

【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10月14日
【計算期間】	第16期（自 2022年1月18日 至 2022年7月15日）
【ファンド名】	ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド（為替ヘッジあり） ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド（為替ヘッジなし）
【発行者名】	ブラックロック・ジャパン株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 有田 浩之
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番3号
【事務連絡者氏名】	猪浦 純子
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番3号
【電話番号】	03-6703-7940
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

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

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

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

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

<商品分類表>

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

<属性区分表>

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

< 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	海外	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
投資対象資産による区分	株式	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
補足分類	特殊型 (絶対収益追求型)	目論見書または投資信託約款において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

・ 属性区分

投資対象資産による属性区分	その他資産（投資信託証券）	目論見書または投資信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいう。
決算頻度による属性区分	年2回	目論見書または投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。
投資対象地域による属性区分	グローバル (日本を含む)	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
投資形態による属性区分	ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいう。
為替ヘッジによる属性区分	為替ヘッジあり (フルヘッジ)	目論見書または投資信託約款において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。なお、「為替ヘッジ」とは、対円での為替リスクに対するヘッジの有無をいう。
	為替ヘッジなし	目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。なお、「為替ヘッジ」とは、対円での為替リスクに対するヘッジの有無をいう。
特殊型による属性区分	絶対収益追求型	目論見書または投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。

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

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

信託金の限度額は、「為替ヘッジあり」、「為替ヘッジなし」合わせて1,000億円です。ただし、委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

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

ファンドの特色（当ファンドおよびマザーファンドの特色）

- a. 主として、世界の株式および株式関連の派生商品等に投資し、買い建て・売り建てポジションを構築することにより、世界の株式市場の動向に左右されにくい安定的な収益を追求し、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。
- b. 主として、世界の株式および株式関連の派生商品等に投資し、絶対収益の追求を目指す2つの投資信託証券（以下「投資対象ファンド」といいます。）に投資を行います。

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

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

- 各投資対象ファンドにおいて買い建て・売り建てのポジションを構築するにあたっては、積極的にデリバティブ取引（先物・スワップなど）を活用します。

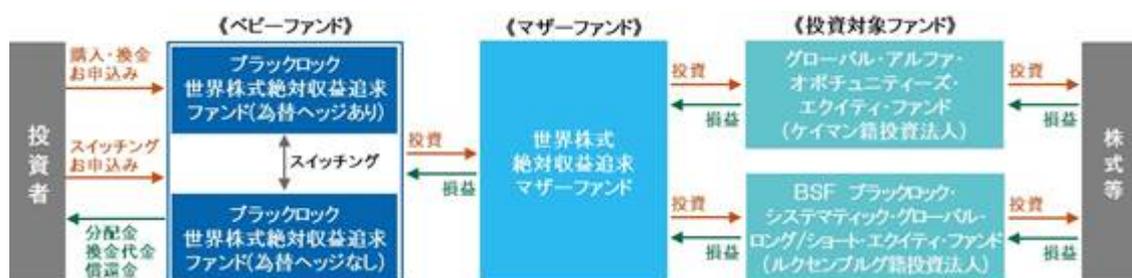
買い建て額と売り建て額の合計額は、各投資対象ファンドの純資産総額を上回る金額となります。

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

- c. ファンドは、世界株式絶対収益追求マザーファンドをマザーファンドとするファミリーファンド方式で運用します。ファンドは、マザーファンドを通じて、投資信託証券を実質的な投資対象とするファンド・オブ・ファンズです。

投資対象とする投資信託証券は、本書提出日現在、以下の通りです。

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



<ファンドの仕組みについて>

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。

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

スイッチングの取扱いについては、各販売会社により異なりますので、詳細は販売会社にお問い合わせください。

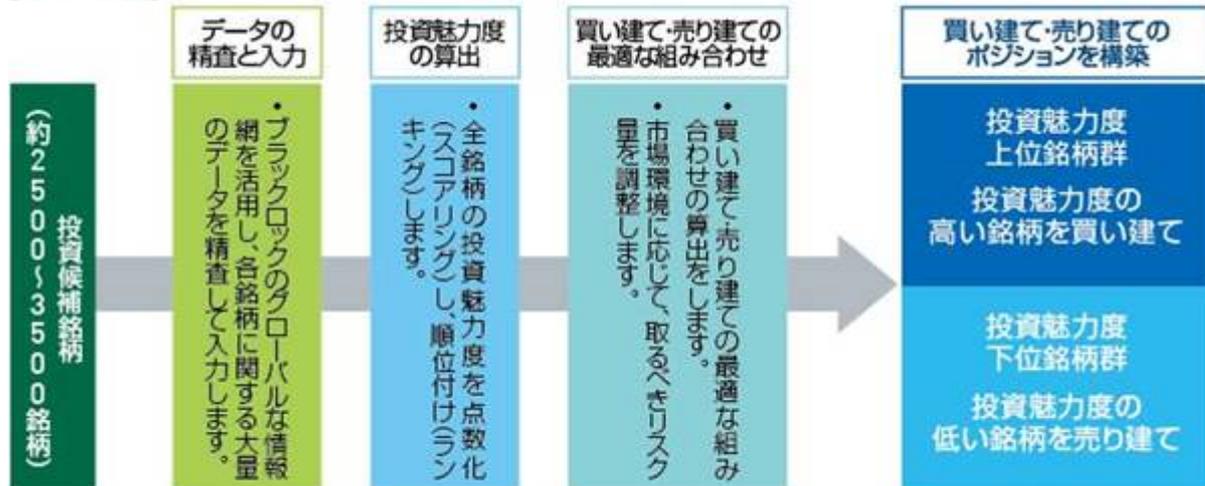
d. 各投資対象ファンドの運用戦略は、ブラックロック独自の計量モデルを活用します。

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

<運用プロセス（投資対象ファンドの運用プロセス）>

独自の計量モデルを活用し、買い建て・売り建ての最適な組み合わせのポートフォリオを構築します。

[イメージ図]



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

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

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

スイッチングの際には、換金時と同様の税金がかかります。

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

分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。運用状況によっては、分配を行わない場合もあります。

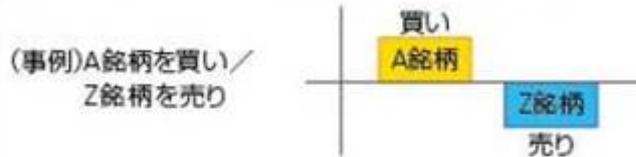
(追加的記載事項)

買い建て/売り建てポジションとその損益について

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

[イメージ図]

買い建て／売り建ての組み合わせによる損益



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

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

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

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

(参考)グロスポジションについて

投資対象ファンドは、デリバティブ取引を活用し、買い建てと売り建てポジションを構築します。
グロスポジションとは、純資産総額に対する買い建て額と売り建て額の割合の合計をいいます。

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

[イメージ図]

グロスポジション：500% の例



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

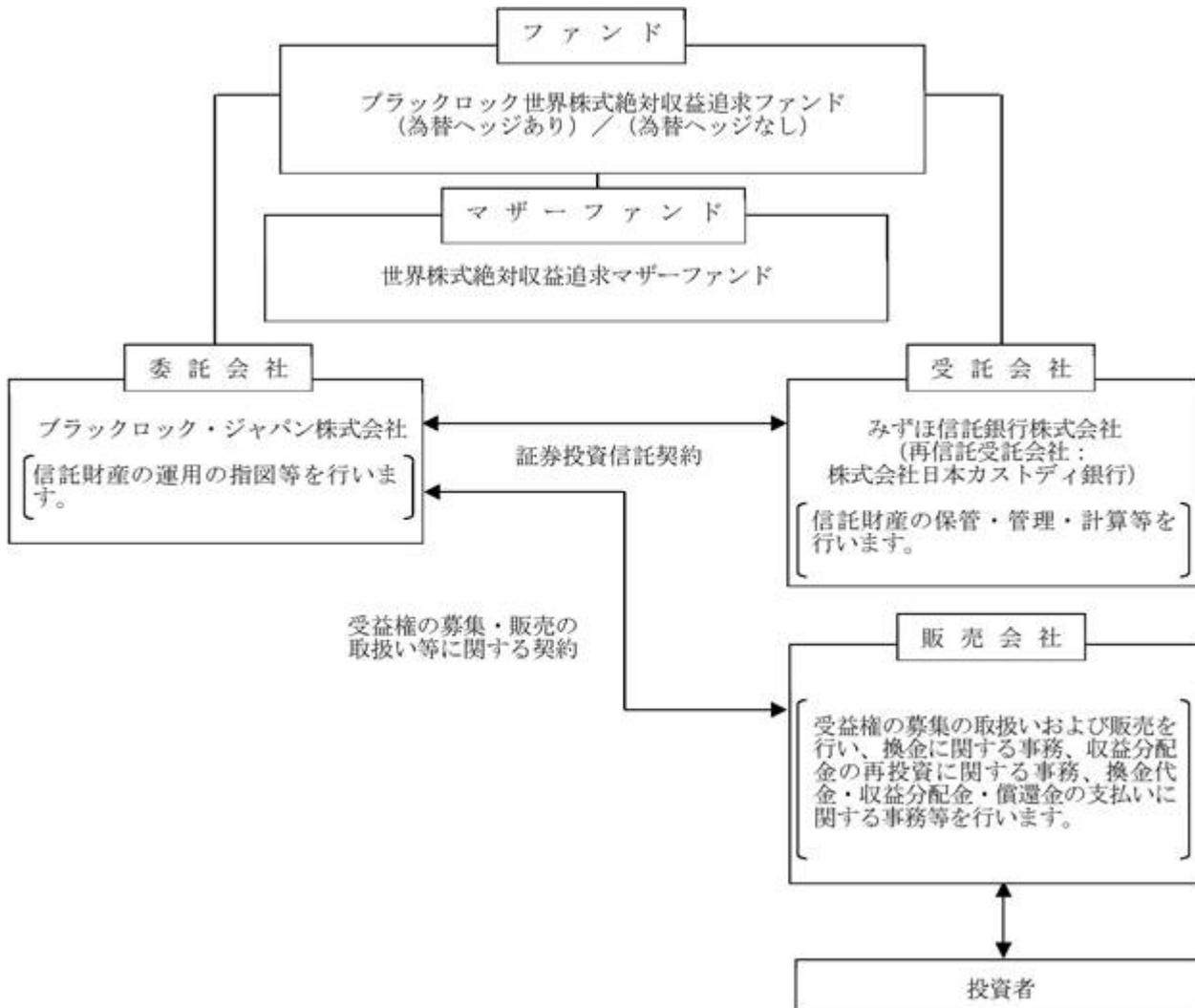
(2) 【ファンドの沿革】

2014年7月7日 信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

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

(3) 【ファンドの仕組み】

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。

< 委託会社の概況 >

2022年7月末現在の委託会社の概況は、以下のとおりです。

a . 資本金 3,120百万円

b . 沿革

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

c . 大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

世界株式絶対収益追求マザーファンドの受益証券への投資を通じて、主として世界の株式および株式関連の派生商品等に投資し、ロング・ショート（買い建ておよび売り建て）ポジションを構築する投資信託証券に投資を行い、市場動向に左右されにくい投資収益を追求します。マザーファンドの投資対象ファンドは、別に定めるブラックロック・グループの運用会社が運用するものとします。

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

（為替ヘッジあり）

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

（為替ヘッジなし）

実質外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

委託会社は、自己または第三者の利益を図るために投資者の利益を害することとなる潜在的なおそれのある取引を行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

世界株式絶対収益追求マザーファンド

運用の基本方針

1. 基本方針

この投資信託は、市場動向に左右されにくい安定的な収益を追求し、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

主として世界の株式および株式関連の派生商品等に投資を行い、ロング・ショート（買建および売建）ポジションを構築する投資信託証券に投資を行います。投資対象とする投資信託証券は、別に定めるブラックロック・グループの運用会社が運用するものとします。

(2) 投資態度

主として世界の株式および株式関連の派生商品等に投資し、ロング・ショート（買建および売建）ポジションを構築する投資信託証券（以下、「投資対象ファンド」といいます。）に投資を行い、市場動向に左右されにくい投資収益を追求します。投資対象ファンドは、別に定めるブラックロック・グループの運用会社が運用するものとします。

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

別に定める投資信託証券は、委託会社の判断により、変更することがあります。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

(3) 投資制限

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

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

(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、主として世界株式絶対収益追求マザーファンドの受益証券のほか、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

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

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

投資対象とする金融商品

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

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

マザーファンドの投資対象ファンドの概要

a. グローバル・アルファ・オポチュニティーズ・エクイティ・ファンド

形態	ケイマン籍（オープン・エンド型）会社型外国投資証券（米ドル建て）
投資目的および投資態度	ファンドは、世界の株式および株式関連の派生商品等に投資するロング・ショート（買い建ておよび売り建て）ポジションを構築することにより長期的に米国短期金利を上回るトータル・リターンを目指します。
存続期間	無期限
主な投資対象	<ul style="list-style-type: none"> ・世界の株式および関連するデリバティブ取引に投資します。 ・主として、先進国の企業の発行する株式および関連するデリバティブ取引への投資を行いますが、先進国以外の国の企業が発行する株式および関連するデリバティブ取引にも投資することがあります。 ・世界の株式および関連するデリバティブ取引について、買い建ておよび売り建ての両方を行います。 ・買い建ておよび売り建てのポジションについては、主にスワップ取引を含むデリバティブ取引を活用して行います。買い建てと売り建ての想定元本の合計（グロスポジション）は、原則として純資産総額の200%～500%の範囲内とします。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・一発行会社の発行する株式について、発行済株数の50%を越えて当該発行会社に投資しないこととします。 ・資金の借入れについては、純資産総額の10%以内とします。 ・現物株式による売り建てについては、純資産総額の範囲とします。
管理報酬	年1.65%
その他費用	管理業務会社、保管会社および名義書換事務代行会社への報酬等および事務諸費に要する費用についてはファンドから差し引かれます。
決算日	年1回（原則として12月末日）に決算を行います。
収益分配方針	分配を行いません。
申込手数料	ありません。
投資顧問会社	ブラックロック・インスティテューショナル・トラスト・カンパニー，エヌ．エイ．
保管会社	ステート・ストリート・バンク&トラスト・カンパニー

b. B S F ブラックロック・システマティック・グローバル・ロング/ショート・エクイティ・ファンド

形態	ルクセンブルグ籍(オープン・エンド型)会社型外国投資証券(米ドル建て)
投資目的および投資態度	ファンドは、株式等に投資するロング・ショート(買い建ておよび売り建て)ポジションを構築することにより市場動向に係わらずプラスの絶対収益の追求を目指します。ファンドの純資産の少なくとも70%を先進国の株式もしくは株式関連の派生商品等へ投資を行います。ファンドは、先進国の株式に広く分散投資を行い、それと同時に市場動向との相関性の低いリターンを生み出すことを目指します。
存続期間	無期限
主な投資対象	先進国の株式もしくは株式関連の派生商品等に投資します。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・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1.50%
その他費用	管理業務会社、保管会社および名義書換事務代行会社への報酬等および事務諸費に要する費用についてはファンドから差し引かれます。
決算日	年1回(原則として5月末日)に決算を行います。
収益分配方針	分配を行います。ただし、必ず分配を行うものではありません。
申込手数料	ありません。
管理会社	ブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エー
投資顧問会社	ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク
保管会社	ステート・ストリート・バンク・インターナショナル GmbH、ルクセンブルグ支店

(3) 【運用体制】

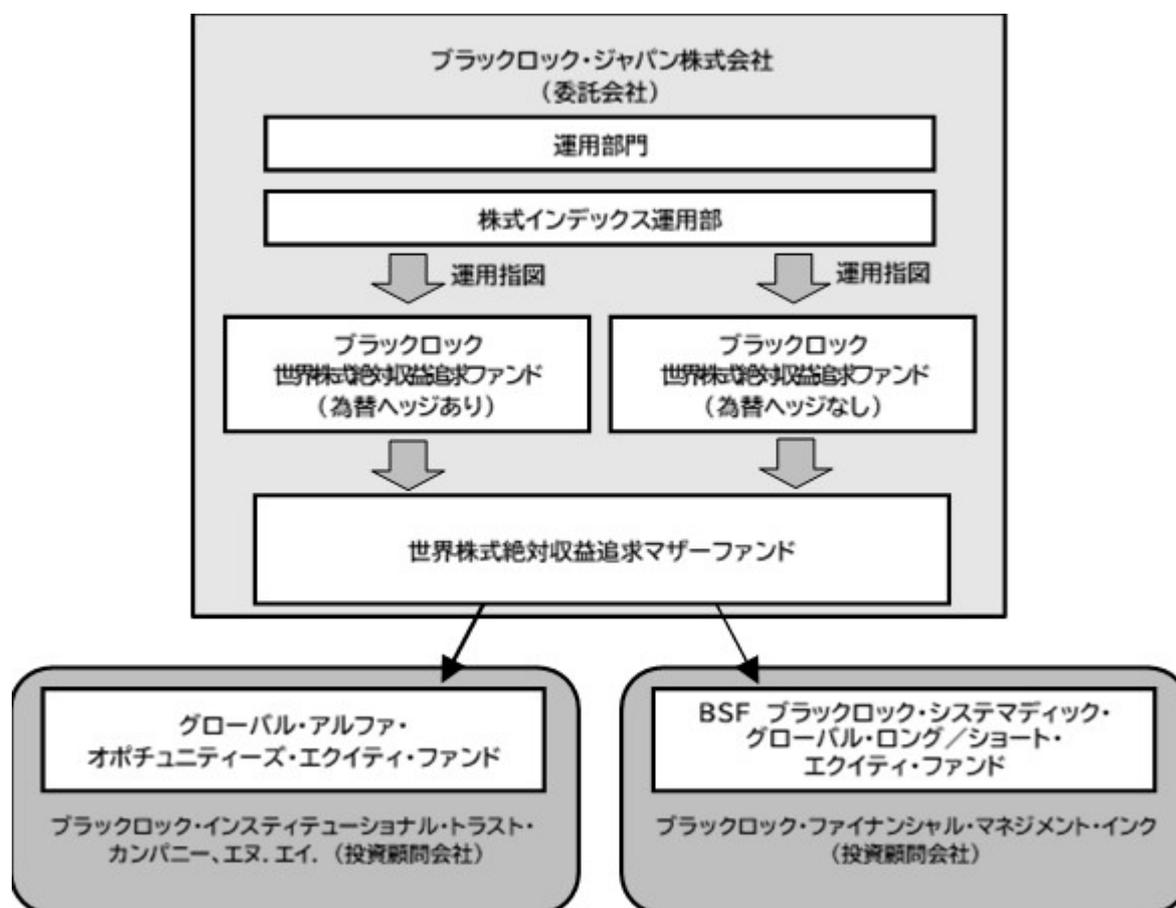
ファンドの運用・管理の各業務の役割分担を社内規程により定めております。

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わた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、株式インデックス運用部（当ファンド担当：8名程度）が担当いたします。

運用体制図



運用体制等は、変更となる場合があります。

ブラックロック・グループ

ブラックロック・グループは、運用資産残高約8.49兆ドル^{*}（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。

* 2022年6月末現在。（円換算レートは1ドル=135.855円を使用）

(4)【分配方針】

収益分配方針

年2回の毎決算時（原則として1月15日および7月15日。休業日の場合は翌営業日。）に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。

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。

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。

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。

収益の分配

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

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

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

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

収益分配金の支払い

a．支払時期と支払場所

(a) 一般コースの場合

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

(b) 累積投資コースの場合

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

各ファンドの約款で定める投資制限

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

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. 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．買い建て・売り建てポジションを構築する戦略リスク

投資対象ファンドは、計量モデルを活用し、買い建て・売り建てポジションを構築する運用戦略により投資収益を追求しますが、当戦略がその目的を達成できる保証はありません。買い建てた銘柄の価格が下落した場合、もしくは売り建てた銘柄の価格が上昇した場合は損失が発生し、それに伴い当ファンドの基準価額が下落する可能性があります。また買い建てと売り建ての双方で損失した場合は、運用上想定されていた以上に当ファンドの運用成果に影響があり、損失が拡大する可能性があります。

b．株価変動リスク

投資対象ファンドは、世界各国の株式および株式関連の派生商品に投資を行います。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．デリバティブ取引のリスク

投資対象ファンドは、株式関連のデリバティブ取引（先物・スワップなど）を行います。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、投資対象ファンドの純資産規模を上回る金額のデリバティブ取引を行います。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、大きい損失を被る可能性があります。このような事態が生じた場合には当ファンドの運用成果に影響を与えます。

d．為替変動リスク

「為替ヘッジあり」は、為替変動リスクの低減を図ることを目指し、原則として外貨建資産に対して為替ヘッジを行います。為替変動による影響の全てを回避することはできません。またヘッジ対象通貨の金利が円金利より高い場合、ヘッジ・コストがかかります。

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

e．カンントリー・リスク

投資対象ファンドは、エマージング（新興）市場の発行体が発行する株式にも一部投資する場合があります。エマージング諸国の経済は、先進諸国に比べて不安定であり、その株式市場を取り巻く社会的・経済的環境はより不透明な場合が多く、エマージング諸国の政府は自国経済を規制または監督する上で大きな影響力を行使することがあります。したがって、先進国市場に投資する場合に比べて、投資先の国の政治・経済事情、通貨・資本規制等の要因により、より大幅に株価が変動することが考えられ、それに伴い当ファンドの運用成果に影響を与えます。

ファンド運営上のリスク

a．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換金の受付についても取り消す場合があります（スイッチングを含みます）。

b．ファンドの繰上償還

各ファンドは各ファンドの換金により受益権の口数が30億口を下回ることとなった場合、または投資者のため有利と認められる場合、その他やむを得ない事情が発生したとき等は、各ファンドを償還させる場合があります。

c．法令・税制・会計等の変更

法令・税制・会計方法等は今後変更される可能性があります。

d．流動性リスクに関する事項

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

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

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

リスクの管理体制は、変更となる場合があります。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

本書提出日現在、購入の申込受付は行っておりませんので、該当事項はありません。

(2)【換金（解約）手数料】

換金手数料
ありません。

信託財産留保額
ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬の総額

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

a．ファンドの信託報酬

計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.7183%（税抜0.653%）の率を乗じて得た額とします。信託報酬に係る委託会社、販売会社、受託会社との間の配分および当該報酬を対価とする役務の内容は次の通りとします。

