc	Goldman Sachs	51,528
138	Applied Materials Inc	HSBC	2,036
146	Applied Materials Inc	JP Morgan	1,962
(281)	Aptiv Plc	Bank of America Merrill Lynch	(3,198)
(1,465)	Aptiv Plc	Barclays Bank	(13,126)
(349)	Aptiv Plc	Credit Suisse	(2,317)
(949)	Aptiv Plc	Goldman Sachs	(10,800)
(317)	Aptiv Plc	HSBC	(2,105)
(72)	Aptiv Plc	JP Morgan	(478)
(3,645)	Aramark	Barclays Bank	328
566	Arch Capital Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(300)
2,558	Archer-Daniels-Midland Co	Bank of America Merrill Lynch	(2,839)
7,286	Archer-Daniels-Midland Co	Barclays Bank	(656)
340	Archer-Daniels-Midland Co	Credit Suisse	(374)
4,097	Archer-Daniels-Midland Co	Goldman Sachs	(4,548)
160	Archer-Daniels-Midland Co	HSBC	(176)
496	Arista Networks Inc	Barclays Bank	1,448
407	Arrow Electronics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(370)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
2,921	Arrow Electronics Inc	Barclays Bank	(9,698)
223	Arrow Electronics Inc	Citibank	(740)
150	Arrow Electronics Inc	Credit Suisse	452
243	Arrow Electronics Inc	Goldman Sachs	(221)
697	Arrow Electronics Inc	HSBC	2,098
(799)	Arthur J Gallagher & Co	Bank of America Merrill Lynch	(88)
(433)	Arthur J Gallagher & Co	Barclays Bank	(525)
(73)	Arthur J Gallagher & Co	Goldman Sachs	(8)
(365)	Arthur J Gallagher & Co	HSBC	1,526
150	Assurant Inc	Barclays Bank	302
373	Assurant Inc	Citibank	750
7,821	AT&T Inc	Barclays Bank	(2,503)
1,039	Athene Holding Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	447
969	Athene Holding Ltd 'A'	Barclays Bank	(68)
651	Athene Holding Ltd 'A'	Citibank	(46)
452	Athene Holding Ltd 'A'	Goldman Sachs	194
(767)	Atmos Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	(502)
(3,083)	Atmos Energy Corp	Barclays Bank	(906)
(987)	Atmos Energy Corp	Credit Suisse	2,613
(240)	Atmos Energy Corp	Goldman Sachs	(158)
181	Autodesk Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,584
1,662	Autodesk Inc	Barclays Bank	(2,721)
69	Autodesk Inc	Citibank	(112)
280	Autodesk Inc	Credit Suisse	1,853
313	Autodesk Inc	Goldman Sachs	3,159
42	Autodesk Inc	HSBC	(165)
37	Autodesk Inc	JP Morgan	363
88	Automatic Data Processing Inc	Bank of America Merrill Lynch	128
620	Automatic Data Processing Inc	Barclays Bank	(632)
113	Automatic Data Processing Inc	Citibank	(115)
95	Automatic Data Processing Inc	Goldman Sachs	138
72	AutoZone Inc	Barclays Bank	(3,010)
8	AutoZone Inc	Credit Suisse	(124)
7	AutoZone Inc	Goldman Sachs	(83)
(243)	Avalara Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,909)
(1,954)	Avalara Inc	Barclays Bank	(6,311)
(216)	Avalara Inc	Citibank	(698)
(142)	Avalara Inc	Credit Suisse	(1,336)
(946)	Avalara Inc	Goldman Sachs	(5,724)
(256)	Avalara Inc	HSBC	(2,409)
(3,849)	Avantor Inc	Barclays Bank	(1,732)
819	Avery Dennison Corp	Bank of America Merrill Lynch	(352)
1,709	Avery Dennison Corp	Barclays Bank	3,127
801	Avery Dennison Corp	Goldman Sachs	(344)
113	Avery Dennison Corp	HSBC	(119)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
124	Avery Dennison Corp	JP Morgan	(130)
9,128	Axalta Coating Systems Ltd	Barclays Bank	7,759
(1,927)	Baker Hughes Co	Bank of America Merrill Lynch	(98)
(9,209)	Baker Hughes Co	Barclays Bank	1,953
(509)	Baker Hughes Co	Goldman Sachs	(8)
(2,660)	Baker Hughes Co	JP Morgan	1,187
(240)	Ball Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,553
(639)	Ball Corp	Barclays Bank	3,163
(943)	Ball Corp	Goldman Sachs	6,101
506	Bank of America Corp	Goldman Sachs	(177)
1,751	Bank of New York Mellon Corp	Barclays Bank	595
663	Bank of New York Mellon Corp	Citibank	225
1,151	Bank of New York Mellon Corp	Goldman Sachs	(12)
(17,184)	Bank OZK	JP Morgan	3,952
(1,163)	Baxter International Inc	Bank of America Merrill Lynch	849
(1,304)	Baxter International Inc	Barclays Bank	430
(2,337)	Baxter International Inc	Citibank	1,519
(577)	Baxter International Inc	Goldman Sachs	421
(280)	Becton Dickinson and Co	Bank of America Merrill Lynch	(137)
(415)	Becton Dickinson and Co	Barclays Bank	706
(607)	Becton Dickinson and Co	Citibank	984
(63)	Becton Dickinson and Co	Credit Suisse	12
(48)	Becton Dickinson and Co	Goldman Sachs	93
(208)	Becton Dickinson and Co	HSBC	418
858	Berkshire Hathaway Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	189
476	Berkshire Hathaway Inc 'B'	Barclays Bank	(138)
350	Berkshire Hathaway Inc 'B'	Goldman Sachs	77
17	Berkshire Hathaway Inc 'B'	HSBC	(49)
2,698	Best Buy Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10,441)
426	Best Buy Co Inc	Barclays Bank	670
117	Best Buy Co Inc	Citibank	180
321	Best Buy Co Inc	Credit Suisse	(2,209)
69	Best Buy Co Inc	HSBC	(659)
113	Biogen Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,460)
450	Biogen Inc	Barclays Bank	(5,121)
38	Biogen Inc	Goldman Sachs	(491)
20	Biogen Inc	HSBC	(163)
(562)	BioMarin Pharmaceutical Inc	Bank of America Merrill Lynch	22
(1,051)	BioMarin Pharmaceutical Inc	Barclays Bank	263
(219)	BioMarin Pharmaceutical Inc	Citibank	55
(2,765)	BioMarin Pharmaceutical Inc	Goldman Sachs	111
(333)	BioMarin Pharmaceutical Inc	JP Morgan	(303)
(547)	Bio-Rad Laboratories Inc 'A'	Barclays Bank	(5,093)
(596)	Black Knight Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,120)
(1,053)	Black Knight Inc	Barclays Bank	(232)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(369)	Black Knight Inc	Citibank	(81)
(566)	Black Knight Inc	Credit Suisse	923
(5,849)	Black Knight Inc	Goldman Sachs	(10,996)
(216)	Black Knight Inc	JP Morgan	352
(1,437)	Blackstone Group Inc	Credit Suisse	(5,834)
(32)	Booking Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,429)
(20)	Booking Holdings Inc	Barclays Bank	(326)
(6)	Booking Holdings Inc	Goldman Sachs	(315)
(4)	Booking Holdings Inc	JP Morgan	(286)
1,711	Booz Allen Hamilton Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,857
704	Booz Allen Hamilton Holding Corp	Barclays Bank	(487)
130	Booz Allen Hamilton Holding Corp	HSBC	204
(1,547)	BorgWarner Inc	Bank of America Merrill Lynch	557
(988)	BorgWarner Inc	Barclays Bank	(1,126)
(2,073)	BorgWarner Inc	Citibank	(2,363)
(1,464)	BorgWarner Inc	Goldman Sachs	527
(1,168)	BorgWarner Inc	HSBC	1,916
(1,339)	BorgWarner Inc	JP Morgan	2,196
(8,744)	Boston Scientific Corp	Barclays Bank	2,186
(1,445)	Bristol-Myers Squibb Co	Bank of America Merrill Lynch	(303)
(461)	Bristol-Myers Squibb Co	Barclays Bank	653
(402)	Bristol-Myers Squibb Co	Credit Suisse	(68)
(1,097)	Bristol-Myers Squibb Co	Goldman Sachs	(65)
(102)	Broadcom Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,304)
(1,425)	Broadcom Inc	Barclays Bank	(18,513)
(25)	Broadcom Inc	Citibank	(329)
(37)	Broadcom Inc	Credit Suisse	(1,341)
(140)	Broadcom Inc	Goldman Sachs	(4,535)
(96)	Broadcom Inc	HSBC	(3,478)
1	Brookfield Property Partners LP	JP Morgan	1
(865)	Brown & Brown Inc	Bank of America Merrill Lynch	(251)
(1,090)	Brown & Brown Inc	Barclays Bank	(376)
(122)	Brown & Brown Inc	Citibank	(44)
(691)	Brown & Brown Inc	Credit Suisse	587
(600)	Brown & Brown Inc	HSBC	510
(2,660)	Brown-Forman Corp ' B '	Bank of America Merrill Lynch	(6,384)
1,336	Bunge Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3,634)
1,273	Bunge Ltd	Barclays Bank	25
1,712	Bunge Ltd	Goldman Sachs	(4,657)
810	Bunge Ltd	HSBC	(3,013)
31	Bunge Ltd	JP Morgan	(115)
(48)	Burlington Stores Inc	Bank of America Merrill Lynch	612
(639)	Burlington Stores Inc	Barclays Bank	(1,764)
(36)	Burlington Stores Inc	Credit Suisse	190
(88)	Burlington Stores Inc	Goldman Sachs	1,123

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(45)	Cable One Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,548)
(77)	Cable One Inc	Barclays Bank	(657)
(8)	Cable One Inc	Citibank	(68)
(25)	Cable One Inc	Credit Suisse	(1,827)
(34)	Cable One Inc	Goldman Sachs	(3,436)
(15)	Cable One Inc	HSBC	(1,096)
(2)	Cable One Inc	JP Morgan	(146)
(2,018)	Cabot Oil & Gas Corp	Goldman Sachs	3,854
178	Cadence Design Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	918
190	Cadence Design Systems Inc	Barclays Bank	(83)
6,718	Cadence Design Systems Inc	Citibank	4,434
47	Cadence Design Systems Inc	Credit Suisse	134
79	Cadence Design Systems Inc	Goldman Sachs	407
177	Cadence Design Systems Inc	HSBC	504
166	Cadence Design Systems Inc	JP Morgan	473
(3,032)	Campbell Soup Co	Goldman Sachs	2,092
1,160	Capital One Financial Corp	Barclays Bank	46
552	Cardinal Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	(210)
7,875	Cardinal Health Inc	Barclays Bank	(4,410)
915	Cardinal Health Inc	HSBC	(2,068)
(369)	CarMax Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,413
(843)	CarMax Inc	Barclays Bank	(1,104)
(112)	CarMax Inc	Citibank	(147)
(762)	CarMax Inc	Goldman Sachs	7,049
(4,825)	Carnival Corp	Barclays Bank	(8,009)
(2,326)	Carnival Corp	Citibank	(3,861)
(6,599)	Carnival Corp	Goldman Sachs	(13,462)
(517)	Carnival Corp	HSBC	(1,976)
(259)	Carrier Global Corp	Bank of America Merrill Lynch	(456)
(715)	Carrier Global Corp	Barclays Bank	(1,108)
(828)	Carvana Co	Bank of America Merrill Lynch	(31,903)
(232)	Carvana Co	Barclays Bank	(2,619)
(13)	Carvana Co	Citibank	(147)
(87)	Carvana Co	Credit Suisse	(1,993)
(76)	Carvana Co	Goldman Sachs	(2,928)
(3,601)	Catalent Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10,119)
(1,326)	Catalent Inc	Barclays Bank	(2,829)
(301)	Catalent Inc	Credit Suisse	(9)
(109)	Catalent Inc	Goldman Sachs	(143)
(217)	Catalent Inc	HSBC	(7)
(548)	Catalent Inc	JP Morgan	(16)
(353)	Caterpillar Inc	Barclays Bank	(717)
(90)	Caterpillar Inc	Credit Suisse	50
(12)	Caterpillar Inc	Goldman Sachs	45
(339)	Choe Global Markets Inc	Bank of America Merrill Lynch	454

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
443	CBRE Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	487
602	CBRE Group Inc 'A'	Barclays Bank	(590)
435	CBRE Group Inc 'A'	Citibank	(426)
240	CBRE Group Inc 'A'	Credit Suisse	286
1,204	CBRE Group Inc 'A'	Goldman Sachs	1,324
543	CBRE Group Inc 'A'	HSBC	665
257	CBRE Group Inc 'A'	JP Morgan	306
74	CDW Corp	Bank of America Merrill Lynch	(253)
182	CDW Corp	Goldman Sachs	(677)
(2,220)	Centene Corp	Credit Suisse	(8,969)
(1,623)	CenterPoint Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(531)
(10,008)	CenterPoint Energy Inc	Barclays Bank	(2,067)
(713)	CenterPoint Energy Inc	Citibank	(193)
(408)	CenterPoint Energy Inc	Credit Suisse	(258)
(6,416)	CenterPoint Energy Inc	Goldman Sachs	(1,732)
(310)	Ceridian HCM Holding Inc	Bank of America Merrill Lynch	(502)
(1,079)	Ceridian HCM Holding Inc	Barclays Bank	(239)
(390)	Ceridian HCM Holding Inc	Citibank	(43)
(830)	Ceridian HCM Holding Inc	Credit Suisse	(4,590)
(183)	Ceridian HCM Holding Inc	Goldman Sachs	(296)
(5,189)	Ceridian HCM Holding Inc	HSBC	(28,695)
(324)	Ceridian HCM Holding Inc	JP Morgan	(1,191)
8,356	Cerner Corp	Bank of America Merrill Lynch	13,717
321	Cerner Corp	Barclays Bank	401
508	Cerner Corp	Citibank	635
468	Cerner Corp	Credit Suisse	176
1,092	Cerner Corp	Goldman Sachs	1,589
217	Cerner Corp	HSBC	195
498	CF Industries Holdings Inc	Barclays Bank	753
372	CH Robinson Worldwide Inc	Bank of America Merrill Lynch	(748)
641	CH Robinson Worldwide Inc	Barclays Bank	(449)
120	CH Robinson Worldwide Inc	Credit Suisse	(565)
529	CH Robinson Worldwide Inc	HSBC	(2,492)
(2,029)	Charles Schwab Corp	Goldman Sachs	(1,725)
(318)	Charter Communications Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(2,442)
(132)	Charter Communications Inc 'A'	Barclays Bank	1,135
(57)	Charter Communications Inc 'A'	Citibank	490
(60)	Charter Communications Inc 'A'	Goldman Sachs	(461)
(20)	Charter Communications Inc 'A'	HSBC	4
(19)	Charter Communications Inc 'A'	JP Morgan	4
703	Check Point Software Technologies Ltd	Bank of America Merrill Lynch	28
1,256	Check Point Software Technologies Ltd	Barclays Bank	(2,575)
119	Check Point Software Technologies Ltd	Citibank	(244)
585	Check Point Software Technologies Ltd	Goldman Sachs	23
197	Check Point Software Technologies Ltd	HSBC	(565)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(171)	Cheniere Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(137)
(233)	Cheniere Energy Inc	Barclays Bank	(184)
(3,205)	Cheniere Energy Inc	Goldman Sachs	(2,564)
(285)	Cheniere Energy Inc	JP Morgan	(918)
(231)	Chevron Corp	Bank of America Merrill Lynch	838
(4,996)	Chevron Corp	Barclays Bank	6,869
(1,426)	Chevron Corp	Goldman Sachs	10,011
(593)	Chevron Corp	JP Morgan	841
(394)	Chewy Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,344)
(377)	Chewy Inc 'A'	Barclays Bank	(720)
(1,768)	Chewy Inc 'A'	Citibank	(3,377)
(1,405)	Chewy Inc 'A'	Goldman Sachs	(4,791)
85	Chipotle Mexican Grill Inc	Barclays Bank	2,518
(642)	Church & Dwight Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,644
(2,911)	Church & Dwight Co Inc	Barclays Bank	3,430
(549)	Church & Dwight Co Inc	Citibank	807
(665)	Church & Dwight Co Inc	Credit Suisse	2,194
(2,755)	Church & Dwight Co Inc	Goldman Sachs	6,397
(176)	Church & Dwight Co Inc	JP Morgan	644
307	Cigna Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,802)
94	Cigna Corp	Barclays Bank	(252)
122	Cigna Corp	Citibank	(327)
56	Cigna Corp	Credit Suisse	(451)
422	Cigna Corp	Goldman Sachs	(2,477)
(1,461)	Cincinnati Financial Corp	HSBC	(1,476)
409	Cintas Corp	Barclays Bank	(409)
98	Cintas Corp	Citibank	(98)
164	Cintas Corp	HSBC	(1,181)
86	Cintas Corp	JP Morgan	(619)
(2,279)	Cisco Systems Inc - CDI	Barclays Bank	1,117
(101)	Cisco Systems Inc - CDI	Citibank	49
(919)	Cisco Systems Inc - CDI	Credit Suisse	239
(2,455)	Cisco Systems Inc - CDI	Goldman Sachs	98
353	Citigroup Inc	Bank of America Merrill Lynch	455
2,776	Citigroup Inc	Barclays Bank	1,888
157	Citigroup Inc	Credit Suisse	562
506	Citigroup Inc	HSBC	1,811
5,173	Citizens Financial Group Inc	Barclays Bank	3,000
217	Citrix Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(414)
458	Citrix Systems Inc	Barclays Bank	(403)
372	Citrix Systems Inc	Goldman Sachs	(711)
(463)	Clorox Co	Bank of America Merrill Lynch	1,829
(410)	Clorox Co	Barclays Bank	543
(152)	Clorox Co	Citibank	318
(364)	Clorox Co	Goldman Sachs	1,438

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(96)	Clorox Co	HSBC	467
(150)	Clorox Co	JP Morgan	1,689
(1,120)	Cloudflare Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(12,432)
(134)	Cloudflare Inc 'A'	Barclays Bank	(426)
(128)	Cloudflare Inc 'A'	Credit Suisse	(1,688)
(690)	Cloudflare Inc 'A'	Goldman Sachs	(7,659)
(509)	CME Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,186)
(157)	CME Group Inc	Barclays Bank	(245)
(980)	CME Group Inc	Citibank	(1,421)
(59)	CME Group Inc	Goldman Sachs	(137)
320	Coca-Cola Co	Bank of America Merrill Lynch	208
819	Coca-Cola Co	Barclays Bank	82
809	Coca-Cola Co	Citibank	396
1,126	Coca-Cola Co	Goldman Sachs	732
1,023	Coca-Cola Co	HSBC	389
166	Coca-Cola Europacific Partners Plc	Barclays Bank	30
617	Coca-Cola Europacific Partners Plc	Citibank	(160)
479	Cognex Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,529
257	Cognex Corp	Barclays Bank	524
480	Cognex Corp	Goldman Sachs	2,534
73	Cognex Corp	HSBC	221
1,089	Cognizant Technology Solutions Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1,007
514	Cognizant Technology Solutions Corp 'A'	Barclays Bank	236
3,761	Cognizant Technology Solutions Corp 'A'	Goldman Sachs	3,479
128	Cognizant Technology Solutions Corp 'A'	HSBC	(314)
745	Colgate-Palmolive Co	Bank of America Merrill Lynch	171
(812)	Comcast Corp 'A'	Goldman Sachs	(1,531)
(590)	Conagra Brands Inc	Goldman Sachs	(224)
(1,856)	ConocoPhillips	Bank of America Merrill Lynch	3,829
(2,287)	ConocoPhillips	Barclays Bank	(208)
(1,063)	ConocoPhillips	Citibank	383
(259)	ConocoPhillips	Credit Suisse	463
(1,322)	ConocoPhillips	Goldman Sachs	3,384
(14,613)	ConocoPhillips	JP Morgan	18,412
(2,357)	Consolidated Edison Inc	Bank of America Merrill Lynch	839
(905)	Consolidated Edison Inc	Barclays Bank	670
(401)	Consolidated Edison Inc	Credit Suisse	1,047
51	Constellation Brands Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	3
557	Constellation Brands Inc 'A'	Barclays Bank	1,805
49	Constellation Brands Inc 'A'	Goldman Sachs	189
(560)	Cooper Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,929)
(189)	Cooper Cos Inc	Goldman Sachs	(988)
255	Copart Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,545
1,233	Copart Inc	Barclays Bank	536
204	Copart Inc	Citibank	177

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
669	Copart Inc	Goldman Sachs	3,630
109	Copart Inc	HSBC	643
309	Copart Inc	JP Morgan	440
2,596	Corning Inc	Barclays Bank	(986)
348	Corning Inc	Citibank	(132)
518	Corning Inc	Goldman Sachs	(290)
231	Corning Inc	HSBC	(372)
1,520	Corteva Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,094)
3,154	Corteva Inc	Barclays Bank	1,104
494	Corteva Inc	Citibank	173
1,026	Corteva Inc	Credit Suisse	(1,529)
1,158	Corteva Inc	Goldman Sachs	(834)
829	Corteva Inc	HSBC	(1,235)
416	Corteva Inc	JP Morgan	(620)
(141)	CoStar Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,082)
(163)	CoStar Group Inc	Barclays Bank	(1,318)
(51)	CoStar Group Inc	Citibank	(493)
(248)	CoStar Group Inc	Credit Suisse	(3,541)
(131)	CoStar Group Inc	Goldman Sachs	(4,721)
(18)	CoStar Group Inc	HSBC	(586)
(12)	CoStar Group Inc	JP Morgan	(134)
75	Costco Wholesale Corp	Goldman Sachs	(486)
108	Costco Wholesale Corp	JP Morgan	(670)
(343)	Coupa Software Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,697)
(1,342)	Coupa Software Inc	Barclays Bank	1,160
(142)	Coupa Software Inc	Credit Suisse	(464)
(325)	Coupa Software Inc	Goldman Sachs	(3,588)
(61)	Coupa Software Inc	HSBC	143
(47)	CrowdStrike Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(385)
(216)	CrowdStrike Holdings Inc 'A'	Barclays Bank	(1,685)
(282)	CrowdStrike Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	(9,481)
(221)	CrowdStrike Holdings Inc 'A'	JP Morgan	(7,640)
(71)	Crown Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	578
(2,166)	Crown Holdings Inc	Barclays Bank	16,223
2,316	CSX Corp	Barclays Bank	1,783
125	CSX Corp	Citibank	96
113	CSX Corp	Goldman Sachs	(32)
112	CSX Corp	HSBC	(37)
127	CSX Corp	JP Morgan	(386)
1,405	Cummins Inc	Bank of America Merrill Lynch	(12,701)
1,337	CVS Health Corp	Barclays Bank	(4,372)
1,613	CVS Health Corp	Goldman Sachs	3,032
339	CVS Health Corp	HSBC	200
(1,517)	CyberArk Software Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(15,519)
(315)	CyberArk Software Ltd	Barclays Bank	(79)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(246)	CyberArk Software Ltd	Citibank	55
(552)	CyberArk Software Ltd	Goldman Sachs	(5,647)
(187)	CyberArk Software Ltd	HSBC	(1,270)
(86)	CyberArk Software Ltd	JP Morgan	(584)
(1,280)	Danaher Corp	Bank of America Merrill Lynch	(5,741)
(184)	Danaher Corp	Barclays Bank	(410)
(384)	Danaher Corp	Credit Suisse	1,110
(3,054)	Danaher Corp	Goldman Sachs	(15,671)
(213)	Danaher Corp	HSBC	616
(96)	Danaher Corp	JP Morgan	(436)
1,530	Darden Restaurants Inc	Barclays Bank	2,861
(449)	Datadog Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(4,499)
(1,222)	Datadog Inc 'A'	Barclays Bank	(1,576)
(301)	Datadog Inc 'A'	Credit Suisse	(4,271)
(1,481)	Datadog Inc 'A'	Goldman Sachs	(14,840)
(20)	Datadog Inc 'A'	JP Morgan	(284)
1,219	DaVita Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,825)
404	DaVita Inc	Barclays Bank	(624)
110	DaVita Inc	Credit Suisse	(870)
83	DaVita Inc	Goldman Sachs	3
157	DaVita Inc	HSBC	(1,242)
528	Deere & Co	Barclays Bank	919
29	Deere & Co	Credit Suisse	(879)
364	Dell Technologies Inc 'C'	Bank of America Merrill Lynch	91
533	Dell Technologies Inc 'C'	Barclays Bank	(799)
52	Dell Technologies Inc 'C'	Credit Suisse	(54)
140	Dell Technologies Inc 'C'	Goldman Sachs	35
127	Dell Technologies Inc 'C'	JP Morgan	(132)
347	Delta Air Lines Inc	Barclays Bank	524
1,409	Delta Air Lines Inc	Goldman Sachs	1,310
1,398	DENTSPLY SIRONA Inc	Goldman Sachs	(2,838)
970	Devon Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	(611)
8,012	Devon Energy Corp	Barclays Bank	4,887
520	Devon Energy Corp	Goldman Sachs	(328)
(69)	Dexcom Inc	Citibank	(966)
(30)	Dexcom Inc	Goldman Sachs	(768)
105	Discover Financial Services	Barclays Bank	260
(328)	Discovery Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(97)
(1,328)	Discovery Inc 'A'	Barclays Bank	(1,102)
(279)	Discovery Inc 'A'	Credit Suisse	1,437
(799)	DISH Network Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	965
(1,079)	DISH Network Corp 'A'	Barclays Bank	971
(342)	DISH Network Corp 'A'	Credit Suisse	1,005
(696)	DISH Network Corp 'A'	HSBC	2,046
(398)	DocuSign Inc	Barclays Bank	(2,416)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(474)	DocuSign Inc	Citibank	(2,877)
(190)	Dollar General Corp	Goldman Sachs	236
389	Dollar Tree Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,581)
316	Dollar Tree Inc	Barclays Bank	(3,068)
346	Dollar Tree Inc	Citibank	(3,356)
173	Dollar Tree Inc	Credit Suisse	(3,207)
295	Dollar Tree Inc	Goldman Sachs	(2,166)
32	Dollar Tree Inc	HSBC	(593)
491	Domino's Pizza Inc	Barclays Bank	2,931
4,298	Dover Corp	Bank of America Merrill Lynch	731
772	Dow Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,922)
185	Dow Inc	Barclays Bank	(209)
198	Dow Inc	Goldman Sachs	(493)
222	DR Horton Inc	Barclays Bank	930
291	DR Horton Inc	Goldman Sachs	(105)
384	DR Horton Inc	HSBC	(3,517)
(1,068)	DraftKings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(6,878)
(566)	DraftKings Inc 'A'	Barclays Bank	(1,183)
(356)	DraftKings Inc 'A'	Citibank	(744)
(272)	DraftKings Inc 'A'	Credit Suisse	(452)
(653)	DraftKings Inc 'A'	Goldman Sachs	(4,205)
(672)	DraftKings Inc 'A'	JP Morgan	(3,098)
5,797	Dropbox Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	6,854
3,401	Dropbox Inc 'A'	Barclays Bank	767
17	Dropbox Inc 'A'	Citibank	3
761	Dropbox Inc 'A'	Goldman Sachs	951
327	DuPont de Nemours Inc	Bank of America Merrill Lynch	(232)
767	DuPont de Nemours Inc	Barclays Bank	(514)
404	DuPont de Nemours Inc	Citibank	(271)
147	DuPont de Nemours Inc	Credit Suisse	428
863	DuPont de Nemours Inc	Goldman Sachs	(286)
559	DuPont de Nemours Inc	HSBC	1,627
578	DuPont de Nemours Inc	JP Morgan	1,373
(1,058)	Dynatrace Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,396)
(56)	Dynatrace Inc	Citibank	(59)
(668)	Dynatrace Inc	Goldman Sachs	(3,407)
1,765	eBay Inc	Barclays Bank	(181)
302	eBay Inc	Citibank	(27)
4,441	eBay Inc	Credit Suisse	(2,487)
590	eBay Inc	HSBC	(330)
345	eBay Inc	JP Morgan	(193)
54	Ecolab Inc	Bank of America Merrill Lynch	(354)
337	Ecolab Inc	Barclays Bank	(74)
55	Ecolab Inc	Citibank	(12)
334	Ecolab Inc	Goldman Sachs	(2,191)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
106	Ecolab Inc	HSBC	(329)
(476)	Edison International	Bank of America Merrill Lynch	904
(5,215)	Edison International	Barclays Bank	7,503
1,735	Edwards Lifesciences Corp	Bank of America Merrill Lynch	10,497
3,877	Edwards Lifesciences Corp	Barclays Bank	1,745
335	Edwards Lifesciences Corp	Citibank	151
920	Edwards Lifesciences Corp	Goldman Sachs	5,566
354	Edwards Lifesciences Corp	HSBC	1,947
(2,328)	Elanco Animal Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,258)
(9,618)	Elanco Animal Health Inc	Barclays Bank	(1,924)
(507)	Elanco Animal Health Inc	Credit Suisse	(1,896)
(572)	Elanco Animal Health Inc	Goldman Sachs	(555)
(591)	Elanco Animal Health Inc	HSBC	(2,210)
(754)	Elanco Animal Health Inc	JP Morgan	(2,820)
1,977	Electronic Arts Inc	Bank of America Merrill Lynch	9,938
1,884	Electronic Arts Inc	Barclays Bank	1,324
64	Electronic Arts Inc	Credit Suisse	146
3,598	Electronic Arts Inc	Goldman Sachs	19,429
814	Electronic Arts Inc	HSBC	2,408
186	Electronic Arts Inc	JP Morgan	424
(234)	Eli Lilly & Co	Bank of America Merrill Lynch	(985)
(299)	Eli Lilly & Co	Barclays Bank	213
(60)	Eli Lilly & Co	Citibank	11
(122)	Eli Lilly & Co	Credit Suisse	(608)
(160)	Eli Lilly & Co	HSBC	(453)
434	Emerson Electric Co	Bank of America Merrill Lynch	74
4,015	Emerson Electric Co	Barclays Bank	6,745
136	Emerson Electric Co	Credit Suisse	42
195	Emerson Electric Co	Goldman Sachs	33
346	Emerson Electric Co	HSBC	107
(405)	Enphase Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9,975)
(657)	Enphase Energy Inc	Barclays Bank	(1,432)
(460)	Enphase Energy Inc	Goldman Sachs	(11,330)
(68)	Enphase Energy Inc	JP Morgan	(1,695)
204	EPAM Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	6,087
219	EPAM Systems Inc	Barclays Bank	(1,494)
(377)	Equifax Inc	Barclays Bank	927
653	Equitable Holdings Inc	Goldman Sachs	(1,371)
2,469	Equitable Holdings Inc	HSBC	(6,370)
(740)	Erie Indemnity Co 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1,033
(1,055)	Erie Indemnity Co 'A'	Barclays Bank	(4,508)
(142)	Erie Indemnity Co 'A'	Credit Suisse	1,065
(198)	Erie Indemnity Co 'A'	Goldman Sachs	227
(8,855)	Essential Utilities Inc	Bank of America Merrill Lynch	(14,168)
(3,609)	Essential Utilities Inc	Barclays Bank	(947)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(368)	Essential Utilities Inc	Citibank	(110)
(2,984)	Essential Utilities Inc	Credit Suisse	(3,103)
(1,448)	Essential Utilities Inc	Goldman Sachs	(2,317)
(1,939)	Essential Utilities Inc	JP Morgan	(2,017)
(158)	Estee Lauder Cos Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(227)
(268)	Estee Lauder Cos Inc 'A'	Barclays Bank	(930)
(67)	Estee Lauder Cos Inc 'A'	Credit Suisse	(599)
(42)	Estee Lauder Cos Inc 'A'	Goldman Sachs	(415)
(153)	Etsy Inc	HSBC	367
(287)	Everest Re Group Ltd	Citibank	1,036
(369)	Eversource Energy	Bank of America Merrill Lynch	421
(1,254)	Eversource Energy	Barclays Bank	151
(425)	Eversource Energy	Credit Suisse	1,811
(603)	Exact Sciences Corp	Bank of America Merrill Lynch	(9,564)
(1,725)	Exact Sciences Corp	Barclays Bank	(1,811)
(136)	Exact Sciences Corp	Citibank	(143)
(114)	Exact Sciences Corp	Credit Suisse	(1,333)
(144)	Exact Sciences Corp	Goldman Sachs	(2,284)
(78)	Exact Sciences Corp	HSBC	(912)
3,234	Exelon Corp	Bank of America Merrill Lynch	97
(58)	Expedia Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(435)
(104)	Expedia Group Inc	Barclays Bank	(608)
(1,170)	Expedia Group Inc	Credit Suisse	(4,516)
229	Expeditors International of Washington Inc	Barclays Bank	380
173	Expeditors International of Washington Inc	Credit Suisse	976
315	Expeditors International of Washington Inc	Goldman Sachs	766
8,869	Expeditors International of Washington Inc	JP Morgan	49,642
(284)	Exxon Mobil Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,085
(3,028)	Exxon Mobil Corp	Barclays Bank	3,755
(183)	F5 Networks Inc	Bank of America Merrill Lynch	(875)
(90)	F5 Networks Inc	Barclays Bank	8
(114)	F5 Networks Inc	Credit Suisse	(282)
760	Facebook Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	10,085
602	Facebook Inc 'A'	Barclays Bank	2,468
179	Facebook Inc 'A'	Citibank	734
66	Facebook Inc 'A'	Goldman Sachs	876
117	Facebook Inc 'A'	JP Morgan	2,663
103	FactSet Research Systems Inc	Barclays Bank	558
25	Fair Isaac Corp	Bank of America Merrill Lynch	151
973	Fair Isaac Corp	Barclays Bank	5,183
41	Fair Isaac Corp	Credit Suisse	552
159	Fair Isaac Corp	Goldman Sachs	2,206
21	Fair Isaac Corp	HSBC	349
38	Fair Isaac Corp	JP Morgan	135
2,622	Fastenal Co	Barclays Bank	498

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	FedEx Corp	Bank of America Merrill Lynch	105
909	FedEx Corp	Barclays Bank	2,700
104	FedEx Corp	Credit Suisse	576
60	FedEx Corp	Goldman Sachs	333
60	FedEx Corp	JP Morgan	332
(152)	Fidelity National Information Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5)
(3,042)	Fidelity National Information Services Inc	Barclays Bank	6,267
(303)	Fidelity National Information Services Inc	Citibank	624
1,579	Fifth Third Bancorp	Goldman Sachs	(1,200)
337	First Republic Bank	Barclays Bank	330
(862)	Fiserv Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,082)
(4,459)	Fiserv Inc	Barclays Bank	2,934
(767)	Fiserv Inc	Goldman Sachs	(1,825)
(804)	Fiserv Inc	HSBC	541
(156)	FleetCor Technologies Inc	Barclays Bank	(222)
212	FMC Corp	Bank of America Merrill Lynch	(367)
2,657	FMC Corp	Barclays Bank	(133)
(5,999)	Ford Motor Co	Barclays Bank	(8,819)
(1,259)	Ford Motor Co	Goldman Sachs	(2,996)
1,761	Fortinet Inc	Bank of America Merrill Lynch	25,006
(654)	Fortive Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,269)
(286)	Fortive Corp	Barclays Bank	(160)
120	Fortune Brands Home & Security Inc	Bank of America Merrill Lynch	(382)
1,544	Fortune Brands Home & Security Inc	Barclays Bank	(1,729)
108	Fortune Brands Home & Security Inc	Citibank	(121)
(677)	Fox Corp 'A'	Credit Suisse	1,002
(1,910)	Franklin Resources Inc	Barclays Bank	(1,375)
(193)	Garmin Ltd	Barclays Bank	(434)
392	Gartner Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,231
497	Gartner Inc	Barclays Bank	(432)
128	Gartner Inc	Credit Suisse	87
158	Gartner Inc	Goldman Sachs	496
106	Gartner Inc	HSBC	72
127	Gartner Inc	JP Morgan	86
(56)	Generac Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(213)
(1,710)	General Electric Co	Bank of America Merrill Lynch	(1,556)
(18,455)	General Electric Co	Barclays Bank	(13,373)
(2,506)	General Electric Co	Citibank	(2,217)
(1,289)	General Electric Co	Goldman Sachs	(1,173)
(763)	General Electric Co	HSBC	(626)
(869)	General Mills Inc	Bank of America Merrill Lynch	(61)
(3,876)	General Mills Inc	Barclays Bank	736
(2,064)	General Mills Inc	Citibank	392
(631)	General Mills Inc	Goldman Sachs	(44)
(449)	General Motors Co	Barclays Bank	(1,217)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
815	Genuine Parts Co	Bank of America Merrill Lynch	(1,002)
772	Genuine Parts Co	Barclays Bank	(191)
614	Genuine Parts Co	Citibank	(106)
1,723	Genuine Parts Co	Goldman Sachs	(2,119)
539	Genuine Parts Co	HSBC	(816)
286	Genuine Parts Co	JP Morgan	(709)
959	Gilead Sciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,906)
1,752	Gilead Sciences Inc	Barclays Bank	(2,101)
101	Gilead Sciences Inc	Citibank	(133)
452	Gilead Sciences Inc	Credit Suisse	(619)
478	Gilead Sciences Inc	Goldman Sachs	(1,415)
2,971	Gilead Sciences Inc	HSBC	(4,070)
(1,445)	Global Payments Inc	Barclays Bank	2,225
155	Globe Life Inc	Bank of America Merrill Lynch	(57)
221	Globe Life Inc	Barclays Bank	18
122	Globe Life Inc	Goldman Sachs	(45)
7	Globe Life Inc	HSBC	(3)
2,953	GoDaddy Inc 'A'	Barclays Bank	2,835
41	GoDaddy Inc 'A'	Citibank	39
42	GoDaddy Inc 'A'	HSBC	3
(167)	Guidewire Software Inc	Bank of America Merrill Lynch	(103)
(1,094)	Guidewire Software Inc	Barclays Bank	(504)
(288)	Guidewire Software Inc	Goldman Sachs	(232)
(103)	Guidewire Software Inc	JP Morgan	(158)
(12,670)	Halliburton Co	Barclays Bank	38
(1,145)	Halliburton Co	Credit Suisse	(151)
(465)	Hartford Financial Services Group Inc	Barclays Bank	(51)
(2,186)	Hasbro Inc	Bank of America Merrill Lynch	(37)
(127)	Hasbro Inc	Barclays Bank	(158)
151	HCA Healthcare Inc	Barclays Bank	1,309
1,337	HCA Healthcare Inc	Citibank	11,592
141	HCA Healthcare Inc	Goldman Sachs	746
(112)	HEICO Corp	Bank of America Merrill Lynch	(595)
(130)	HEICO Corp	Barclays Bank	(251)
(183)	HEICO Corp	Credit Suisse	(1,381)
(1,498)	HEICO Corp	Goldman Sachs	(9,992)
488	Henry Schein Inc	Barclays Bank	(756)
1,750	Hershey Co	Barclays Bank	(1,776)
63	Hershey Co	Citibank	(66)
107	Hershey Co	Goldman Sachs	60
108	Hershey Co	HSBC	(109)
(126)	Hess Corp	Bank of America Merrill Lynch	(36)
(3,490)	Hess Corp	Barclays Bank	1,506
(192)	Hess Corp	Credit Suisse	(242)
(465)	Hess Corp	Goldman Sachs	1,209

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
6,313	Hewlett Packard Enterprise Co	Barclays Bank	(2,525)
2,396	Hewlett Packard Enterprise Co	HSBC	(1,078)
816	Hewlett Packard Enterprise Co	JP Morgan	(367)
(714)	Hilton Worldwide Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,542)
(94)	Hilton Worldwide Holdings Inc	Citibank	(158)
(563)	Hilton Worldwide Holdings Inc	Goldman Sachs	(2,004)
(225)	Hilton Worldwide Holdings Inc	HSBC	(830)
2,161	Hologic Inc	Bank of America Merrill Lynch	908
820	Hologic Inc	Barclays Bank	262
242	Hologic Inc	Citibank	99
319	Hologic Inc	Credit Suisse	(648)
237	Hologic Inc	Goldman Sachs	100
1,793	Home Depot Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,625)
750	Home Depot Inc	Barclays Bank	2,242
65	Home Depot Inc	Goldman Sachs	(72)
248	Home Depot Inc	HSBC	(1,932)
80	Home Depot Inc	JP Morgan	(1,777)
(1,029)	Horizon Therapeutics Plc	Barclays Bank	3,663
(228)	Horizon Therapeutics Plc	Citibank	812
(159)	Horizon Therapeutics Plc	Goldman Sachs	339
(10,317)	Hormel Foods Corp	Barclays Bank	7,428
(3,181)	Howmet Aerospace Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,630)
(352)	Howmet Aerospace Inc	Barclays Bank	(507)
(3,034)	Howmet Aerospace Inc	Goldman Sachs	(5,370)
(306)	Howmet Aerospace Inc	HSBC	(887)
7,508	HP Inc	Bank of America Merrill Lynch	(28,605)
6,484	HP Inc	Barclays Bank	(19,971)
1,315	HP Inc	Credit Suisse	(7,916)
1,753	HP Inc	Goldman Sachs	(6,679)
901	HP Inc	JP Morgan	(5,424)
(19)	HubSpot Inc	Bank of America Merrill Lynch	(408)
(23)	HubSpot Inc	Barclays Bank	59
(1)	HubSpot Inc	Credit Suisse	(18)
(116)	HubSpot Inc	Goldman Sachs	(2,491)
(139)	Humana Inc	Barclays Bank	708
(5,058)	Huntington Bancshares Inc	Barclays Bank	(1,113)
(79)	IAC Via InterActive Corp	Bank of America Merrill Lynch	5,152
(924)	IAC Via InterActive Corp	Barclays Bank	86,080
(382)	IAC Via InterActive Corp	Citibank	35,587
(611)	IAC Via InterActive Corp	Goldman Sachs	39,843
(198)	IAC Via InterActive Corp	HSBC	14,786
(200)	IDEX Corp	Bank of America Merrill Lynch	(55)
(384)	IDEX Corp	Barclays Bank	(559)
(50)	IDEX Corp	Credit Suisse	(53)
287	IDEXX Laboratories Inc	Bank of America Merrill Lynch	9,125