	信託報酬の配分	役務の内容
委託会社	年0.0275% （税抜0.025%）	ファンドの運用、基準価額の計算、運用報告書等各種書類の作成等
販売会社	年0.6600% （税抜0.60%）	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等
受託会社	年0.0308% （税抜0.028%）	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行等

b．投資対象ファンドにかかる運用管理費用

年1.575%程度が投資対象ファンドから支払われます。
各投資対象ファンドへ均等に配分したものととして算出しています。

信託報酬の支払時期と支払方法等

信託報酬は、日々計上され、毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとします。

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

(4)【その他の手数料等】

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

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

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

- 1．受益権の管理事務に関連する費用
- 2．有価証券届出書、有価証券報告書等法定提出書類の作成、印刷および提出に係る費用

3. 目論見書の作成、印刷および交付に係る費用
4. 信託約款の作成、印刷および届出に係る費用
5. 運用報告書の作成、印刷、交付および提出に係る費用
6. 公告に係る費用
7. 他の信託との併合および信託約款の変更またはファンドの償還に係る事項を記載した書面の作成、印刷および交付に係る費用
8. この信託の監査人、法律顧問および税務顧問に対する報酬および費用

委託会社は、年0.11%（税抜 0.10%）を上限とする、上記の諸費用の金額をあらかじめ合理的に見積もった上で算出する率を毎日純資産総額に対して乗じて得た額、または上記の諸費用の金額をあらかじめ合理的に見積もった上で算出する額を、上記の諸費用の支払の合計額とみなして、ファンドから受領することができます。諸費用および諸費用に係る消費税等相当額は、日々計上され、毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支払われるものとします。

外貨建資産の保管等に要する費用^{*}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

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

個別元本方式について

- a. 追加型株式投資信託について、投資者毎の信託時の受益権の価額等（購入時手数料は含まれません。）が当該投資者の元本（「個別元本」といいます。）にあたります。
- b. 投資者が同一ファンドの受益権を複数回購入した場合、個別元本は、当該投資者が追加信託を行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%、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%、地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。原則として確定申告が必要ですが、特定口座（源泉徴収口座）の利用が可能な場合があります。

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

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

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

b．法人の投資者に対する課税

法人の投資者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税15.315%、地方税の源泉徴収はありません。）の税率による源泉徴収が行われます。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7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7月末現在のものです。

「ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド(為替ヘッジあり)」

(1)【投資状況】

資産の種類	金額(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	21,507,635	98.77
内 日本	21,507,635	98.77
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	268,278	1.23
純資産総額	21,775,913	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

順位	銘柄	国/地域	種類	数量(口)	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
1	世界株式絶対収益追求マ ザーファンド	日本	親投資信託 受益証券	15,234,194	1.4332	21,833,647	1.4118	21,507,635	98.77

(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	98.77

(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7月末現在、同日前1年以内における各月末および各計算期間末の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額(円)		1口当たりの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期(2015年1月15日)	957,773,597	(同左)	0.9845	(同左)
第2期(2015年7月15日)	706,420,247	716,876,433	1.0134	1.0284
第3期(2016年1月15日)	431,355,676	(同左)	0.9882	(同左)
第4期(2016年7月15日)	257,693,759	(同左)	0.9387	(同左)
第5期(2017年1月16日)	205,337,547	(同左)	0.9494	(同左)
第6期(2017年7月18日)	186,476,290	(同左)	0.9820	(同左)
第7期(2018年1月15日)	159,770,771	(同左)	0.9934	(同左)
第8期(2018年7月17日)	125,789,790	(同左)	0.9650	(同左)
第9期(2019年1月15日)	115,787,456	(同左)	0.9544	(同左)
第10期(2019年7月16日)	101,429,981	(同左)	0.9724	(同左)
第11期(2020年1月15日)	89,167,045	(同左)	0.9387	(同左)
第12期(2020年7月15日)	83,645,450	(同左)	0.9403	(同左)
第13期(2021年1月15日)	68,745,586	(同左)	0.9060	(同左)
第14期(2021年7月15日)	50,959,802	(同左)	0.9222	(同左)
第15期(2022年1月17日)	42,005,589	(同左)	0.8852	(同左)
第16期(2022年7月15日)	29,622,820	(同左)	0.8760	(同左)
2021年7月末現在	50,799,637		0.9193	
2021年8月末現在	45,033,787		0.8979	
2021年9月末現在	44,802,092		0.8933	
2021年10月末現在	45,306,804		0.9033	
2021年11月末現在	43,067,083		0.9075	
2021年12月末現在	43,065,817		0.9075	
2022年1月末現在	42,831,460		0.9026	
2022年2月末現在	43,151,738		0.9093	
2022年3月末現在	43,008,252		0.9063	
2022年4月末現在	40,683,088		0.8930	
2022年5月末現在	38,686,617		0.8868	
2022年6月末現在	29,910,926		0.8846	
2022年7月末現在	21,775,913		0.8893	

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1期	
第2期	0.0150
第3期	
第4期	
第5期	
第6期	
第7期	
第8期	
第9期	
第10期	
第11期	
第12期	
第13期	
第14期	
第15期	
第16期	

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1期	1.6
第2期	4.5
第3期	2.5
第4期	5.0
第5期	1.1
第6期	3.4
第7期	1.2
第8期	2.9
第9期	1.1
第10期	1.9
第11期	3.5
第12期	0.2
第13期	3.6
第14期	1.8
第15期	4.0
第16期	1.0

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

(4)【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第1期	998,560,692	25,710,000	972,850,692
第2期	22,680,735	298,452,329	697,079,098
第3期	98,124,924	358,683,774	436,520,248
第4期	2,804,198	164,800,640	274,523,806
第5期	35,149,826	93,384,340	216,289,292
第6期	13,280,231	39,666,243	189,903,280
第7期		29,077,262	160,826,018
第8期		30,468,963	130,357,055
第9期	50,604	9,091,990	121,315,669
第10期		17,002,909	104,312,760
第11期		9,323,895	94,988,865
第12期		6,030,604	88,958,261
第13期		13,080,309	75,877,952
第14期		20,619,325	55,258,627
第15期		7,802,788	47,455,839
第16期		13,641,039	33,814,800

「ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド(為替ヘッジなし)」

(1) 投資状況

資産の種類	金額(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	786,905,447	100.03
内 日本	786,905,447	100.03
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	253,283	0.03
純資産総額	786,652,164	100.00

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

順位	銘柄	国/地域	種類	数量(口)	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
1	世界株式絶対収益追求マ ザーファンド	日本	親投資信託 受益証券	557,377,424	1.4332	798,833,361	1.4118	786,905,447	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7月末現在、同日前1年以内における各月末および各計算期間末の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額(円)		1口当たりの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期(2015年1月15日)	12,135,487,725	13,301,883,530	1.0404	1.1404
第2期(2015年7月15日)	13,312,136,629	13,921,571,606	1.0922	1.1422
第3期(2016年1月15日)	9,391,426,507	9,484,247,383	1.0118	1.0218
第4期(2016年7月15日)	5,796,915,954	(同左)	0.8628	(同左)
第5期(2017年1月16日)	4,505,061,079	(同左)	0.9534	(同左)
第6期(2017年7月18日)	3,258,112,206	(同左)	0.9780	(同左)
第7期(2018年1月15日)	2,468,653,368	(同左)	0.9856	(同左)
第8期(2018年7月17日)	2,040,093,900	(同左)	0.9822	(同左)
第9期(2019年1月15日)	1,584,286,967	(同左)	0.9544	(同左)
第10期(2019年7月16日)	1,342,789,696	(同左)	0.9825	(同左)
第11期(2020年1月15日)	1,120,990,956	(同左)	0.9781	(同左)
第12期(2020年7月15日)	899,644,956	(同左)	0.9622	(同左)
第13期(2021年1月15日)	772,254,819	(同左)	0.8996	(同左)
第14期(2021年7月15日)	725,219,342	(同左)	0.9714	(同左)
第15期(2022年1月17日)	685,558,634	(同左)	0.9712	(同左)
第16期(2022年7月15日)	804,086,393	(同左)	1.1745	(同左)
2021年7月末現在	719,284,647		0.9645	
2021年8月末現在	705,213,273		0.9457	
2021年9月末現在	714,832,825		0.9586	
2021年10月末現在	714,157,834		0.9847	
2021年11月末現在	702,157,972		0.9902	
2021年12月末現在	708,090,864		1.0018	
2022年1月末現在	706,006,629		1.0002	
2022年2月末現在	709,984,703		1.0087	
2022年3月末現在	743,486,270		1.0653	
2022年4月末現在	764,924,785		1.1069	
2022年5月末現在	755,444,674		1.0946	
2022年6月末現在	797,992,237		1.1656	
2022年7月末現在	786,652,164		1.1566	

分配の推移

	1口当たりの分配金(円)
第1期	0.1000
第2期	0.0500
第3期	0.0100
第4期	
第5期	
第6期	
第7期	
第8期	
第9期	
第10期	
第11期	
第12期	
第13期	
第14期	
第15期	
第16期	

収益率の推移

	収益率(%)
第1期	14.0
第2期	9.8
第3期	6.4
第4期	14.7
第5期	10.5
第6期	2.6
第7期	0.8
第8期	0.3
第9期	2.8
第10期	2.9
第11期	0.4
第12期	1.6
第13期	6.5
第14期	8.0
第15期	0.0
第16期	20.9

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

(4) 設定及び解約の実績

	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第1期	12,278,492,168	614,534,115	11,663,958,053
第2期	4,455,831,030	3,931,089,532	12,188,699,551
第3期	3,291,947,721	6,198,559,640	9,282,087,632
第4期	209,741,336	2,773,360,058	6,718,468,910
第5期	90,712,428	2,084,085,529	4,725,095,809
第6期	29,368,515	1,423,205,002	3,331,259,322
第7期	82,625,597	909,247,881	2,504,637,038
第8期	1,027,622	428,549,479	2,077,115,181
第9期	638,045	417,760,595	1,659,992,631
第10期	273,194	293,550,581	1,366,715,244
第11期	234,649	220,845,674	1,146,104,219
第12期	138,048	211,281,813	934,960,454
第13期		76,532,356	858,428,098
第14期		111,853,868	746,574,230
第15期		40,716,283	705,857,947
第16期		21,239,440	684,618,507

(参考情報)「世界株式絶対収益追求マザーファンド」

(1) 投資状況

資産の種類	金額(円)	投資比率(%)
投資証券	808,324,686	99.99
内 ケイマン諸島	406,396,855	50.27
内 ルクセンブルグ	401,927,831	49.72
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	89,210	0.01
純資産総額	808,413,896	100.00

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

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

順位	銘柄	国/地域	種類	投資口数	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	グローバル・アルファ・オポチュニティーズ・エクイティ・ファンド・リミテッド クラスA投資証券	ケイマン諸島	投資証券	292,651	1,349.43	394,913,513	1,388.66	406,396,855	50.27
2	ブラックロック・ストラテジック・ファンズ ブラックロック・システムティック・グローバル・ロング/ショート・エクイティ・ファンド クラスJ投資証券	ルクセンブルグ	投資証券	26,836	14,909.40	400,121,577	14,976.70	401,927,831	49.72

(注) 投資比率は、純資産総額に対する評価金額の比率です。

種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.99

(注) 投資比率は、純資産総額に対する評価金額の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

本書提出日現在、購入の申込受付は行っておりませんので、該当事項はありません。

2【換金（解約）手続等】

(1) 換金の申込と受付

投資者は、自己に帰属する受益権について、委託会社に換金の申込をすることができます。投資者が換金の申込をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。換金の申込の受付は、午後3時までとなっております（スイッチングを含みます。）。ただし、受付時間は販売会社により異なることがあります。詳細は販売会社にお問い合わせください。受付時間を過ぎての換金の申込は翌営業日の取扱いとします。

(2) 換金単位

換金単位は各販売会社により異なりますので、詳細は販売会社にお問い合わせください。

(3) 換金不可日

以下に定める日のいずれかに該当する場合には、販売会社の営業日であっても換金（スイッチングを含みます。）は受け付けません。詳細は販売会社にお問い合わせください。

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

(4) 換金価額

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

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

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

(5) 換金受付の制限

信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の換金の申込には制限があります。詳細は販売会社にお問い合わせください。

(6) 換金代金の支払い

換金代金は原則として換金受付日から起算して8営業日目から販売会社においてお支払いします。

(7) 換金の申込の受付中止および取消

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、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（スイッチングを含みます。）。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

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

当ファンドの主たる投資対象の評価方法は以下の通りです。

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

（参考）マザーファンドの主たる投資対象の評価方法

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

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

ホームページアドレス： www.blackrock.com/jp/

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

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

(4)【計算期間】

毎年1月16日から7月15日まで、および7月16日から翌年1月15日までとすることを原則とします。計算期間終了日に該当する日が休業日のときは該当日の翌営業日を計算期間の終了日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

(5)【その他】

ファンドの償還条件等

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

b．委託会社は換金により、各ファンドの受益権の口数が30億口を下回ることとなった場合には、受託会社と合意のうえ、各ファンドを償還させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、償還しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- c . a . および b . の場合において、委託会社は、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。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っている投資者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- d . c . の書面決議において、投資者(委託会社およびファンドの信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る投資者としての受託会社を除きます。以下 d . において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている投資者が議決権を行使しないときは、当該知っている投資者は書面決議について賛成するものとみなします。
- e . c . の書面決議は議決権を行使することができる投資者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- 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、監督官庁よりファンドの償還の命令を受けたときはその命令に従い、ファンドを償還させます。
- h . 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社はこのファンドを償還させます。
- i . h . にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、「 信託約款の変更 b . 」に規定する書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- j . 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または投資者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、信託約款の変更の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。

信託約款の変更

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

- c . b . の書面決議において、投資者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る投資者としての受託会社を除きます。以下c . に同じ。）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、当ファンドのすべての投資者に対してその効力を生じます。
- f . b . ~ e . までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての投資者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- g . a . ~ f . までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行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を通じて知っている受益者にお届けいたします。

関係法人との契約の更改等に関する手続

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

公告

委託会社が投資者に対してする公告は、電子公告により行い、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8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16期計算期間(2022年1月18日から2022年7月15日まで)の財務諸表について、PWCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

(3) 当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行っておりますので、参考情報として「世界株式絶対収益追求マザーファンド」の貸借対照表、注記表及び附属明細表を記載しております。

なお、当該参考情報は監査意見の対象外となっております。

1【財務諸表】

【ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド(為替ヘッジあり)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第15期 (2022年1月17日現在)	第16期 (2022年7月15日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	408,338	310,882
親投資信託受益証券	41,192,905	30,026,494
派生商品評価勘定	607,420	10,182
流動資産合計	42,208,663	30,347,558
資産合計	42,208,663	30,347,558
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	10,985	563,442
未払受託者報酬	7,115	5,968
未払委託者報酬	159,503	133,946
その他未払費用	25,471	21,382
流動負債合計	203,074	724,738
負債合計	203,074	724,738
純資産の部		
元本等		
元本	47,455,839	33,814,800
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	5,450,250	4,191,980
(分配準備積立金)	521,529	371,615
元本等合計	42,005,589	29,622,820
純資産合計	42,005,589	29,622,820
負債純資産合計	42,208,663	30,347,558

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第15期 (自 2021年7月16日 至 2022年1月17日)	第16期 (自 2022年1月18日 至 2022年7月15日)
営業収益		
有価証券売買等損益	138,648	7,903,068
為替差損益	1,866,017	8,042,760
営業収益合計	1,727,369	139,692
営業費用		
受託者報酬	7,115	5,968
委託者報酬	159,503	133,946
その他費用	31,715	21,620
営業費用合計	198,333	161,534
営業利益又は営業損失()	1,925,702	301,226
経常利益又は経常損失()	1,925,702	301,226
当期純利益又は当期純損失()	1,925,702	301,226
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()	167,287	7,191
期首剰余金又は期首欠損金()	4,298,825	5,450,250
剰余金増加額又は欠損金減少額	606,990	1,566,687
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	606,990	1,566,687
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金()	5,450,250	4,191,980

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法

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

2 デリバティブの評価基準及び評価方法

為替予約取引

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

3 収益及び費用の計上基準

有価証券売買等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準

約定日基準で計上しております。

4 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16期計算期間は前計算期間末が休業日であったため、2022年1月18日から2022年7月15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15期 (2022年1月17日現在)	第16期 (2022年7月15日現在)
1 当該計算期間の末日における受益権総数	47,455,839口	33,814,800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 5,450,250円	元本の欠損 4,191,980円
3 1口当たり純資産額	0.8852円	0.8760円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第15期 (自 2021年7月16日 至 2022年1月17日)	第16期 (自 2022年1月18日 至 2022年7月15日)
分配金の計算過程	<p>当計算期末における、費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(222,867円)、分配準備積立金(521,529円)により、分配対象収益は744,396円となりましたが、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、当期は分配を見合わせました。</p>	<p>当計算期末における、費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(158,804円)、分配準備積立金(371,615円)により、分配対象収益は530,419円となりましたが、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、当期は分配を見合わせました。</p>

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

1 金融商品に対する取組方針

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

2 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク

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

当ファンドの主な投資リスクとして、「買い建て・売り建てポジションを構築する戦略リスク」、「株価変動リスク」、「デリバティブ取引のリスク」、「為替変動リスク」、「カントリー・リスク」等があります。

当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であり、親投資信託の外貨建資産の時価総額のうち当ファンドに属するとみなした額の為替変動リスクの低減を目的としており、投機を目的とした為替予約は行わない方針であります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変化により損失が発生する信用リスクであります。

3 金融商品に係るリスク管理体制

(1) 市場リスクの管理

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

(2) 信用リスクの管理

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

(3) 取引先リスクの管理

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

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

金融商品の時価等に関する事項

第15期 (2022年1月17日現在)	第16期 (2022年7月15日現在)
<p>1 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>	<p>1 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p>
<p>2 時価の算定方法 (1) 有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引については、「(その他の注記)」の「3 デリバティブ取引関係」に記載されております。 (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>	<p>2 時価の算定方法 (1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左</p>
<p>3 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	<p>3 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 同左</p>
<p>4 金銭債権の計算期間末日後の償還予定額 金銭債権については全て1年以内に償還予定であります。</p>	<p>4 金銭債権の計算期間末日後の償還予定額 同左</p>

金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」附則(令和3年9月24日改正内閣府令第61号)第2条第5項に従い、記載を省略しております。

(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 期中元本変動額

項目	第15期 (2022年1月17日現在)	第16期 (2022年7月15日現在)
期首元本額	55,258,627円	47,455,839円
期中追加設定元本額	- 円	- 円
期中一部解約元本額	7,802,788円	13,641,039円

2 有価証券関係

第15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	167,441
合計	167,441

第16期(2022年7月15日現在)

売買目的有価証券

種類	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	5,282,900
合計	5,282,900

3 デリバティブ取引関係

取引の時価等に関する事項

通貨関連

区分	種類	第15期(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 (円)		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売 建				
	アメリカドル	43,245,758	-	42,638,338	607,420
	買 建				
	アメリカドル	1,268,415	-	1,257,430	10,985
合 計		44,514,173	-	43,895,768	596,435

区分	種類	第16期(2022年7月15日現在)			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超 (円)		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売 建				
	アメリカドル	29,945,740	-	30,509,182	563,442
	買 建				
	アメリカドル	821,886	-	832,068	10,182
合 計		30,767,626	-	31,341,250	553,260

(注1) 時価の算定方法

為替予約取引

- 1 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日(以下「当該日」という。)の対顧客先物相場が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算期間末日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

- 2 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

- 3 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。

(注2) 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	世界株式絶対収益追求マザーファンド	20,950,666	30,026,494	
親投資信託受益証券 合計		20,950,666	30,026,494	
合計		20,950,666	30,026,494	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

当該事項はデリバティブ取引関係の注記事項として記載しております。

【ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド(為替ヘッジなし)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第15期 (2022年1月17日現在)	第16期 (2022年7月15日現在)
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	688,558,185	807,107,795
未収入金	937,056	-
流動資産合計	689,495,241	807,107,795
資産合計	689,495,241	807,107,795
負債の部		
流動負債		
未払解約金	937,056	-
未払受託者報酬	111,501	112,307
未払委託者報酬	2,489,747	2,507,887
その他未払費用	398,303	401,208
流動負債合計	3,936,607	3,021,402
負債合計	3,936,607	3,021,402
純資産の部		
元本等		
元本	705,857,947	684,618,507
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	20,299,313	119,467,886
(分配準備積立金)	20,255,248	88,017,475
元本等合計	685,558,634	804,086,393
純資産合計	685,558,634	804,086,393
負債純資産合計	689,495,241	807,107,795

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第15期 (自 2021年7月16日 至 2022年1月17日)	第16期 (自 2022年1月18日 至 2022年7月15日)
営業収益		
有価証券売買等損益	3,207,328	144,261,990
営業収益合計	3,207,328	144,261,990
営業費用		
受託者報酬	111,501	112,307
委託者報酬	2,489,747	2,507,887
その他費用	398,303	401,208
営業費用合計	2,999,551	3,021,402
営業利益又は営業損失()	207,777	141,240,588
経常利益又は経常損失()	207,777	141,240,588
当期純利益又は当期純損失()	207,777	141,240,588
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()	316,829	2,084,202
期首剰余金又は期首欠損金()	21,354,888	20,299,313
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,164,627	610,813
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,164,627	610,813
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金()	20,299,313	119,467,886

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法

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

2 収益及び費用の計上基準

有価証券売買等損益の計上基準

約定日基準で計上しております。

3 その他財務諸表作成のための基礎となる事項

計算期間末日の取扱い

第16期計算期間は前計算期間末が休業日であったため、2022年1月18日から2022年7月15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15期 (2022年1月17日現在)	第16期 (2022年7月15日現在)
1 当該計算期間の末日における受益権総数	705,857,947口	684,618,507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 20,299,313円	元本の欠損 - 円
3 1口当たり純資産額	0.9712円	1.1745円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第15期 (自 2021年7月16日 至 2022年1月17日)	第16期 (自 2022年1月18日 至 2022年7月15日)
分配金の計算過程	当計算期末における、費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(18,593,820円)、収益調整金(その他収益調整金)(13,723,250円)、分配準備積立金(20,255,248円)により、分配対象収益は52,572,318円となりましたが、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、当期は分配を見合わせました。	当計算期末における、費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(68,371,711円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(18,140,098円)、収益調整金(その他収益調整金)(13,310,313円)、分配準備積立金(19,645,764円)により、分配対象収益は119,467,886円となりましたが、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、当期は分配を見合わせました。

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

1 金融商品に対する取組方針

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

2 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク

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

当ファンドの主な投資リスクとして、「買い建て・売り建てポジションを構築する戦略リスク」、「株価変動リスク」、「デリバティブ取引のリスク」、「為替変動リスク」、「カントリー・リスク」等があります。

3 金融商品に係るリスク管理体制

(1) 市場リスクの管理

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

(2) 信用リスクの管理

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

(3) 取引先リスクの管理

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

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

金融商品の時価等に関する事項

第15期 (2022年1月17日現在)	第16期 (2022年7月15日現在)
<p>1 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>	<p>1 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p>
<p>2 時価の算定方法 (1) 有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>	<p>2 時価の算定方法 (1) 有価証券 同左 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左</p>
<p>3 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>3 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 同左</p>
<p>4 金銭債権の計算期間末日後の償還予定額 金銭債権については全て1年以内に償還予定であります。</p>	<p>4 金銭債権の計算期間末日後の償還予定額 同左</p>

金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」附則(令和3年9月24日改正内閣府令第61号)第2条第5項に従い、記載を省略しております。

(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 期中元本変動額

項目	第15期 (2022年1月17日現在)	第16期 (2022年7月15日現在)
期首元本額	746,574,230円	705,857,947円
期中追加設定元本額	- 円	- 円
期中一部解約元本額	40,716,283円	21,239,440円

2 有価証券関係

第15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	2,799,004
合計	2,799,004

第16期(2022年7月15日現在)

売買目的有価証券

種類	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	142,139,267
合計	142,139,267

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	世界株式絶対収益追求マザーファンド	563,150,848	807,107,795	
親投資信託受益証券 合計		563,150,848	807,107,795	
合計		563,150,848	807,107,795	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考情報)

当ファンドは、「世界株式絶対収益追求マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。同マザーファンドの2022年7月15日現在(以下「計算日」という)の状況は次の通りであります。

なお、以下に記載した情報は監査意見の対象外であります。

「世界株式絶対収益追求マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

項目	(2022年7月15日現在)
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	6,578,753
投資証券	830,547,454
流動資産合計	837,126,207
資産合計	837,126,207
負債の部	
流動負債	
流動負債合計	-
負債合計	-
純資産の部	
元本等	
元本	584,101,514
剰余金	
剰余金又は欠損金()	253,024,693
元本等合計	837,126,207
純資産合計	837,126,207
負債純資産合計	837,126,207

(注) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年7月16日から翌年7月15日までであります。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法

投資証券は移動平均法に基づき、原則として以下の通り時価評価しております。

(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券

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

(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券

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

(3) 時価が入手できなかった有価証券

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

2 デリバティブの評価基準及び評価方法

為替予約取引

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

3 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準

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

4 その他財務諸表作成のための基礎となる事項

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7月15日現在)
1 当該計算日における受益権総数	584,101,514口
2 1口当たり純資産額	1.4332円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

1 金融商品に対する取組方針

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

2 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク

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

当ファンドの主な投資リスクとして、「買い建て・売り建てポジションを構築する戦略リスク」、「株価変動リスク」、「デリバティブ取引のリスク」、「為替変動リスク」、「カントリー・リスク」等があります。

当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。為替予約取引は、外貨建有価証券の売買の決済等に必要となる外貨の売買の為に、その受渡日までの数日間の為替予約を利用しております。なお、当ファンドは外貨建資産の為替変動リスクの低減を目的としており、投機を目的とする為替予約は行わない方針であります。為替予約取引に係る主要なリスクは、為替相場の変動による価格変動リスク及び取引相手の信用状況の変化により損失が発生する信用リスクであります。

3 金融商品に係るリスク管理体制

(1) 市場リスクの管理

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

(2) 信用リスクの管理

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

(3) 取引先リスクの管理

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

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

金融商品の時価等に関する事項

(2022年7月15日現在)

- | | |
|----------------|---|
| (2022年7月15日現在) | |
| 1 | 貸借対照表計上額、時価及び差額
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2 | 時価の算定方法
(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。 |
| 3 | 金融商品の時価等に関する事項の補足説明
金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 |
| 4 | 金銭債権の計算日後の償還予定額
金銭債権は全て1年以内に償還予定であります。 |

金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」附則(令和3年9月24日改正内閣府令第61号)第2条第5項に従い、記載を省略しております。

(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7月15日現在)	
同計算期間の期首元本額	618,014,136円
同計算期間中の追加設定元本額	210,912円
同計算期間中の一部解約元本額	34,123,534円
同計算期間末日の元本額	584,101,514円
当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託の元本額は次の通りです。	
ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド（為替ヘッジなし）	563,150,848円
ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド（為替ヘッジあり）	20,950,666円
合計	584,101,514円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	(2022年7月15日現在)
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	30,079,668
合計	30,079,668

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

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ブラックロック・ストラテジック・ファンズ ブラックロック・システムティック・グローバル・ロング/ショート・エクイティ・ファンド クラスJ投資証券	27,036.410	2,994,552.770	
		グローバル・アルファ・オポチュニティーズ・エクイティ・ファンド・リミテッド クラスA投資証券	297,582.957	2,983,189.090	
	アメリカドル 小計	324,619.367	5,977,741.860 (830,547,454)		
投資証券 合計				830,547,454 (830,547,454)	
合計				830,547,454 (830,547,454)	

(注1)投資証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

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

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

3 外貨建有価証券の内訳

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考情報)

当ファンドは、「ブラックロック・ストラテジック・ファンズ ブラックロック・システムティック・グローバル・ロング/ショート・エクイティ・ファンド クラスJ投資証券」及び「グローバル・アルファ・オポチュニティーズ・エクイティ・ファンド・リミテッド クラスA投資証券」(以下、両者を併せて「同ファンド」という。)を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された投資証券は、すべて同ファンドの投資証券であります。同ファンドの状況は以下のとおりであります。

なお、以下に記載した情報は監査意見の対象外です。

同ファンドの状況

(1)「ブラックロック・ストラテジック・ファンズ ブラックロック・システムティック・グローバル・ロング/ショート・エクイティ・ファンド クラスJ投資証券」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11月30日に終了する中間計算期間(2021年6月1日から2021年11月30日まで)に係る中間財務書類であります。

当該中間財務書類は、当該ファンドを含む「ブラックロック・ストラテジック・ファンズ」の2021年11月30日現在の中間財務書類のうち、当該ファンドにかかる部分を、委託会社において抜粋し、その原文を翻訳したものです。なお、中間財務書類に含まれる「投資有価証券明細表」の銘柄については原文通り英語表記で行っております。なお、ルクセンブルグにおける独立監査人の監査を受けておりません。

(2)「グローバル・アルファ・オポチュニティーズ・エクイティ・ファンド・リミテッド クラスA投資証券」は、ケイマン諸島において設立されたオープンエンド型投資法人が発行するファンドであり、当該ファンドの現時点で日本語に翻訳された直近の情報は、2021年12月31日に終了する計算期間(2021年1月1日から2021年12月31日まで)に係る財務書類であります。当該財務書類は、その原文を翻訳したものです。

グローバル・アルファ・オポチュニティーズ・エクイティ・ファンド・リミテッド

要約投資有価証券明細表 2021年12月31日

期末現在の未決済デリバティブ金融商品

差金決済契約(以下「CFD」という。)

参照事業体	取引相手	期日	正味名目価額 (米ドル)	未実現評価益 (損) (米ドル)	参照事業体の 純額 (米ドル)	未実現評価益 (損)の対純資 産比率(%)
持分証券 - 買建/売建	Merrill Lynch International	2022年1月15日	8,675	(2,601) ^(a)	5,890	(0.1)
	Morgan Stanley & Co. International	2022年1月22日	25,360	(24,379) ^(b)	2,909	(0.8)
			34,035	(26,980)	8,799	

(a) 183米ドルの正味配当金および融資手数料を含む。

(b) (1,928)米ドルの正味配当金および融資手数料を含む。

期末現在、Merrill Lynch Internationalを取引相手とする2022年1月15日期日のCFD合計の基礎となる個々の買建および売建ポジションならびに関連する持分証券の価額は、下表のとおりである。

国	価額 (米ドル)	CFD価額の比率 (%)
参照事業体 - 買建		
普通株式		
オーストラリア		
素材	11,884	201.8
コミュニケーション	6,406	108.8
消費財、循環型	1,368	23.2
消費財、非循環型	3,552	60.3
エネルギー	3,386	57.5
金融	3,690	62.6
資本財	767	13.0
	31,053	
カナダ		
素材	1,418	24.1
消費財、循環型	2,001	33.9
消費財、非循環型	1,703	28.9
エネルギー	2,166	36.8
資本財	5,058	85.9
技術	140	2.4
電気・ガス・水道	1,193	20.2
	13,679	
チリ		
素材	5,022	85.3
中国		
金融	4,931	83.7
フランス		
コミュニケーション	879	14.9
消費財、循環型	2,541	43.2
技術	490	8.3
電気・ガス・水道	1,107	18.8
	5,017	

国	価額 (米ドル)	CFD価額の比率 (%)
ドイツ		
素材	6,718	114.0
消費財、循環型	6,383	108.4
消費財、非循環型	3,233	54.9
金融	375	6.4
資本財	9,023	153.2
技術	173	2.9
	25,905	
中国香港特別行政区		
消費財、循環型	640	10.9
消費財、非循環型	1,012	17.2
エネルギー	6,003	101.9
金融	16,158	274.3
	23,813	
イスラエル		
金融	1,629	27.7
資本財	1,413	24.0
	3,042	
イタリア		
消費財、非循環型	2,397	40.7
金融	178	3.0
	2,575	
日本		
素材	5,106	86.7
コミュニケーション	6,632	112.6
消費財、循環型	12,545	213.0
消費財、非循環型	43,911	745.5
エネルギー	5,856	99.4
金融	35,267	598.7
資本財	11,290	191.7
技術	6,672	113.3
	127,279	
ルクセンブルグ		
コミュニケーション	468	7.9
中国マカオ特別行政区		
消費財、循環型	485	8.2
オランダ		
エネルギー	3,888	66.0
金融	6,006	102.0
技術	1,607	27.3
	11,501	

国	価額 (米ドル)	CFD価額の比率 (%)
ニュージーランド 資本財	4,372	74.2
ノルウェー コミュニケーション	1,967	33.4
フィリピン 消費財、非循環型	1,472	25.0
シンガポール 金融	2,396	40.7
スペイン 金融	2,801	47.6
スウェーデン 資本財	3,586	60.9
スイス 金融	1,660	28.2
英国 コミュニケーション	1,591	27.0
消費財、循環型	2,578	43.8
エネルギー	1,609	27.3
資本財	1,601	27.2
	7,379	
米国 コミュニケーション	3,031	51.4
消費財、循環型	23,287	395.4
消費財、非循環型	21,927	372.3
エネルギー	8,672	147.2
金融	13,111	222.6
資本財	24,543	416.7
技術	38,958	661.4
	133,529	
参照事業体 - 買建合計	413,932	

国	価額 (米ドル)	CFD価額の比率 (%)
参照事業体 - 売建		
普通株式		
ベルギー		
コミュニケーション	(916)	(15.6)
消費財、循環型	(4,879)	(82.8)
	(5,795)	
カナダ		
素材	(19,351)	(328.6)
コミュニケーション	(3,576)	(60.7)
消費財、循環型	(6,828)	(115.9)
消費財、非循環型	(1,013)	(17.2)
エネルギー	(1,091)	(18.5)
金融	(9,706)	(164.8)
資本財	(338)	(5.7)
技術	(4,372)	(74.2)
	(46,275)	
中国		
金融	(18,024)	(306.0)
資本財	(13,420)	(227.9)
	(31,444)	
デンマーク		
消費財、非循環型	(1,686)	(28.6)
フィンランド		
技術	(760)	(12.9)
フランス		
エネルギー	(406)	(6.9)
資本財	(2,809)	(47.7)
	(3,215)	
ドイツ		
素材	(141)	(2.4)
コミュニケーション	(4,236)	(71.9)
消費財、循環型	(1,174)	(20.0)
消費財、非循環型	(8,536)	(144.9)
資本財	(4,358)	(74.0)
	(18,445)	
中国香港特別行政区		
金融	(39,634)	(672.9)
電気・ガス・水道	(3,114)	(52.9)
	(42,748)	
イスラエル		
消費財、非循環型	(11,687)	(198.4)
金融	(5,099)	(86.6)
資本財	(519)	(8.8)
	(17,305)	

国	価額 (米ドル)	CFD価額の比率 (%)
イタリア		
消費財、循環型	(2,591)	(44.0)
金融	(2,603)	(44.2)
電気・ガス・水道	(485)	(8.2)
	(5,679)	
日本		
消費財、循環型	(26,445)	(449.0)
消費財、非循環型	(3,743)	(63.5)
金融	(38,685)	(656.8)
資本財	(15,674)	(266.1)
技術	(11,945)	(202.8)
電気・ガス・水道	(6,330)	(107.5)
	(102,822)	
ルクセンブルグ		
素材	(2,240)	(38.0)
中国マカオ特別行政区		
消費財、循環型	(16,478)	(279.8)
オランダ		
消費財、循環型	(386)	(6.5)
ノルウェー		
金融	(1,871)	(31.8)
技術	(814)	(13.8)
	(2,685)	
スペイン		
エネルギー	(741)	(12.6)
金融	(316)	(5.4)
電気・ガス・水道	(1,444)	(24.5)
	(2,501)	
スウェーデン		
資本財	(4,494)	(76.3)
技術	(6,694)	(113.6)
	(11,188)	
スイス		
消費財、循環型	(3,469)	(58.9)
消費財、非循環型	(356)	(6.0)
資本財	(3,962)	(67.3)
	(7,787)	

国	価額 (米ドル)	CFD価額の比率 (%)
英国		
コミュニケーション	(4,111)	(69.8)
消費財、循環型	(441)	(7.5)
消費財、非循環型	(2,748)	(46.7)
金融	(3,782)	(64.2)
技術	(3,135)	(53.2)
電気・ガス・水道	(244)	(4.1)
	(14,461)	
米国		
素材	(13,563)	(230.3)
コミュニケーション	(768)	(13.0)
消費財、循環型	(12,775)	(216.9)
消費財、非循環型	(3,585)	(60.9)
金融	(9,944)	(168.8)
資本財	(18,453)	(313.3)
技術	(2,820)	(47.9)
電気・ガス・水道	(10,101)	(171.5)
	(72,009)	
ザンビア		
素材	(2,133)	(36.2)
参照事業体 - 売建合計	(408,042)	
参照事業体 - Merrill Lynch International純額	5,890	

期末現在、Morgan Stanley & Co. Internationalを取引相手とする2022年1月22日期日のCFD合計の基礎となる個々の買建および売建ポジションならびに関連する持分証券の価額は、下表のとおりである。

国	価額 (米ドル)	CFD価額の比率 (%)
参照事業体 - 買建		
普通株式		
オーストラリア		
素材	25,483	876.0
コミュニケーション	59,542	2,046.8
消費財、循環	15,202	522.6
消費財、非循環型	30,582	1,051.3
エネルギー	20,218	695.0
金融	22,167	762.0
資本財	2,226	76.5
	175,420	
オーストリア		
資本財	15,667	538.6
ベルギー		
金融	36,263	1,246.6
カナダ		
コミュニケーション	1,809	62.2
消費財、循環	4,368	150.1
消費財、非循環型	22,868	786.1
エネルギー	3,847	132.2
金融	178,957	6,151.8
資本財	124,002	4,262.7
技術	24,894	855.8
電気・ガス・水道	8,717	299.7
	369,462	
チリ		
素材	4,949	170.1
中国		
金融	287	9.9
デンマーク		
金融	3,852	132.4
資本財	20,380	700.6
	24,232	
フランス		
コミュニケーション	11,860	407.7
消費財、循環型	50,289	1,728.8
消費財、非循環型	44,645	1,534.7
金融	2,559	88.0
技術	17,385	597.6
	126,738	

国	価額 (米ドル)	CFD価額の比率 (%)
ドイツ		
素材	8,524	293.0
コミュニケーション	9,458	325.1
消費財、循環型	60,625	2,084.1
消費財、非循環型	14,426	495.9
金融	84,074	2,890.1
資本財	60,782	2,089.5
技術	3,639	125.1
	241,528	
中国香港特別行政区		
消費財、循環型	836	28.7
エネルギー	3,002	103.2
金融	6,281	215.9
資本財	7,011	241.0
技術	1,081	37.2
	18,211	
アイルランド		
消費財、非循環型	2,962	101.8
イスラエル		
消費財、循環型	259	8.9
金融	2,073	71.3
資本財	1,236	42.5
技術	1,688	58.0
	5,256	
イタリア		
消費財、非循環型	21,504	739.2
金融	15,693	539.5
電気・ガス・水道	785	27.0
	37,982	
日本		
素材	50,062	1,720.9
コミュニケーション	64,517	2,217.8
消費財、循環型	71,333	2,452.2
消費財、非循環型	140,017	4,813.2
金融	128,718	4,424.8
資本財	114,250	3,927.5
技術	43,463	1,494.1
	612,360	
ルクセンブルグ		
コミュニケーション	468	16.1

国	価額 (米ドル)	CFD価額の比率 (%)
オランダ		
コミュニケーション	29,080	999.6
消費財、非循環型	24,514	842.7
エネルギー	11,418	392.5
金融	46,352	1,593.4
技術	53,042	1,823.4
	164,406	
ニュージーランド		
資本財	17,037	585.7
電気・ガス・水道	787	27.0
	17,824	
ノルウェー		
コミュニケーション	6,827	234.7
消費財、非循環型	6,745	231.9
エネルギー	4,435	152.4
	18,007	
シンガポール		
コミュニケーション	2,684	92.3
金融	60,144	2,067.5
	62,828	
スペイン		
金融	49,548	1,703.3
スウェーデン		
コミュニケーション	11,524	396.2
消費財、循環型	524	18.00
金融	4,929	169.4
資本財	28,639	984.5
	45,616	
スイス		
金融	48,140	1,654.9
英国		
コミュニケーション	4,774	164.1
消費財、循環型	53,537	1,840.4
消費財、非循環型	38,500	1,323.5
金融	20,124	691.8
資本財	57,682	1,982.9
電気・ガス・水道	36,481	1,254.0
	211,098	

国	価額 (米ドル)	CFD価額の比率 (%)
米国		
素材	104,623	3,596.5
コミュニケーション	130,529	4,487.1
消費財、循環型	131,873	4,533.3
消費財、非循環型	502,227	17,264.6
多角化事業	5,689	195.6
エネルギー	127,566	4,385.2
金融	452,175	15,544.0
資本財	434,660	14,941.9
技術	480,623	16,521.9
電気・ガス・水道	78,244	2,689.7
	<u>2,448,209</u>	
参照事業体 - 買建合計	<u>4,737,461</u>	

国	価額 (米ドル)	CFD価額の比率 (%)
参照事業体 - 売建		
普通株式		
アルゼンチン		
コミュニケーション	(10,787)	(370.8)
技術	(10,365)	(356.3)
	(21,152)	
オーストラリア		
素材	(14,325)	(492.4)
消費財、非循環型	(10,400)	(357.5)
金融	(63,948)	(2,198.3)
資本財	(44,346)	(1,524.4)
技術	(3,152)	(108.4)
	(136,171)	
オーストリア		
素材	(2,001)	(68.8)
ベルギー		
コミュニケーション	(7,952)	(273.4)
消費財、循環型	(2,537)	(87.2)
	(10,489)	
バミューダ		
金融	(3,895)	(133.9)
カナダ		
素材	(151)	(5.2)
コミュニケーション	(49,017)	(1,685.0)
消費財、循環型	(28,077)	(965.2)
消費財、非循環型	(27,586)	(948.3)
エネルギー	(329)	(11.3)
金融	(57,537)	(1,977.9)
資本財	(35,340)	(1,214.8)
技術	(308)	(10.6)
	(198,345)	
中国		
コミュニケーション	(26,507)	(911.2)
金融	(1,639)	(56.4)
	(28,146)	
デンマーク		
消費財、非循環型	(25,894)	(890.2)
金融	(21,513)	(739.5)
	(47,407)	
フランス		
エネルギー	(38,169)	(1,312.1)
資本財	(10,821)	(372.0)
	(48,990)	

国	価額 (米ドル)	CFD価額の比率 (%)
ドイツ		
素材	(34,139)	(1,173.6)
コミュニケーション	(48,277)	(1,659.6)
消費財、循環型	(5,327)	(183.1)
消費財、非循環型	(36,136)	(1,242.2)
金融	(137,546)	(4,728.3)
資本財	(68,924)	(2,369.3)
技術	(2,805)	(96.4)
電気・ガス・水道	(6,918)	(237.8)
	(340,072)	
中国香港特別行政区		
金融	(14,417)	(495.6)
資本財	(1,222)	(42.0)
	(15,639)	
アイルランド		
消費財、循環型	(3,017)	(103.7)
消費財、非循環型	(19,201)	(660.1)
技術	(6,101)	(209.7)
	(28,319)	
イスラエル		
素材	(29,852)	(1,026.2)
金融	(6,101)	(209.7)
	(35,953)	
イタリア		
消費財、循環型	(2,007)	(69.0)
金融	(4,698)	(161.5)
電気・ガス・水道	(46,536)	(1,599.7)
	(53,241)	
日本		
素材	(19,124)	(657.4)
消費財、循環型	(116,360)	(4,000.0)
消費財、非循環型	(55,606)	(1,911.5)
金融	(199,786)	(6,867.9)
資本財	(164,424)	(5,652.3)
技術	(59,943)	(20,606.0)
電気・ガス・水道	(2,814)	(96.7)
	(618,057)	
ルクセンブルグ		
素材	(23,173)	(796.6)
消費財、循環型	(979)	(33.6)
資本財	(3,724)	(128.0)
技術	(229)	(7.9)
	(28,105)	