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	IDEXX Laboratories Inc	Barclays Bank	605
44	IDEXX Laboratories Inc	Credit Suisse	1,445
601	IDEXX Laboratories Inc	Goldman Sachs	19,762
35	IDEXX Laboratories Inc	HSBC	1,084
85	IDEXX Laboratories Inc	JP Morgan	2,792
(228)	IHS Markit Ltd	Barclays Bank	(41)
300	Illinois Tool Works Inc	Barclays Bank	(93)
113	Illinois Tool Works Inc	Citibank	(70)
3,148	Illinois Tool Works Inc	Credit Suisse	(22,980)
(26)	Illumina Inc	Bank of America Merrill Lynch	(680)
(214)	Illumina Inc	Barclays Bank	(1,209)
(25)	Illumina Inc	Citibank	(141)
(8)	Illumina Inc	HSBC	(201)
1,069	Incyte Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,541
732	Incyte Corp	Barclays Bank	573
122	Incyte Corp	Credit Suisse	191
161	Incyte Corp	Goldman Sachs	98
914	Incyte Corp	HSBC	2,184
(6,290)	Ingersoll Rand Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,535)
(1,849)	Ingersoll Rand Inc	Barclays Bank	(92)
(388)	Ingersoll Rand Inc	Citibank	(19)
(554)	Ingersoll Rand Inc	Credit Suisse	147
(619)	Ingersoll Rand Inc	Goldman Sachs	(545)
(410)	Insulet Corp	Bank of America Merrill Lynch	(16,908)
(116)	Insulet Corp	Barclays Bank	(1,496)
(34)	Insulet Corp	Citibank	(439)
(45)	Insulet Corp	Goldman Sachs	(844)
1,165	Intel Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,085
2,133	Intel Corp	Barclays Bank	341
71	Intel Corp	Citibank	11
(405)	Intercontinental Exchange Inc	Barclays Bank	(26)
(128)	International Business Machines Corp	Bank of America Merrill Lynch	175
(947)	International Business Machines Corp	Barclays Bank	928
(472)	International Flavors & Fragrances Inc	Barclays Bank	90
(108)	International Flavors & Fragrances Inc	Citibank	21
(3,092)	International Flavors & Fragrances Inc	Credit Suisse	3,216
(56)	International Flavors & Fragrances Inc	Goldman Sachs	60
(237)	International Flavors & Fragrances Inc	JP Morgan	246
5,077	International Paper Co	Barclays Bank	(6,600)
313	International Paper Co	Credit Suisse	319
1,936	International Paper Co	Goldman Sachs	(1,936)
356	International Paper Co	JP Morgan	363
1,187	Interpublic Group of Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,329
7,832	Interpublic Group of Cos Inc	Barclays Bank	2,910
1,117	Interpublic Group of Cos Inc	Goldman Sachs	1,251

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
404	Interpublic Group of Cos Inc	HSBC	364
1,333	Interpublic Group of Cos Inc	JP Morgan	1,114
600	Intuit Inc	Bank of America Merrill Lynch	11,802
358	Intuit Inc	Citibank	(473)
(218)	Intuitive Surgical Inc	Barclays Bank	(1,544)
(33)	Intuitive Surgical Inc	Goldman Sachs	(831)
377	Invesco Ltd	Barclays Bank	577
1,558	Invesco Ltd	Credit Suisse	483
417	Invesco Ltd	Goldman Sachs	321
382	Invesco Ltd	HSBC	118
(268)	Ionis Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	19
(1,300)	Ionis Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	(2,366)
(770)	Ionis Pharmaceuticals Inc	Citibank	(1,401)
(234)	Ionis Pharmaceuticals Inc	HSBC	(236)
(256)	IPG Photonics Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3,295)
(618)	IPG Photonics Corp	Barclays Bank	(1,148)
(113)	IPG Photonics Corp	Citibank	(194)
(63)	IPG Photonics Corp	Credit Suisse	(408)
(188)	IPG Photonics Corp	Goldman Sachs	(1,492)
(144)	IQVIA Holdings Inc	Goldman Sachs	(1,250)
272	J M Smucker Co	Barclays Bank	(631)
83	J M Smucker Co	HSBC	(140)
(65)	Jack Henry & Associates Inc	Barclays Bank	173
(84)	Jack Henry & Associates Inc	Goldman Sachs	197
(119)	Jack Henry & Associates Inc	HSBC	560
273	Jazz Pharmaceuticals Plc	Bank of America Merrill Lynch	363
331	Jazz Pharmaceuticals Plc	Barclays Bank	(275)
23	Jazz Pharmaceuticals Plc	Citibank	(19)
607	Jazz Pharmaceuticals Plc	Goldman Sachs	807
14	Jazz Pharmaceuticals Plc	HSBC	28
501	Jazz Pharmaceuticals Plc	JP Morgan	1,017
2,274	JB Hunt Transport Services Inc	Barclays Bank	1,023
59	JB Hunt Transport Services Inc	JP Morgan	(527)
(519)	Johnson & Johnson	Bank of America Merrill Lynch	125
(974)	Johnson & Johnson	Barclays Bank	1,266
(102)	Johnson & Johnson	Credit Suisse	138
(750)	Johnson & Johnson	Goldman Sachs	855
(539)	Johnson & Johnson	HSBC	550
(115)	Johnson & Johnson	JP Morgan	(13)
4,933	Johnson Controls International Plc	Bank of America Merrill Lynch	3,108
862	Johnson Controls International Plc	Barclays Bank	1,332
458	Johnson Controls International Plc	Credit Suisse	304
724	Johnson Controls International Plc	Goldman Sachs	456
160	Johnson Controls International Plc	HSBC	114
796	Johnson Controls International Plc	JP Morgan	565

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(75)	JPMorgan Chase & Co	Barclays Bank	(53)
(181)	JPMorgan Chase & Co	Goldman Sachs	78
(3,145)	Juniper Networks Inc	Barclays Bank	1,604
(83)	Kansas City Southern	Barclays Bank	(189)
(68)	Kansas City Southern	Citibank	(330)
(120)	Kansas City Southern	Goldman Sachs	(429)
695	Kellogg Co	Citibank	(424)
(13,738)	Keurig Dr Pepper Inc	Bank of America Merrill Lynch	(13,601)
(3,821)	Keurig Dr Pepper Inc	Barclays Bank	(382)
372	KeyCorp	Bank of America Merrill Lynch	(179)
18,504	KeyCorp	Barclays Bank	-
1,553	Keysight Technologies Inc	Goldman Sachs	4,411
(1,766)	Kimberly-Clark Corp	Barclays Bank	2,316
(1,068)	Kimberly-Clark Corp	Credit Suisse	6,102
(1,061)	Kimberly-Clark Corp	Goldman Sachs	3,037
(111)	Kimberly-Clark Corp	HSBC	696
1,108	Kinder Morgan Inc	Bank of America Merrill Lynch	(510)
7,070	Kinder Morgan Inc	Barclays Bank	(3,464)
1,266	KKR & Co Inc	Barclays Bank	468
184	KKR & Co Inc	Credit Suisse	(48)
218	KLA Corp	Bank of America Merrill Lynch	3,466
52	KLA Corp	Credit Suisse	883
90	KLA Corp	Goldman Sachs	1,725
47	KLA Corp	JP Morgan	799
595	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(690)
8,053	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	Barclays Bank	(5,798)
861	Kraft Heinz Co	Goldman Sachs	(493)
648	Kroger Co	Bank of America Merrill Lynch	(266)
2,726	Kroger Co	Barclays Bank	1,036
(992)	L3Harris Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	40
(632)	L3Harris Technologies Inc	Barclays Bank	(768)
(243)	L3Harris Technologies Inc	Credit Suisse	(361)
(315)	L3Harris Technologies Inc	Goldman Sachs	13
(305)	L3Harris Technologies Inc	HSBC	(317)
(102)	L3Harris Technologies Inc	JP Morgan	(106)
247	Laboratory Corp of America Holdings	Bank of America Merrill Lynch	1,292
48	Laboratory Corp of America Holdings	Barclays Bank	154
371	Laboratory Corp of America Holdings	Goldman Sachs	2,653
49	Laboratory Corp of America Holdings	HSBC	(127)
289	Lam Research Corp	Bank of America Merrill Lynch	16,698
48	Lam Research Corp	Barclays Bank	730
22	Lam Research Corp	Credit Suisse	600
277	Lam Research Corp	Goldman Sachs	16,005
(1,970)	Lamb Weston Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9,476)
(2,114)	Las Vegas Sands Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,093)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(6,718)	Las Vegas Sands Corp	Barclays Bank	(67)
(1,059)	Las Vegas Sands Corp	Goldman Sachs	(1,048)
(594)	Las Vegas Sands Corp	HSBC	(362)
(287)	Las Vegas Sands Corp	JP Morgan	(175)
(315)	Lear Corp	Barclays Bank	(1,994)
(191)	Lear Corp	Citibank	(1,209)
(394)	Lear Corp	Goldman Sachs	(3,294)
(321)	Lear Corp	HSBC	(876)
796	Lennar Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	732
177	Lennar Corp 'A'	Credit Suisse	(1,584)
128	Lennar Corp 'A'	Goldman Sachs	118
271	Lennar Corp 'A'	HSBC	(2,425)
299	Lennox International Inc	Bank of America Merrill Lynch	478
372	Lennox International Inc	Barclays Bank	2,671
34	Lennox International Inc	Credit Suisse	(122)
170	Lennox International Inc	Goldman Sachs	272
(1,082)	Liberty Broadband Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3,376)
(2,091)	Liberty Broadband Corp	Barclays Bank	1,422
(461)	Liberty Broadband Corp	Citibank	313
(901)	Liberty Broadband Corp	Credit Suisse	(451)
(1,499)	Liberty Broadband Corp	Goldman Sachs	(4,677)
(84)	Liberty Broadband Corp	HSBC	(42)
(282)	Liberty Broadband Corp	JP Morgan	(141)
(3,980)	Liberty Global Plc 'A'	Barclays Bank	(40)
(3,887)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	Bank of America Merrill Lynch	(2,954)
(2,763)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	Barclays Bank	939
(1,025)	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C'	Barclays Bank	(1,302)
(945)	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C'	HSBC	(1,276)
(313)	Lincoln National Corp	Barclays Bank	(160)
(93)	Linde Plc	Bank of America Merrill Lynch	26
(74)	Linde Plc	Barclays Bank	50
(1,689)	Linde Plc	Goldman Sachs	473
(40)	Linde Plc	HSBC	16
(1,655)	Live Nation Entertainment Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9,251)
(896)	Live Nation Entertainment Inc	Barclays Bank	1,443
(125)	Live Nation Entertainment Inc	Goldman Sachs	(699)
695	LKQ Corp	Bank of America Merrill Lynch	265
2,685	LKQ Corp	Barclays Bank	1,578
537	LKQ Corp	Citibank	381
2,314	LKQ Corp	Goldman Sachs	(231)
277	LKQ Corp	HSBC	277
553	LKQ Corp	JP Morgan	553
3,320	Loews Corp	Barclays Bank	(664)
2,183	Lowe's Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,528
596	Lowe's Cos Inc	Barclays Bank	2,176

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
64	Lowe's Cos Inc	Credit Suisse	(1,055)
227	Lowe's Cos Inc	Goldman Sachs	159
578	Lowe's Cos Inc	HSBC	(6,775)
(48)	Lululemon Athletica Inc	Bank of America Merrill Lynch	(412)
(12,129)	Lumen Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	8,612
(1,075)	LyondellBasell Industries NV 'A'	Barclays Bank	(1,096)
343	M&T Bank Corp	Barclays Bank	(305)
(906)	Marathon Petroleum Corp	Bank of America Merrill Lynch	(712)
(427)	Marathon Petroleum Corp	Barclays Bank	(457)
(963)	Marathon Petroleum Corp	Goldman Sachs	(270)
36	Markel Corp	Citibank	(162)
(294)	MarketAxess Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,366)
(93)	MarketAxess Holdings Inc	Barclays Bank	(786)
(21)	MarketAxess Holdings Inc	Credit Suisse	(562)
(40)	MarketAxess Holdings Inc	Goldman Sachs	(458)
(23)	MarketAxess Holdings Inc	HSBC	(74)
(519)	Marriott International Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,931)
(1,537)	Marriott International Inc 'A'	Barclays Bank	(2,598)
(145)	Marsh & McLennan Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	(560)
(889)	Marsh & McLennan Cos Inc	Barclays Bank	(1,707)
(843)	Marsh & McLennan Cos Inc	Citibank	(1,619)
(501)	Marsh & McLennan Cos Inc	Credit Suisse	(281)
(453)	Marsh & McLennan Cos Inc	Goldman Sachs	(1,749)
(103)	Martin Marietta Materials Inc	Barclays Bank	289
(2,145)	Marvell Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11,776)
(437)	Marvell Technology Inc	Barclays Bank	(297)
(1,382)	Marvell Technology Inc	Goldman Sachs	(7,587)
(1,122)	Marvell Technology Inc	JP Morgan	(4,466)
5,731	Masco Corp	Bank of America Merrill Lynch	(20,058)
2,488	Masco Corp	Barclays Bank	(984)
725	Masco Corp	Citibank	(247)
178	Masco Corp	Credit Suisse	(1,210)
1,271	Masco Corp	Goldman Sachs	(3,448)
741	Masco Corp	HSBC	(1,818)
182	Masimo Corp	Bank of America Merrill Lynch	466
159	Masimo Corp	Barclays Bank	(415)
61	Masimo Corp	Citibank	(159)
88	Masimo Corp	Goldman Sachs	225
255	Masimo Corp	HSBC	(326)
(534)	Match Group Inc	Barclays Bank	2,093
(23)	Match Group Inc	Citibank	90
(40)	Match Group Inc	Goldman Sachs	(136)
1,588	Maxim Integrated Products Inc	Bank of America Merrill Lynch	16,801
892	Maxim Integrated Products Inc	Barclays Bank	1,169
673	Maxim Integrated Products Inc	Goldman Sachs	7,120

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
4,306	Maxim Integrated Products Inc	HSBC	40,304
106	Maxim Integrated Products Inc	JP Morgan	992
(434)	McCormick & Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	35
(555)	McCormick & Co Inc	Barclays Bank	855
(202)	McCormick & Co Inc	Citibank	311
(198)	McCormick & Co Inc	Goldman Sachs	16
339	McDonald's Corp	Bank of America Merrill Lynch	677
336	McDonald's Corp	Barclays Bank	291
224	McDonald's Corp	Goldman Sachs	495
42	McDonald's Corp	JP Morgan	(135)
259	McKesson Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,805)
1,521	McKesson Corp	Barclays Bank	(11,027)
91	McKesson Corp	Citibank	(660)
204	McKesson Corp	Goldman Sachs	(1,422)
295	McKesson Corp	HSBC	(2,873)
215	McKesson Corp	JP Morgan	(2,094)
(1,342)	Medtronic Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1,076)
(4,014)	Medtronic Plc	Barclays Bank	6,034
(843)	Medtronic Plc	Citibank	1,273
(595)	Medtronic Plc	Credit Suisse	127
(1,673)	Medtronic Plc	Goldman Sachs	(1,773)
(209)	Medtronic Plc	HSBC	(111)
(5,831)	Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR	Bank of America Merrill Lynch	573
(6,136)	Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR	Barclays Bank	(127)
(848)	Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR	Citibank	(51)
(1,340)	Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR	HSBC	1,755
(7)	MercadoLibre Inc	Bank of America Merrill Lynch	(153)
(127)	MercadoLibre Inc	Barclays Bank	1,100
(969)	Merck & Co Inc	Barclays Bank	491
287	MetLife Inc	Bank of America Merrill Lynch	(98)
7,955	MetLife Inc	Barclays Bank	(80)
45	MetLife Inc	Credit Suisse	(50)
1,809	MetLife Inc	Goldman Sachs	(615)
160	MetLife Inc	JP Morgan	(178)
262	Mettler-Toledo International Inc	Bank of America Merrill Lynch	10,782
215	Mettler-Toledo International Inc	Barclays Bank	4,036
45	Mettler-Toledo International Inc	Credit Suisse	1,661
75	Mettler-Toledo International Inc	Goldman Sachs	2,530
16	Mettler-Toledo International Inc	JP Morgan	902
697	MGM Resorts International	Bank of America Merrill Lynch	2,872
276	MGM Resorts International	Credit Suisse	941
(2,045)	Microchip Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(27,464)
(998)	Microchip Technology Inc	Barclays Bank	(2,844)
(392)	Microchip Technology Inc	Credit Suisse	(4,364)
(406)	Microchip Technology Inc	Goldman Sachs	(5,453)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(118)	Micron Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(443)
(682)	Micron Technology Inc	Barclays Bank	(846)
(287)	Micron Technology Inc	Goldman Sachs	(1,076)
406	Microsoft Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,827
716	Microsoft Corp	Barclays Bank	(788)
147	Microsoft Corp	Goldman Sachs	662
114	Microsoft Corp	HSBC	285
2,287	Microsoft Corp	JP Morgan	5,718
62	Moderna Inc	Barclays Bank	1,292
98	Moderna Inc	JP Morgan	2,617
91	Mohawk Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(689)
757	Mohawk Industries Inc	Barclays Bank	1,817
80	Mohawk Industries Inc	Goldman Sachs	(606)
122	Mohawk Industries Inc	HSBC	(1,928)
120	Mohawk Industries Inc	JP Morgan	(1,896)
290	Molina Healthcare Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,100)
590	Molina Healthcare Inc	Citibank	(1,558)
115	Molina Healthcare Inc	Credit Suisse	(1,999)
48	Molina Healthcare Inc	Goldman Sachs	(513)
59	Molina Healthcare Inc	JP Morgan	(1,025)
269	Molson Coors Beverage Co ' B '	Bank of America Merrill Lynch	105
735	Molson Coors Beverage Co ' B '	Barclays Bank	419
1,761	Molson Coors Beverage Co ' B '	Goldman Sachs	687
349	Mondelez International Inc ' A '	Goldman Sachs	370
630	Mondelez International Inc ' A '	HSBC	920
(371)	MongoDB Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10,299)
(414)	MongoDB Inc	Barclays Bank	(2,140)
(72)	MongoDB Inc	Citibank	(372)
681	Monolithic Power Systems Inc	Barclays Bank	9,003
29	Monolithic Power Systems Inc	Citibank	383
157	Monster Beverage Corp	Bank of America Merrill Lynch	458
1,861	Monster Beverage Corp	Barclays Bank	1,707
135	Monster Beverage Corp	Citibank	176
563	Monster Beverage Corp	Goldman Sachs	1,644
1,988	Monster Beverage Corp	HSBC	5,308
(200)	Moody ' s Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,132)
520	Morgan Stanley	Bank of America Merrill Lynch	1,487
482	Morgan Stanley	Barclays Bank	607
141	Morgan Stanley	Citibank	178
2,354	Morgan Stanley	Goldman Sachs	6,732
599	Morgan Stanley	HSBC	2,684
2,142	Mosaic Co	Bank of America Merrill Lynch	(1,971)
795	Mosaic Co	Barclays Bank	350
588	Mosaic Co	Citibank	259
364	Mosaic Co	Credit Suisse	229

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
1,167	Mosaic Co	Goldman Sachs	(1,074)
353	Mosaic Co	JP Morgan	222
194	Motorola Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	904
973	Motorola Solutions Inc	Barclays Bank	2,403
4	Motorola Solutions Inc	JP Morgan	20
(220)	MSCI Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,717)
(32)	MSCI Inc	Barclays Bank	(169)
(67)	MSCI Inc	Citibank	(354)
(33)	MSCI Inc	Goldman Sachs	(408)
(54)	MSCI Inc	HSBC	473
(77)	Nasdaq Inc	Bank of America Merrill Lynch	(286)
(636)	Nasdaq Inc	Barclays Bank	(1,296)
(66)	Nasdaq Inc	Credit Suisse	(259)
(230)	Nasdaq Inc	Goldman Sachs	(853)
(62)	Nasdaq Inc	HSBC	(227)
(80)	Nasdaq Inc	JP Morgan	(142)
1,967	NetApp Inc	Barclays Bank	(3,187)
160	NetApp Inc	Citibank	(259)
310	NetApp Inc	Credit Suisse	(462)
1,911	NetApp Inc	Goldman Sachs	(2,045)
41	NetApp Inc	HSBC	(61)
134	NetApp Inc	JP Morgan	(200)
(292)	Netflix Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,050)
(73)	Netflix Inc	Barclays Bank	(29)
(294)	Netflix Inc	Goldman Sachs	(4,078)
(35)	Netflix Inc	HSBC	(4)
(318)	Neurocrine Biosciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	(999)
(711)	Neurocrine Biosciences Inc	Barclays Bank	(292)
(380)	Neurocrine Biosciences Inc	Goldman Sachs	(1,193)
(288)	Neurocrine Biosciences Inc	HSBC	(1,434)
(301)	Neurocrine Biosciences Inc	JP Morgan	(1,499)
1,003	Newell Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	600
(159)	Newmont Corp	Bank of America Merrill Lynch	83
(5,551)	Newmont Corp	Barclays Bank	1,369
(417)	Newmont Corp	Credit Suisse	(2,139)
(1,256)	Newmont Corp	Goldman Sachs	653
(246)	Newmont Corp	JP Morgan	(1,262)
375	News Corp 'A'	Barclays Bank	56
3,393	News Corp 'A'	Goldman Sachs	271
624	News Corp 'A'	HSBC	(281)
(2,538)	NextEra Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,023)
(4,358)	NextEra Energy Inc	Barclays Bank	1,782
(2,211)	NextEra Energy Inc	Goldman Sachs	(2,919)
(293)	NextEra Energy Inc	HSBC	463
886	NIKE Inc 'B'	Barclays Bank	2,126