国	価額 (米ドル)	CFD価額の比率 (%)
ニュージーランド		
資本財	(12,014)	(413.0)
ノルウェー		
金融	(1,310)	(45.0)
技術	(433)	(14.9)
	(1,743)	
シンガポール		
消費財、非循環型	(14,094)	(484.5)
金融	(50,874)	(1,748.8)
	(64,968)	
スペイン		
エネルギー	(1,482)	(51.0)
金融	(17,038)	(585.7)
資本財	(7,866)	(270.4)
	(26,386)	
スウェーデン		
消費財、循環型	(2,678)	(92.1)
消費財、非循環型	(4,356)	(149.7)
金融	(2,505)	(86.1)
資本財	(24,435)	(840.0)
技術	(12,698)	(436.5)
	(46,672)	
スイス		
消費財、循環型	(595)	(20.5)
消費財、非循環型	(14,578)	(501.1)
金融	(15,624)	(537.1)
資本財	(11,887)	(408.6)
技術	(2,170)	(74.6)
	(44,854)	
英国		
コミュニケーション	(35,496)	(1,220.2)
消費財、循環型	(26,068)	(896.1)
消費財、非循環型	(23,908)	(821.9)
エネルギー	(3,467)	(119.2)
金融	(89,665)	(3,082.3)
資本財	(10,032)	(344.9)
技術	(11,687)	(401.7)
電気・ガス・水道	(58,685)	(2,017.4)
	(259,008)	

国	価額 (米ドル)	CFD価額の比率 (%)
米国		
素材	(114,111)	(3,922.7)
コミュニケーション	(209,201)	(7,191.5)
消費財、循環型	(294,314)	(10,117.4)
消費財、非循環型	(517,981)	(17,806.1)
エネルギー	(61,116)	(2,100.9)
金融	(556,402)	(19,126.9)
資本財	(417,196)	(14,341.6)
技術	(446,584)	(15,351.8)
電気・ガス・水道	(46,020)	(1,582.0)
	<u>(2,662,925)</u>	
参照事業体 - 売建合計	<u>(4,734,552)</u>	
参照事業体 - Morgan Stanley & Co. International純額	<u>2,909</u>	

リスク・エクスポージャー別のデリバティブ金融商品

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

	商品契約 (米ドル)	信用契約 (米ドル)	株式契約 (米ドル)	為替契約 (米ドル)	金利契約 (米ドル)	合計 (米ドル)
負債 - デリバティブ金融商品						
差金決済契約						
差金決済契約に係る未実現評価損	-	-	26,980	-	-	26,980

2021年12月31日に終了した会計年度における損益計算書上のデリバティブ金融商品による影響は、下表のとおりである。

	商品契約 (米ドル)	信用契約 (米ドル)	株式契約 (米ドル)	為替契約 (米ドル)	金利契約 (米ドル)	合計 (米ドル)
以下に係る実現純利益（損失）						
差金決済契約	-	-	141,282	-	-	141,282
以下に係る未実現評価益（損）の純変動額						
差金決済契約	-	-	(11,692)	-	-	(11,692)

未決済デリバティブ金融商品の平均残高^(a)

	(米ドル)
差金決済契約	
契約の平均名目価額 - 買建	5,731,429
契約の平均名目価額 - 売建	5,714,057

^(a) 未決済の平均名目価額は、2021年12月31日に終了した会計年度における平均取引高を表す。

期末現在のデリバティブ金融商品 - 相殺

ファンドのデリバティブ資産および負債（種類別）は下表のとおりである。

	資産 (米ドル)	負債 (米ドル)
デリバティブ金融商品		
差金決済契約	-	26,980
資産負債計算書上のデリバティブ資産および負債の合計	-	26,980
マスター・ネットリング契約または同様の契約（以下「MNA」という。）の 対象となるデリバティブ金融商品合計	-	26,980

下表は、MNAに基づき相殺可能な金額およびファンドの関連する受取および/または差入担保を控除後の、2021年12月31日現在のファンドのデリバティブ資産および負債を示している。

取引相手	MNAの対象となる 取引相手別のデリ バティブ負債 (米ドル)	相殺可能な デリバティブ (米ドル)	非現金担保 ^(a) (米ドル)	現金担保 ^(a) (米ドル)	デリバティブ負 債（純額） ^(b) (米ドル)
Merrill Lynch International	2,601	-	-	-	2,601
Morgan Stanley & Co. International	24,379	-	-	(24,379)	-
	26,980	-	-	(24,379)	2,601

^(a) 財務報告の目的上、受取または差入担保の超過額は表示されていない。

^(b) 債務不履行時に取引相手に支払われる純額を表す。

期末の公正価値ヒエラルキー

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

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

	レベル1 (米ドル)	レベル2 (米ドル)	レベル3 (米ドル)	合計 (米ドル)
デリバティブ金融商品 ^(a)				
負債				
株式契約	-	(26,980)	-	(26,980)

^(a) デリバティブ金融商品は差金決済契約である。差金決済契約は、デリバティブ金融商品に係る未実現評価益(損)で評価されている。

グローバル・アルファ・オポチュニティーズ・エクイティ・ファンド・リミテッド
資産負債計算書 2021年12月31日

	米ドル
資産	
現金	1,977,610
ブローカーに対する債権	5,074
差入担保金：	
担保 - OTCデリバティブ	1,070,000
外国通貨、公正価値（取得原価287,580米ドル）	291,149
前払費用	8,381
資産合計	3,352,214
負債	
未払金：	
未払投資運用報酬	9,021
未払管理事務代行報酬	18,851
専門家報酬	3,227
未払監査報酬	46,530
その他の未払費用	515
以下に係る未実現評価損：	
差金決済契約	26,980
負債合計	105,124
純資産	3,247,090

財務書類に対する注記を参照のこと。

グローバル・アルファ・オポチュニティーズ・エクイティ・ファンド・リミテッド

損益計算書 2021年12月31日に終了した会計年度

	米ドル
費用	
投資運用報酬	59,746
管理事務代行報酬	56,746
監査報酬	46,530
取締役報酬	16,000
登録関連費用	10,489
専門家報酬	3,118
その他の費用	8,608
支払利息を除く費用合計	201,237
支払利息	1,482
費用合計	202,719
投資純利益（損失）	(202,719)
実現および未実現利益（損失）	
以下に係る実現純利益（損失）：	
差金決済契約	141,282
外国通貨取引	(2,654)
実現純利益（損失）	138,628
以下に係る未実現評価益（損）の純変動額：	
差金決済契約	(11,692)
外貨換算	(9,147)
未実現評価益（損）の純変動	(20,839)
実現および未実現純利益（損失）	117,789
運用による純資産の純増加（減少）額	(84,930)

財務書類に対する注記を参照のこと。

グローバル・アルファ・オポチュニティーズ・エクイティ・ファンド・リミテッド
純資産変動計算書 2021年12月31日に終了した会計年度

	米ドル
純資産の増加(減少)	
運用	
投資純利益(損失)	(202,719)
実現純利益(損失)	138,628
未実現評価益(損)の純変動	(20,839)
運用による純資産の純増加(減少)額	(84,930)
資本取引	
投資証券買戻し	(757,642)
資本取引による純資産の純増加(減少)額	(757,642)
純資産	
純資産の純増加(減少)額	(842,572)
期首純資産	4,089,662
期末純資産	3,247,090

財務書類に対する注記を参照のこと。

グローバル・アルファ・オポチュニティーズ・エクイティ・ファンド・リミテッド
 キャッシュ・フロー計算書 2021年12月31日に終了した会計年度

	米ドル
営業活動により生じた（に使用した）キャッシュ・フロー	
運用による純資産の純増加（減少）額	(84,930)
運用による純資産の純増加（減少）額から営業活動により生じた（に使用した）現金純額への調整：	
実現純（利益）損失	(138,628)
未実現評価（益）損の純変動	20,839
デリバティブに関して取引相手から受領した（に支払った）純支払額	141,282
営業資産の（増加）減少：	
ブローカーに対する債権	2,649
前払費用	(152)
営業負債の増加（減少）：	
ブローカーに対する債務	(1,496)
未払金：	
未払投資運用報酬	(2,502)
未払管理事務代行報酬	(5,133)
未払専門家報酬	3,227
未払監査報酬	(470)
その他の未払費用	438
営業活動により生じた（に使用した）現金純額	(64,876)
財務活動により生じた（に使用した）キャッシュ・フロー	
投資証券買戻し	(757,642)
財務活動により生じた（に使用した）現金純額	(757,642)
拘束性および非拘束性の現金および外国通貨の純増加（減少）額	(822,518)
現金に対する為替レートの影響額	(11,801)
拘束性および非拘束性の現金および外国通貨	
期首	4,173,078
期末	3,338,759
キャッシュ・フロー情報の補足的開示	
利息支払額	1,482

財務書類に対する注記を参照のこと。

グローバル・アルファ・オポチュニティーズ・エクイティ・ファンド・リミテッド
キャッシュ・フロー計算書 2021年12月31日に終了した会計年度(続き)
期末現在の拘束性および非拘束性の現金および外国通貨から資産負債計算書への調整

	米ドル
現金	1,977,610
外国通貨、公正価値	291,149
差入担保金:	
担保 - OTCデリバティブ	1,070,000
期末	3,338,759

財務書類に対する注記を参照のこと。

グローバル・アルファ・オポチュニティーズ・エクイティ・ファンド・リミテッド

財務ハイライト 2021年12月31日に終了した会計年度

	クラス A
	米ドル
期首純資産価額	10.47
投資純利益(損失) ^(a)	(0.58)
実現および未実現純利益(損失)	0.36
運用による純資産の純増加(減少)額	(0.22)
期末純資産価額	10.25
トータル・リターン ^(b)	
トータル・リターン	(2.09) %
平均純資産に占める割合	
投資純利益(損失)	(5.61) %
投資費用 ^(c)	0.04 %
営業費用	5.57 %
費用合計	5.61 %

(a) 当期における発行済の平均投資証券口数に基づく。

(b) 該当がある場合、投資運用報酬による影響を含む。

(c) 支払利息を含む。

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

財務書類に対する注記を参照のこと。

純資産計算書 2021年11月30日現在（未監査）

	注記	ブラックロック・システムティック・ グローバル・ロング/ショート・ エクイティ・ファンド 米ドル
資産		
投資有価証券 - 取得原価		52,905,741
未実現評価益		16,445
投資有価証券 - 時価	2 (a)	52,922,186
銀行預金	2 (a)	8,242,488
ブローカーに対する債権	14	1,195,024
未収利息および未収配当金	2 (a)、2 (d)	23,213
売却投資有価証券未収金	2 (a)、2 (d)	14,207,389
販売投資証券未収金	2 (a)	45,663
以下に係る未実現評価益：		
先物取引	2 (d)	421,335
未決済先渡為替予約	2 (d)	322,624
差金決済契約	2 (d)	5,416,270
買建オプション/スワップシヨンの時価	2 (d)	142,672
その他の資産	2 (a)	154,095
資産合計		83,092,959
負債		
ブローカーに対する債務	14	280,000
未払利息および未払配当金	2 (a)、2 (d)	79,804
購入投資有価証券未払金	2 (a)、2 (d)	18,829,610
買戻し投資証券未払金	2 (a)	125,845
以下に係る未実現評価損：		
先物取引	2 (d)	307,465
未決済先渡為替予約	2 (d)	1,110,791
差金決済契約	2 (d)	5,601,162
売建オプション/スワップシヨンの時価	2 (d)	79,514
未払費用およびその他の負債	2 (a)、4、5、6、7、8	1,255,677
負債合計		27,669,868
純資産合計		55,423,091

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11月30日現在(未監査)

ブラックロック・システムティック・グローバル・
ロング/ショート・エクイティ・ファンド

	通貨	2021年	2021年	2020年	2019年
		11月30日現在	5月31日現在	5月31日現在	5月31日現在
純資産合計	米ドル	55,423,091	47,865,656	72,200,396	103,685,956
以下の1口当たり純資産価額:					
クラスA無分配投資証券	米ドル	108.07	112.00	108.48	112.23
クラスAユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	ユーロ	93.07	96.86	94.73	100.48
クラスAスウェーデン・コロナ ・ヘッジ無分配投資証券	スウェーデン・ コロナ	940.00	977.04	952.17	1,008.03
クラスA Iユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	ユーロ	93.95	97.77	95.56	-
クラスC無分配投資証券	米ドル	96.70	100.72	98.53	102.95
クラスD無分配投資証券	米ドル	108.05	111.63	107.46	110.52
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	100.92	104.72	101.81	107.35
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	104.52	108.11	104.55	109.26
クラスEユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	ユーロ	92.92	96.96	95.30	101.60
クラスIユーロ・ヘッジ 無分配投資証券	ユーロ	95.80	99.27	96.22	-
クラスJ分配型投資証券	米ドル	112.99	116.76	112.41	115.62
クラスX無分配投資証券	米ドル	126.29	129.52	122.84	124.47

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11月30日に終了した会計期間（未監査）

	注記	ブラックロック・システマティック・ グローバル・ロング/ショート・ エクイティ・ファンド
		米ドル
期首純資産		47,865,656
収益		
預金利息	2 (c)	360
債券利息	2 (c)	7,887
差金決済契約に係る受取利息	2 (c)、2 (d)	123
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)	676,573
収益合計		684,943
費用		
差金決済契約に係る支払利息	2 (c)、2 (d)	257,543
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)	747,552
年間サービス費用	5	74,128
預託報酬	2 (i)、6	462,380
税金	8	12,256
販売報酬	4	27,119
ローン・コミットメント・フィー	14	202
投資運用報酬および投資運用再委託報酬	4	382,058
払戻考慮前費用合計		1,963,238
費用の払戻し	4	428,018
払戻考慮後費用合計		1,535,220
投資純損失		(850,277)
以下に係る実現純利益 / (損失) :		
投資有価証券	2 (a)、2 (b)	147,874
差金決済契約	2 (d)	(1,501,450)
先物取引	2 (d)	766,679
外国通貨および先渡為替予約	2 (d)、2 (e)、2 (j)	(1,917,890)
オプション/スワップション契約	2 (d)	(130,520)
当期実現純損失		(2,635,307)
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)	(33,504)
差金決済契約	2 (d)	(66,331)
先物取引	2 (d)	(72,990)
外国通貨および先渡為替予約	2 (d)、2 (e)、2 (j)	(1,169,543)
オプション/スワップション契約	2 (d)	3,620
当期末実現評価益 / (損) の純変動		(1,338,748)
運用成績による純資産の減少		(4,824,332)
資本の変動		
投資証券発行による正味受取額		19,798,220
投資証券買戻しによる正味支払額		(7,416,453)
資本の変動による純資産の増加		12,381,767
期末純資産		55,423,091

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11月30日に終了した会計期間（未監査）

ブラックロック・システマティック・グローバル・
ロング/ショート・エクイティ・ファンド

	期首発行済 投資証券口数	当期発行 投資証券口数	当期買戻し 投資証券口数	期末発行済 投資証券口数
クラスA無分配投資証券	38,547	2	1,879	36,670
クラスAユーロ・ヘッジ無分配投資証券	42,815	-	2,000	40,815
クラスAスウェーデン・クローナ・ヘッジ無分配投資証券	589	225	88	726
クラスA Iユーロ・ヘッジ無分配投資証券	45	-	-	45
クラスC無分配投資証券	1,038	-	509	529
クラスD無分配投資証券	7,322	37,377	7,302	37,397
クラスDユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	148,443	122,512	27,288	243,667
クラスD英債券・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	3,659	543	829	3,373
クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券	102,173	5,966	17,656	90,483
クラスIユーロ・ヘッジ無分配投資証券	8,894	585	803	8,676
クラスJ分配型投資証券	32,496	-	3,816	28,680
クラスX無分配投資証券	7,690	55	1,729	6,016

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・システマティック・グローバル・ロング/ショート・エクイティ・ファンド

投資有価証券明細表 2021年11月30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			
普通株式およびワラント			
ケイマン諸島			
1,888	GLOBALFOUNDRIES Inc	127,308	0.23
18,000	Hedosophia European Growth	205,837	0.37
6,000	Hedosophia European Growth (Wts 13/5/2027)	5,291	0.01
		338,436	0.61
オランダ			
4,017	Climate Transition Capital Acquisition I BV	43,994	0.08
1,339	Climate Transition Capital Acquisition I BV (Wts 29/6/2026)	305	0.00
3,340	European FinTech IPO Co 1 BV (Wts 26/3/2026)	1,938	0.01
10,022	European FinTech IPO Co 1 BV (Unit)	111,247	0.20
9,928	Pegasus Acquisition Co Europe BV (Unit)	111,836	0.20
		269,320	0.49
英国			
13,927	Alphawave IP Group Plc	38,041	0.07
8,743	Revolution Beauty Group Ltd	13,958	0.02
		51,999	0.09
米国			
462	Allbirds Inc	8,926	0.02
9	Braze Inc 'A'	692	0.00
471	Expensify Inc 'A'	23,720	0.04
2,395	Fluence Energy Inc	81,861	0.15
145	Gitlab Inc 'A'	14,403	0.02
1,720	Informatica Inc 'A'	60,217	0.11
177	Rivian Automotive Inc 'A'	21,270	0.04
238	Sweetgreen Inc 'A'	10,267	0.02
1,638	Udemy Inc	44,636	0.08
		265,992	0.48
普通株式およびワラント合計			
		925,747	1.67

債券

米国			
USD 1,000,000	United States Cash Management Bill 8/2/2022 (Zero Coupon)	999,922	1.80
USD 4,000,000	United States Cash Management Bill 15/2/2022 (Zero Coupon)	3,999,680	7.22
USD 3,000,000	United States Cash Management Bill 22/2/2022 (Zero Coupon)	2,999,723	5.41
USD 2,000,000	United States Cash Management Bill 1/3/2022 (Zero Coupon)	1,999,763	3.61
USD 4,000,000	United States Cash Management Bill 8/3/2022 (Zero Coupon)	3,999,464	7.22
USD 5,000,000	United States Treasury Bill 2/12/2021 (Zero Coupon)	4,999,997	9.02
USD 3,000,000	United States Treasury Bill 14/12/2021 (Zero Coupon)	2,999,944	5.41
USD 4,000,000	United States Treasury Bill 16/12/2021 (Zero Coupon)	3,999,933	7.22

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
	米国(続き)		
USD 100	United States Treasury Bill 21/12/2021 (Zero Coupon)	100	0.00
USD 3,000,000	United States Treasury Bill 30/12/2021 (Zero Coupon)	2,999,915	5.41
USD 4,000,000	United States Treasury Bill 4/1/2022 (Zero Coupon)	3,999,906	7.22
USD 1,000,000	United States Treasury Bill 25/1/2022 (Zero Coupon)	999,931	1.80
USD 4,000,000	United States Treasury Bill 3/2/2022 (Zero Coupon)	3,999,696	7.22
USD 4,000,000	United States Treasury Bill 10/2/2022 (Zero Coupon)	3,999,641	7.22
USD 3,000,000	United States Treasury Bill 17/2/2022 (Zero Coupon)	2,999,707	5.41
USD 4,000,000	United States Treasury Bill 24/2/2022 (Zero Coupon)	3,999,542	7.22
USD 3,000,000	United States Treasury Bill - WI Post Auction 3/3/2022 (Zero Coupon)	2,999,575	5.41
		51,996,439	93.82
債券合計		51,996,439	93.82
公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている 譲渡可能な有価証券および短期金融商品合計		52,922,186	95.49
投資有価証券(時価)合計		52,922,186	95.49
その他の純資産		2,500,905	4.51
純資産合計(米ドル)		55,423,091	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		
2,690	a2 Milk Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(705)
8,881	a2 Milk Co Ltd	Goldman Sachs	(2,171)
11,568	a2 Milk Co Ltd	Morgan Stanley	(3,134)
(303)	Afterpay Ltd	Goldman Sachs	1,421
(1,146)	Altium Ltd	Goldman Sachs	(2,068)
86,967	Alumina Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(5,215)
86,518	Alumina Ltd	Goldman Sachs	(5,206)
193,634	Alumina Ltd	Morgan Stanley	(9,014)
(793)	Ampol Ltd	Goldman Sachs	899
(1,197)	Appen Ltd	Goldman Sachs	1,455
6,868	Aristocrat Leisure Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(16,640)
5,629	Aristocrat Leisure Ltd	Goldman Sachs	(13,002)
6,401	Aristocrat Leisure Ltd	Morgan Stanley	(5,295)
(173)	ASX Ltd	Goldman Sachs	393
163	AUB Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(106)
1,875	AUB Group Ltd	Goldman Sachs	(1,222)
381	Australian Ethical Investment Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4
479	Australian Ethical Investment Ltd	Goldman Sachs	58
(32,214)	Australian Pharmaceutical Industries Ltd	Goldman Sachs	230
(131)	Bapcor Ltd	Goldman Sachs	32
(5,403)	Bega Cheese Ltd	Goldman Sachs	77
941	Bendigo & Adelaide Bank Ltd	Morgan Stanley	(80)
(10)	Blackmores Ltd	Goldman Sachs	24
(930)	BlueScope Steel Ltd	Goldman Sachs	853
(20,481)	Bravura Solutions Ltd	Goldman Sachs	1,516
(44)	Breville Group Ltd	Goldman Sachs	13
(3,623)	BWX Ltd	Goldman Sachs	208
909	Cedar Woods Properties Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(78)
605	Cedar Woods Properties Ltd	Goldman Sachs	(52)
4,328	Centuria Office REIT (REIT)	Goldman Sachs	(155)
(20,632)	Chalice Mining Ltd	Goldman Sachs	(148)
3,714	Charter Hall Long Wale REIT (REIT)	Goldman Sachs	266
(8,636)	CIMIC Group Ltd	Goldman Sachs	4,453
(143,709)	Cleanaway Waste Management Ltd	Goldman Sachs	10,203
(657)	Cochlear Ltd	Goldman Sachs	2,706
258	Codan Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(118)
164	Collins Foods Ltd	Goldman Sachs	132
(1,118)	Commonwealth Bank of Australia	Goldman Sachs	3,837
(2,360)	Computershare Ltd	Goldman Sachs	819
(71,882)	Cooper Energy Ltd	Goldman Sachs	1,802
9,943	Coronado Global Resources Inc - CDI	Bank of America Merrill Lynch	(961)
16,614	Coronado Global Resources Inc - CDI	Goldman Sachs	(1,606)
(24,505)	Costa Group Holdings Ltd	Goldman Sachs	3,335