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
209	Nordson Corp	Bank of America Merrill Lynch	3,699
256	Nordson Corp	Barclays Bank	4,920
190	Nordson Corp	Citibank	3,652
997	Nordson Corp	Goldman Sachs	17,647
112	Nordson Corp	HSBC	1,457
146	Nordson Corp	JP Morgan	1,899
59	Norfolk Southern Corp	Bank of America Merrill Lynch	(286)
189	Norfolk Southern Corp	Barclays Bank	79
424	Norfolk Southern Corp	Goldman Sachs	(2,052)
341	Northern Trust Corp	Bank of America Merrill Lynch	194
739	Northern Trust Corp	Barclays Bank	392
167	Northern Trust Corp	Citibank	89
181	Northern Trust Corp	Credit Suisse	183
660	Northern Trust Corp	Goldman Sachs	376
910	NortonLifeLock Inc	HSBC	2,017
34	Novocure Ltd	Barclays Bank	638
154	Novocure Ltd	Goldman Sachs	4,466
(131)	Nucor Corp	Bank of America Merrill Lynch	(132)
(3,198)	Nucor Corp	Barclays Bank	2,622
(518)	Nucor Corp	JP Morgan	358
(52)	NVIDIA Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3,292)
(98)	NVIDIA Corp	Barclays Bank	(2,479)
(157)	NVIDIA Corp	Goldman Sachs	(13,056)
2	NVR Inc	Bank of America Merrill Lynch	31
49	NVR Inc	Barclays Bank	11,491
8	NVR Inc	Credit Suisse	(2,629)
707	NXP Semiconductors NV	Barclays Bank	4,977
60	NXP Semiconductors NV	Citibank	422
(179)	Occidental Petroleum Corp	Bank of America Merrill Lynch	77
(1,280)	Occidental Petroleum Corp	Barclays Bank	(887)
(2,962)	Occidental Petroleum Corp	Goldman Sachs	1,274
(418)	Occidental Petroleum Corp	HSBC	280
(114)	Okta Inc	Bank of America Merrill Lynch	285
(416)	Okta Inc	Barclays Bank	8,370
(1,254)	Okta Inc	Goldman Sachs	3,135
399	Old Dominion Freight Line Inc	Bank of America Merrill Lynch	(676)
268	Old Dominion Freight Line Inc	Barclays Bank	129
37	Old Dominion Freight Line Inc	Citibank	28
1,173	Old Dominion Freight Line Inc	Goldman Sachs	(4,852)
1,237	Old Dominion Freight Line Inc	HSBC	(5,789)
38	Old Dominion Freight Line Inc	JP Morgan	63
580	Omnicom Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(505)
4,746	Omnicom Group Inc	Barclays Bank	(4,556)
483	Omnicom Group Inc	Citibank	(464)
723	Omnicom Group Inc	Goldman Sachs	(629)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
204	Omnicom Group Inc	HSBC	(522)
491	Omnicom Group Inc	JP Morgan	(1,257)
(3,693)	ON Semiconductor Corp	Bank of America Merrill Lynch	(12,187)
(789)	ON Semiconductor Corp	Barclays Bank	(552)
(385)	ON Semiconductor Corp	Credit Suisse	(359)
(377)	ONEOK Inc	Barclays Bank	528
(2,949)	Oracle Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,061
(520)	Oracle Corp	Barclays Bank	333
(312)	Oracle Corp	Credit Suisse	440
(2,072)	Oracle Corp	Goldman Sachs	704
84	O'Reilly Automotive Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,054)
469	O'Reilly Automotive Inc	Barclays Bank	(583)
52	O'Reilly Automotive Inc	Citibank	(92)
61	O'Reilly Automotive Inc	Credit Suisse	(49)
32	O'Reilly Automotive Inc	Goldman Sachs	(63)
259	Otis Worldwide Corp	Citibank	52
366	Otis Worldwide Corp	Goldman Sachs	(249)
979	Owens Corning	Bank of America Merrill Lynch	352
1,021	Owens Corning	Barclays Bank	1,521
341	Owens Corning	Citibank	504
278	Owens Corning	Credit Suisse	(22)
353	Owens Corning	Goldman Sachs	127
2,102	Owens Corning	HSBC	(3,300)
111	Owens Corning	JP Morgan	(174)
311	PACCAR Inc	Bank of America Merrill Lynch	(697)
705	PACCAR Inc	Barclays Bank	(197)
544	PACCAR Inc	Goldman Sachs	(1,219)
(37)	Packaging Corp of America	Bank of America Merrill Lynch	240
(361)	Packaging Corp of America	Barclays Bank	1,029
(136)	Palo Alto Networks Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,733)
(67)	Palo Alto Networks Inc	Barclays Bank	85
(465)	Palo Alto Networks Inc	Goldman Sachs	(12,764)
561	Parker-Hannifin Corp	Barclays Bank	1,279
(117)	Paychex Inc	Barclays Bank	88
(122)	Paycom Software Inc	Barclays Bank	834
(155)	Paycom Software Inc	Goldman Sachs	(1,147)
(521)	PayPal Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,159)
(561)	PayPal Holdings Inc	Barclays Bank	(1,599)
(88)	PayPal Holdings Inc	Citibank	(251)
(10)	PayPal Holdings Inc	HSBC	(164)
1	Pebblebrook Hotel Trust (REIT)	Credit Suisse	-
(650)	Peloton Interactive Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(10,011)
(473)	Peloton Interactive Inc 'A'	Barclays Bank	(4,328)
(99)	Peloton Interactive Inc 'A'	Credit Suisse	(2,259)
(737)	Peloton Interactive Inc 'A'	Goldman Sachs	(13,281)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
4,802	Pentair Plc	Barclays Bank	4,370
3,873	PepsiCo Inc	Bank of America Merrill Lynch	6,855
883	PepsiCo Inc	Barclays Bank	13
131	PepsiCo Inc	Citibank	12
69	PepsiCo Inc	Credit Suisse	84
484	PepsiCo Inc	Goldman Sachs	857
(2,167)	PerkinElmer Inc	Barclays Bank	(997)
(1,749)	Pfizer Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,266
(2,917)	Pfizer Inc	Barclays Bank	3,150
(173)	Phillips 66	Bank of America Merrill Lynch	(13)
(410)	Phillips 66	Barclays Bank	529
(263)	Phillips 66	HSBC	360
868	Pinterest Inc 'A'	Barclays Bank	2,075
300	Pinterest Inc 'A'	Citibank	717
1,094	Pinterest Inc 'A'	Goldman Sachs	7,877
172	Pinterest Inc 'A'	HSBC	1,085
(908)	Pioneer Natural Resources Co	Bank of America Merrill Lynch	3,816
(67)	Pioneer Natural Resources Co	Barclays Bank	(155)
(161)	Pioneer Natural Resources Co	Citibank	(89)
(863)	Pioneer Natural Resources Co	Goldman Sachs	1,603
(1,074)	Plug Power Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,186)
(2,528)	Plug Power Inc	Barclays Bank	(8,426)
(2,617)	Plug Power Inc	Citibank	(9,159)
(1,512)	Plug Power Inc	Credit Suisse	(11,403)
(1,020)	Plug Power Inc	Goldman Sachs	(5,875)
(1,708)	Plug Power Inc	HSBC	(18,156)
104	PNC Financial Services Group Inc	Citibank	72
61	PNC Financial Services Group Inc	Goldman Sachs	(265)
807	Pool Corp	Barclays Bank	4,689
45	Pool Corp	Citibank	261
45	Pool Corp	Goldman Sachs	40
(354)	PPD Inc	Barclays Bank	-
(374)	PPG Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	90
(597)	PPG Industries Inc	Barclays Bank	(90)
(389)	PPG Industries Inc	Goldman Sachs	93
416	Principal Financial Group Inc	Citibank	(154)
(585)	Procter & Gamble Co	Goldman Sachs	1,685
(2,703)	Progressive Corp	Bank of America Merrill Lynch	20,218
(611)	Progressive Corp	Barclays Bank	(582)
(132)	Progressive Corp	Credit Suisse	879
(234)	Progressive Corp	Goldman Sachs	1,750
(416)	Progressive Corp	JP Morgan	2,771
2,422	Prudential Financial Inc	Barclays Bank	1,550
800	PTC Inc	Barclays Bank	1,056
182	PTC Inc	Goldman Sachs	1,179

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(2,341)	Public Service Enterprise Group Inc	Barclays Bank	60
(351)	Public Service Enterprise Group Inc	Goldman Sachs	60
529	PulteGroup Inc	Bank of America Merrill Lynch	(106)
2,667	PulteGroup Inc	Barclays Bank	4,721
246	PulteGroup Inc	Citibank	435
427	PulteGroup Inc	Goldman Sachs	(85)
22	PulteGroup Inc	HSBC	(100)
72	Qorvo Inc	Bank of America Merrill Lynch	838
532	Qorvo Inc	Barclays Bank	2,176
226	Qorvo Inc	Goldman Sachs	1,849
171	Qorvo Inc	HSBC	1,924
68	Qorvo Inc	JP Morgan	744
1,564	QUALCOMM Inc	Bank of America Merrill Lynch	7,413
1,238	QUALCOMM Inc	Barclays Bank	2,018
302	QUALCOMM Inc	Citibank	492
179	QUALCOMM Inc	Credit Suisse	272
1,709	QUALCOMM Inc	Goldman Sachs	6,897
1,193	QUALCOMM Inc	HSBC	6,681
338	QUALCOMM Inc	JP Morgan	1,893
124	Quest Diagnostics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(42)
602	Quest Diagnostics Inc	Barclays Bank	722
376	Raymond James Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(500)
286	Raymond James Financial Inc	Barclays Bank	(555)
361	Raymond James Financial Inc	Citibank	(700)
186	Raymond James Financial Inc	Credit Suisse	(458)
489	Raymond James Financial Inc	Goldman Sachs	(650)
79	Raymond James Financial Inc	HSBC	(194)
233	Raymond James Financial Inc	JP Morgan	(573)
32	Regeneron Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	63
30	Regeneron Pharmaceuticals Inc	HSBC	3
1,435	Regions Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	14
3,631	Regions Financial Corp	Barclays Bank	1,961
2,403	Regions Financial Corp	Goldman Sachs	24
5,984	Regions Financial Corp	HSBC	4,548
1,126	Regions Financial Corp	JP Morgan	856
(196)	Reinsurance Group of America Inc	Barclays Bank	(443)
(680)	Reinsurance Group of America Inc	Citibank	(1,537)
(394)	RenaissanceRe Holdings Ltd	Barclays Bank	(13)
(130)	RenaissanceRe Holdings Ltd	Citibank	(31)
(252)	RenaissanceRe Holdings Ltd	Credit Suisse	1,479
(1,747)	RenaissanceRe Holdings Ltd	Goldman Sachs	2,274
(2,945)	Republic Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,503
(107)	Republic Services Inc	Credit Suisse	(79)
(3,740)	Republic Services Inc	Goldman Sachs	3,179
(366)	Republic Services Inc	HSBC	1,050

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(322)	Republic Services Inc	JP Morgan	924
(243)	ResMed Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,536)
(55)	ResMed Inc	Barclays Bank	26
(212)	ResMed Inc	Citibank	102
(158)	ResMed Inc	Goldman Sachs	(1,714)
(92)	ResMed Inc	HSBC	(1,163)
(200)	RingCentral Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(5,388)
(457)	RingCentral Inc 'A'	Barclays Bank	(7,230)
(43)	RingCentral Inc 'A'	Citibank	(436)
(57)	RingCentral Inc 'A'	Credit Suisse	(119)
(312)	RingCentral Inc 'A'	Goldman Sachs	(8,405)
(117)	RingCentral Inc 'A'	HSBC	(243)
(157)	RingCentral Inc 'A'	JP Morgan	(934)
249	Robert Half International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(234)
3,583	Robert Half International Inc	Barclays Bank	2,759
88	Robert Half International Inc	Citibank	68
638	Robert Half International Inc	Goldman Sachs	(600)
178	Robert Half International Inc	HSBC	(358)
1,187	Rockwell Automation Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,448)
(38)	Roku Inc	Credit Suisse	113
(3,209)	Rollins Inc	Bank of America Merrill Lynch	6,450
(63)	Rollins Inc	Barclays Bank	20
(492)	Rollins Inc	Credit Suisse	1,540
(1,787)	Rollins Inc	Goldman Sachs	3,592
(3,108)	Rollins Inc	HSBC	9,728
(259)	Roper Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,395)
(676)	Roper Technologies Inc	Barclays Bank	(3,099)
(54)	Roper Technologies Inc	Citibank	(301)
(76)	Roper Technologies Inc	Goldman Sachs	(912)
(1,267)	Roper Technologies Inc	JP Morgan	(7,108)
122	Ross Stores Inc	Bank of America Merrill Lynch	33
1,208	Ross Stores Inc	Barclays Bank	3,257
100	Ross Stores Inc	Citibank	288
21	Ross Stores Inc	Credit Suisse	(96)
499	Ross Stores Inc	Goldman Sachs	(689)
(300)	Royal Caribbean Cruises Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,619)
(1,086)	Royal Caribbean Cruises Ltd	Barclays Bank	(8,036)
(234)	Royal Caribbean Cruises Ltd	Citibank	(990)
(801)	Royal Caribbean Cruises Ltd	Goldman Sachs	(6,993)
(183)	Royal Caribbean Cruises Ltd	HSBC	(1,709)
(2,074)	Royalty Pharma Plc 'A'	Barclays Bank	1,244
(236)	RPM International Inc	Bank of America Merrill Lynch	701
(218)	RPM International Inc	Barclays Bank	150
(42)	S&P Global Inc	Bank of America Merrill Lynch	(190)
(585)	S&P Global Inc	Barclays Bank	(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)		
(1,029)	salesforce.com Inc	Bank of America Merrill Lynch	(20,840)
(1,855)	salesforce.com Inc	Barclays Bank	(20,604)
(316)	salesforce.com Inc	Citibank	(3,511)
(298)	salesforce.com Inc	Credit Suisse	(5,843)
(587)	salesforce.com Inc	Goldman Sachs	(11,995)
(50)	salesforce.com Inc	HSBC	(1,122)
(253)	Sarepta Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	906
(1,824)	Sarepta Therapeutics Inc	Barclays Bank	2,610
(228)	Sarepta Therapeutics Inc	Citibank	356
(358)	Sarepta Therapeutics Inc	Credit Suisse	(1,998)
(1,923)	Sarepta Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(257)
(150)	Sarepta Therapeutics Inc	HSBC	(843)
(3,265)	Schlumberger NV	Bank of America Merrill Lynch	139
(7,562)	Schlumberger NV	Barclays Bank	1,133
(1,600)	Schlumberger NV	JP Morgan	508
(330)	Seagate Technology Holdings Plc	Goldman Sachs	2,798
(341)	Seagen Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,513)
(480)	Seagen Inc	Barclays Bank	(806)
(1,308)	Seagen Inc	Goldman Sachs	(9,640)
1,644	Sealed Air Corp	Bank of America Merrill Lynch	526
1,791	Sealed Air Corp	Barclays Bank	681
555	Sealed Air Corp	Citibank	211
564	Sealed Air Corp	Credit Suisse	23
3,114	Sealed Air Corp	Goldman Sachs	996
1,250	Sealed Air Corp	JP Morgan	50
(609)	SEI Investments Co	Bank of America Merrill Lynch	(311)
(413)	SEI Investments Co	Barclays Bank	(85)
(513)	SEI Investments Co	Goldman Sachs	(156)
(481)	Sempra Energy	Bank of America Merrill Lynch	110
(199)	Sempra Energy	Barclays Bank	(24)
(296)	Sensata Technologies Holding Plc	Bank of America Merrill Lynch	(210)
36	ServiceNow Inc	Bank of America Merrill Lynch	(119)
645	ServiceNow Inc	Barclays Bank	(1,611)
25	ServiceNow Inc	Goldman Sachs	487
649	Sherwin-Williams Co	Bank of America Merrill Lynch	(426)
1,205	Sherwin-Williams Co	Barclays Bank	(1,922)
238	Sherwin-Williams Co	Credit Suisse	(1,219)
625	Sherwin-Williams Co	Goldman Sachs	(441)
62	Sherwin-Williams Co	HSBC	(317)
174	Sherwin-Williams Co	JP Morgan	(316)
33,867	Sirius XM Holdings Inc	Barclays Bank	3,725
729	Skyworks Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,257
53	Skyworks Solutions Inc	Barclays Bank	59
1	Skyworks Solutions Inc	JP Morgan	4
(321)	Slack Technologies Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(368)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(1,244)	Slack Technologies Inc 'A'	Citibank	(1,344)
(1,985)	Slack Technologies Inc 'A'	Goldman Sachs	(5,128)
(896)	Snap Inc 'A'	Barclays Bank	(1,792)
(604)	Snap Inc 'A'	Goldman Sachs	(4,959)
(65)	Snap-on Inc	Bank of America Merrill Lynch	(30)
(54)	Snowflake Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,371)
(531)	Snowflake Inc 'A'	Barclays Bank	(2,182)
(74)	Snowflake Inc 'A'	Goldman Sachs	(1,878)
(59)	Snowflake Inc 'A'	HSBC	(2,608)
(79)	SolarEdge Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,160)
(328)	SolarEdge Technologies Inc	Barclays Bank	(1,063)
(395)	SolarEdge Technologies Inc	Credit Suisse	(17,505)
(211)	SolarEdge Technologies Inc	Goldman Sachs	(8,440)
(83)	SolarEdge Technologies Inc	HSBC	(3,708)
(57)	SolarEdge Technologies Inc	JP Morgan	(2,546)
(258)	Southwest Airlines Co	Bank of America Merrill Lynch	165
(1,989)	Southwest Airlines Co	Barclays Bank	(1,551)
(566)	Southwest Airlines Co	Credit Suisse	(62)
(1,315)	Southwest Airlines Co	Goldman Sachs	842
(395)	Southwest Airlines Co	HSBC	(43)
(38,622)	Spectrum Brands Holdings Inc	JP Morgan	233,663
(1,512)	Splunk Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10,327)
(457)	Splunk Inc	Barclays Bank	(466)
(152)	Splunk Inc	Citibank	(326)
(107)	Splunk Inc	HSBC	(798)
(786)	Square Inc 'A'	Barclays Bank	(9,094)
(58)	Square Inc 'A'	Goldman Sachs	(1,137)
(104)	Square Inc 'A'	HSBC	(633)
(403)	SS&C Technologies Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	97
(611)	SS&C Technologies Holdings Inc	Barclays Bank	385
(255)	SS&C Technologies Holdings Inc	Goldman Sachs	61
(448)	SS&C Technologies Holdings Inc	HSBC	(246)
157	Stanley Black & Decker Inc	Barclays Bank	818
48	Stanley Black & Decker Inc	Goldman Sachs	95
162	Starbucks Corp	Bank of America Merrill Lynch	11
2,678	Starbucks Corp	Barclays Bank	3,399
4,671	Starbucks Corp	Citibank	6,353
137	Starbucks Corp	Credit Suisse	(58)
593	Starbucks Corp	Goldman Sachs	1,720
180	Starbucks Corp	HSBC	(76)
106	Starbucks Corp	JP Morgan	66
47	State Street Corp	Bank of America Merrill Lynch	28
1,599	State Street Corp	Barclays Bank	911
317	State Street Corp	Goldman Sachs	190
120	State Street Corp	HSBC	(102)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(576)	Steel Dynamics Inc	Bank of America Merrill Lynch	684
(1,064)	Steel Dynamics Inc	Barclays Bank	(391)
(914)	Steel Dynamics Inc	HSBC	1,417
(91)	STERIS Plc	Bank of America Merrill Lynch	520
(368)	STERIS Plc	Barclays Bank	(57)
(75)	STERIS Plc	Credit Suisse	1,259
(93)	STERIS Plc	JP Morgan	1,561
(1,738)	Sunrun Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,089)
(1,921)	Sunrun Inc	Barclays Bank	250
(367)	Sunrun Inc	Citibank	199
(636)	Sunrun Inc	Credit Suisse	(2,493)
(485)	Sunrun Inc	Goldman Sachs	(2,289)
(538)	Sunrun Inc	HSBC	(2,209)
(2,392)	Sunrun Inc	JP Morgan	(9,377)
39	SVB Financial Group	Citibank	298
1,098	Synchrony Financial	Bank of America Merrill Lynch	549
385	Synchrony Financial	Barclays Bank	389
336	Synchrony Financial	Goldman Sachs	168
255	Synopsys Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,677
433	Synopsys Inc	Barclays Bank	1,479
3,102	Synopsys Inc	Citibank	17,868
64	Synopsys Inc	Credit Suisse	1,405
288	Synopsys Inc	Goldman Sachs	3,326
166	Synopsys Inc	HSBC	3,644
250	Synopsys Inc	JP Morgan	2,718
247	Sysco Corp	Bank of America Merrill Lynch	138
116	T Rowe Price Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(14)
231	T Rowe Price Group Inc	Barclays Bank	802
5	T Rowe Price Group Inc	Citibank	17
90	T Rowe Price Group Inc	Goldman Sachs	(11)
515	Take-Two Interactive Software Inc	Barclays Bank	278
210	Target Corp	Bank of America Merrill Lynch	3,549
851	Target Corp	Barclays Bank	1,164
335	Target Corp	HSBC	4,318
(2,391)	TE Connectivity Ltd	Barclays Bank	(2,726)
(575)	Teladoc Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,237)
(911)	Teladoc Health Inc	Barclays Bank	(6,917)
(91)	Teladoc Health Inc	Citibank	(751)
(1,002)	Teladoc Health Inc	Goldman Sachs	(13,246)
(93)	Teledyne Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(462)
(470)	Teledyne Technologies Inc	Barclays Bank	(3,882)
(71)	Teledyne Technologies Inc	Citibank	(625)
(33)	Teledyne Technologies Inc	Goldman Sachs	(105)
(30)	Teledyne Technologies Inc	JP Morgan	(402)
(454)	Teleflex Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,063)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(299)	Teleflex Inc	Barclays Bank	383
(48)	Teleflex Inc	Goldman Sachs	(430)
376	Teradyne Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,696
1,444	Teradyne Inc	Barclays Bank	6,729
94	Teradyne Inc	Citibank	438
155	Teradyne Inc	Credit Suisse	1,629
92	Teradyne Inc	Goldman Sachs	1,149
(37)	Tesla Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,790)
(256)	Tesla Inc	Barclays Bank	(4,808)
(21)	Tesla Inc	Citibank	(394)
(39)	Tesla Inc	Credit Suisse	(2,009)
(19)	Tesla Inc	Goldman Sachs	(919)
(52)	Tesla Inc	JP Morgan	199
(10,748)	Teva Pharmaceutical Industries Ltd ADR	Bank of America Merrill Lynch	3,869
96	Texas Instruments Inc	Bank of America Merrill Lynch	863
340	Texas Instruments Inc	Barclays Bank	384
679	Texas Instruments Inc	Credit Suisse	5,276
781	Texas Instruments Inc	Goldman Sachs	5,562
(504)	Thermo Fisher Scientific Inc	Barclays Bank	(3,548)
(110)	Thermo Fisher Scientific Inc	Citibank	(774)
(143)	Thermo Fisher Scientific Inc	Goldman Sachs	(2,371)
684	TJX Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,057)
3,591	TJX Cos Inc	Barclays Bank	3,586
230	TJX Cos Inc	Credit Suisse	208
528	TJX Cos Inc	Goldman Sachs	(576)
142	TJX Cos Inc	HSBC	(774)
159	TJX Cos Inc	JP Morgan	(867)
(688)	T-Mobile US Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,292)
(3,872)	T-Mobile US Inc	Barclays Bank	(14,616)
(557)	T-Mobile US Inc	Credit Suisse	(3,034)
(3,218)	T-Mobile US Inc	Goldman Sachs	(4,395)
(98)	T-Mobile US Inc	HSBC	(214)
43	Tractor Supply Co	Bank of America Merrill Lynch	(202)
816	Tractor Supply Co	Barclays Bank	(65)
55	Tractor Supply Co	Citibank	(4)
72	Tractor Supply Co	Credit Suisse	(1,008)
65	Tractor Supply Co	HSBC	(910)
57	Tractor Supply Co	JP Morgan	(798)
(34)	Trade Desk Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(2,737)
(107)	Trade Desk Inc 'A'	Barclays Bank	(3,235)
(22)	Trade Desk Inc 'A'	Citibank	(211)
(191)	Trade Desk Inc 'A'	Goldman Sachs	(14,546)
(14)	Trade Desk Inc 'A'	JP Morgan	(1,380)
(557)	Tradeweb Markets Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(6)
(302)	Tradeweb Markets Inc 'A'	Citibank	(788)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(1,936)	Tradeweb Markets Inc 'A'	Goldman Sachs	(19)
166	Trane Technologies Plc	Bank of America Merrill Lynch	475
952	Trane Technologies Plc	Barclays Bank	4,094
83	Trane Technologies Plc	Credit Suisse	(22)
125	Trane Technologies Plc	Goldman Sachs	440
148	Trane Technologies Plc	HSBC	693
(394)	TransUnion	Bank of America Merrill Lynch	410
(1,445)	TransUnion	Barclays Bank	3,309
(576)	TransUnion	Citibank	1,319
(1,195)	TransUnion	Goldman Sachs	1,243
(683)	Travelers Cos Inc	Goldman Sachs	376
(371)	Travelers Cos Inc	HSBC	731
427	Trimble Inc	Bank of America Merrill Lynch	176
408	Trimble Inc	Barclays Bank	(61)
669	Trimble Inc	Citibank	(100)
280	Trimble Inc	Credit Suisse	483
143	Trimble Inc	Goldman Sachs	(68)
438	Trimble Inc	HSBC	477
293	Trimble Inc	JP Morgan	15
877	Truist Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(210)
1,253	Truist Financial Corp	Barclays Bank	714
242	Truist Financial Corp	Goldman Sachs	(58)
(797)	Twilio Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(30,924)
(289)	Twilio Inc 'A'	Barclays Bank	(3,062)
(80)	Twilio Inc 'A'	Citibank	(953)
(355)	Twilio Inc 'A'	Goldman Sachs	(12,516)
(29)	Twilio Inc 'A'	HSBC	(1,198)
(552)	Twitter Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,981)
(387)	Twitter Inc	Barclays Bank	(364)
(1,389)	Twitter Inc	Citibank	(1,306)
(1,254)	Twitter Inc	Goldman Sachs	(4,504)
(597)	Twitter Inc	JP Morgan	(925)
(66)	Tyler Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(754)
(611)	Tyler Technologies Inc	Barclays Bank	409
(134)	Tyler Technologies Inc	Goldman Sachs	(1,530)
(26)	Tyler Technologies Inc	JP Morgan	(284)
987	Tyson Foods Inc 'A'	Barclays Bank	(1,046)
391	Tyson Foods Inc 'A'	Citibank	(414)
962	Tyson Foods Inc 'A'	Credit Suisse	654
1,312	Tyson Foods Inc 'A'	Goldman Sachs	(1,456)
214	Tyson Foods Inc 'A'	HSBC	146
(1,389)	Uber Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,396)
(603)	Uber Technologies Inc	Barclays Bank	(482)
(661)	Uber Technologies Inc	HSBC	(3,253)
(229)	Uber Technologies Inc	JP Morgan	(1,154)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
1,798	UGI Corp	Bank of America Merrill Lynch	4,028
4,709	UGI Corp	Barclays Bank	5,839
484	UGI Corp	Citibank	600
334	UGI Corp	Credit Suisse	(53)
2,052	UGI Corp	Goldman Sachs	4,596
772	UGI Corp	HSBC	(124)
43	Ulta Salon Cosmetics & Fragrance Inc	Bank of America Merrill Lynch	669
97	Ulta Salon Cosmetics & Fragrance Inc	Barclays Bank	2,865
19	Ulta Salon Cosmetics & Fragrance Inc	Citibank	561
191	Ulta Salon Cosmetics & Fragrance Inc	Goldman Sachs	2,970
123	Union Pacific Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4)
336	Union Pacific Corp	Barclays Bank	393
51	Union Pacific Corp	Citibank	60
54	Union Pacific Corp	Credit Suisse	(200)
184	Union Pacific Corp	Goldman Sachs	(6)
119	Union Pacific Corp	HSBC	(441)
157	United Parcel Service Inc ' B '	Bank of America Merrill Lynch	(265)
437	United Parcel Service Inc ' B '	Barclays Bank	511
40	United Rentals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(80)
69	United Rentals Inc	Barclays Bank	555
79	United Rentals Inc	Citibank	635
127	United Rentals Inc	Goldman Sachs	(899)
142	United Rentals Inc	HSBC	(2,014)
(56)	UnitedHealth Group Inc	Barclays Bank	(54)
(585)	UnitedHealth Group Inc	Citibank	(567)
(31)	UnitedHealth Group Inc	Goldman Sachs	(102)
253	Universal Health Services Inc ' B '	Bank of America Merrill Lynch	(245)
1,375	Universal Health Services Inc ' B '	Barclays Bank	866
72	Universal Health Services Inc ' B '	Citibank	45
121	Universal Health Services Inc ' B '	Credit Suisse	312
568	Universal Health Services Inc ' B '	Goldman Sachs	(551)
152	Universal Health Services Inc ' B '	HSBC	392
130	Vail Resorts Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,115
339	Vail Resorts Inc	Barclays Bank	2,109
85	Vail Resorts Inc	Credit Suisse	754
34	Vail Resorts Inc	Goldman Sachs	292
80	Vail Resorts Inc	HSBC	710
9	Vail Resorts Inc	JP Morgan	80
(273)	Valero Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	(812)
(1,090)	Valero Energy Corp	Barclays Bank	(1,564)
(202)	Valero Energy Corp	Citibank	(422)
(138)	Valero Energy Corp	Credit Suisse	(105)
(1,705)	Valero Energy Corp	Goldman Sachs	2,080
(295)	Valero Energy Corp	HSBC	(103)
(638)	Valero Energy Corp	JP Morgan	(1,363)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
889	Veeva Systems Inc 'A'	Barclays Bank	25,363
86	Veeva Systems Inc 'A'	Citibank	2,454
90	Veeva Systems Inc 'A'	Credit Suisse	3,798
56	Veeva Systems Inc 'A'	Goldman Sachs	2,432
42	Veeva Systems Inc 'A'	JP Morgan	1,772
1,077	VeriSign Inc	Barclays Bank	(4,933)
(632)	Verisk Analytics Inc	Bank of America Merrill Lynch	84
(625)	Verisk Analytics Inc	Barclays Bank	838
(81)	Verisk Analytics Inc	Citibank	109
(939)	Verisk Analytics Inc	Goldman Sachs	103
(213)	Verisk Analytics Inc	HSBC	1,433
(239)	Verisk Analytics Inc	JP Morgan	1,608
3,074	Verizon Communications Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,457)
2,423	Verizon Communications Inc	Barclays Bank	(1,187)
2,067	Verizon Communications Inc	Credit Suisse	(6,263)
761	Verizon Communications Inc	Goldman Sachs	(1,103)
1,638	Vertex Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(12,645)
845	Vertex Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	(2,189)
247	Vertex Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(1,907)
147	Vertex Pharmaceuticals Inc	HSBC	(628)
(129)	VF Corp	Barclays Bank	13
(738)	VF Corp	Goldman Sachs	5,114
(299)	ViacomCBS Inc 'B'	Barclays Bank	(263)
(643)	ViacomCBS Inc 'B'	Credit Suisse	(2,025)
(1,938)	Viatis Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,764
(8,978)	Viatis Inc	Barclays Bank	941
(1,786)	Viatis Inc	Citibank	214
(4,339)	Viatis Inc	Credit Suisse	(868)
(7,421)	Viatis Inc	Goldman Sachs	6,753
(5,653)	Viatis Inc	HSBC	(1,131)
(2,121)	Viatis Inc	JP Morgan	(424)
(128)	Vimeo Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,376)
(1,500)	Vimeo Inc	Barclays Bank	(63,000)
(620)	Vimeo Inc	Citibank	(26,040)
(991)	Vimeo Inc	Goldman Sachs	(41,622)
(321)	Vimeo Inc	HSBC	(13,482)
(4,037)	Visa Inc 'A'	Barclays Bank	7,479
(203)	Visa Inc 'A'	Credit Suisse	40
(1,007)	Visa Inc 'A'	Goldman Sachs	(866)
524	VMware Inc 'A'	Barclays Bank	(2,253)
630	Voya Financial Inc	Credit Suisse	(1,896)
88	Vulcan Materials Co	Bank of America Merrill Lynch	(862)
(336)	W R Berkley Corp	Barclays Bank	84
(139)	W R Berkley Corp	HSBC	402
(311)	Walgreens Boots Alliance Inc	Bank of America Merrill Lynch	821

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)	Walgreens Boots Alliance Inc	Barclays Bank	393
(1,661)	Walt Disney Co	Barclays Bank	(7,209)
(139)	Walt Disney Co	Credit Suisse	785
(225)	Walt Disney Co	Goldman Sachs	(1,928)
(203)	Walt Disney Co	HSBC	1,147
(114)	Walt Disney Co	JP Morgan	644
(387)	Waste Connections Inc	Bank of America Merrill Lynch	209
(2,400)	Waste Connections Inc	Barclays Bank	(1,403)
(542)	Waste Connections Inc	JP Morgan	1,182
(3,361)	Waste Management Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,679
(1,436)	Waste Management Inc	Barclays Bank	617
(1,271)	Waste Management Inc	Citibank	547
(38)	Waste Management Inc	Goldman Sachs	32
(206)	Waste Management Inc	JP Morgan	531
36	Waters Corp	Bank of America Merrill Lynch	479
760	Waters Corp	Barclays Bank	3,689
62	Waters Corp	Citibank	313
32	Waters Corp	Credit Suisse	148
229	Waters Corp	HSBC	1,142
33	Waters Corp	JP Morgan	149
(83)	Wayfair Inc 'A'	Goldman Sachs	(408)
(27)	Wayfair Inc 'A'	HSBC	393
(1,458)	Wells Fargo & Co	Barclays Bank	(700)
(765)	Wells Fargo & Co	Citibank	(367)
(4,276)	Wells Fargo & Co	Goldman Sachs	5,046
1,746	West Pharmaceutical Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	34,722
132	West Pharmaceutical Services Inc	Barclays Bank	1,055
30	West Pharmaceutical Services Inc	Citibank	240
134	West Pharmaceutical Services Inc	Goldman Sachs	1,056
31	West Pharmaceutical Services Inc	JP Morgan	70
(3,018)	Western Digital Corp	JP Morgan	(19,949)
3,066	Western Union Co	Bank of America Merrill Lynch	(1,288)
2,734	Western Union Co	Barclays Bank	(629)
427	Western Union Co	Credit Suisse	(568)
1,150	Western Union Co	Goldman Sachs	(483)
(1,559)	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3,679)
(588)	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	Barclays Bank	(1,094)
(877)	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	Goldman Sachs	(2,070)
(156)	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	JP Morgan	(296)
176	Westrock Co	Bank of America Merrill Lynch	(614)
1,034	Westrock Co	Barclays Bank	62
337	Westrock Co	Goldman Sachs	(1,176)
198	Whirlpool Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,669)
787	Whirlpool Corp	Barclays Bank	1,645
64	Whirlpool Corp	Citibank	134

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
469	Whirlpool Corp	Goldman Sachs	(3,954)
(1,726)	Williams Cos Inc	Credit Suisse	(1,381)
(875)	Willis Towers Watson Plc	Barclays Bank	1,365
(83)	Willis Towers Watson Plc	JP Morgan	624
(179)	Wix.com Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(6,279)
(294)	Wix.com Ltd	Barclays Bank	(3,719)
(147)	Wix.com Ltd	Credit Suisse	3,194
(120)	Wix.com Ltd	Goldman Sachs	(2,379)
(59)	Wix.com Ltd	JP Morgan	(145)
189	Workday Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(300)
443	Workday Inc 'A'	Barclays Bank	(2,339)
134	Workday Inc 'A'	Goldman Sachs	(332)
55	Workday Inc 'A'	HSBC	81
82	Workday Inc 'A'	JP Morgan	(293)
829	WW Grainger Inc	HSBC	(9,998)
(575)	Wynn Resorts Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4,105)
(926)	Wynn Resorts Ltd	Barclays Bank	(2,012)
(168)	Wynn Resorts Ltd	Credit Suisse	(741)
(143)	Wynn Resorts Ltd	Goldman Sachs	(346)
261	Xilinx Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,267
84	Xilinx Inc	Barclays Bank	271
283	Xilinx Inc	Credit Suisse	1,392
1,541	Xilinx Inc	Goldman Sachs	13,653
113	Xilinx Inc	HSBC	837
183	Xilinx Inc	JP Morgan	951
160	XPO Logistics Inc	Bank of America Merrill Lynch	429
126	XPO Logistics Inc	Barclays Bank	401
(511)	Xylem Inc	Citibank	(1,134)
209	Yum! Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	276
3,805	Yum! Brands Inc	Barclays Bank	(2,093)
174	Yum! Brands Inc	Credit Suisse	(339)
684	Yum! Brands Inc	Goldman Sachs	903
159	Zebra Technologies Corp 'A'	Barclays Bank	(727)
263	Zebra Technologies Corp 'A'	Goldman Sachs	3,956
23	Zebra Technologies Corp 'A'	HSBC	299
(583)	Zendesk Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,571)
(537)	Zendesk Inc	Barclays Bank	200
(301)	Zendesk Inc	Citibank	78
(148)	Zendesk Inc	Goldman Sachs	(653)
(926)	Zendesk Inc	HSBC	(4,380)
(630)	Zillow Group Inc 'C'	Bank of America Merrill Lynch	(4,504)
(291)	Zillow Group Inc 'C'	Barclays Bank	(1,277)
(119)	Zillow Group Inc 'C'	Citibank	(522)
(364)	Zillow Group Inc 'C'	Goldman Sachs	(2,603)
315	Zimmer Biomet Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	794

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
122	Zimmer Biomet Holdings Inc	HSBC	(442)
(545)	Zoetis Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,493)
(789)	Zoetis Inc	Barclays Bank	(221)
(120)	Zoetis Inc	Credit Suisse	(661)
(500)	Zoetis Inc	Goldman Sachs	(3,205)
(117)	Zoetis Inc	HSBC	(645)
(49)	Zoom Video Communications Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,107)
(498)	Zoom Video Communications Inc 'A'	Barclays Bank	(4,626)
(47)	Zoom Video Communications Inc 'A'	Citibank	(469)
(238)	Zoom Video Communications Inc 'A'	Goldman Sachs	(4,878)
(51)	Zoom Video Communications Inc 'A'	HSBC	(2,195)
(31)	Zoom Video Communications Inc 'A'	JP Morgan	(151)
(239)	Zscaler Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,390)
(279)	Zscaler Inc	Barclays Bank	(5,524)
(117)	Zscaler Inc	Citibank	(2,317)
(114)	Zscaler Inc	Credit Suisse	(3,241)
(618)	Zscaler Inc	Goldman Sachs	(19,109)
(151)	Zscaler Inc	HSBC	(4,293)
			<u>(446,150)</u>
	合計(基礎となるエクスポージャー総額 - 374,412,412米ドル)		<u>(596,770)</u>

0.5米ドル未満の金額は端数切捨てにより0と表示されている。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

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)
金融デリバティブ商品						
スワップ						
CCCDS	USD 13,914,000	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	20/6/2026	29,593	339,004
CCCDS	EUR 12,050,000	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	20/6/2026	26,677	372,398
CCCDS	USD 2,925,000	ファンドは5.000%の固定金利を受け取り、Markit CDX.NA.HY.25 Version 8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	20/6/2026	9,921	283,270
CCCDS	EUR 2,435,000	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	20/6/2026	21,050	352,096
CCIRS	EUR 1,069,000	ファンドは0.074%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	(12,651)	(12,626)
CCIRS	EUR 1,395,000	ファンドは0.083%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	(15,346)	(14,891)
CCIRS	EUR 7,478,000	ファンドは0.087%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	(75,166)	(76,382)
CCIRS	EUR 4,144,000	ファンドは0.099%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	(35,412)	(36,044)
CCIRS	EUR 798,000	ファンドは0.117%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	(5,295)	(5,162)
CCIRS	EUR 1,935,000	ファンドは0.139%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	(7,343)	(7,298)
CCIRS	EUR 2,920,000	ファンドは0.151%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	(5,585)	(6,690)
CCIRS	EUR 602,000	ファンドは0.229%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	4,416	4,431
CCIRS	GBP 20,829,000	ファンドは0.731%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	15/9/2026	(39,123)	(32,590)
CCIRS	SEK 56,751,000	ファンドは0.875%の固定金利を受け取り、SEK 3ヶ月STIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	(9,028)	(11,027)
CCIRS	HKD 10,105,000	ファンドは0.931%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	15/9/2026	2,348	2,367
CCIRS	USD 1,271,000	ファンドは0.978%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	15/9/2026	384	198
CCIRS	USD 1,303,000	ファンドは1.002%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	15/9/2026	1,940	1,811
CCIRS	USD 2,745,000	ファンドは1.014%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	15/9/2026	5,781	5,306
CCIRS	USD 1,849,000	ファンドは1.034%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	15/9/2026	5,373	5,400
CCIRS	USD 1,354,000	ファンドは1.045%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	15/9/2026	4,703	4,723
CCIRS	USD 1,323,000	ファンドは1.076%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	15/9/2026	6,620	6,639
CCIRS	HKD 21,315,000	ファンドは1.113%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	15/9/2026	29,687	29,727

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	USD 2,807,000	ファンドは1.140%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	15/9/2026	22,307	22,955
CCIRS	USD 2,314,000	ファンドは1.182%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	15/9/2026	23,194	23,778
CCIRS	USD 2,457,000	ファンドは1.220%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	15/9/2026	29,372	29,796
CCIRS	USD 495,000	ファンドは1.222%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	15/9/2026	5,991	6,064
CCIRS	CAD 1,411,000	ファンドは1.488%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	15/9/2026	319	420
CCIRS	CAD 18,079,000	ファンドは1.600%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	15/9/2026	86,733	87,144
CCIRS	CAD 5,636,000	ファンドは1.615%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	15/9/2026	30,966	30,581
CCIRS	AUD 878,000	ファンドは1.872%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	15/9/2031	3,479	3,492
CCIRS	AUD 4,956,400	ファンドは1.979%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	15/9/2031	53,447	58,341
CCIRS	ZAR 5,804,000	ファンドは6.295%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	15/9/2026	3,390	3,396
CCIRS	ZAR 47,313,000	ファンドは6.461%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	15/9/2026	52,255	52,302
CCIRS	ZAR 151,154,000	ファンドは6.478%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	15/9/2026	174,766	174,910
CCIRS	AUD 1,717,000	ファンドはAUD 6ヶ月BBSWの変動金利を受け取り、0.981%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	1,646	1,743
CCIRS	AUD 8,923,943	ファンドはAUD 6ヶ月BBSWの変動金利を受け取り、1.167%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(50,440)	(54,198)
CCIRS	CAD 749,000	ファンドはCAD 3ヶ月CDORの変動金利を受け取り、2.040%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	(2,187)	(2,125)
CCIRS	CAD 9,587,000	ファンドはCAD 3ヶ月CDORの変動金利を受け取り、2.110%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	(76,347)	(78,930)
CCIRS	CAD 2,978,000	ファンドはCAD 3ヶ月CDORの変動金利を受け取り、2.164%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	(36,469)	(36,915)
CCIRS	GBP 10,818,500	ファンドはGBP 6ヶ月LIBORの変動金利を受け取り、1.025%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	65,260	65,538
CCIRS	MXN 165,341,000	ファンドはMXN 1ヶ月Mexican Interbank Rateの変動金利を受け取り、5.735%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	9/9/2026	206,274	206,386
CCIRS	PLN 100,269,196	ファンドはPLN 6ヶ月WIBORの変動金利を受け取り、1.315%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	412,158	412,533
CCIRS	SEK 109,613,000	ファンドはSEK 3ヶ月STIBORの変動金利を受け取り、0.464%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(12,972)	(11,258)
CCIRS	SGD 1,119,000	ファンドはSGD 6ヶ月SORF6の変動金利を受け取り、1.037%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	1,166	1,178
CCIRS	SGD 3,005,000	ファンドはSGD 6ヶ月STIBORの変動金利を受け取り、1.191%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(14,148)	(14,115)
CCIRS	SGD 837,000	ファンドはSGD 6ヶ月STIBORの変動金利を受け取り、1.198%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(4,159)	(4,150)
CCIRS	SGD 3,037,000	ファンドはSGD 6ヶ月STIBORの変動金利を受け取り、1.286%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(25,071)	(25,038)
CCIRS	SGD 2,546,000	ファンドはSGD 6ヶ月STIBORの変動金利を受け取り、1.326%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(24,820)	(24,793)
CCIRS	USD 1,444,000	ファンドはUSD 3ヶ月LIBORの変動金利を受け取り、1.628%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	(1,737)	(1,332)
CCIRS	USD 966,000	ファンドはUSD 3ヶ月LIBORの変動金利を受け取り、1.650%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	(2,882)	(2,863)