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)		
(131)	Credit Corp Group Ltd	Goldman Sachs	(132)
(13,414)	Cromwell Property Group	Goldman Sachs	-
(14,479)	Crown Resorts Ltd	Goldman Sachs	(12,049)
13,499	CSR Ltd	Morgan Stanley	(2,030)
(26,427)	De Grey Mining Ltd	Goldman Sachs	757
669	Dicker Data Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(220)
743	Dicker Data Ltd	Goldman Sachs	(245)
1,772	Domain Holdings Australia Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(355)
2,373	Domain Holdings Australia Ltd	Morgan Stanley	(544)
(20,615)	Electro Optic Systems Holdings Ltd	Goldman Sachs	5,168
(27,579)	EML Payments Ltd	Goldman Sachs	(14,456)
(13,449)	Endeavour Group Ltd	Goldman Sachs	2,496
2,872	Flight Centre Travel Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3,015)
6,503	Flight Centre Travel Group Ltd	Goldman Sachs	(10,568)
8,429	Flight Centre Travel Group Ltd	Morgan Stanley	(3,562)
964	Fortescue Metals Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	811
2,550	Fortescue Metals Group Ltd	Goldman Sachs	1,134
1,865	Fortescue Metals Group Ltd	Morgan Stanley	959
(1)	G8 Education Ltd	Bank of America Merrill Lynch	-
(12,159)	G8 Education Ltd	Goldman Sachs	348
(51,655)	Gold Road Resources Ltd	Goldman Sachs	6,289
(19,923)	Goodman Group (REIT)	Goldman Sachs	(11,986)
(19,706)	GPT Group (REIT)	Goldman Sachs	(2,543)
1,360	GUD Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(321)
723	GUD Holdings Ltd	Goldman Sachs	(171)
12,635	GWA Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,991)
7,702	GWA Group Ltd	Goldman Sachs	(1,214)
(1,083)	Hansen Technologies Ltd	Goldman Sachs	405
14,659	Harvey Norman Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(630)
17,516	Harvey Norman Holdings Ltd	Goldman Sachs	(753)
22,006	Harvey Norman Holdings Ltd	Morgan Stanley	(1,418)
(791)	Healius Ltd	Goldman Sachs	(13)
391	HUB24 Ltd	Bank of America Merrill Lynch	165
192	HUB24 Ltd	Goldman Sachs	(105)
1,602	Iluka Resources Ltd	Goldman Sachs	(597)
732	Iluka Resources Ltd	Morgan Stanley	43
3,988	Inghams Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(71)
4,967	Inghams Group Ltd	Goldman Sachs	(96)
(5,261)	Insurance Australia Group Ltd	Goldman Sachs	(38)
(4,542)	InvoCare Ltd	Goldman Sachs	1,596
13,555	IOOF Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,218)
15,835	IOOF Holdings Ltd	Goldman Sachs	(1,372)
16,563	IOOF Holdings Ltd	Morgan Stanley	(1,634)
(1,299)	IPH Ltd	Goldman Sachs	(65)
(688)	IRESS Ltd	Goldman Sachs	(97)

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)		
446	James Hardie Industries Plc - CDI	Goldman Sachs	(252)
225	JB Hi-Fi Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(332)
1,330	JB Hi-Fi Ltd	Goldman Sachs	(1,962)
750	JB Hi-Fi Ltd	Morgan Stanley	(688)
10,085	Johns Lyng Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,975
17,257	Johns Lyng Group Ltd	Goldman Sachs	5,225
1,364	Jumbo Interactive Ltd	Goldman Sachs	1,495
(6,626)	Jupiter Mines Ltd	Goldman Sachs	105
264	Kelsian Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(183)
1,787	Kogan.com Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,367)
877	Kogan.com Ltd	Goldman Sachs	(806)
(9,680)	Lendlease Corp Ltd (Unit)	Goldman Sachs	(3,137)
272	Lifestyle Communities Ltd	Bank of America Merrill Lynch	65
218	Lifestyle Communities Ltd	Goldman Sachs	(24)
(30,648)	Lynas Rare Earths Ltd	Goldman Sachs	(18,877)
(838)	Lynas Rare Earths Ltd	Morgan Stanley	(186)
(748)	McMillan Shakespeare Ltd	Goldman Sachs	532
13,414	Medibank Pvt Ltd	Morgan Stanley	(288)
(213)	Megaport Ltd	Goldman Sachs	(62)
16,523	Metcash Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(967)
15,465	Metcash Ltd	Goldman Sachs	(1,002)
38,518	Metcash Ltd	Morgan Stanley	(1,680)
386	Monadelphous Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	44
2,777	Mount Gibson Iron Ltd	Goldman Sachs	(50)
(12,241)	National Australia Bank Ltd	Goldman Sachs	14,196
(18,180)	Nearmap Ltd	Goldman Sachs	2,693
378	Netwealth Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(32)
770	Netwealth Group Ltd	Goldman Sachs	(66)
(1,169)	nib holdings Ltd	Goldman Sachs	151
(11,241)	Northern Star Resources Ltd	Goldman Sachs	9,661
885	Nufarm Ltd	Goldman Sachs	(285)
21,800	Nufarm Ltd	Morgan Stanley	(3,903)
(2,246)	Nuix Ltd	Goldman Sachs	933
615	Objective Corp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(348)
849	Objective Corp Ltd	Goldman Sachs	(477)
(2,697)	Oil Search Ltd	Goldman Sachs	753
(8,381)	Omni Bridgeway Ltd	Goldman Sachs	(2,161)
2,521	Orocobre Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,217
573	Orocobre Ltd	Goldman Sachs	267
1,593	Orocobre Ltd	Morgan Stanley	776
(1,748)	Paladin Energy Ltd	Goldman Sachs	10
161	Pendal Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(33)
(15,972)	Perenti Global Ltd	Goldman Sachs	1,132
3,031	Perpetual Ltd	Morgan Stanley	(4,776)
(20,266)	Perseus Mining Ltd	Goldman Sachs	2,685

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益 / (損) (米ドル)
	オーストラリア(続き)		
8,080	Pilbara Minerals Ltd	Bank of America Merrill Lynch	868
3,989	Pilbara Minerals Ltd	Goldman Sachs	75
5,029	Pinnacle Investment Management Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(5,153)
6,082	Pinnacle Investment Management Group Ltd	Goldman Sachs	(6,120)
7,157	Platinum Asset Management Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,025)
33,979	Platinum Asset Management Ltd	Goldman Sachs	(4,844)
23,245	Platinum Asset Management Ltd	Morgan Stanley	(1,498)
(249)	PointsBet Holdings Ltd	Goldman Sachs	60
3,755	PolyNovo Ltd	Bank of America Merrill Lynch	79
(812)	Premier Investments Ltd	Goldman Sachs	713
(1,706)	Qube Holdings Ltd	Goldman Sachs	73
(5,884)	Ramsay Health Care Ltd	Goldman Sachs	7,417
(6,058)	Redbubble Ltd	Goldman Sachs	911
1,178	Reliance Worldwide Corp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(278)
3,555	Reliance Worldwide Corp Ltd	Goldman Sachs	(840)
537	Reliance Worldwide Corp Ltd	Morgan Stanley	(108)
(107,491)	Resolute Mining Ltd	Goldman Sachs	7,314
(2,456)	Rio Tinto Ltd	Goldman Sachs	(2,920)
(1,228)	Rural Funds Group (REIT)	Goldman Sachs	15
(35,374)	Scentre Group (REIT)	Goldman Sachs	(1,267)
(2,529)	SEEK Ltd	Goldman Sachs	1,448
137	Select Harvests Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(36)
559	Select Harvests Ltd	Goldman Sachs	(53)
(14,471)	Sigma Healthcare Ltd	Goldman Sachs	(104)
9,071	Sims Ltd	Morgan Stanley	(5,977)
(626)	SmartGroup Corp Ltd	Goldman Sachs	79
678	Sonic Healthcare Ltd	Goldman Sachs	726
4,733	South32 Ltd	Bank of America Merrill Lynch	102
9,070	South32 Ltd	Goldman Sachs	253
22,836	South32 Ltd	Morgan Stanley	(829)
3,726	St Barbara Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(592)
5,673	St Barbara Ltd	Goldman Sachs	(1,036)
(3,946)	Suncorp Group Ltd	Goldman Sachs	740
(1,264)	Super Retail Group Ltd	Goldman Sachs	280
(63,466)	Tabcorp Holdings Ltd	Goldman Sachs	8,743
(154)	Telix Pharmaceuticals Ltd	Goldman Sachs	6
(66,093)	Telstra Corp Ltd	Goldman Sachs	(2,893)
1,100	Temple & Webster Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(116)
381	Temple & Webster Group Ltd	Goldman Sachs	(37)
(27,434)	TopBetta Holdings Ltd	Goldman Sachs	2,642
(20,860)	TPG Telecom Ltd	Morgan Stanley	(3,076)
7,093	United Malt Grp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(628)
2,925	United Malt Grp Ltd	Goldman Sachs	(97)
1,631	Uniti Group Ltd	Goldman Sachs	463
(69,436)	Vicinity Centres (REIT)	Goldman Sachs	1,893

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)			
(106,814)	Vicinity Centres (REIT)	Morgan Stanley	5,479
6,948	Virgin Money UK Plc - CDI	Goldman Sachs	299
5,153	Virgin Money UK Plc - CDI	Morgan Stanley	(627)
599	Waypoint REIT (REIT)	Goldman Sachs	(48)
(1,973)	Webjet Ltd	Goldman Sachs	1,046
(37,263)	Western Areas Ltd	Goldman Sachs	8,006
(12,467)	Westgold Resources Ltd	Goldman Sachs	1,071
150	Woodside Petroleum Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(115)
4,789	Woodside Petroleum Ltd	Goldman Sachs	(3,670)
399	Woodside Petroleum Ltd	Morgan Stanley	(77)
(13,499)	Woolworths Group Ltd	Goldman Sachs	(9,357)
(6,352)	Zip Co Ltd	Goldman Sachs	3,442
(5,704)	Zip Co Ltd	Morgan Stanley	1,345
			(82,440)
オーストリア			
(94)	ANDRITZ AG	Bank of America Merrill Lynch	200
41	AT&S Austria Technologie & Systemtechnik AG	Bank of America Merrill Lynch	(33)
(2,532)	CA Immobilien Anlagen AG	Bank of America Merrill Lynch	7,341
(160)	DO & CO AG	Goldman Sachs	2,640
2,130	Erste Group Bank AG	Goldman Sachs	(5,986)
3,692	Erste Group Bank AG	Morgan Stanley	(1,932)
(2,649)	FACC AG	Goldman Sachs	2,622
(754)	IMMOFINANZ AG	Bank of America Merrill Lynch	736
(2,063)	IMMOFINANZ AG	Goldman Sachs	2,138
(1,687)	OMV AG	Morgan Stanley	6,430
189	Porr AG	Goldman Sachs	(18)
26	Schoeller-Bleckmann Oilfield Equipment AG	Bank of America Merrill Lynch	(178)
(695)	Semperit AG Holding	Bank of America Merrill Lynch	1,021
(682)	Semperit AG Holding	Goldman Sachs	1,048
(2,006)	voestalpine AG	Bank of America Merrill Lynch	3,761
(198)	voestalpine AG	Morgan Stanley	(10)
			19,780
ベルギー			
95	Ackermans & van Haaren NV	Morgan Stanley	(61)
(778)	Ageas SA	Bank of America Merrill Lynch	669
(122)	Argenx SE	Bank of America Merrill Lynch	1,264
(35)	Argenx SE	Goldman Sachs	741
3,219	Azelis Group NV	Goldman Sachs	(10,091)
1,832	Barco NV	Bank of America Merrill Lynch	(3,648)
4,300	Barco NV	Goldman Sachs	(8,562)
175	Bekaert SA	Bank of America Merrill Lynch	(478)
208	Bekaert SA	Goldman Sachs	(544)
(2)	Biocartis Group NV	Goldman Sachs	1
(6)	Cie d' Entreprises CFE	Bank of America Merrill Lynch	50

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
ベルギー(続き)			
(73)	D'iereeren SA/NV	Bank of America Merrill Lynch	24
(366)	Econocom Group SA/NV	Bank of America Merrill Lynch	53
(79)	Euronav NV	Bank of America Merrill Lynch	7
92	Fagron	Bank of America Merrill Lynch	(1)
(75)	Gimv NV	Goldman Sachs	70
(21)	Intervest Offices & Warehouses NV	Bank of America Merrill Lynch	(8)
(154)	KBC Group NV	Bank of America Merrill Lynch	535
(469)	KBC Group NV	Goldman Sachs	2,967
117	Kinopolis Group NV	Bank of America Merrill Lynch	(767)
604	Kinopolis Group NV	Goldman Sachs	(4,349)
(10)	Montea NV	Bank of America Merrill Lynch	(33)
(2,629)	Ontex Group NV	Bank of America Merrill Lynch	2,845
(10,389)	Ontex Group NV	Goldman Sachs	11,821
(33)	Retail Estates NV	Bank of America Merrill Lynch	24
(16)	Sofina SA	Bank of America Merrill Lynch	(72)
2,650	Telenet Group Holding NV	Bank of America Merrill Lynch	(1,689)
3,342	Telenet Group Holding NV	Goldman Sachs	(2,129)
3,279	Telenet Group Holding NV	Morgan Stanley	672
483	Umicore SA	Goldman Sachs	(250)
(64)	VGP NV	Goldman Sachs	(328)
(12)	Xior Student Housing NV	Bank of America Merrill Lynch	5
			(11,262)
カナダ			
(389)	Absolute Software Corp	Goldman Sachs	7
(276)	Aleafia Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	80
1,111	AltaGas Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(496)
509	AltaGas Ltd	Goldman Sachs	3
1,015	AltaGas Ltd	Morgan Stanley	36
1,057	Altius Minerals Corp	Bank of America Merrill Lynch	(670)
1,138	Altius Minerals Corp	Goldman Sachs	(564)
131	Altus Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(8)
1,333	ARC Resources Ltd	Morgan Stanley	(198)
373	Argonaut Gold Inc	Goldman Sachs	(67)
108	Aritzia Inc	Bank of America Merrill Lynch	-
(239)	ATS Automation Tooling Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	5
28	AutoCanada Inc	Bank of America Merrill Lynch	(95)
1,985	Ballard Power Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,179)
1,676	Ballard Power Systems Inc	Goldman Sachs	(761)
671	Ballard Power Systems Inc	Morgan Stanley	40
(3,487)	Barrick Gold Corp	Goldman Sachs	1,220
(3,090)	Barrick Gold Corp	Morgan Stanley	(408)
(81)	Bausch Health Cos Inc	Goldman Sachs	35
1,113	Birchcliff Energy Ltd	Goldman Sachs	(230)
(3,182)	BlackBerry Ltd	Goldman Sachs	152
9,972	Bombardier Inc 'B'	Goldman Sachs	(386)

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)		
163	Boralex Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(260)
879	Boralex Inc 'A'	Goldman Sachs	(1,404)
185	Boralex Inc 'A'	Morgan Stanley	(212)
(35)	Boyd Group Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	12
(688)	Brookfield Asset Management Inc 'A'	Goldman Sachs	1,005
(913)	Brookfield Asset Management Inc 'A'	Morgan Stanley	1,192
(2,367)	Brookfield Asset Management Reinsurance Partners Ltd 'A'	Goldman Sachs	4,375
(156)	CAE Inc	Morgan Stanley	344
(4,865)	Calibre Mining Corp	Bank of America Merrill Lynch	800
(3,579)	Cameco Corp	Goldman Sachs	7,680
(951)	Cameco Corp	Morgan Stanley	97
490	Canada Goose Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,146)
401	Canada Goose Holdings Inc	Goldman Sachs	(1,170)
104	Canadian Apartment Properties REIT (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(87)
140	Canadian Western Bank	Bank of America Merrill Lynch	(197)
629	Canadian Western Bank	Goldman Sachs	(830)
(2,436)	Capstone Mining Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,469)
(7,150)	Capstone Mining Corp	Goldman Sachs	(4,311)
182	Cargojet Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,812)
205	Cargojet Inc	Goldman Sachs	(1,559)
229	Cargojet Inc	Morgan Stanley	(1,105)
(7,888)	Celestica Inc	Goldman Sachs	7,104
(2,492)	Centerra Gold Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,830
(30,061)	Centerra Gold Inc	Goldman Sachs	34,135
(859)	CI Financial Corp	Morgan Stanley	637
178	Cineplex Inc	Bank of America Merrill Lynch	(56)
496	Cineplex Inc	Goldman Sachs	(587)
175	Cogeco Communications Inc	Goldman Sachs	(113)
(175)	Cogeco Inc	Bank of America Merrill Lynch	(166)
(90)	Cogeco Inc	Goldman Sachs	(81)
(26)	Colliers International Group Inc	Morgan Stanley	106
(10)	Constellation Software Inc	Morgan Stanley	(174)
12,390	Crescent Point Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,426)
51,043	Crescent Point Energy Corp	Goldman Sachs	(9,993)
10,291	Crescent Point Energy Corp	Morgan Stanley	(1,370)
656	CT Real Estate Investment Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(406)
1,492	CT Real Estate Investment Trust (REIT)	Goldman Sachs	(923)
(17,219)	Denison Mines Corp	Goldman Sachs	4,720
910	Descartes Systems Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,637)
262	Descartes Systems Group Inc	Goldman Sachs	(759)
351	Descartes Systems Group Inc	Morgan Stanley	(946)
446	Docebo Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,476
211	Docebo Inc	Goldman Sachs	780
70	Docebo Inc	Morgan Stanley	245

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
カナダ(続き)			
(1,673)	Dollarama Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,109
(236)	Dundee Precious Metals Inc	Bank of America Merrill Lynch	119
(63)	Dye & Durham Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(10)
(81)	Dye & Durham Ltd	Goldman Sachs	(12)
(1,690)	Dye & Durham Ltd	Morgan Stanley	(1,359)
1,768	Energy Fuels Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,549)
2,554	Energy Fuels Inc	Goldman Sachs	(1,891)
484	Equinox Gold Corp	Morgan Stanley	(129)
(85)	Equitable Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	202
626	Evertz Technologies Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(222)
709	Evertz Technologies Ltd	Goldman Sachs	(233)
(8,111)	Extendicare Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,959
128	First National Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(273)
1,872	First National Financial Corp	Goldman Sachs	(3,988)
336	Franco-Nevada Corp	Morgan Stanley	739
2,923	Freehold Royalties Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3,747)
17,357	Freehold Royalties Ltd	Goldman Sachs	(22,548)
(89)	Galaxy Digital Holdings Ltd	Morgan Stanley	282
1,831	GFL Environmental Inc	Bank of America Merrill Lynch	695
2,848	GFL Environmental Inc	Goldman Sachs	2,301
3,218	GFL Environmental Inc	Morgan Stanley	1,739
3,014	Great-West Lifeco Inc	Morgan Stanley	(3,139)
(484)	HLS Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	97
(869)	Hudbay Minerals Inc	Goldman Sachs	(151)
(181)	iA Financial Corp Inc	Morgan Stanley	548
(5,804)	IAMGOLD Corp	Goldman Sachs	409
1,630	Imperial Oil Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,327)
1,036	Imperial Oil Ltd	Goldman Sachs	(1,451)
485	Imperial Oil Ltd	Morgan Stanley	(281)
2,924	Innergex Renewable Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(756)
7,477	Innergex Renewable Energy Inc	Goldman Sachs	(1,932)
4,010	Innergex Renewable Energy Inc	Morgan Stanley	(1,759)
(2,789)	J55 Capital Corp	Goldman Sachs	(52)
1,078	Keyera Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,669)
2,682	Keyera Corp	Goldman Sachs	(4,138)
1,788	Keyera Corp	Morgan Stanley	(1,582)
459	Killam Apartment Real Estate Investment Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(104)
3,102	Killam Apartment Real Estate Investment Trust (REIT)	Goldman Sachs	(705)
60	Kinaxis Inc	Bank of America Merrill Lynch	(570)
293	Kinaxis Inc	Goldman Sachs	(1,237)
49	Kinaxis Inc	Morgan Stanley	(536)
(11,027)	Kinross Gold Corp	Bank of America Merrill Lynch	7,556
(21,439)	Kinross Gold Corp	Morgan Stanley	6,800
(681)	Largo Inc	Bank of America Merrill Lynch	656

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益 / (損) (米ドル)
カナダ(続き)			
(1,411)	Largo Inc	Goldman Sachs	1,359
(194)	Lassonde Industries Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1,179
(95)	Lassonde Industries Inc 'A'	Goldman Sachs	540
29	Laurentian Bank of Canada	Bank of America Merrill Lynch	(21)
31	Laurentian Bank of Canada	Goldman Sachs	(50)
(1,801)	LifeWorks Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,228
(1,687)	LifeWorks Inc	Goldman Sachs	2,087
630	Lightspeed Commerce Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,819)
40	Lightspeed Commerce Inc	Goldman Sachs	(588)
721	Lightspeed Commerce Inc	Morgan Stanley	(2,582)
440	Lithium Americas Corp	Bank of America Merrill Lynch	3,446
63	Lithium Americas Corp	Goldman Sachs	493
99	Lithium Americas Corp	Morgan Stanley	489
594	MAG Silver Corp	Bank of America Merrill Lynch	129
963	MAG Silver Corp	Goldman Sachs	(1,873)
(191)	Maple Leaf Foods Inc	Bank of America Merrill Lynch	291
(176)	Maple Leaf Foods Inc	Goldman Sachs	135
(129)	Martinrea International Inc	Bank of America Merrill Lynch	38
1,172	Maverix Metals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(624)
654	Maverix Metals Inc	Goldman Sachs	(348)
(859)	Metro Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,671
(1,759)	Metro Inc	Goldman Sachs	5,469
(4,000)	Metro Inc	Morgan Stanley	2,349
62	Morguard Corp	Bank of America Merrill Lynch	(265)
570	Morguard Corp	Goldman Sachs	(2,437)
(404)	MTY Food Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	964
157	Mullen Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(47)
(46,700)	New Gold Inc	Goldman Sachs	10,606
11,452	NexGen Energy Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4,765)
2,149	NexGen Energy Ltd	Goldman Sachs	(849)
59,782	NexGen Energy Ltd	Morgan Stanley	8,427
1,070	Novagold Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	(871)
985	Novagold Resources Inc	Goldman Sachs	(70)
(809)	Nutrien Ltd	Goldman Sachs	(5)
(30)	Nutrien Ltd	Morgan Stanley	9
(25,545)	OceanaGold Corp	Bank of America Merrill Lynch	7,802
(12,001)	OceanaGold Corp	Goldman Sachs	3,665
115	Ovintiv Inc	Bank of America Merrill Lynch	(21)
50	Ovintiv Inc	Goldman Sachs	(9)
1,760	Ovintiv Inc	Morgan Stanley	(110)
645	Pason Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(174)
2,529	Pason Systems Inc	Goldman Sachs	(683)
675	Peyto Exploration & Development Corp	Bank of America Merrill Lynch	(251)
332	Peyto Exploration & Development Corp	Goldman Sachs	(172)
(15,397)	Power Corp of Canada	Morgan Stanley	16,157