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	USD 1,386,000	ファンドはUSD 3ヶ月LIBORの変動金利を受け取り、1.666%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	(3,015)	(6,345)
CCIRS	USD 1,386,000	ファンドはUSD 3ヶ月LIBORの変動金利を受け取り、1.668%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	(6,793)	(6,476)
CCIRS	USD 1,479,000	ファンドはUSD 3ヶ月LIBORの変動金利を受け取り、1.770%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	(21,318)	(21,303)
CCIRS	USD 1,226,000	ファンドはUSD 3ヶ月LIBORの変動金利を受け取り、1.807%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	(21,424)	(21,965)
CCIRS	USD 1,300,000	ファンドはUSD 3ヶ月LIBORの変動金利を受け取り、1.836%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	(26,517)	(26,932)
CCIRS	USD 279,000	ファンドはUSD 3ヶ月LIBORの変動金利を受け取り、1.881%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	(6,842)	(6,959)
IRS	GBP 3,537,000	ファンドは0.509%の固定金利を受け取り、GBP12ヶ月SONIAの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(422)	603
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	(81,655)	(81,655)
IRS KRW	2,837,421,000	ファンドは1.566%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	15/9/2026	(12,987)	(12,987)
IRS	EUR 5,717,000	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	15/9/2026	7,730	9,055
IRS	EUR 1,139,000	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	15/9/2026	(3,264)	(3,244)
IRS	EUR 14,858,000	ファンドはEUR 6ヶ月LIBORの変動金利を受け取り、-0.251%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	36,258	36,621
IRS	EUR 3,801,000	ファンドはEUR 6ヶ月LIBORの変動金利を受け取り、-0.253%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	9,832	9,896
IRS	EUR 1,552,000	ファンドはEUR 6ヶ月LIBORの変動金利を受け取り、-0.268%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	5,530	5,498
IRS	EUR 8,212,000	ファンドはEUR 6ヶ月LIBORの変動金利を受け取り、-0.28%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	34,116	34,862
IRS	EUR 2,059,000	ファンドはEUR 6ヶ月LIBORの変動金利を受け取り、-0.291%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	10,004	10,257
IRS	EUR 2,767,000	ファンドはEUR 6ヶ月LIBORの変動金利を受け取り、-0.301%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	15,385	15,432
IRS	GBP 1,828,000	ファンドはGBP12ヶ月SONIAの変動金利を受け取り、0.808%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2031	1,402	(138)
IRS	INR 6,669,000	ファンドはINR 6ヶ月India National Stock Exchange NSE Interbank Offer Rateの変動金利を受け取り、5.350%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	(382)	(382)
IRS	THB 21,250,000	ファンドはTHB 6ヶ月Thailand Fixing Rateの変動金利を受け取り1.053%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2026	1,150	1,150
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	85,972	85,972
IRS	KRW 911,021,000	ファンドは1.575%の固定金利を受け取り、KRW 3ヶ月KSDAの変動金利を支払う	Citibank	15/9/2026	(3,806)	(3,806)
IRS	INR 40,707,520	ファンドはINR 6ヶ月MIBORの変動金利を受け取り、5.250%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	15/9/2026	61	61
IRS	THB 123,654,000	ファンドはTHB 6ヶ月Thailand Fixing Rateの変動金利を受け取り1.270%の固定金利を支払う	Goldman Sachs	15/9/2026	(35,211)	(35,211)
IRS KRW	1,606,941,000	ファンドは1.504%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	15/9/2026	(11,781)	(11,781)
IRS KRW	9,525,697,000	ファンドは1.508%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	15/9/2026	(68,354)	(68,354)
IRS	INR 93,487,000	ファンドはINR 6ヶ月MIBORの変動金利を受け取り、5.180%の固定金利を支払う	HSBC	15/9/2026	3,984	3,984

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	INR 126,354,000	ファンドはINR 6ヶ月MIBORの変動金利を受け取り、5.352%の固定金利を支払う	HSBC	15/9/2026	(7,421)	(7,421)
IRS	KRW 1,413,114,000	ファンドは1.472%の固定金利を受け取り、KRW 3ヶ月KSDAの変動金利を支払う	JP Morgan	15/9/2026	(12,368)	(12,368)
IRS	KRW 3,573,387,000	ファンドは1.585%の固定金利を受け取り、KRW 3ヶ月KSDAの変動金利を支払う	JP Morgan	15/9/2026	(13,340)	(13,340)
IRS	KRW 2,946,870,000	ファンドは1.608%の固定金利を受け取り、KRW 3ヶ月KSDAの変動金利を支払う	JP Morgan	15/9/2026	(8,056)	(8,056)
IRS	INR 79,020,480	ファンドはINR 6ヶ月MIBORの変動金利を受け取り、5.240%の固定金利を支払う	JP Morgan	15/9/2026	582	582
IRS	KRW 1,699,380,000	ファンドは1.556%の固定金利を受け取り、KRW 3ヶ月KSDAの変動金利を支払う	Morgan Stanley	15/9/2026	(8,533)	(8,533)
IRS	CNY 40,804,000	ファンドは2.959%の固定金利を受け取り、CNY 3ヶ月China Fixing Repo Ratesの変動金利を支払う	Standard Chartered Bank	15/9/2026	56,618	56,618
TRS	BRL 41	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	16/6/2021	(59,101)	(59,101)
TRS	BRL 9	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	16/6/2021	(9,230)	(9,230)
TRS	BRL 20	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	16/6/2021	(11,862)	(11,862)
TRS	KRW 500,000	ファンドはKOSPI 200 Indexを受け取り、0.000%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	10/6/2021	1,646	1,646
TRS	KRW 750,000	ファンドはKOSPI 200 Indexを受け取り、0.000%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	10/6/2021	5,310	5,310
TRS	KRW 3,500,000	ファンドはKOSPI 200 Indexを受け取り、0.000%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	10/6/2021	8,812	8,812
TRS	TWD 18,800	ファンドはTAIEX Futures Indexを受け取り、0.000%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	872,191	872,191
TRS	TWD 3,800	ファンドはTAIEX Futures Indexを受け取り、0.000%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	131,172	131,172
TRS	TWD 11,600	ファンドはTAIEX Futures Indexを受け取り、0.000%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	107,323	107,323
TRS	THB 23,000	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	29/6/2021	(22,208)	(22,208)
TRS	THB 24,000	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	29/6/2021	(14,459)	(14,459)
TRS	THB 27,400	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	29/6/2021	(13,859)	(13,859)
TRS	THB 31,400	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	29/6/2021	(2,809)	(2,809)
TRS	PLN 720	ファンドはWIG20 Indexを受け取り、0.000%の固定金利を支払う	HSBC	18/6/2021	37,936	37,936
TRS	PLN 840	ファンドはWIG20 Indexを受け取り、0.000%の固定金利を支払う	HSBC	18/6/2021	31,824	31,824
合計(基礎となるエクスポージャー総額 - 385,483,502米ドル)					1,842,856	3,105,521

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。

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)	未実現純評価益 / (損) (米ドル)
金融デリバティブ商品					
先物取引					
(50)	EUR	Amsterdam Index Futures June 2021	2021年6月	8,680,100	(107,896)
722	AUD	Australian 10 Year Bond Futures June 2021	2021年6月	78,202,582	388,482
141	EUR	CAC 40 Index Futures June 2021	2021年6月	11,116,142	289,473
(359)	CAD	Canadian 10 Year Bond Futures September 2021	2021年9月	42,833,961	(82,490)
5	USD	E-Mini S&P 500 Index Futures June 2021	2021年6月	1,051,400	17,775
(194)	EUR	Euro Bund Futures June 2021	2021年6月	40,203,831	362,935
(143)	GBP	FTSE 100 Index Futures June 2021	2021年6月	14,231,794	(342,886)
213	USD	FTSE China A50 Futures June 2021	2021年6月	3,867,654	55,278
104	EUR	FTSE MIB Index Futures June 2021	2021年6月	16,020,688	425,601
(227)	ZAR	FTSE/JSE Top 40 Index Futures June 2021	2021年6月	10,219,458	(28,612)
(70)	EUR	IBEX 35 Index Futures June 2021	2021年6月	7,827,772	(14,286)
1	JPY	Japan 10 Year Bond Futures June 2021	2021年6月	1,381,430	91
148	USD	MSCI Hong Kong Index Futures June 2021	2021年6月	11,967,280	(19,240)
13	SGD	MSCI Singapore Index Futures June 2021	2021年6月	353,633	2,239
(494)	SEK	OMX Stockholm 30 Index Futures June 2021	2021年6月	13,406,057	(133,340)
(54)	CAD	S&P/TSX 60 Index Futures June 2021	2021年6月	10,626,131	(437,937)
(345)	USD	SGX NIFTY 50 Futures June 2021	2021年6月	10,750,200	(210,702)
(128)	AUD	SPI 200 Index Futures June 2021	2021年6月	17,747,604	(825,805)
155	CHF	Swiss Market Index Futures June 2021	2021年6月	19,594,258	970,600
55	JPY	Topix Index Futures June 2021	2021年6月	9,674,161	(41,728)
(463)	GBP	UK Long Gilt Bond Futures September 2021	2021年9月	83,485,071	(160,745)
417	USD	US Treasury 10 Year Note Futures September 2021	2021年9月	54,965,813	19,701
合計				468,207,020	126,508

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

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)
金融デリバティブ商品						
未決済先渡為替予約						
AUD	2,277,275	USD	1,770,373	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(7,768)
AUD	2,115,000	USD	1,638,784	Barclays Bank	16/6/2021	(1,780)
AUD	1,488,000	USD	1,153,530	Deutsche Bank	16/6/2021	(1,822)
AUD	182,000	USD	140,348	Goldman Sachs	16/6/2021	520
AUD	543,000	USD	415,665	JP Morgan	16/6/2021	4,615
AUD	950,000	USD	732,026	Morgan Stanley	16/6/2021	3,272
AUD	1,227,000	USD	936,441	Standard Chartered Bank	16/6/2021	13,254
AUD	726,000	USD	566,006	UBS	16/6/2021	(4,084)
AUD	1,487,000	USD	1,152,944	Deutsche Bank	21/7/2021	(1,828)
AUD	82,000	USD	63,161	JP Morgan	21/7/2021	317
AUD	5,352,850	USD	4,194,022	Deutsche Bank	18/8/2021	(49,872)
BRL	14,693,148	USD	2,603,252	BNP Paribas	16/6/2021	210,752
BRL	10,351,000	USD	1,850,093	Citibank	16/6/2021	132,312
BRL	11,091,769	USD	1,972,590	Deutsche Bank	16/6/2021	151,687
BRL	1,591,851	USD	274,646	Goldman Sachs	16/6/2021	30,222
BRL	379,231	USD	67,446	JP Morgan	16/6/2021	5,183
BRL	16,063,000	USD	2,829,565	UBS	16/6/2021	246,792
BRL	20,509,000	USD	3,743,065	Barclays Bank	21/7/2021	171,757
BRL	10,323,000	USD	1,849,314	Citibank	21/7/2021	121,173
BRL	3,557,000	USD	640,982	Goldman Sachs	21/7/2021	37,989
BRL	7,738,000	USD	1,416,412	HSBC	21/7/2021	60,642
BRL	15,287,000	USD	2,697,928	JP Morgan	21/7/2021	220,102
BRL	914,000	USD	172,774	UBS	21/7/2021	1,693
BRL	8,983,550	USD	1,689,109	Citibank	18/8/2021	20,552
BRL	459,000	USD	86,512	Goldman Sachs	18/8/2021	840
BRL	1,893,000	USD	357,885	HSBC	18/8/2021	2,372
CAD	49,889,000	USD	39,537,143	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	1,755,431
CAD	1,587,000	USD	1,315,009	BNP Paribas	16/6/2021	(1,466)
CAD	3,023,000	USD	2,422,792	Goldman Sachs	16/6/2021	79,312
CAD	457,000	USD	363,923	JP Morgan	16/6/2021	14,331
CAD	2,613,000	USD	2,082,675	Morgan Stanley	16/6/2021	80,077
CAD	302,000	USD	242,064	Standard Chartered Bank	16/6/2021	7,898
CAD	465,000	USD	370,456	UBS	16/6/2021	14,419
CAD	1,586,000	USD	1,314,155	BNP Paribas	21/7/2021	(1,502)
CAD	294,000	USD	234,635	Morgan Stanley	21/7/2021	8,695
CAD	1,586,000	USD	1,314,135	BNP Paribas	18/8/2021	(1,526)
CAD	1,213,000	USD	1,007,151	JP Morgan	18/8/2021	(3,245)
CHF	21,000	EUR	18,990	Standard Chartered Bank	16/6/2021	149
CHF	1,181,083	USD	1,278,707	Deutsche Bank	16/6/2021	33,424
CLP	171,038,000	USD	233,633	BNP Paribas	16/6/2021	3,476
CLP	369,250,000	USD	513,732	Citibank	16/6/2021	(1,844)
CLP	325,295,000	USD	455,755	Credit Suisse	16/6/2021	(4,800)

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	3,036,932,000	USD	4,307,717	Deutsche Bank	16/6/2021	(97,636)
CLP	83,001,000	USD	113,624	Goldman Sachs	16/6/2021	1,440
CLP	171,049,000	USD	233,536	Bank of America Merrill Lynch	21/7/2021	3,524
CLP	325,345,000	USD	455,646	Credit Suisse	21/7/2021	(4,743)
CLP	1,258,849,000	USD	1,789,790	Deutsche Bank	21/7/2021	(45,124)
CLP	43,720,000	USD	62,607	HSBC	21/7/2021	(2,015)
CLP	171,075,000	USD	233,575	Bank of America Merrill Lynch	18/8/2021	3,461
CLP	325,427,000	USD	455,755	Credit Suisse	18/8/2021	(4,853)
CLP	43,728,000	USD	62,617	HSBC	18/8/2021	(2,029)
CNH	10,170,000	USD	1,584,692	Deutsche Bank	16/6/2021	10,562
CNH	10,171,000	USD	1,581,207	Deutsche Bank	21/7/2021	10,673
CNH	10,170,000	USD	1,578,108	UBS	18/8/2021	10,954
EUR	482,761	CHF	533,000	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(2,820)
EUR	416,419	CHF	459,000	BNP Paribas	16/6/2021	(1,594)
EUR	366,944	CHF	405,000	JP Morgan	16/6/2021	(1,998)
EUR	487,225	CHF	534,000	Standard Chartered Bank	16/6/2021	1,519
EUR	161,268	HUF	58,131,000	Standard Chartered Bank	21/7/2021	(6,910)
EUR	531,000	USD	632,793	JP Morgan	16/6/2021	15,414
EUR	169,000	USD	202,481	Standard Chartered Bank	16/6/2021	3,822
EUR	5,292,149	USD	6,309,268	UBS	16/6/2021	151,006
EUR	12,396,000	USD	14,765,152	Standard Chartered Bank	21/7/2021	377,205
EUR	1,113,000	USD	1,362,601	Deutsche Bank	18/8/2021	(2,290)
EUR	1,903,000	USD	2,328,526	UBS	18/8/2021	(2,675)
GBP	466,000	USD	642,623	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	17,707
GBP	48,000	USD	67,951	Citibank	16/6/2021	66
GBP	1,899,000	USD	2,631,579	Deutsche Bank	16/6/2021	59,339
GBP	2,963,000	USD	4,145,381	JP Morgan	16/6/2021	53,246
GBP	444,000	USD	621,383	Morgan Stanley	16/6/2021	7,773
GBP	1,811,000	USD	2,498,673	Bank of America Merrill Lynch	21/7/2021	67,646
GBP	48,000	USD	67,955	Citibank	21/7/2021	64
GBP	876,000	USD	1,242,589	JP Morgan	21/7/2021	(1,234)
GBP	3,374,000	USD	4,696,702	Morgan Stanley	21/7/2021	84,502
GBP	1,450,000	USD	1,991,749	UBS	21/7/2021	63,007
GBP	2,823,270	USD	3,991,115	Bank of America Merrill Lynch	18/8/2021	9,701
GBP	48,000	USD	67,957	Citibank	18/8/2021	63
GBP	876,000	USD	1,242,610	JP Morgan	18/8/2021	(1,243)
HKD	989,000	USD	127,353	HSBC	16/6/2021	82
HKD	7,777,000	USD	1,001,430	UBS	16/6/2021	655
HUF	196,878,000	EUR	546,054	Morgan Stanley	21/7/2021	23,560
HUF	71,582,000	USD	231,592	Citibank	16/6/2021	19,668
HUF	231,674,000	USD	758,731	HSBC	16/6/2021	54,465
HUF	236,256,000	USD	808,884	Morgan Stanley	16/6/2021	20,396
HUF	698,774,000	USD	2,376,112	Standard Chartered Bank	16/6/2021	76,647

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	259,063,000	USD	911,154	Bank of America Merrill Lynch	21/7/2021	(2,434)
HUF	196,819,000	USD	654,135	Citibank	21/7/2021	36,251
HUF	462,993,000	USD	1,537,299	HSBC	21/7/2021	86,751
HUF	163,663,000	USD	573,701	Morgan Stanley	21/7/2021	383
HUF	148,091,000	USD	516,427	Standard Chartered Bank	21/7/2021	3,034
HUF	259,225,000	USD	911,182	HSBC	18/8/2021	(2,477)
HUF	163,761,000	USD	573,680	Morgan Stanley	18/8/2021	379
HUF	148,179,000	USD	516,347	Standard Chartered Bank	18/8/2021	3,089
INR	13,989,776	USD	186,183	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	6,212
INR	1,341,221,000	USD	18,085,260	Barclays Bank	16/6/2021	359,895
INR	297,660,305	USD	3,973,376	BNP Paribas	16/6/2021	120,201
INR	14,614,000	USD	198,593	Deutsche Bank	16/6/2021	2,386
INR	29,641,729	USD	399,167	Goldman Sachs	16/6/2021	8,482
INR	29,338,919	USD	386,272	JP Morgan	16/6/2021	17,212
INR	16,015,271	USD	215,635	Morgan Stanley	16/6/2021	4,615
INR	553,082,000	USD	7,477,870	UBS	16/6/2021	128,396
INR	1,390,917,570	USD	18,363,701	BNP Paribas	22/7/2021	655,624
INR	5,664,000	USD	77,388	UBS	22/7/2021	61
INR	5,688,000	USD	77,401	Deutsche Bank	18/8/2021	56
INR	1,225,753,740	USD	16,434,871	JP Morgan	18/8/2021	256,908
JPY	62,388,000	USD	569,838	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(753)
JPY	69,685,000	USD	640,185	Barclays Bank	16/6/2021	(4,539)
JPY	20,028,000	USD	184,455	Goldman Sachs	16/6/2021	(1,765)
JPY	762,531,000	USD	6,962,986	JP Morgan	16/6/2021	(7,403)
JPY	148,579,000	USD	1,354,695	Standard Chartered Bank	16/6/2021	598
JPY	291,992,000	USD	2,687,937	UBS	16/6/2021	(24,472)
JPY	48,850,000	USD	446,004	Bank of America Merrill Lynch	21/7/2021	(288)
JPY	2,877,635,000	USD	26,274,109	Goldman Sachs	21/7/2021	(18,095)
JPY	1,887,415,650	USD	17,364,504	Bank of America Merrill Lynch	18/8/2021	(139,877)
KRW	3,908,095,762	USD	3,451,856	BNP Paribas	16/6/2021	74,441
KRW	675,816,330	USD	605,261	Citibank	16/6/2021	4,532
KRW	272,945,074	USD	244,315	Deutsche Bank	16/6/2021	1,964
KRW	632,814,000	USD	568,137	Goldman Sachs	16/6/2021	2,854
KRW	63,480,331	USD	56,818	Morgan Stanley	16/6/2021	460
KRW	1,768,653,503	USD	1,583,866	UBS	16/6/2021	11,999
KRW	93,440,000	USD	83,417	UBS	21/7/2021	900
KRW	93,437,000	USD	83,415	UBS	18/8/2021	904
MXN	712,086,000	USD	33,071,147	Goldman Sachs	16/6/2021	2,647,351
MXN	5,370,000	USD	263,288	Standard Chartered Bank	16/6/2021	6,073
MXN	18,231,000	USD	882,940	UBS	16/6/2021	31,534
MXN	3,423,000	USD	170,474	JP Morgan	21/7/2021	558
MXN	3,434,000	USD	170,495	JP Morgan	18/8/2021	556
NOK	4,800,000	USD	566,283	Barclays Bank	16/6/2021	8,902
NOK	7,477,000	USD	896,433	Citibank	16/6/2021	(463)

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)
NOK	1,215,000	USD	141,724	Deutsche Bank	16/6/2021	3,869
NOK	7,749,000	USD	909,376	Goldman Sachs	16/6/2021	19,187
NOK	8,696,000	USD	1,041,063	JP Morgan	16/6/2021	980
NOK	951,000	USD	112,855	Morgan Stanley	16/6/2021	1,104
NOK	1,320,000	USD	159,856	UBS	16/6/2021	(1,680)
NOK	7,475,000	USD	896,244	Citibank	21/7/2021	(464)
NOK	6,927,000	USD	831,603	JP Morgan	21/7/2021	(1,493)
NOK	1,320,000	USD	159,865	UBS	21/7/2021	(1,681)
NOK	5,422,000	USD	650,950	JP Morgan	18/8/2021	(1,178)
NOK	1,320,000	USD	159,873	UBS	18/8/2021	(1,684)
NZD	1,818,000	USD	1,306,852	Barclays Bank	16/6/2021	14,521
NZD	1,030,000	USD	732,635	JP Morgan	16/6/2021	15,998
NZD	5,305,000	USD	3,766,544	Morgan Stanley	16/6/2021	89,277
NZD	2,571,000	USD	1,862,499	Barclays Bank	18/8/2021	5,804
NZD	756,000	USD	547,771	Standard Chartered Bank	18/8/2021	1,602
PLN	46,248,000	USD	12,006,759	JP Morgan	16/6/2021	579,735
PLN	4,834,000	USD	1,254,400	Morgan Stanley	16/6/2021	61,184
PLN	2,497,000	USD	656,545	UBS	16/6/2021	23,019
PLN	3,438,000	USD	909,298	JP Morgan	21/7/2021	26,516
PLN	4,847,000	USD	1,277,831	Societe Generale	21/7/2021	41,508
PLN	2,496,000	USD	656,454	UBS	21/7/2021	22,950
RUB	100,060,993	USD	1,349,150	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	12,799
RUB	361,760,000	USD	4,830,545	BNP Paribas	16/6/2021	93,437
RUB	13,854,007	USD	184,320	Goldman Sachs	16/6/2021	4,248
RUB	269,063,000	USD	3,529,423	JP Morgan	16/6/2021	132,843
RUB	95,602,000	USD	1,283,002	Citibank	21/7/2021	11,940
RUB	562,804,490	USD	7,236,998	JP Morgan	21/7/2021	386,263
RUB	389,889,600	USD	5,185,185	Bank of America Merrill Lynch	18/8/2021	74,686
SEK	4,894,000	USD	574,816	Barclays Bank	16/6/2021	15,462
SEK	3,854,000	USD	464,860	Citibank	16/6/2021	(19)
SEK	65,695,000	USD	7,700,852	Deutsche Bank	16/6/2021	222,788
SEK	14,374,000	USD	1,644,329	Goldman Sachs	16/6/2021	89,356
SEK	4,639,000	USD	545,292	JP Morgan	16/6/2021	14,230
SEK	7,882,000	USD	905,749	Standard Chartered Bank	16/6/2021	44,919
SEK	3,851,000	USD	464,638	Citibank	21/7/2021	(29)
SEK	3,851,000	USD	464,740	Citibank	18/8/2021	(32)
SGD	18,634,429	USD	13,849,257	BNP Paribas	16/6/2021	248,432
SGD	1,445,571	USD	1,087,190	Morgan Stanley	16/6/2021	6,442
SGD	1,448,000	USD	1,079,151	Standard Chartered Bank	16/6/2021	16,318
SGD	1,886,000	USD	1,423,862	Bank of America Merrill Lynch	21/7/2021	2,832
SGD	1,881,000	USD	1,409,453	Barclays Bank	21/7/2021	13,458
SGD	122,429	USD	92,055	BNP Paribas	21/7/2021	558
SGD	583,000	USD	438,874	Citibank	21/7/2021	2,146
SGD	1,049,000	USD	782,124	HSBC	21/7/2021	11,408
SGD	2,548,000	USD	1,922,051	JP Morgan	21/7/2021	5,423

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)
SGD	4,024,571	USD	3,031,541	Morgan Stanley	21/7/2021	12,908
SGD	122,429	USD	92,047	BNP Paribas	18/8/2021	560
SGD	8,139,560	USD	6,142,021	HSBC	18/8/2021	14,836
SGD	1,445,571	USD	1,087,000	Morgan Stanley	18/8/2021	6,447
SGD	1,274,000	USD	960,946	Standard Chartered Bank	18/8/2021	2,722
THB	7,492,000	USD	239,109	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	735
THB	38,378,795	USD	1,235,923	Barclays Bank	16/6/2021	(7,291)
THB	47,584,000	USD	1,543,447	Citibank	16/6/2021	(20,126)
THB	90,077,000	USD	2,880,319	Goldman Sachs	16/6/2021	3,344
THB	11,994,000	USD	381,888	JP Morgan	16/6/2021	2,079
THB	46,284,205	USD	1,471,506	Standard Chartered Bank	16/6/2021	10,203
THB	7,739,529	USD	247,435	Barclays Bank	21/7/2021	308
THB	37,549,000	USD	1,193,767	Goldman Sachs	21/7/2021	8,180
THB	11,347,000	USD	361,807	HSBC	21/7/2021	1,412
THB	29,004,471	USD	928,982	Standard Chartered Bank	21/7/2021	(546)
THB	27,563,000	USD	875,592	Goldman Sachs	18/8/2021	6,613
THB	7,501,000	USD	238,972	HSBC	18/8/2021	1,111
TWD	10,663,378	USD	382,919	BNP Paribas	16/6/2021	4,665
TWD	8,698,000	USD	312,408	Citibank	16/6/2021	3,740
TWD	69,227,622	USD	2,470,298	Deutsche Bank	16/6/2021	45,930
TWD	25,917,000	USD	920,606	Standard Chartered Bank	16/6/2021	21,403
TWD	5,934,000	USD	214,666	Deutsche Bank	21/7/2021	2,116
TWD	5,912,000	USD	214,693	BNP Paribas	18/8/2021	2,137
USD	1,309,544	AUD	1,707,443	Barclays Bank	16/6/2021	(12,012)
USD	312,559	AUD	402,000	JP Morgan	16/6/2021	1,412
USD	22,515,507	AUD	29,235,000	Morgan Stanley	16/6/2021	(112,310)
USD	48,369	AUD	62,557	Standard Chartered Bank	16/6/2021	(50)
USD	6,321,754	AUD	8,286,000	HSBC	21/7/2021	(92,600)
USD	779,577	AUD	1,005,000	JP Morgan	18/8/2021	1,511
USD	2,676,860	BRL	15,722,000	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(334,190)
USD	1,053,058	BRL	5,928,000	BNP Paribas	16/6/2021	(82,262)
USD	329,276	BRL	1,842,000	JP Morgan	16/6/2021	(23,502)
USD	690,300	BRL	3,616,000	Morgan Stanley	16/6/2021	(2,230)
USD	8,229,189	BRL	46,836,430	Citibank	21/7/2021	(711,094)
USD	115,852	BRL	613,000	UBS	21/7/2021	(1,159)
USD	115,873	BRL	615,000	UBS	18/8/2021	(1,168)
USD	614,538	CAD	750,000	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(6,228)
USD	1,771,772	CAD	2,223,000	Citibank	16/6/2021	(68,180)
USD	1,848,292	CAD	2,245,000	Goldman Sachs	16/6/2021	(9,870)
USD	8,659,364	CAD	10,723,000	JP Morgan	16/6/2021	(215,946)
USD	4,201,808	CAD	5,213,000	Morgan Stanley	16/6/2021	(112,934)
USD	105,957	CAD	133,000	Bank of America Merrill Lynch	21/7/2021	(4,121)
USD	9,998,382	CAD	12,090,970	Morgan Stanley	18/8/2021	(8,374)
USD	873,593	CHF	814,000	Goldman Sachs	16/6/2021	(30,726)
USD	4,774,382	CLP	3,469,715,535	Deutsche Bank	16/6/2021	(35,663)

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)
USD	172,636	CLP	126,403,000	Goldman Sachs	16/6/2021	(2,596)
USD	63,365	CLP	44,435,465	Morgan Stanley	16/6/2021	1,765
USD	1,232,652	CLP	875,971,500	BNP Paribas	21/7/2021	18,623
USD	172,618	CLP	126,425,000	Goldman Sachs	21/7/2021	(2,597)
USD	643,097	CLP	450,871,000	HSBC	21/7/2021	18,225
USD	92,336	CLP	64,153,500	Citibank	18/8/2021	3,447
USD	172,608	CLP	126,439,000	Goldman Sachs	18/8/2021	(2,582)
USD	488,262	CNH	3,117,000	Citibank	16/6/2021	(667)
USD	487,038	CNH	3,116,000	Citibank	21/7/2021	(652)
USD	486,165	CNH	3,116,000	HSBC	18/8/2021	(710)
USD	783,369	EUR	655,000	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(16,208)
USD	828,565	EUR	692,000	HSBC	16/6/2021	(16,180)
USD	2,394,315	EUR	2,012,000	JP Morgan	16/6/2021	(61,790)
USD	2,084,912	EUR	1,749,000	Morgan Stanley	16/6/2021	(50,141)
USD	345,431	EUR	287,000	Standard Chartered Bank	16/6/2021	(4,919)
USD	2,536,572	EUR	2,099,000	UBS	16/6/2021	(25,736)
USD	413,909	EUR	345,000	Bank of America Merrill Lynch	21/7/2021	(7,527)
USD	2,591,146	EUR	2,153,000	BNP Paribas	21/7/2021	(38,855)
USD	1,995,625	EUR	1,650,000	Goldman Sachs	21/7/2021	(19,935)
USD	464,169	EUR	380,000	HSBC	21/7/2021	(20)
USD	2,537,389	EUR	2,083,000	JP Morgan	21/7/2021	(7,103)
USD	212,814	EUR	174,000	Standard Chartered Bank	21/7/2021	264
USD	35,655,202	EUR	29,268,937	JP Morgan	18/8/2021	(117,358)
USD	212,929	EUR	174,000	Standard Chartered Bank	18/8/2021	266
USD	361,811	GBP	260,000	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(6,614)
USD	113,251	GBP	81,000	Barclays Bank	16/6/2021	(1,528)
USD	231,963	GBP	167,000	JP Morgan	16/6/2021	(4,679)
USD	4,142,764	GBP	2,961,000	Morgan Stanley	16/6/2021	(53,030)
USD	960,121	GBP	683,000	Standard Chartered Bank	16/6/2021	(7,702)
USD	5,778,686	GBP	4,208,000	HSBC	21/7/2021	(184,356)
USD	1,463,586	GBP	1,036,000	JP Morgan	21/7/2021	(4,502)
USD	541,619	GBP	381,000	UBS	21/7/2021	1,714
USD	541,641	GBP	381,000	Standard Chartered Bank	18/8/2021	1,732
USD	1,335,853	GBP	944,000	UBS	18/8/2021	(1,876)
USD	1,642,733	HKD	12,757,000	Barclays Bank	16/6/2021	(1,039)
USD	1,004,120	HUF	309,817,000	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(83,366)
USD	739,255	HUF	221,827,000	Citibank	16/6/2021	(39,377)
USD	811,238	HUF	239,155,000	Goldman Sachs	16/6/2021	(28,217)
USD	525,151	HUF	157,012,000	HSBC	16/6/2021	(25,975)
USD	249,272	HUF	75,206,000	JP Morgan	16/6/2021	(14,708)
USD	1,981,428	HUF	595,388,000	Citibank	21/7/2021	(107,026)
USD	810,948	HUF	239,223,000	Goldman Sachs	21/7/2021	(28,179)
USD	301,549	HUF	89,729,000	HSBC	21/7/2021	(13,195)
USD	692,381	HUF	208,614,000	Standard Chartered Bank	21/7/2021	(39,378)
USD	1,136,562	HUF	334,825,790	Goldman Sachs	18/8/2021	(37,159)

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	15,637,288	INR	1,157,851,299	BNP Paribas	16/6/2021	(286,072)
USD	416,788	INR	30,704,000	Deutsche Bank	16/6/2021	(5,470)
USD	521,963	INR	39,205,701	JP Morgan	16/6/2021	(17,213)
USD	231,752	INR	17,450,000	Morgan Stanley	16/6/2021	(8,229)
USD	4,233,752	INR	317,459,000	BNP Paribas	22/7/2021	(107,164)
USD	389,629	INR	29,731,000	HSBC	22/7/2021	(16,911)
USD	21,986,965	JPY	2,387,461,000	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	209,247
USD	3,563,884	JPY	389,393,000	JP Morgan	16/6/2021	11,956
USD	595,665	JPY	64,758,000	Standard Chartered Bank	16/6/2021	4,961
USD	1,977,082	JPY	213,826,000	Bank of America Merrill Lynch	21/7/2021	26,098
USD	13,588,552	KRW	15,465,811,000	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(366,330)
USD	870,177	KRW	983,171,000	BNP Paribas	16/6/2021	(16,943)
USD	90,113	KRW	101,585,000	Deutsche Bank	16/6/2021	(1,548)
USD	737,734	KRW	836,981,000	Goldman Sachs	16/6/2021	(17,477)
USD	2,201,555	KRW	2,465,742,000	JP Morgan	16/6/2021	(23,297)
USD	602,308	KRW	681,360,000	Morgan Stanley	16/6/2021	(12,487)
USD	6,755,969	KRW	7,566,212,540	HSBC	21/7/2021	(71,473)
USD	4,335,369	KRW	4,886,715,000	Morgan Stanley	21/7/2021	(74,204)
USD	460,251	KRW	519,278,000	Societe Generale	21/7/2021	(8,325)
USD	793,723	KRW	890,384,000	UBS	21/7/2021	(9,723)
USD	11,084,634	KRW	12,340,080,230	Citibank	18/8/2021	(51,252)
USD	460,363	KRW	519,239,000	Societe Generale	18/8/2021	(8,206)
USD	210,201	KRW	234,868,000	UBS	18/8/2021	(1,748)
USD	4,295,663	MXN	88,105,000	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(123,717)
USD	1,472,543	MXN	29,867,000	Barclays Bank	16/6/2021	(25,597)
USD	1,124,076	MXN	22,956,000	Goldman Sachs	16/6/2021	(27,406)
USD	1,830,498	MXN	36,576,000	JP Morgan	16/6/2021	(4,168)
USD	1,031,676	MXN	20,765,000	Morgan Stanley	16/6/2021	(9,905)
USD	174,519	MXN	3,496,000	Standard Chartered Bank	16/6/2021	(842)
USD	10,394,361	MXN	211,767,000	Goldman Sachs	21/7/2021	(186,708)
USD	174,486	MXN	3,509,000	Standard Chartered Bank	21/7/2021	(844)
USD	15,502,540	MXN	311,665,360	Citibank	18/8/2021	(21,874)
USD	522,419	NOK	4,434,000	Deutsche Bank	16/6/2021	(8,908)
USD	1,111,662	NOK	9,440,000	Goldman Sachs	16/6/2021	(19,535)
USD	441,760	NOK	3,626,000	JP Morgan	16/6/2021	7,255
USD	559,164	NOK	4,667,000	Morgan Stanley	16/6/2021	(83)
USD	1,489,259	NOK	12,696,000	Standard Chartered Bank	16/6/2021	(32,104)
USD	441,650	NOK	3,625,000	JP Morgan	21/7/2021	7,242
USD	558,958	NOK	4,665,000	Morgan Stanley	21/7/2021	(81)
USD	1,195,114	NOK	9,996,000	Standard Chartered Bank	21/7/2021	(2,774)
USD	306,579	NOK	2,526,890	Bank of America Merrill Lynch	18/8/2021	3,756
USD	321,254	NOK	2,636,000	JP Morgan	18/8/2021	5,356
USD	558,975	NOK	4,665,000	Morgan Stanley	18/8/2021	(78)
USD	1,039,349	NZD	1,442,000	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(8,737)

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	659,625	NZD	938,000	BNP Paribas	16/6/2021	(22,139)
USD	240,978	NZD	334,000	Goldman Sachs	16/6/2021	(1,783)
USD	557,590	NZD	775,000	JP Morgan	16/6/2021	(5,701)
USD	4,386,914	NZD	6,062,000	Morgan Stanley	16/6/2021	(19,116)
USD	510,318	NZD	725,000	Goldman Sachs	21/7/2021	(16,581)
USD	2,278,055	NZD	3,121,000	Morgan Stanley	21/7/2021	9,847
USD	4,292,956	NZD	5,890,400	JP Morgan	18/8/2021	12,500
USD	2,277,828	NZD	3,121,000	Morgan Stanley	18/8/2021	9,849
USD	351,885	PLN	1,346,000	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(14,432)
USD	4,605,715	PLN	17,613,000	Citibank	16/6/2021	(187,702)
USD	450,946	PLN	1,658,000	Goldman Sachs	16/6/2021	(282)
USD	847,370	PLN	3,285,000	HSBC	16/6/2021	(46,650)
USD	3,810,310	PLN	14,113,000	JP Morgan	16/6/2021	(30,574)
USD	397,353	PLN	1,528,000	Morgan Stanley	16/6/2021	(18,495)
USD	668,976	PLN	2,637,000	Standard Chartered Bank	16/6/2021	(48,690)
USD	3,231,275	PLN	12,027,000	UBS	16/6/2021	(41,898)
USD	7,541,785	PLN	28,760,000	Bank of America Merrill Lynch	21/7/2021	(286,603)
USD	450,744	PLN	1,657,000	Goldman Sachs	21/7/2021	(286)
USD	5,419,134	PLN	20,318,226	Barclays Bank	18/8/2021	(111,814)
USD	450,781	PLN	1,657,000	Goldman Sachs	18/8/2021	(281)
USD	567,322	RUB	41,992,000	Barclays Bank	16/6/2021	(4,239)
USD	2,222,422	RUB	167,782,000	Citibank	16/6/2021	(61,289)
USD	1,021,881	RUB	77,665,000	Goldman Sachs	16/6/2021	(35,232)
USD	228,309	RUB	17,525,000	JP Morgan	16/6/2021	(10,227)
USD	1,298,714	RUB	99,962,000	Morgan Stanley	16/6/2021	(61,887)
USD	343,120	RUB	25,446,000	UBS	16/6/2021	(3,230)
USD	191,289	RUB	14,163,000	BNP Paribas	21/7/2021	(551)
USD	119,367	RUB	8,968,000	Goldman Sachs	21/7/2021	(2,106)
USD	523,162	RUB	40,838,000	HSBC	21/7/2021	(29,994)
USD	228,238	RUB	17,604,000	JP Morgan	21/7/2021	(10,210)
USD	1,297,996	RUB	100,413,000	Morgan Stanley	21/7/2021	(62,111)
USD	2,099,006	RUB	157,823,000	UBS	21/7/2021	(38,729)
USD	211,277	RUB	15,688,000	Barclays Bank	18/8/2021	(365)
USD	191,283	RUB	14,220,000	BNP Paribas	18/8/2021	(554)
USD	567,341	RUB	42,359,000	Goldman Sachs	18/8/2021	(4,110)
USD	205,504	SEK	1,758,000	Bank of America Merrill Lynch	16/6/2021	(6,533)
USD	528,694	SEK	4,471,000	Barclays Bank	16/6/2021	(10,564)
USD	3,472,626	SEK	29,462,000	Citibank	16/6/2021	(80,861)
USD	112,163	SEK	964,000	Deutsche Bank	16/6/2021	(4,107)
USD	2,249,724	SEK	18,683,000	JP Morgan	16/6/2021	(3,680)
USD	2,838,268	SEK	23,583,000	Morgan Stanley	16/6/2021	(6,137)
USD	500,026	SEK	4,180,736	Standard Chartered Bank	16/6/2021	(4,223)
USD	3,771,307	SEK	32,218,000	Societe Generale	21/7/2021	(115,675)
USD	4,583,851	SEK	38,126,140	Morgan Stanley	18/8/2021	(16,906)
USD	4,814,394	SGD	6,471,000	Barclays Bank	16/6/2021	(81,176)