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)			
(747)	Pretium Resources Inc	Morgan Stanley	(7)
5,216	Real Matters Inc	Goldman Sachs	(6,209)
(3,522)	Restaurant Brands International Inc	Goldman Sachs	814
(1,933)	Restaurant Brands International Inc	Morgan Stanley	1,428
(232)	RioCan Real Estate Investment Trust (REIT)	Morgan Stanley	145
(61)	Ritchie Bros Auctioneers Inc	Morgan Stanley	32
(3,491)	Rogers Communications Inc 'B'	Goldman Sachs	5,606
(1,243)	Rogers Communications Inc 'B'	Morgan Stanley	1,802
(2,483)	Rogers Sugar Inc	Bank of America Merrill Lynch	(136)
(2,455)	Rogers Sugar Inc	Goldman Sachs	(135)
(636)	Russel Metals Inc	Bank of America Merrill Lynch	596
(71)	Russel Metals Inc	Goldman Sachs	94
34,587	Sandstorm Gold Ltd	Goldman Sachs	(17,606)
(171)	Saputo Inc	Morgan Stanley	58
8,013	Savaria Corp	Goldman Sachs	(5,899)
142	Seabridge Gold Inc	Goldman Sachs	51
(12)	Shopify Inc 'A'	Morgan Stanley	(566)
(3,107)	Sienna Senior Living Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,725
(344)	Sienna Senior Living Inc	Goldman Sachs	302
(4,867)	Sierra Wireless Inc	Goldman Sachs	3,087
2,067	Silvercorp Metals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(631)
513	Silvercorp Metals Inc	Goldman Sachs	(156)
(1,238)	Sleep Country Canada Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,131
(365)	SNC-Lavalin Group Inc	Morgan Stanley	171
64	Solaris Resources Inc	Goldman Sachs	18
(2,157)	Stelco Holdings Inc	Morgan Stanley	7,424
(185)	Sun Life Financial Inc	Goldman Sachs	394
(2,488)	Sun Life Financial Inc	Morgan Stanley	5,865
166	SunOpta Inc	Goldman Sachs	(80)
(1,293)	Superior Plus Corp	Bank of America Merrill Lynch	446
(4,585)	Superior Plus Corp	Goldman Sachs	1,587
804	Teck Resources Ltd 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(205)
1,143	Teck Resources Ltd 'B'	Goldman Sachs	(320)
1,193	TELUS Corp	Bank of America Merrill Lynch	(19)
1,321	TELUS Corp	Goldman Sachs	(113)
1,454	TELUS Corp	Morgan Stanley	273
(1,981)	Timbercreek Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	364
73	TMX Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(264)
3,814	Topaz Energy Corp	Goldman Sachs	(30)
52	Topicus.com Inc	Bank of America Merrill Lynch	(715)
205	Topicus.com Inc	Goldman Sachs	(2,430)
86	Topicus.com Inc	Morgan Stanley	(389)
106	Torex Gold Resources Inc	Goldman Sachs	70
(157)	Toronto-Dominion Bank	Goldman Sachs	18
(4)	Toronto-Dominion Bank	Morgan Stanley	1

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)			
4,238	Tourmaline Oil Corp	Bank of America Merrill Lynch	(6,671)
4,718	Tourmaline Oil Corp	Goldman Sachs	(7,426)
123	Tourmaline Oil Corp	Morgan Stanley	(3)
94	Transcontinental Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(14)
229	Transcontinental Inc 'A'	Goldman Sachs	(30)
(1,041)	Turquoise Hill Resources Ltd	Goldman Sachs	(2,323)
105	Vermilion Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6)
1,230	Vermilion Energy Inc	Goldman Sachs	(67)
3,011	Village Farms International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,987)
3,629	Village Farms International Inc	Goldman Sachs	(6,893)
(902)	Voyager Digital Ltd	Morgan Stanley	185
(253)	West Fraser Timber Co Ltd	Goldman Sachs	18
2,891	Wheaton Precious Metals Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3,192)
3,918	Wheaton Precious Metals Corp	Goldman Sachs	(4,326)
9,285	Wheaton Precious Metals Corp	Morgan Stanley	2,036
5,507	Whitecap Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	(906)
4,358	Whitecap Resources Inc	Morgan Stanley	(444)
(1,248)	Winpak Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3,215
(1,007)	Winpak Ltd	Goldman Sachs	2,594
195	Yamana Gold Inc	Goldman Sachs	(74)
2,485	Yamana Gold Inc	Morgan Stanley	(360)
			14,533
デンマーク			
3	ALK-Abello A/S	Bank of America Merrill Lynch	105
4	ALK-Abello A/S	Goldman Sachs	75
8,085	Alm Brand A/S	Bank of America Merrill Lynch	(188)
27,999	Alm Brand A/S	Goldman Sachs	(1,234)
(2)	AP Moller - Maersk A/S 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(34)
(1)	AP Moller - Maersk A/S 'A'	Morgan Stanley	(37)
(12)	AP Moller - Maersk A/S 'B'	Morgan Stanley	(471)
(9)	Brodrene Hartmann A/S	Bank of America Merrill Lynch	72
109	Carlsberg A/S 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(564)
199	Chemometec A/S	Goldman Sachs	(3,456)
788	Chr Hansen Holding A/S	Goldman Sachs	(238)
(438)	D/S Norden A/S	Bank of America Merrill Lynch	16
333	Demant A/S	Morgan Stanley	74
(105)	Dfds A/S	Bank of America Merrill Lynch	128
1,786	FLSmidth & Co A/S	Bank of America Merrill Lynch	(7,433)
1,427	FLSmidth & Co A/S	Goldman Sachs	(5,939)
136	FLSmidth & Co A/S	Morgan Stanley	(601)
11	Genmab A/S	Goldman Sachs	(262)
20	Genmab A/S	Morgan Stanley	(1)
(132)	H Lundbeck A/S	Bank of America Merrill Lynch	340
(259)	H Lundbeck A/S	Morgan Stanley	347
15	Netcompany Group A/S	Bank of America Merrill Lynch	(125)

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)		
291	Netcompany Group A/S	Goldman Sachs	(2,426)
21	NeuroSearch A/S	Bank of America Merrill Lynch	14
50	NeuroSearch A/S	Goldman Sachs	(36)
711	Nilfisk Holding A/S	Bank of America Merrill Lynch	(707)
768	Nilfisk Holding A/S	Goldman Sachs	(764)
(157)	NKT A/S	Bank of America Merrill Lynch	182
41	NNIT A/S	Goldman Sachs	(38)
264	Novozymes A/S 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(226)
391	Novozymes A/S 'B'	Morgan Stanley	(957)
65	Per Aarsleff Holding A/S	Bank of America Merrill Lynch	(74)
(2,142)	Ringkjoebing Landbobank A/S	Bank of America Merrill Lynch	(1,966)
(15)	ROCKWOOL International A/S 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(71)
(155)	Royal Unibrew A/S	Bank of America Merrill Lynch	591
(654)	Scandinavian Tobacco Group A/S 'A'	Bank of America Merrill Lynch	135
47	Schouw & Co A/S	Bank of America Merrill Lynch	(26)
1,535	Topdanmark A/S	Goldman Sachs	5,684
(843)	Zealand Pharma A/S	Bank of America Merrill Lynch	2,009
			<u>(18,102)</u>
	フィンランド		
(236)	Aktia Bank Oyj	Bank of America Merrill Lynch	17
(870)	Aktia Bank Oyj	Goldman Sachs	252
(1,466)	BasWare Oyj	Goldman Sachs	4,837
12	Cargotec Oyj	Bank of America Merrill Lynch	(52)
(842)	Citycon Oyj	Goldman Sachs	108
(58,277)	Finnair Oyj	Goldman Sachs	8,329
27	Harvia Oyj	Bank of America Merrill Lynch	62
(123)	Kemira OYJ	Bank of America Merrill Lynch	65
(1,155)	Kojamo Oyj	Bank of America Merrill Lynch	473
1,176	Kone Oyj 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(2,730)
574	Kone Oyj 'B'	Goldman Sachs	(1,332)
1,660	Kone Oyj 'B'	Morgan Stanley	(5,732)
38	Musti Group Oyj	Bank of America Merrill Lynch	(4)
69	Musti Group Oyj	Goldman Sachs	(193)
17,733	Nokia Oyj	Morgan Stanley	(4,146)
(431)	Orion Oyj 'B'	Bank of America Merrill Lynch	294
2,764	Outokumpu Oyj	Bank of America Merrill Lynch	(1,523)
3,240	Outokumpu Oyj	Morgan Stanley	(1,823)
(68)	Remedy Entertainment Oyj	Goldman Sachs	28
179	Rovio Entertainment Oyj	Bank of America Merrill Lynch	(100)
213	Rovio Entertainment Oyj	Goldman Sachs	(119)
(1,444)	Sanoma Oyj	Bank of America Merrill Lynch	912
(436)	Sanoma Oyj	Goldman Sachs	337
434	Tokmanni Group Corp	Goldman Sachs	(89)
883	Uponor Oyj	Bank of America Merrill Lynch	(1,475)
374	Uponor Oyj	Goldman Sachs	(726)

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)			
3,040	YIT Oyj	Bank of America Merrill Lynch	(1,219)
3,736	YIT Oyj	Goldman Sachs	(2,188)
			<u>(7,737)</u>
フランス			
(241)	ABC arbitrage	Bank of America Merrill Lynch	(32)
(2,643)	Accor SA	Goldman Sachs	2,720
11,468	Air France-KLM	Bank of America Merrill Lynch	(4,186)
11,521	Air France-KLM	Goldman Sachs	(6,202)
5,735	Air France-KLM	Morgan Stanley	(2,323)
129	Albioma SA	Bank of America Merrill Lynch	(65)
16	Albioma SA	Goldman Sachs	8
6,006	ALD SA	Bank of America Merrill Lynch	(9,704)
5,868	ALD SA	Goldman Sachs	(9,481)
2,746	ALD SA	Morgan Stanley	(2,187)
(776)	Alstom SA	Bank of America Merrill Lynch	1,657
1,655	Antin Infrastructure Partners SA	Bank of America Merrill Lynch	(3,126)
15	Arkema SA	Bank of America Merrill Lynch	(87)
189	Arkema SA	Goldman Sachs	(1,097)
32	Arkema SA	Morgan Stanley	(297)
39	Beneteau SA	Bank of America Merrill Lynch	(54)
168	BioMerieux	Morgan Stanley	7
(769)	BNP Paribas SA	Bank of America Merrill Lynch	4,820
(1,990)	BNP Paribas SA	Goldman Sachs	13,993
(2,046)	BNP Paribas SA	Morgan Stanley	8,381
618	Carrefour SA	Morgan Stanley	(981)
60	Cellectis SA	Goldman Sachs	(83)
2,812	CGG SA	Goldman Sachs	(78)
(316)	CNP Assurances	Bank of America Merrill Lynch	40
(271)	Coface SA	Bank of America Merrill Lynch	(49)
(205)	Dassault Aviation SA	Bank of America Merrill Lynch	278
(1,940)	Eiffage SA	Bank of America Merrill Lynch	6,320
(348)	Elior Group SA	Bank of America Merrill Lynch	63
13,323	Engie SA	Goldman Sachs	(9,247)
10,199	Engie SA	Morgan Stanley	(3,180)
(150)	EssilorLuxottica SA	Morgan Stanley	1,770
448	Eurazeo SE	Bank of America Merrill Lynch	(3,212)
283	Eurazeo SE	Goldman Sachs	(2,029)
112	Eurazeo SE	Morgan Stanley	(599)
(533)	Eutelsat Communications SA	Bank of America Merrill Lynch	489
(3,313)	Eutelsat Communications SA	Goldman Sachs	2,263
4,553	Exclusive Networks SA	Bank of America Merrill Lynch	(1,036)
(377)	Faurecia SE	Bank of America Merrill Lynch	3,676
(363)	Faurecia SE	Goldman Sachs	3,540
(27)	Fnac Darty SA	Bank of America Merrill Lynch	24
(68)	Gaztransport Et Technigaz SA	Bank of America Merrill Lynch	(180)

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)		
(191)	Gaztransport Et Technigaz SA	Goldman Sachs	(109)
(2,265)	Getlink SE	Bank of America Merrill Lynch	(619)
62	Hermes International	Bank of America Merrill Lynch	11,420
54	Hermes International	Goldman Sachs	9,014
6	Hermes International	Morgan Stanley	171
25	ID Logistics Group	Bank of America Merrill Lynch	427
1,637	Interparfums SA	Goldman Sachs	(10,617)
516	JCDecaux SA	Bank of America Merrill Lynch	(1,163)
243	JCDecaux SA	Goldman Sachs	(547)
(48)	Kaufman & Broad SA	Goldman Sachs	(13)
173	Kering SA	Bank of America Merrill Lynch	(764)
579	Klepierre SA (REIT)	Morgan Stanley	(581)
293	Legrand SA	Morgan Stanley	(653)
251	L'Oreal SA	Bank of America Merrill Lynch	(7,014)
351	L'Oreal SA	Goldman Sachs	(8,225)
1,066	L'Oreal SA	Morgan Stanley	(21,651)
(28)	Maisons du Monde SA	Bank of America Merrill Lynch	5
602	Manitou BF SA	Bank of America Merrill Lynch	(2,021)
1,040	Manitou BF SA	Goldman Sachs	(3,491)
(487)	McPhy Energy SA	Goldman Sachs	(993)
(560)	Mercialys SA	Bank of America Merrill Lynch	359
(227)	Mercialys SA	Goldman Sachs	179
(211)	Metropole Television SA	Bank of America Merrill Lynch	208
(1,076)	Nacon SA	Bank of America Merrill Lynch	833
(1,538)	Nacon SA	Goldman Sachs	1,190
(48)	Nexans SA	Bank of America Merrill Lynch	1
(82)	Nexity SA	Bank of America Merrill Lynch	26
309	Orpea SA	Goldman Sachs	40
67	Pernod Ricard SA	Bank of America Merrill Lynch	(352)
53	Pernod Ricard SA	Goldman Sachs	(310)
25	Quadiant SA	Bank of America Merrill Lynch	(54)
39	Quadiant SA	Goldman Sachs	(83)
1,429	Renault SA	Bank of America Merrill Lynch	(6,918)
269	Renault SA	Goldman Sachs	(205)
5,212	Renault SA	Morgan Stanley	(26,296)
4,099	Rubis SCA	Bank of America Merrill Lynch	(16,744)
1,158	Rubis SCA	Goldman Sachs	(4,730)
5,936	Rubis SCA	Morgan Stanley	(13,374)
(759)	Safran SA	Bank of America Merrill Lynch	1,445
(2,474)	Sanofi	Goldman Sachs	15,792
(2,173)	Sanofi	Morgan Stanley	12,115
20	Sartorius Stedim Biotech	Goldman Sachs	1,352
(107)	SEB SA	Bank of America Merrill Lynch	616
(1,491)	SEB SA	Morgan Stanley	8,652
2,223	SES SA	Morgan Stanley	197

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)			
992	SMCP SA	Bank of America Merrill Lynch	(720)
755	SMCP SA	Goldman Sachs	(293)
20	Societe BIC SA	Bank of America Merrill Lynch	(30)
97	Societe BIC SA	Goldman Sachs	39
5,153	Societe Generale SA	Goldman Sachs	(13,046)
4,028	Societe Generale SA	Morgan Stanley	(7,700)
(1,651)	STMicroelectronics NV	Bank of America Merrill Lynch	(534)
1	Technicolor SA	Bank of America Merrill Lynch	-
34	Teleperformance	Bank of America Merrill Lynch	365
65	Teleperformance	Goldman Sachs	629
163	Teleperformance	Morgan Stanley	1,280
(3,176)	TotalEnergies SE	Morgan Stanley	3,742
129	Trigano SA	Bank of America Merrill Lynch	(2,145)
100	Trigano SA	Goldman Sachs	(1,476)
377	Valeo SA	Bank of America Merrill Lynch	(1,205)
1,072	Valeo SA	Goldman Sachs	(3,428)
2,497	Valeo SA	Morgan Stanley	(8,410)
137	Veolia Environnement SA	Goldman Sachs	(242)
195	Verallia SA	Goldman Sachs	(457)
21	Vicat SA	Bank of America Merrill Lynch	(104)
17	Vicat SA	Goldman Sachs	(58)
5	Vilmorin & Cie SA	Bank of America Merrill Lynch	(4)
12	Vilmorin & Cie SA	Goldman Sachs	(26)
(1,972)	Vinci SA	Morgan Stanley	1,813
(38)	Voltalia SA	Bank of America Merrill Lynch	38
176	Wendel SE	Bank of America Merrill Lynch	(2,724)
436	Wendel SE	Goldman Sachs	(6,747)
223	Wendel SE	Morgan Stanley	(2,081)
			(116,475)
ドイツ			
(77)	1&1 Drillisch AG	Bank of America Merrill Lynch	177
(2,330)	Aareal Bank AG	Bank of America Merrill Lynch	(2,598)
72	Adesso SE	Bank of America Merrill Lynch	37
124	Adesso SE	Goldman Sachs	138
(361)	Allianz SE Reg	Morgan Stanley	380
2	Amadeus Fire AG	Bank of America Merrill Lynch	(21)
58	Amadeus Fire AG	Goldman Sachs	(620)
(982)	BASF SE	Bank of America Merrill Lynch	5,174
(38)	BASF SE	Goldman Sachs	9
(1,587)	BASF SE	Morgan Stanley	7,259
4	Basler AG	Bank of America Merrill Lynch	(3)
(277)	Bayer AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	1,189
28	BayWa AG	Goldman Sachs	(17)
(220)	Befesa SA	Bank of America Merrill Lynch	225
(125)	Bilfinger SE	Bank of America Merrill Lynch	209

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)		
(287)	Bilfinger SE	Goldman Sachs	679
(159)	CANCOM SE	Bank of America Merrill Lynch	(471)
(363)	CANCOM SE	Goldman Sachs	(1,449)
(5,578)	CECONOMY AG	Goldman Sachs	2,894
(6,175)	Commerzbank AG	Bank of America Merrill Lynch	323
(39)	CompuGroup Medical SE & Co KGaA	Bank of America Merrill Lynch	(23)
(100)	Corestate Capital Holding SA	Goldman Sachs	150
(67)	Delivery Hero SE	Bank of America Merrill Lynch	611
545	Deutsche Beteiligungs AG	Bank of America Merrill Lynch	(1,023)
267	Deutsche Beteiligungs AG	Goldman Sachs	(501)
160	Deutsche Lufthansa AG Reg	Goldman Sachs	(223)
5,924	Deutsche Lufthansa AG Reg	Morgan Stanley	(4,658)
442	Deutsche Pfandbriefbank AG	Goldman Sachs	(66)
(357)	Deutsche Telekom AG Reg	Goldman Sachs	402
(26,040)	Deutsche Telekom AG Reg	Morgan Stanley	34,430
(1,246)	Deutz AG	Bank of America Merrill Lynch	32
(12)	Draegerwerk AG & Co KGaA	Goldman Sachs	160
16	Draegerwerk AG & Co KGaA (Pref)	Goldman Sachs	(232)
1,499	Duerr AG	Goldman Sachs	(6,277)
(644)	Eckert & Ziegler Strahlenund Medizintechnik AG	Bank of America Merrill Lynch	9,160
(114)	Eckert & Ziegler Strahlenund Medizintechnik AG	Goldman Sachs	1,621
174	Encavis AG	Bank of America Merrill Lynch	(15)
174	Encavis AG	Goldman Sachs	(14)
(6,311)	flatexDEGIRO AG	Bank of America Merrill Lynch	(21,366)
(1,228)	flatexDEGIRO AG	Goldman Sachs	(4,639)
(413)	flatexDEGIRO AG	Morgan Stanley	(1,238)
1,946	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	Bank of America Merrill Lynch	(15,030)
551	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	Goldman Sachs	(4,526)
1,116	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	Morgan Stanley	(5,003)
(337)	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	Bank of America Merrill Lynch	1,986
(93)	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	Goldman Sachs	548
(150)	Fresenius SE & Co KGaA	Bank of America Merrill Lynch	244
81	Gerresheimer AG	Bank of America Merrill Lynch	118
283	Gerresheimer AG	Goldman Sachs	499
46	Gerresheimer AG	Morgan Stanley	18
(4,025)	Grand City Properties SA	Bank of America Merrill Lynch	5,971
42	GRENKE AG	Bank of America Merrill Lynch	(13)
(326)	Hamborner AG (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	80
(106)	Hamborner AG (REIT)	Goldman Sachs	34
(726)	Hella GmbH & Co KGaA	Morgan Stanley	(210)
561	HelloFresh SE	Bank of America Merrill Lynch	1,537
520	HelloFresh SE	Goldman Sachs	1,264