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	627,266	SGD	833,000	Citibank	16/6/2021	(2,932)
USD	802,666	SGD	1,082,000	HSBC	16/6/2021	(15,911)
USD	2,693,974	SGD	3,615,000	JP Morgan	16/6/2021	(40,918)
USD	896,398	SGD	1,187,000	Standard Chartered Bank	16/6/2021	(1,614)
USD	627,196	SGD	833,000	Citibank	21/7/2021	(2,940)
USD	444,299	SGD	594,000	JP Morgan	21/7/2021	(5,041)
USD	895,553	SGD	1,186,000	Standard Chartered Bank	21/7/2021	(1,615)
USD	1,523,384	SGD	2,020,000	Standard Chartered Bank	18/8/2021	(4,568)
USD	179,201	THB	5,595,000	Barclays Bank	16/6/2021	87
USD	6,371,588	THB	196,597,000	BNP Paribas	16/6/2021	77,871
USD	437,534	THB	13,732,000	Goldman Sachs	16/6/2021	(2,073)
USD	179,182	THB	5,599,000	HSBC	21/7/2021	(42)
USD	1,721,120	THB	54,264,000	Societe Generale	21/7/2021	(15,876)
USD	278,858	THB	8,671,930	Goldman Sachs	18/8/2021	1,297
USD	989,169	TWD	27,697,000	BNP Paribas	16/6/2021	(17,538)
USD	9,347,828	TWD	262,880,000	Credit Suisse	16/6/2021	(207,116)
USD	1,660,031	TWD	46,964,000	Deutsche Bank	16/6/2021	(46,979)
USD	204,573	TWD	5,745,636	JP Morgan	16/6/2021	(4,265)
USD	1,797,423	TWD	50,114,000	Morgan Stanley	16/6/2021	(24,078)
USD	164,802	TWD	4,629,364	UBS	16/6/2021	(3,462)
USD	288,363	TWD	7,979,000	Bank of America Merrill Lynch	21/7/2021	(3,127)
USD	6,703,469	TWD	189,037,830	HSBC	21/7/2021	(202,478)
USD	1,714,337	TWD	47,590,000	Morgan Stanley	21/7/2021	(24,225)
USD	81,381	TWD	2,262,000	UBS	21/7/2021	(1,254)
USD	7,478,630	TWD	204,667,660	BNP Paribas	18/8/2021	(27,800)
USD	1,713,826	TWD	47,413,000	Morgan Stanley	18/8/2021	(25,102)
USD	8,361,493	ZAR	130,181,000	Bank of America Merrill Lynch	17/6/2021	(1,087,217)
USD	614,441	ZAR	9,227,000	Deutsche Bank	17/6/2021	(55,267)
USD	180,169	ZAR	2,711,000	Goldman Sachs	17/6/2021	(16,599)
USD	111,391	ZAR	1,631,000	JP Morgan	17/6/2021	(6,989)
USD	559,199	ZAR	8,187,000	Morgan Stanley	17/6/2021	(35,024)
USD	617,752	ZAR	9,317,000	Standard Chartered Bank	17/6/2021	(58,488)
USD	145,926	ZAR	2,092,000	Morgan Stanley	21/7/2021	(5,232)
USD	630,777	ZAR	8,945,000	Standard Chartered Bank	18/8/2021	(13,180)
ZAR	78,100,000	USD	5,441,137	Morgan Stanley	17/6/2021	227,466
ZAR	20,613,000	USD	1,404,451	Standard Chartered Bank	17/6/2021	91,668
ZAR	11,479,114	USD	780,216	UBS	17/6/2021	52,953
ZAR	69,016,000	USD	4,665,492	UBS	21/7/2021	321,260
ZAR	95,891,750	USD	6,743,676	JP Morgan	18/8/2021	159,639
						4,359,247
ヘッジを使用した豪ドル建投資証券クラス						
AUD	31,444,803	USD	24,456,606	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(118,531)
USD	63,693	AUD	81,951	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	264
						(118,267)

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・リアル建投資証券クラス						
BRL	13,597	USD	2,535	State Street Bank & Trust Company	2/6/2021	72
BRL	13,633	USD	2,569	State Street Bank & Trust Company	2/7/2021	39
USD	2,570	BRL	13,597	State Street Bank & Trust Company	2/6/2021	(38)
						73
ヘッジを使用したスイス・フラン建投資証券クラス						
CHF	378,850	USD	417,203	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	3,672
						3,672
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	14,279,990	USD	17,252,919	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	178,723
USD	110,661	EUR	90,812	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(193)
						178,530
ヘッジを使用した英ポンド建投資証券クラス						
GBP	12,323,466	USD	17,150,241	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	312,309
USD	136,729	GBP	97,489	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(1,413)
						310,896
ヘッジを使用した日本円建投資証券クラス						
JPY	9,041,541,201	USD	82,857,896	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	(384,291)
						(384,291)
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	185	USD	134	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	1
						1
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	30,405	USD	3,621	State Street Bank & Trust Company	15/6/2021	46
						46
合計(基礎となるエクスポージャー総額 - 1,063,857,930米ドル)						4,349,907

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 2021年5月31日現在

	純資産比率 (%)
政府	69.14
金融	5.20
投資有価証券 - 時価	74.34
その他の純資産	25.66
	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（未監査）

2021年3月31日に終了した会計期間

	注記	2021年3月31日に 終了した会計期間	2020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		17,247	114,639
金融商品に係る純利益		136	111
投資収益合計		17,383	114,750
営業費用		(8,829)	(11,511)
金融資産のネガティブ・イールド		(6,369)	-
純営業利益		2,185	103,239
財務費用：			
償還可能投資証券保有者への分配金	5	(2,149)	(99,813)
財務費用合計		(2,149)	(99,813)
純利益		36	3,426
償還可能投資証券保有者に帰属する純資産の増加		36	3,426

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（未監査）

2021年3月31日に終了した会計期間

	2021年3月31日に 終了した会計期間	2020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	21,281,310	14,146,140
償還可能投資証券保有者に帰属する純資産の増加	36	3,426
投資証券取引：		
償還可能投資証券の発行	79,180,133	69,747,935
償還可能投資証券の買戻	(81,314,431)	(60,032,664)
分配金再投資額	1,839	50,078
投資証券取引による純資産の増加 / (減少)	(2,132,459)	9,765,349
期末純資産	19,148,887	23,914,915

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(未監査)

2021年3月31日現在

	注記	2021年3月31日現在	2020年9月30日現在
		千米ドル	千米ドル
流動資産			
現金		604,671	791,865
未収金		1,229	6,207
損益を通じて公正価値で測定する金融資産	4	19,403,915	20,519,603
流動資産合計		20,009,815	21,317,675
流動負債			
未払金		860,928	36,365
流動負債合計		860,928	36,365
償還可能投資証券保有者に帰属する純資産	8	19,148,887	21,281,310

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 2021年3月31日現在(未監査)

保有高	通貨	銘柄	公正価値 (千円)	純資産比率 (%)
債券				
国債(2020年9月30日:71.03%)				
米国(2020年9月30日:71.03%)				
393,305,000	USD	US Cash Management Bill, 0.00%, 06/07/2021	393,222	2.05
213,700,000	USD	US Cash Management Bill, 0.00%, 13/07/2021	213,668	1.12
292,480,000	USD	US Cash Management Bill, 0.00%, 27/07/2021	292,451	1.53
100,000,000	USD	US Treasury, 2.88%, 15/11/2021	101,728	0.53
3,900,000	USD	US Treasury, 2.50%, 15/02/2022	3,982	0.02
3,965,000	USD	US Treasury, 1.75%, 28/02/2022	4,025	0.02
3,965,000	USD	US Treasury, 0.38%, 31/03/2022	3,976	0.02
220,849,700	USD	US Treasury, FRN, 0.16%, 30/04/2021	220,868	1.15
160,000,000	USD	US Treasury, FRN, 0.17%, 31/01/2022	160,189	0.84
337,000,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 01/04/2021	337,000	1.76
775,000,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 06/04/2021	774,997	4.05
450,000,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 08/04/2021	449,998	2.35
671,700,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 13/04/2021	671,693	3.51
673,480,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 15/04/2021	673,469	3.52
731,640,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 20/04/2021	731,629	3.82
925,000,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 22/04/2021	924,984	4.83
570,875,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 29/04/2021	570,826	2.98
387,345,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 04/05/2021	387,333	2.02
975,000,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 06/05/2021	974,912	5.09
504,125,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 11/05/2021	504,077	2.63
350,000,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 13/05/2021	349,994	1.83
144,235,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 20/05/2021	144,204	0.75
450,000,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 25/05/2021	449,988	2.35
690,335,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 01/06/2021	690,269	3.60
148,295,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 10/06/2021	148,282	0.77
325,000,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 17/06/2021	324,969	1.70
412,805,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 24/06/2021	412,788	2.16
830,000,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 01/07/2021	829,891	4.33
54,555,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 15/07/2021	54,530	0.28
330,660,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 05/08/2021	330,579	1.73
349,575,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 12/08/2021	349,486	1.83
125,160,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 19/08/2021	125,131	0.65
47,955,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 09/09/2021	47,925	0.25
114,353,600	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 04/11/2021	114,261	0.60
326,110,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 02/12/2021	325,861	1.70
5,185,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 30/12/2021	5,181	0.03
255,741,700	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 27/01/2022	255,549	1.33
米国合計			13,353,915	69.73
国債に対する投資合計			13,353,915	69.73
債券に対する投資合計			13,353,915	69.73

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 (2020年9月30日:25.39%)						
米国(2020年9月30日:25.39%)						
700,000,000	USD	Barclays Capital, Inc.	0.01%	01/04/2021	700,000	3.66
945,000,000	USD	BNP Paribas SA	0.01%	01/04/2021	945,000	4.93
5,000,000	USD	BNP Paribas SA	0.01%	01/04/2021	5,000	0.03
250,000,000	USD	BofA Securities, Inc.	0.01%	01/04/2021	250,000	1.31
10,000,000	USD	BofA Securities, Inc.	0.01%	01/04/2021	10,000	0.05
500,000,000	USD	Citigroup Global Markets, Inc.	0.01%	01/04/2021	500,000	2.61
50,000,000	USD	Citigroup Global Markets, Inc.	0.01%	01/04/2021	50,000	0.26
100,000,000	USD	Credit Agricole Corporate and Investment Bank	0.01%	01/04/2021	100,000	0.52
450,000,000	USD	Credit Suisse AG	0.01%	01/04/2021	450,000	2.35
574,146,078	USD	JP Morgan Chase Bank	0.01%	01/04/2021	574,146	3.00
524,509,804	USD	JP Morgan Chase Bank	0.01%	01/04/2021	524,510	2.74
117,154,412	USD	JP Morgan Chase Bank	0.01%	01/04/2021	117,154	0.61
106,841,000	USD	JP Morgan Chase Bank	0.01%	01/04/2021	106,841	0.56
73,529,412	USD	JP Morgan Chase Bank	0.01%	01/04/2021	73,530	0.38
48,897,059	USD	JP Morgan Chase Bank	0.01%	01/04/2021	48,897	0.26
35,583,333	USD	JP Morgan Chase Bank	0.01%	01/04/2021	35,583	0.19
19,338,971	USD	JP Morgan Chase Bank	0.01%	01/04/2021	19,339	0.10
775,000,000	USD	Societe Generale SA	0.01%	01/04/2021	775,000	4.05
765,000,000	USD	TD Securities (USA) LLC	0.01%	01/04/2021	765,000	3.99
米国合計					6,050,000	31.60
リバースレポ取引に対する投資合計					6,050,000	31.60
損益を通じて公正価値で測定する金融資産合計					19,403,915	101.33
現金					604,671	3.16
その他の資産および負債					(859,699)	(4.49)
償還可能投資証券保有者に帰属する純資産					19,148,887	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					2.47	
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					94.50	
その他の資産					3.03	
資産合計					100.00	

¹ 担保として保有する有価証券は6,128,853,000米ドルであった。

2 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】(2022年1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	7,564,217,719円
負債総額	2,334,670円
純資産総額(-)	7,561,883,049円
発行済数量	9,957,701,896口
1 単位当たり純資産額(/)	0.7594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	7,564,295,908円
負債総額	166,893円
純資産総額(-)	7,564,129,015円
発行済数量	9,609,004,671口
1 単位当たり純資産額(/)	0.7872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われます。また、受益証券を保有している投資者に対しては、償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日から受益証券と引き換えに当該投資者に支払います。

10 質権口記載または記録の受益権の取り扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額等

資本金 3,120百万円

発行する株式の総数 36,000株

発行済株式の総数 15,000株

直近5ヵ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、社内関係者で共有しております。また、委託会社の業務に関するリスクについて社内規程を定めて管理を行っております。

2【事業の内容及び営業の概況】

投信法に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行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っています。

委託会社の運用する証券投資信託は2022年1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	176	10,301,689
単位型株式投資信託	62	460,555
合計	238	10,762,244

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35期事業年度(自2021年1月1日 至2021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34期 (2020年12月31日現在)	第35期 (2021年12月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	17,786	17,813
立替金	29	16
前払費用	190	223
未収入金	2	3
未収委託者報酬	1,756	2,017
未収運用受託報酬	2,166	2,244
未収収益	2	872
その他流動資産	0	2
流動資産計	22,805	23,827
固定資産		
有形固定資産		
建物附属設備	1	1,002
器具備品	1	480
有形固定資産計	1,482	1,364
無形固定資産		
ソフトウェア	6	10
無形固定資産計	6	10
投資その他の資産		
投資有価証券	142	50
長期差入保証金	1,122	1,118
前払年金費用	899	1,001
長期前払費用	34	12
繰延税金資産	888	889
投資その他の資産計	3,088	3,072
固定資産計	4,577	4,448
資産合計	27,383	28,275

	第34期 (2020年12月31日現在)	第35期 (2021年12月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	121	143
未払金	2	
未払収益分配金	4	4
未払償還金	74	70
未払手数料	444	459
その他未払金	1,508	2,991
未払費用	2	859
未払消費税等	210	272
未払法人税等	343	402
前受金	84	166
賞与引当金	1,987	2,156
役員賞与引当金	195	203
流動負債計	5,835	7,630
固定負債		
退職給付引当金	69	82
資産除去債務	783	784
固定負債計	853	866
負債合計	6,688	8,497
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	10,386	9,470
利益剰余金合計	10,723	9,807
株主資本合計	20,691	19,775
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	3	3
評価・換算差額等合計	3	3
純資産合計	20,694	19,778
負債・純資産合計	27,383	28,275

(2)【損益計算書】

(単位：百万円)

		第34期 (自 2020年 1月 1日 至 2020年12月31日)	第35期 (自 2021年 1月 1日 至 2021年12月31日)
営業収益			
委託者報酬		5,605	6,653
運用受託報酬	1	7,342	8,355
その他営業収益	1	12,092	14,536
営業収益計		25,041	29,546
営業費用			
支払手数料		1,405	1,534
広告宣伝費		127	170
調査費			
調査費		352	298
委託調査費	1	3,346	4,326
調査費計		3,698	4,625
委託計算費		85	94
営業雑経費			
通信費		64	51
印刷費		82	95
諸会費		49	39
営業雑経費計		195	187
営業費用計		5,512	6,611
一般管理費			
給料			
役員報酬		601	579
給料・手当		4,691	5,106
賞与		2,384	2,616
給料計		7,678	8,302
退職給付費用		331	352
福利厚生費		1,028	1,073
事務委託費	1	2,701	3,360
交際費		16	11
寄付金		1	-
旅費交通費		60	24
租税公課		246	260
不動産賃借料		905	902
水道光熱費		60	53
固定資産減価償却費		428	426
資産除去債務利息費用		0	0
事務過誤取引損		-	519
諸経費		390	348
一般管理費計		13,851	15,638
営業利益		5,677	7,296

	第34期 (自 2020年 1月 1日 至 2020年12月31日)	第35期 (自 2021年 1月 1日 至 2021年12月31日)
営業外収益		
為替差益	-	102
その他	5	1
営業外収益計	5	103
営業外費用		
為替差損	20	-
固定資産除却損	0	0
営業外費用計	20	0
経常利益	5,662	7,398
特別利益		
特別利益計	-	-
特別損失		
特別退職金	-	0
特別損失計	-	0
税引前当期純利益	5,662	7,398
法人税、住民税及び事業税	1,970	2,415
法人税等調整額	64	0
当期純利益	3,756	4,984

(3)【株主資本等変動計算書】

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

第35期 (自 2021年1月1日 至 2021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				
2021年1月1日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	10,386	10,723	20,691	3	3	20,694
当期変動額											
剰余金の配当						5,900	5,900	5,900			5,900
当期純利益						4,984	4,984	4,984			4,984
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)									0	0	0
当期変動額合計	-	-	-	-	-	915	915	915	0	0	915
2021年12月31日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	9,470	9,807	19,775	3	3	19,778

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3～15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. 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。

(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」(企業会計基準第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 (2020年12月31日)	当事業年度 (2021年12月31日)
建物附属設備	2,010 百万円	2,246 百万円
器具備品	1,290 百万円	1,470 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 (2020年12月31日)	当事業年度 (2021年12月31日)
未収入金	- 百万円	524 百万円
未収収益	185 百万円	377 百万円
その他未払金	1,496 百万円	1,940 百万円
未払費用	89 百万円	112 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 (2020年12月31日)	当事業年度 (2021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 2020年1月1日 至 2020年12月31日)	当事業年度 (自 2021年1月1日 至 2021年12月31日)
運用受託報酬	247 百万円	249 百万円
その他営業収益	5,052 百万円	6,036 百万円
委託調査費	763 百万円	1,178 百万円
事務委託費	851 百万円	1,204 百万円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(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

	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
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

当事業年度(自 2021年1月1日 至 2021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
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

(リース取引関係)

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掛かる未経過リース料は以下のとおりであります。

	当事業年度 (自 2021年1月1日 至 2021年12月31日)
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)

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。

(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（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	-

当事業年度(2021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	17,813	17,813	-
(2) 未収委託者報酬	2,017	2,017	-
(3) 未収運用受託報酬	2,244	2,244	-
(4) 未収収益	981	981	-
(5) 未収入金	527	527	-
(6) 長期差入保証金	1,118	1,119	0
資産計	24,703	24,704	0
(1) 未払手数料	459	459	-
(2) 未払費用	760	760	-
(3) その他未払金	2,991	2,991	-
負債計	4,210	4,210	-

(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、(4) 未収収益及び(5) 未収入金

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。

(6) 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) 未払費用及び(3) その他未払金

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(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	-	-	-

当事業年度(2021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	17,813	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	2,017	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	2,244	-	-	-
(4) 未収収益	981	-	-	-
(5) 未収入金	527	-	-	-
合計	23,584	-	-	-

(退職給付関係)

前事業年度(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)

	前事業年度 (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)

	前事業年度 (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)

	前事業年度 (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
非積立型制度の退職給付債務	1,233
	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)

	前事業年度 (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。

	前事業年度 (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

	前事業年度 (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。

当事業年度（自 2021年1月1日 至 2021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 2021年1月 1日 至 2021年12月31日)
退職給付債務の期首残高	2,149
勤務費用	322
利息費用	20
数理計算上の差異の発生額	188
退職給付の支払額	94
過去勤務費用の発生額	0
退職給付債務の期末残高	2,588

(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 2021年1月 1日 至 2021年12月31日)
年金資産の期首残高	3,313
期待運用収益	9
数理計算上の差異の発生額	17
事業主からの拠出額	359
退職給付の支払額	94
年金資産の期末残高	3,606

(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 (2021年12月31日)
積立型制度の退職給付債務	2,505
年金資産	3,606
非積立型制度の退職給付債務	1,100
	82
未積立退職給付債務	1,018
未認識数理計算上の差異	65
未認識過去勤務費用	33
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	919
退職給付引当金	82
前払年金費用	1,001
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	919

(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 2021年1月 1日 至 2021年12月31日)
勤務費用	322
利息費用	20
期待運用収益	9
数理計算上の差異の費用処理額	59
過去勤務費用の処理額	3
確定給付制度に係る退職給付費用合計	270
特別退職金	0
合計	270

(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 (2021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87%、株式13%及びその他1%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 2021年1月 1日 至 2021年12月31日)
割引率	0.7%
長期期待運用収益率	0.3%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、80百万円 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 (2020年12月31日)	当事業年度 (2021年12月31日)
繰延税金資産		
未払費用	215	161
賞与引当金	608	660
資産除去債務	239	240
未払事業税	72	89
退職給付引当金	21	25
有形固定資産	2	1
その他	95	78
繰延税金資産合計	1,256	1,257
繰延税金負債		
退職給付引当金	275	306
資産除去債務に対応する除去費用	90	59
その他	1	1
繰延税金負債合計	367	367
繰延税金資産の純額	888	889

(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せん。

	(単位：百万円)	
	前事業年度 (2020年12月31日)	当事業年度 (2021年12月31日)
固定資産 - 繰延税金資産	888	889

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 (2020年12月31日)		当事業年度 (2021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	2.9		2.0	
その他	0.0		0.0	
税効果会計適用後の法人税等の負担率	33.6	%	32.6	%

(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 2020年1月 1日 至 2020年12月31日)	当事業年度 (自 2021年1月 1日 至 2021年12月31日)
期首残高	782	783
時の経過による調整額	0	0
期末残高	783	784

(セグメント情報等)

前事業年度（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。

当事業年度(自 2021年1月1日 至 2021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	6,653	8,355	14,536	29,546

(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
14,396	13,081	2,067	29,546

(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	6,285	投資運用業
ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	4,259	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 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	その他未払金	1,496

当事業年度(自 2021年1月1日 至 2021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	249	未収収益	377
							受入手数料	6,036	未収入金	524
							委託調査費	1,178	未払費用	112
							事務委託費	1,204		
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	1,940	その他未払金	1,940

(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 2020年1月1日 至 2020年12月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2021年1月1日 至 2021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 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		
							事務委託費	16		

当事業年度 (自 2021年1月1日 至 2021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	4,259	未収収益	321
							委託調査費	282		
							事務委託費	20		

(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 2020年1月 1日 至 2020年12月31日)	当事業年度 (自 2021年1月 1日 至 2021年12月31日)
1株当たり純資産額	1,379,616 円 17 銭	1,318,566 円 41 銭
1株当たり当期純利益金額	250,430 円 95 銭	332,267 円 26 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 2020年1月 1日 至 2020年12月31日)	当事業年度 (自 2021年1月 1日 至 2021年12月31日)
当期純利益 (百万円)	3,756	4,984
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)	3,756	4,984
普通株式の期中平均株式数 (株)	15,000	15,000

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うことを内容とした運用を行うこと(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うことを内容とした運用を行うこと(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うことを内容とした運用を行うこと。
- (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・連絡等を行います。

(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す。

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【参考情報】

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

2021年4月9日	有価証券報告書、有価証券届出書
2021年10月15日	半期報告書、有価証券届出書

独立監査人の監査報告書

2022年 2月28日

ブラックロック・ジャパン株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ

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2021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

2022年3月9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2021年1月16日から2022年1月17日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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2022年1月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、ブラックロック・ジャパン株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。