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益 / (損) (米ドル)
	ドイツ(続き)		
1,112	HelloFresh SE	Morgan Stanley	(770)
(246)	HOCHTIEF AG	Morgan Stanley	163
(397)	Home24 SE	Bank of America Merrill Lynch	474
(2,906)	Home24 SE	Goldman Sachs	3,472
(9)	Hornbach Holding AG & Co KGaA	Bank of America Merrill Lynch	58
32	HUGO BOSS AG	Bank of America Merrill Lynch	(248)
449	HUGO BOSS AG	Morgan Stanley	(3,178)
17	Hypoport SE	Bank of America Merrill Lynch	(915)
30	Hypoport SE	Goldman Sachs	(1,615)
(136)	Jenoptik AG	Bank of America Merrill Lynch	(203)
57	Krones AG	Goldman Sachs	(173)
(7)	MBB SE	Goldman Sachs	34
(1)	Medios AG	Bank of America Merrill Lynch	-
(355)	Medios AG	Goldman Sachs	(141)
6,036	MLP SE	Goldman Sachs	(6,387)
305	Nordex SE	Bank of America Merrill Lynch	462
(77)	PNE AG	Goldman Sachs	42
(3,034)	Porsche Automobil Holding SE (Pref)	Bank of America Merrill Lynch	25,469
(787)	Porsche Automobil Holding SE (Pref)	Goldman Sachs	8,776
(1,063)	Porsche Automobil Holding SE (Pref)	Morgan Stanley	8,951
890	RTL Group SA	Morgan Stanley	(2,592)
267	S&T AG	Bank of America Merrill Lynch	(264)
82	S&T AG	Goldman Sachs	(83)
665	SAP SE	Goldman Sachs	(2,851)
3,116	SAP SE	Morgan Stanley	(22,904)
28	Sartorius AG (Pref)	Goldman Sachs	1,310
728	Scout24 AG	Bank of America Merrill Lynch	(5,098)
946	Scout24 AG	Goldman Sachs	(6,652)
266	Scout24 AG	Morgan Stanley	(424)
(493)	Shop Apotheke Europe NV	Bank of America Merrill Lynch	(3,085)
(718)	Shop Apotheke Europe NV	Goldman Sachs	(4,493)
(15)	Shop Apotheke Europe NV	Morgan Stanley	(195)
1,531	Siemens AG Reg	Morgan Stanley	(22,263)
1,161	Siemens Energy AG	Bank of America Merrill Lynch	(674)
1,502	Siemens Energy AG	Morgan Stanley	(358)
(51)	Sixt SE	Goldman Sachs	940
359	SMA Solar Technology AG	Bank of America Merrill Lynch	(1,683)
625	SMA Solar Technology AG	Goldman Sachs	(2,930)
13	Steico SE	Bank of America Merrill Lynch	(142)
104	Steico SE	Goldman Sachs	(1,136)
206	STO SE & Co KGaA (Pref)	Bank of America Merrill Lynch	(2,110)
137	STO SE & Co KGaA (Pref)	Goldman Sachs	(1,403)
(190)	Takkt AG	Bank of America Merrill Lynch	105
(1,283)	Takkt AG	Goldman Sachs	967
(78)	Talanx AG	Morgan Stanley	113

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
ドイツ(続き)			
1,744	Telefonica Deutschland Holding AG	Goldman Sachs	16
2,402	thyssenkrupp AG	Bank of America Merrill Lynch	1,317
906	thyssenkrupp AG	Goldman Sachs	149
195	thyssenkrupp AG	Morgan Stanley	(326)
(411)	Uniper SE	Bank of America Merrill Lynch	48
(2,618)	Uniper SE	Morgan Stanley	(1,549)
(1,443)	Vantage Towers AG	Bank of America Merrill Lynch	82
(68)	Vantage Towers AG	Goldman Sachs	4
(512)	Vantage Towers AG	Morgan Stanley	687
99	Vitesco Technologies Group AG	Bank of America Merrill Lynch	(1,279)
(51)	Vonovia SE 'S'	Bank of America Merrill Lynch	(189)
(183)	Vossloh AG	Goldman Sachs	781
206	Wacker Chemie AG	Morgan Stanley	(4,735)
(113)	Wacker Neuson SE	Bank of America Merrill Lynch	102
(641)	Westwing Group AG	Bank of America Merrill Lynch	(73)
(1,455)	Westwing Group AG	Goldman Sachs	(166)
(52)	Zeal Network SE	Bank of America Merrill Lynch	(57)
			<u>(41,500)</u>
香港			
18,200	AIA Group Ltd	Goldman Sachs	(7,238)
30,000	AIA Group Ltd	Morgan Stanley	(13,662)
(12,000)	Apollo Future Mobility Group Ltd	Goldman Sachs	54
2,500	ASM Pacific Technology Ltd	Goldman Sachs	(706)
1,700	ASM Pacific Technology Ltd	Morgan Stanley	(578)
1,200	Bank of East Asia Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(160)
9,600	Bank of East Asia Ltd	Goldman Sachs	(1,281)
7,000	Bank of East Asia Ltd	Morgan Stanley	(718)
(9,000)	Champion REIT (REIT)	Goldman Sachs	115
(1,000)	Chow Sang Sang Holdings International Ltd	Goldman Sachs	57
40,000	CITIC Telecom International Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(308)
94,000	CITIC Telecom International Holdings Ltd	Goldman Sachs	(723)
(1,000)	CK Asset Holdings Ltd	Goldman Sachs	263
(34,000)	CK Hutchison Holdings Ltd	Goldman Sachs	15,047
(31,000)	CLP Holdings Ltd	Goldman Sachs	(2,585)
6,400	Dah Sing Banking Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(443)
74,400	Dah Sing Banking Group Ltd	Goldman Sachs	(5,154)
14,800	Dah Sing Financial Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3,417)
16,400	Dah Sing Financial Holdings Ltd	Goldman Sachs	(3,787)
4,000	EC Healthcare	Bank of America Merrill Lynch	(21)
16,000	EC Healthcare	Goldman Sachs	(82)
(500)	EssilorLuxottica SA	Goldman Sachs	99
2,000	First Pacific Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(51)
(43,000)	Fortune Real Estate Investment Trust (REIT)	Goldman Sachs	1,477
(13,200)	Fosun Tourism Group	Goldman Sachs	2,709

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	香港(続き)		
(1,000)	Hang Lung Properties Ltd	Goldman Sachs	241
12,000	Health & Happiness H&H International Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3,579)
17,000	Health & Happiness H&H International Holdings Ltd	Goldman Sachs	(5,506)
(41,000)	Hong Kong Technology Venture Co Ltd	Goldman Sachs	10,624
(3,000)	Hongkong & Shanghai Hotels Ltd	Bank of America Merrill Lynch	54
(1,500)	Hongkong & Shanghai Hotels Ltd	Goldman Sachs	27
(1,000)	Hysan Development Co Ltd	Goldman Sachs	346
(1,000)	IGG Inc	Goldman Sachs	59
7,250	L'Occitane International SA	Bank of America Merrill Lynch	2,744
2,500	L'Occitane International SA	Goldman Sachs	946
1,000	Luk Fook Holdings International Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(224)
4,000	Luk Fook Holdings International Ltd	Goldman Sachs	(898)
3,200	Man Wah Holdings Ltd	Morgan Stanley	(780)
(79,000)	Melco International Development Ltd	Goldman Sachs	4,459
(26,000)	Melco International Development Ltd	Morgan Stanley	4,069
23,600	MGM China Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(908)
6,000	MGM China Holdings Ltd	Goldman Sachs	(231)
6,800	MGM China Holdings Ltd	Morgan Stanley	(811)
(1,000)	MTR Corp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	36
(1,000)	New World Development Co Ltd	Goldman Sachs	455
47,000	Pacific Basin Shipping Ltd	Bank of America Merrill Lynch	422
13,000	Pacific Basin Shipping Ltd	Goldman Sachs	117
42,000	Pacific Basin Shipping Ltd	Morgan Stanley	1,401
9,800	PRADA SpA	Bank of America Merrill Lynch	(4,023)
9,300	PRADA SpA	Goldman Sachs	(3,818)
9,000	PRADA SpA	Morgan Stanley	(6,696)
(20,000)	Prosperity (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	154
(64,000)	Prosperity (REIT)	Goldman Sachs	493
23,000	Razer Inc	Bank of America Merrill Lynch	59
11,000	Razer Inc	Goldman Sachs	28
112,000	Sa Sa International Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,437)
246,000	Sa Sa International Holdings Ltd	Goldman Sachs	(3,156)
19,200	Sands China Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,231)
80,000	Shun Tak Holdings Ltd	Morgan Stanley	(410)
(2,000)	Sino Land Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	172
(14,000)	Sino Land Co Ltd	Goldman Sachs	1,203
17,000	SITC International Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	12,212
(24,000)	SJM Holdings Ltd	Goldman Sachs	1,078
(2,000)	SUNeVision Holdings Ltd	Goldman Sachs	16
(38,000)	Sunlight Real Estate Investment Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	49
6,000	Swire Pacific Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(4,195)
3,000	Swire Pacific Ltd 'A'	Morgan Stanley	(1,539)
26,400	Swire Properties Ltd	Morgan Stanley	(8,060)
8,500	Techtronic Industries Co Ltd	Goldman Sachs	(8,941)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
香港(続き)			
(5,200)	Television Broadcasts Ltd	Bank of America Merrill Lynch	840
500	Texhong Textile Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(37)
682,000	United Energy Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	-
582,000	United Energy Group Ltd	Goldman Sachs	50
222,000	United Energy Group Ltd	Morgan Stanley	285
(40,000)	Vobile Group Ltd	Morgan Stanley	564
(157,673)	WH Group Ltd	Goldman Sachs	9,304
13,000	Xinyi Glass Holdings Ltd	Goldman Sachs	(4,886)
14,000	Xinyi Glass Holdings Ltd	Morgan Stanley	(1,940)
19,500	Yue Yuen Industrial Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(6,704)
27,000	Yue Yuen Industrial Holdings Ltd	Goldman Sachs	(9,282)
40,000	Yue Yuen Industrial Holdings Ltd	Morgan Stanley	(7,697)
(4,000)	Zensun Enterprises Ltd	Goldman Sachs	(277)
			(55,852)
アイルランド			
5,430	AIB Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1,875)
9,946	AIB Group Plc	Goldman Sachs	(3,435)
4,925	AIB Group Plc	Morgan Stanley	(1,438)
(1,739)	Flutter Entertainment Plc	Bank of America Merrill Lynch	41,641
(3,319)	Flutter Entertainment Plc	Goldman Sachs	86,544
(459)	Glanbia Plc	Bank of America Merrill Lynch	833
(1,045)	Glenveagh Properties Plc	Bank of America Merrill Lynch	39
(13,274)	Glenveagh Properties Plc	Goldman Sachs	(469)
(560)	Hibernia REIT Plc (REIT)	Goldman Sachs	(36)
(5,389)	Irish Residential Properties Plc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	378
(5,245)	Irish Residential Properties Plc (REIT)	Goldman Sachs	303
1,079	Kerry Group Plc 'A'	Morgan Stanley	(650)
(2,895)	Ryanair Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	1,409
(206)	Smurfit Kappa Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	154
690	Uniphar Plc	Bank of America Merrill Lynch	(54)
1,948	Uniphar Plc	Goldman Sachs	(177)
			123,167
イスラエル			
(12)	AFI Properties Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2
(356)	Ashtrom Group Ltd	Morgan Stanley	15
(19)	AudioCodes Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3)
(306)	Azrieli Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,732
(1,859)	Azrieli Group Ltd	Goldman Sachs	10,540
2,482	Bank Hapoalim BM	Goldman Sachs	22
(202)	Big Shopping Centers Ltd	Morgan Stanley	(103)
(10)	Blue Square Real Estate Ltd	Goldman Sachs	18
(73)	Camtek Ltd	Goldman Sachs	(151)
(4,576)	Cellcom Israel Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,615)
(211)	Clal Insurance Enterprises Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	242
97	Danel Adir Yeoshua Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,246

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)		
183	Danel Adir Yeoshua Ltd	Goldman Sachs	(1,319)
(118)	Delek Automotive Systems Ltd	Goldman Sachs	(12)
(38)	Delek Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	291
(7,685)	Doral Group Renewable Energy Resources Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3,246
(21)	Electra Consumer Products 1970 Ltd	Bank of America Merrill Lynch	24
(1,324)	Enlight Renewable Energy Ltd	Morgan Stanley	85
(241)	First International Bank Of Israel Ltd	Goldman Sachs	49
(12)	Formula Systems 1985 Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(11)
(429)	Gilat Satellite Networks Ltd	Bank of America Merrill Lynch	11
(10,704)	ICL Group Ltd	Goldman Sachs	(931)
(37)	IDI Insurance Co Ltd	Goldman Sachs	54
(31)	Magic Software Enterprises Ltd	Bank of America Merrill Lynch	48
(42)	Matrix IT Ltd	Goldman Sachs	4
(2,284)	Maytronics Ltd	Goldman Sachs	508
(36)	Menora Mivtachim Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	26
(449)	Migdal Insurance & Financial Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	48
(495)	Mivne Real Estate KD Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(12)
(866)	Mivne Real Estate KD Ltd	Morgan Stanley	143
(3,253)	Naphtha Israel Petroleum Corp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,624
(2,221)	Naphtha Israel Petroleum Corp Ltd	Goldman Sachs	1,109
46	Nice Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,126)
11	Nice Ltd	Goldman Sachs	(269)
12	Nice Ltd	Morgan Stanley	2
55	Nova Ltd	Goldman Sachs	73
145	Paz Oil Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	609
114	Paz Oil Co Ltd	Goldman Sachs	(783)
(8,472)	Phoenix Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	-
(4,893)	Phoenix Holdings Ltd	Morgan Stanley	(700)
17	Rami Levy Chain Stores Hashikma Marketing 2006 Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(49)
(377)	Shapir Engineering and Industry Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(46)
(2,932)	Shapir Engineering and Industry Ltd	Goldman Sachs	(354)
(741)	Shapir Engineering and Industry Ltd	Morgan Stanley	16
(168)	Strauss Group Ltd	Goldman Sachs	46
(121)	Tower Semiconductor Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(46)
			14,303
	イタリア		
(874)	Anima Holding SpA	Bank of America Merrill Lynch	238
397	Arnoldo Mondadori Editore SpA	Bank of America Merrill Lynch	(52)
3,371	Arnoldo Mondadori Editore SpA	Goldman Sachs	(441)
(209)	Ascopiave SpA	Bank of America Merrill Lynch	33
(4,648)	Assicurazioni Generali SpA	Bank of America Merrill Lynch	7,473
(539)	Assicurazioni Generali SpA	Goldman Sachs	923
(6,971)	Assicurazioni Generali SpA	Morgan Stanley	5,275

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)		
(887)	Atlantia SpA	Goldman Sachs	(82)
(416)	Azimut Holding SpA	Bank of America Merrill Lynch	7
(5,608)	Banca Popolare di Sondrio SCPA	Goldman Sachs	1,544
(33)	Biesse SpA	Bank of America Merrill Lynch	48
29,117	BPER Banca	Goldman Sachs	(8,084)
60,215	BPER Banca	Morgan Stanley	(8,599)
(292)	Brembo SpA	Bank of America Merrill Lynch	66
124	Brunello Cucinelli SpA	Bank of America Merrill Lynch	(543)
1,383	Brunello Cucinelli SpA	Goldman Sachs	(8,824)
(1,361)	Buzzi Unicem SpA	Goldman Sachs	3,051
(20)	Carel Industries SpA	Bank of America Merrill Lynch	80
(71)	Cerved Group SpA	Goldman Sachs	-
(2,530)	CNH Industrial NV	Bank of America Merrill Lynch	3,251
(7,352)	Credito Emiliano SpA	Bank of America Merrill Lynch	5,103
(2,618)	Credito Emiliano SpA	Goldman Sachs	1,817
528	Datalogic SpA	Bank of America Merrill Lynch	(1,164)
352	Datalogic SpA	Goldman Sachs	(811)
(267)	DiaSorin SpA	Bank of America Merrill Lynch	(425)
(90)	DiaSorin SpA	Goldman Sachs	(143)
(46)	DiaSorin SpA	Morgan Stanley	(351)
(2,570)	doValue SpA	Bank of America Merrill Lynch	1,780
(742)	doValue SpA	Goldman Sachs	549
569	El.En. SpA	Bank of America Merrill Lynch	(203)
63	El.En. SpA	Goldman Sachs	(46)
(741)	Enav SpA	Bank of America Merrill Lynch	65
(2,928)	Eni SpA	Bank of America Merrill Lynch	913
(194)	ERG SpA	Goldman Sachs	(9)
(48)	Esprinet SpA	Bank of America Merrill Lynch	(16)
(760)	EXOR NV	Goldman Sachs	4,324
(28)	Ferrari NV	Bank of America Merrill Lynch	48
(663)	Fila SpA	Goldman Sachs	1,343
(643)	FinecoBank Banca Fineco SpA	Bank of America Merrill Lynch	1,229
168	Gruppo MutuiOnline SpA	Goldman Sachs	(105)
(669)	GVS SpA	Bank of America Merrill Lynch	(100)
(78)	GVS SpA	Goldman Sachs	(10)
(89)	Illimity Bank SpA	Goldman Sachs	54
(8,184)	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	Bank of America Merrill Lynch	(526)
(1,718)	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	Goldman Sachs	(24)
(3,658)	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	Morgan Stanley	1,811
(156)	Interpump Group SpA	Bank of America Merrill Lynch	49
1,109	Leonardo SpA	Bank of America Merrill Lynch	(584)
5,042	Maire Tecnimont SpA	Bank of America Merrill Lynch	(218)
8,794	Maire Tecnimont SpA	Goldman Sachs	(380)
457	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	Bank of America Merrill Lynch	(529)

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)			
628	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	Goldman Sachs	(727)
(2,375)	MFE-MediaForEurope NV	Goldman Sachs	6
(674)	Moncler SpA	Bank of America Merrill Lynch	2,853
(871)	Moncler SpA	Goldman Sachs	3,687
(868)	Moncler SpA	Morgan Stanley	3,891
(304)	Piaggio & C SpA	Bank of America Merrill Lynch	38
(703)	Prysmian SpA	Bank of America Merrill Lynch	(88)
(1,963)	RAI Way SpA	Bank of America Merrill Lynch	470
(1,795)	RAI Way SpA	Goldman Sachs	486
43	Sanlorenzo SpA	Bank of America Merrill Lynch	(78)
159	Sanlorenzo SpA	Goldman Sachs	(285)
174	Sesa SpA	Bank of America Merrill Lynch	(2,825)
630	Sesa SpA	Goldman Sachs	(10,062)
(1,688)	Societa Cattolica Di Assicurazione SpA	Goldman Sachs	432
(167)	Tamburi Investment Partners SpA	Bank of America Merrill Lynch	25
(7,177)	Tenaris SA	Bank of America Merrill Lynch	10,922
(967)	Terna SpA	Bank of America Merrill Lynch	(30)
1,392	Tinexta Spa	Bank of America Merrill Lynch	(3,198)
1,987	Tinexta Spa	Goldman Sachs	(4,562)
23,522	Webuild SpA	Bank of America Merrill Lynch	(3,494)
8,382	Webuild SpA	Goldman Sachs	(1,249)
			5,017
日本			
300	77 Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(179)
700	Adastria Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,480)
6,900	Adastria Co Ltd	Goldman Sachs	(14,487)
(1,100)	ADEKA Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,338
(3,100)	ADEKA Corp	Goldman Sachs	3,772
(1)	Advance Residence Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	111
400	Advantest Corp	Bank of America Merrill Lynch	(426)
(1,400)	Aeon Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	818
(400)	Aeon Delight Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	373
(1,500)	Aeon Delight Co Ltd	Goldman Sachs	1,399
(2,500)	Aeon Hokkaido Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,109
(500)	Aeon Hokkaido Corp	Goldman Sachs	446
(6,400)	Aeon Mall Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	7,105
(3,300)	Aeon Mall Co Ltd	Morgan Stanley	3,048
100	Ai Holdings Corp	Goldman Sachs	(211)
(200)	AI inside Inc	Goldman Sachs	3,304
800	Aichi Steel Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,513)
1,400	Aichi Steel Corp	Goldman Sachs	(2,648)
(47,400)	Aiful Corp	Goldman Sachs	25,258
(2,200)	Ain Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	586
(200)	Ain Holdings Inc	Goldman Sachs	53
1,300	Ajinomoto Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,790)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
1,200	Ajinomoto Co Inc	Goldman Sachs	(1,652)
900	Ajinomoto Co Inc	Morgan Stanley	(679)
100	Akatsuki Inc	Bank of America Merrill Lynch	(339)
500	Alfresa Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(239)
300	Alfresa Holdings Corp	Morgan Stanley	(155)
(400)	Alpen Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	764
(400)	Alpen Co Ltd	Goldman Sachs	764
(700)	Alpha Systems Inc	Goldman Sachs	3,233
3,700	Alps Alpine Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,826)
6,300	Alps Alpine Co Ltd	Goldman Sachs	(4,812)
5,800	Alps Alpine Co Ltd	Morgan Stanley	(4,327)
5,700	Amada Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(5,012)
300	Amada Co Ltd	Morgan Stanley	(253)
100	Anest Iwata Corp	Goldman Sachs	(6)
1,200	Anicom Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(927)
7,100	Anicom Holdings Inc	Goldman Sachs	(5,486)
6,000	AOKI Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,689)
13,600	AOKI Holdings Inc	Goldman Sachs	(6,522)
(1,000)	Aomori Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,291
(900)	Aomori Bank Ltd	Goldman Sachs	2,062
200	Arata Corp	Bank of America Merrill Lynch	(586)
400	Arcland Service Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(210)
300	Arcland Service Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(157)
100	Argo Graphics Inc	Goldman Sachs	(218)
(200)	Ariake Japan Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	853
200	ARTERIA Networks Corp	Goldman Sachs	(311)
3,800	Aruhi Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,350)
2,200	Aruhi Corp	Goldman Sachs	(782)
(600)	Asahi Group Holdings Ltd	Morgan Stanley	1,876
500	Asahi Holdings Inc	Goldman Sachs	(777)
(600)	Asahi Intecc Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,450
2,600	Asahi Kasei Corp	Goldman Sachs	(1,882)
700	Asahi Kasei Corp	Morgan Stanley	(398)
(400)	Atom Corp	Bank of America Merrill Lynch	46
(800)	Awa Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	675
(5,400)	Awa Bank Ltd	Goldman Sachs	4,556
100	Axial Retailing Inc	Bank of America Merrill Lynch	(128)
200	Axial Retailing Inc	Goldman Sachs	(239)
(100)	Bandai Namco Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	587
(700)	Bank of Kyoto Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,026
(700)	Bank of Kyoto Ltd	Goldman Sachs	1,026
(3,000)	Bank of Kyoto Ltd	Morgan Stanley	3,197
(2,300)	Bank of Nagoya Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,961
(500)	Bank of Nagoya Ltd	Goldman Sachs	426
400	Belc Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(325)

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	Belc Co Ltd	Goldman Sachs	(88)
600	Bell System24 Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(684)
100	Bell System24 Holdings Inc	Goldman Sachs	(139)
300	Belluna Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(105)
500	Belluna Co Ltd	Goldman Sachs	(208)
2,600	Benesse Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,710)
8,000	Benesse Holdings Inc	Goldman Sachs	(14,494)
1,000	Benesse Holdings Inc	Morgan Stanley	(1,048)
1,200	BeNext-Yumeshin Group Co	Goldman Sachs	(224)
400	Bengo4.com Inc	Goldman Sachs	(3,908)
(2,200)	BML Inc	Bank of America Merrill Lynch	6,450
(3,000)	BML Inc	Goldman Sachs	9,059
2,600	Bridgestone Corp	Bank of America Merrill Lynch	(7,294)
2,900	Bridgestone Corp	Goldman Sachs	(8,188)
1,800	Bridgestone Corp	Morgan Stanley	(5,195)
(900)	Bunka Shutter Co Ltd	Goldman Sachs	552
(900)	Bushiroad Inc	Bank of America Merrill Lynch	887
1,300	Calbee Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,175)
2,600	Calbee Inc	Goldman Sachs	(6,465)
1,100	Canon Electronics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,485)
900	Canon Electronics Inc	Goldman Sachs	(1,215)
300	Canon Inc	Goldman Sachs	(257)
2,700	Canon Inc	Morgan Stanley	(2,134)
3,200	Casio Computer Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4,746)
2,500	Casio Computer Co Ltd	Goldman Sachs	(3,708)
5,700	Casio Computer Co Ltd	Morgan Stanley	(5,417)
800	Cawachi Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(732)
6,200	Cawachi Ltd	Goldman Sachs	(8,149)
100	Central Glass Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(142)
(900)	Central Japan Railway Co	Bank of America Merrill Lynch	10,671
(100)	Central Japan Railway Co	Goldman Sachs	1,186
(900)	Central Japan Railway Co	Morgan Stanley	8,472
(400)	Change Inc	Goldman Sachs	1,180
(700)	Chiba Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	274
(3,500)	Chubu Electric Power Co Inc	Morgan Stanley	591
3,200	Chubu Shiryo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,835)
3,500	Chubu Shiryo Co Ltd	Goldman Sachs	(3,069)
1,300	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4,895)
100	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	Morgan Stanley	(341)
7,500	CI Takiron Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,731)
15,200	CI Takiron Corp	Goldman Sachs	(5,535)
(7,000)	COLOPL Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,276
(6,000)	COLOPL Inc	Goldman Sachs	4,128
100	Computer Engineering & Consulting Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(83)
1,100	COMSYS Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,849)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
3,200	COMSYS Holdings Corp	Goldman Sachs	(8,346)
6,300	COMSYS Holdings Corp	Morgan Stanley	(12,869)
1,200	Comture Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,279
1,500	Comture Corp	Goldman Sachs	1,599
(52,500)	Concordia Financial Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	17,251
(5,300)	Concordia Financial Group Ltd	Goldman Sachs	1,742
(4,900)	Concordia Financial Group Ltd	Morgan Stanley	1,001
4	CRE Logistics Inc (REIT)	Goldman Sachs	64
200	Create Restaurants Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(71)
300	Create Restaurants Holdings Inc	Goldman Sachs	(110)
(1,700)	Credit Saison Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,053
(400)	Credit Saison Co Ltd	Goldman Sachs	483
1,700	Cybozu Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,432)
1,400	Cybozu Inc	Goldman Sachs	(5,297)
(600)	Daibiru Corp	Bank of America Merrill Lynch	570
(100)	Daibiru Corp	Goldman Sachs	95
100	Daiho Corp	Goldman Sachs	(163)
(600)	Daiichi Jitsugyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,599
(1,000)	Daiichi Jitsugyo Co Ltd	Goldman Sachs	2,664
300	Daiken Corp	Bank of America Merrill Lynch	(565)
2,100	Daiken Corp	Goldman Sachs	(3,954)
100	Daikin Industries Ltd	Goldman Sachs	(2,131)
700	Dainichiseika Color & Chemicals Manufacturing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,026)
2,900	Dainichiseika Color & Chemicals Manufacturing Co Ltd	Goldman Sachs	(4,250)
(100)	Daio Paper Corp	Bank of America Merrill Lynch	240
100	Daiseki Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(293)
300	Daiseki Co Ltd	Goldman Sachs	(300)
(1,900)	Daishi Hokuetsu Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,623
(1,500)	Daishi Hokuetsu Financial Group Inc	Goldman Sachs	3,419
(18)	Daiwa House Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	90
(100)	Daiwabo Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	188
(1,200)	DCM Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	337
(6,100)	DeNA Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	7,395
(1,300)	DeNA Co Ltd	Goldman Sachs	1,674
(100)	Denka Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	161
2,100	Dentsu Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9,310)
800	Dentsu Group Inc	Goldman Sachs	(3,631)
2,300	Dentsu Group Inc	Morgan Stanley	(7,119)
100	Denyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4
200	Denyo Co Ltd	Goldman Sachs	2
(700)	Descente Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,306
1,200	Dexerials Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,187)
700	Dexerials Corp	Goldman Sachs	(576)
1,900	DIC Corp	Morgan Stanley	(3,710)

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	Digital Arts Inc	Goldman Sachs	(689)
(200)	Digital Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	266
700	Dip Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3,979)
700	Dip Corp	Goldman Sachs	(3,979)
300	Direct Marketing MiX Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,070)
300	Direct Marketing MiX Inc	Goldman Sachs	(329)
4,100	Doshisha Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(6,518)
2,800	Doshisha Co Ltd	Goldman Sachs	(4,451)
(100)	DyDo Group Holdings Inc	Goldman Sachs	488
(100)	Earth Corp	Goldman Sachs	444
(1,700)	East Japan Railway Co	Bank of America Merrill Lynch	4,303
(600)	East Japan Railway Co	Morgan Stanley	250
100	Ebara Corp	Morgan Stanley	(266)
1,500	Ebase Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(546)
1,400	Ebase Co Ltd	Goldman Sachs	(622)
7,000	EDION Corp	Goldman Sachs	(2,611)
(100)	EduLab Inc	Bank of America Merrill Lynch	362
(6,400)	EM Systems Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4,547
(400)	EM Systems Co Ltd	Goldman Sachs	284
300	en Japan Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,701)
600	en Japan Inc	Goldman Sachs	(1,309)
(2,600)	Enigmo Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,101
(10,000)	Enigmo Inc	Goldman Sachs	8,074
100	Enplas Corp	Goldman Sachs	(219)
(300)	eRex Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	277
(1,000)	eRex Co Ltd	Goldman Sachs	728
(200)	ES-Con Japan Ltd	Bank of America Merrill Lynch	100
(1,700)	ESPEC Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,068
(300)	ESPEC Corp	Goldman Sachs	365
400	Ezaki Glico Co Ltd	Goldman Sachs	(1,439)
200	Ezaki Glico Co Ltd	Morgan Stanley	(346)
(1,700)	Fancl Corp	Bank of America Merrill Lynch	(75)
(2,800)	Fancl Corp	Morgan Stanley	4,725
(100)	Fast Retailing Co Ltd	Goldman Sachs	7,496
(200)	Fast Retailing Co Ltd	Morgan Stanley	11,936
2,400	FCC Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,707)
6,500	FCC Co Ltd	Goldman Sachs	(7,331)
400	Financial Products Group Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(147)
400	Financial Products Group Co Ltd	Goldman Sachs	(147)
(700)	Freee KK	Bank of America Merrill Lynch	8,206
(6)	Frontier Real Estate Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	1,010
(19)	Frontier Real Estate Investment Corp (REIT)	Goldman Sachs	3,375
200	Fuji Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(123)
100	Fuji Co Ltd	Goldman Sachs	(78)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(2,600)	Fuji Kyuko Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	22,513
11,200	Fuji Media Holdings Inc	Goldman Sachs	(15,915)
600	Fuji Media Holdings Inc	Morgan Stanley	(597)
300	Fuji Oil Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(448)
(200)	Fujicco Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	127
200	Fujimi Inc	Bank of America Merrill Lynch	(480)
(100)	Fujio Food Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	59
(2,200)	Fujitec Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3,361
(9,700)	Fujitec Co Ltd	Goldman Sachs	14,817
(2,300)	Fujitsu General Ltd	Goldman Sachs	4,228
(5,600)	Fujitsu General Ltd	Morgan Stanley	9,499
100	Fukui Computer Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(213)
(100)	Fukuoka Financial Group Inc	Morgan Stanley	98
(300)	Fukushima Galilei Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,159
(500)	Fukushima Galilei Co Ltd	Goldman Sachs	1,932
(1,200)	Fukuyama Transporting Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4,529
100	FULLCAST Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(393)
100	Funai Soken Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(81)
200	Funai Soken Holdings Inc	Goldman Sachs	(150)
200	Furukawa Electric Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(377)
100	G-7 Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(65)
(300)	GA Technologies Co Ltd	Goldman Sachs	83
100	Gakken Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(60)
900	Geo Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(64)
600	Geo Holdings Corp	Goldman Sachs	26
(1,600)	giftee Inc	Bank of America Merrill Lynch	13,718
1,200	Giken Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4,316)
1,600	Giken Ltd	Goldman Sachs	(5,755)
6,300	Glory Ltd	Goldman Sachs	(13,988)
(19)	GLP J-Reit (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	825
(600)	GNI Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	911
(2,500)	GNI Group Ltd	Goldman Sachs	3,797
1,100	Goldcrest Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(322)
7,400	Goldcrest Co Ltd	Goldman Sachs	(2,169)
(1,700)	Goldwin Inc	Bank of America Merrill Lynch	10,417
(1,000)	Goldwin Inc	Goldman Sachs	6,128
(900)	Gree Inc	Bank of America Merrill Lynch	216
(1,400)	GS Yuasa Corp	Bank of America Merrill Lynch	(293)
(100)	GS Yuasa Corp	Goldman Sachs	(131)
(100)	GS Yuasa Corp	Morgan Stanley	129
(100)	G-Tekt Corp	Bank of America Merrill Lynch	69
(5,300)	GungHo Online Entertainment Inc	Bank of America Merrill Lynch	(38,433)
(1,900)	GungHo Online Entertainment Inc	Goldman Sachs	(6,446)
(1,700)	GungHo Online Entertainment Inc	Morgan Stanley	(3,020)
100	Gunze Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(200)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
日本(続き)			
(400)	H.U. Group Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(350)
3,300	H2O Retailing Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,755)
3,800	H2O Retailing Corp	Goldman Sachs	(3,172)
(17,900)	Hachijuni Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	6,359
(14,700)	Hachijuni Bank Ltd	Goldman Sachs	2,089
(24,000)	Hachijuni Bank Ltd	Morgan Stanley	3,410
100	Halows Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(108)
100	Hamamatsu Photonics KK	Morgan Stanley	(284)
(8)	Hankyu Hanshin Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	614
(28)	Hankyu Hanshin Inc (REIT)	Goldman Sachs	2,114
100	Hanwa Co Ltd	Goldman Sachs	(245)
(100)	Harmonic Drive Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(22)
(500)	Harmonic Drive Systems Inc	Morgan Stanley	44
(1)	Heiwa Real Estate Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	68
(29)	Heiwa Real Estate Inc (REIT)	Goldman Sachs	1,957
1,000	Heiwado Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(987)
900	Heiwado Co Ltd	Goldman Sachs	(1,039)
800	Hikari Tsushin Inc	Morgan Stanley	(14,139)
(3,700)	Hino Motors Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4,962
(900)	Hino Motors Ltd	Goldman Sachs	1,207
(300)	Hino Motors Ltd	Morgan Stanley	328
(200)	Hirata Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,474
(200)	Hirata Corp	Goldman Sachs	1,474
(24,200)	Hirogin Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	7,092
(8,900)	Hirogin Holdings Inc	Goldman Sachs	2,608
(17,800)	Hirogin Holdings Inc	Morgan Stanley	1,897
(100)	Hirose Electric Co Ltd	Goldman Sachs	373
500	HIS Co Ltd	Goldman Sachs	(1,300)
200	Hisamitsu Pharmaceutical Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(204)
700	Hisamitsu Pharmaceutical Co Inc	Goldman Sachs	(715)
1,200	Hisamitsu Pharmaceutical Co Inc	Morgan Stanley	(373)
(800)	Hitachi Construction Machinery Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,771
(100)	Hitachi Construction Machinery Co Ltd	Morgan Stanley	311
(100)	Hitachi Transport System Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(133)
(1,300)	Hitachi Zosen Corp	Bank of America Merrill Lynch	260
(3,000)	Hitachi Zosen Corp	Goldman Sachs	1,522
(5,100)	Hokuetsu Corp	Bank of America Merrill Lynch	3,381
(4,800)	Hokuetsu Corp	Goldman Sachs	3,288
(300)	Hokuto Corp	Bank of America Merrill Lynch	126
5,400	Honda Motor Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(10,503)
9,600	Honda Motor Co Ltd	Goldman Sachs	(18,671)
11,600	Honda Motor Co Ltd	Morgan Stanley	(19,677)
(100)	Horiba Ltd	Bank of America Merrill Lynch	471
(3)	Hoshino Resorts Inc (REIT)	Goldman Sachs	2,025
100	Hoshizaki Corp	Bank of America Merrill Lynch	(382)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
400	Hoshizaki Corp	Goldman Sachs	(1,528)
100	Hoshizaki Corp	Morgan Stanley	(320)
(200)	Hosiden Corp	Bank of America Merrill Lynch	200
(1,400)	Hosokawa Micron Corp	Goldman Sachs	1,964
2,500	Hulic Co Ltd	Goldman Sachs	(1,177)
1,900	Hulic Co Ltd	Morgan Stanley	(861)
(8,600)	Hyakugo Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	985
(6,100)	Hyakugo Bank Ltd	Goldman Sachs	778
(100)	Hyakujushi Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	64
(1,000)	Ibiden Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,332)
(500)	Ibiden Co Ltd	Morgan Stanley	(311)
(700)	Ichigo Inc	Bank of America Merrill Lynch	286
(300)	Idemitsu Kosan Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	264
(200)	Idemitsu Kosan Co Ltd	Goldman Sachs	176
(100)	Iida Group Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	163
(1,600)	Iida Group Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	3,382
(1,500)	Iida Group Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	2,078
(800)	Iino Kaiun Kaisha Ltd	Bank of America Merrill Lynch	15
(200)	Iino Kaiun Kaisha Ltd	Goldman Sachs	(12)
400	Inaba Denki Sangyo Co Ltd	Goldman Sachs	(600)
(600)	Inageya Co Ltd	Goldman Sachs	453
(51)	Industrial & Infrastructure Fund Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	2,536
(1)	Industrial & Infrastructure Fund Investment Corp (REIT)	Morgan Stanley	51
500	Infocom Corp	Bank of America Merrill Lynch	(889)
500	Infocom Corp	Goldman Sachs	(646)
(19,376)	INFRONEER Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,409)
(21,972)	INFRONEER Holdings Inc	Morgan Stanley	12,879
300	Insource Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(271)
100	Internet Initiative Japan Inc	Goldman Sachs	64
100	Internet Initiative Japan Inc	Morgan Stanley	(92)
(11)	Invincible Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	606
(63)	Invincible Investment Corp (REIT)	Goldman Sachs	3,469
(199)	Invincible Investment Corp (REIT)	Morgan Stanley	7,334
(400)	IR Japan Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4,441
(200)	IR Japan Holdings Ltd	Goldman Sachs	2,220
(400)	Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	323
(100)	Ito En Ltd	Bank of America Merrill Lynch	950
2	Itochu Advance Logistics Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	103
1	Itochu Advance Logistics Investment Corp (REIT)	Goldman Sachs	52
4,600	Itochu Enex Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,838)
3,000	Itochu Enex Co Ltd	Goldman Sachs	(1,197)
(500)	Itochu-Shokuhin Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,132
(200)	Itochu-Shokuhin Co Ltd	Goldman Sachs	453

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益 / (損) (米ドル)
	日本 (続き)		
(1,700)	Iwatani Corp	Bank of America Merrill Lynch	9,625
(900)	Iwatani Corp	Goldman Sachs	5,435
(1,500)	Iwatani Corp	Morgan Stanley	5,995
700	JAC Recruitment Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,238)
500	JAC Recruitment Co Ltd	Goldman Sachs	(1,599)
(1,500)	Jaccs Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3,490
(2,300)	Jaccs Co Ltd	Goldman Sachs	5,352
100	JAFCO Group Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(187)
900	JAFCO Group Co Ltd	Goldman Sachs	(1,679)
(1,600)	Japan Airport Terminal Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	13,499
(3,600)	Japan Aviation Electronics Industry Ltd	Morgan Stanley	2,110
(185,700)	Japan Display Inc	Goldman Sachs	1,797
300	Japan Elevator Service Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(326)
200	Japan Elevator Service Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(188)
(19)	Japan Excellent Inc	Goldman Sachs	1,112
(1,200)	Japan Exchange Group Inc	Goldman Sachs	501
(63)	Japan Hotel Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	5,255
(67)	Japan Hotel Investment Corp (REIT)	Goldman Sachs	5,593
(87)	Japan Hotel Investment Corp (REIT)	Morgan Stanley	4,790
(100)	Japan Investment Adviser Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	99
(100)	Japan Investment Adviser Co Ltd	Goldman Sachs	99
600	Japan Lifeline Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(421)
3,800	Japan Lifeline Co Ltd	Goldman Sachs	(4,120)
(1)	Japan Logistics Fund Inc (REIT)	Morgan Stanley	151
100	Japan Material Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	7
200	Japan Material Co Ltd	Goldman Sachs	(34)
(146)	Japan Metropolitan Fund Invest (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	4,236
(22)	Japan Metropolitan Fund Invest (REIT)	Morgan Stanley	488
300	Japan Petroleum Exploration Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(128)
1,100	Japan Post Bank Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(20)
600	Japan Post Bank Co Ltd	Goldman Sachs	14
300	Japan Post Bank Co Ltd	Morgan Stanley	(3)
9,400	Japan Post Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,109)
1,000	Japan Post Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(162)
200	Japan Post Insurance Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(103)
600	Japan Post Insurance Co Ltd	Goldman Sachs	(220)
3,600	Japan Post Insurance Co Ltd	Morgan Stanley	(1,146)
(9)	Japan Prime Realty Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	1,079
(1)	Japan Prime Realty Investment Corp (REIT)	Morgan Stanley	102
(34)	Japan Real Estate Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	5,435
(400)	Japan Steel Works Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(208)
(2,000)	Japan Steel Works Ltd	Goldman Sachs	(2,309)
(2,700)	Japan Steel Works Ltd	Morgan Stanley	(360)
200	Japan Wool Textile Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(119)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
10,500	Japan Wool Textile Co Ltd	Goldman Sachs	(6,248)
(100)	JCR Pharmaceuticals Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	296
(100)	JCR Pharmaceuticals Co Ltd	Morgan Stanley	144
(200)	JDC Corp	Bank of America Merrill Lynch	96
1,600	JGC Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,805)
1,600	JGC Holdings Corp	Goldman Sachs	(1,805)
5,100	JGC Holdings Corp	Morgan Stanley	(4,303)
(100)	JIG-SAW Inc	Goldman Sachs	500
100	JM Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(94)
(200)	J-Oil Mills Inc	Bank of America Merrill Lynch	174
200	Joyful Honda Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(126)
2,500	JSP Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,932)
2,900	JSP Corp	Goldman Sachs	(2,241)
(100)	JSR Corp	Bank of America Merrill Lynch	(31)
(200)	Juroku Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	178
(100)	Juroku Financial Group Inc	Goldman Sachs	89
(1,100)	Justsystems Corp	Bank of America Merrill Lynch	6,155
(900)	Justsystems Corp	Goldman Sachs	5,036
(1,200)	Justsystems Corp	Morgan Stanley	7,034
(3,800)	Kadokawa Corp	Bank of America Merrill Lynch	11,434
(500)	Kadokawa Corp	Goldman Sachs	3,819
(1,500)	Kagome Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3,200
200	Kakaku.com Inc	Bank of America Merrill Lynch	(817)
(800)	Kamakura Shinsho Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,393
(900)	Kameda Seika Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,119
(400)	Kameda Seika Co Ltd	Goldman Sachs	497
700	Kamei Corp	Bank of America Merrill Lynch	(441)
4,300	Kamei Corp	Goldman Sachs	(2,711)
900	Kamigumi Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(927)
900	Kamigumi Co Ltd	Goldman Sachs	(927)
700	Kamigumi Co Ltd	Morgan Stanley	(597)
100	Kanamoto Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(205)
900	Kanamoto Co Ltd	Goldman Sachs	(1,797)
100	Kanematsu Electronics Ltd	Goldman Sachs	(151)
(2,300)	Kansai Electric Power Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	409
(3,000)	Kansai Electric Power Co Inc	Goldman Sachs	533
(5,400)	Kansai Electric Power Co Inc	Morgan Stanley	(192)
1,300	Kansai Paint Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3,579)
3,900	Kansai Paint Co Ltd	Goldman Sachs	(10,737)
(7,200)	Kanto Denka Kogyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(575)
(5,100)	Kanto Denka Kogyo Co Ltd	Goldman Sachs	2,310
(500)	Katakura Industries Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	502
(2,200)	Katakura Industries Co Ltd	Goldman Sachs	1,167
100	Katitas Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(138)
100	Katitas Co Ltd	Goldman Sachs	(138)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(2,200)	Kawasaki Heavy Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3,368
600	KeePer Technical Laboratory Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,652)
500	KeePer Technical Laboratory Co Ltd	Goldman Sachs	(1,377)
(300)	Keihan Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	574
(7,100)	Keikyu Corp	Bank of America Merrill Lynch	10,782
(600)	Keikyu Corp	Goldman Sachs	911
(700)	Keikyu Corp	Morgan Stanley	622
(200)	Keio Corp	Bank of America Merrill Lynch	764
(400)	Keio Corp	Goldman Sachs	1,528
(500)	Keio Corp	Morgan Stanley	844
(3,000)	Keiyo Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	520
(400)	Keiyo Bank Ltd	Goldman Sachs	71
(15,900)	Keiyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3,671
(9,500)	Keiyo Co Ltd	Goldman Sachs	2,194
100	Kewpie Corp	Bank of America Merrill Lynch	(111)
400	Kewpie Corp	Goldman Sachs	(558)
200	Kewpie Corp	Morgan Stanley	(275)
(1,200)	Key Coffee Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,396
(2,200)	Key Coffee Inc	Goldman Sachs	2,560
200	Keyence Corp	Morgan Stanley	5,542
(1,500)	KFC Holdings Japan Ltd	Bank of America Merrill Lynch	939
200	KH Neochem Co Ltd	Goldman Sachs	(414)
(1,100)	Kintetsu Department Store Co Ltd	Goldman Sachs	2,354
(400)	Kintetsu World Express Inc	Bank of America Merrill Lynch	203
(300)	Kintetsu World Express Inc	Goldman Sachs	275
(5,100)	Kirin Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3,363
(2,000)	Kirin Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	861
(1,600)	Kisoji Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,904
(2,500)	Kisoji Co Ltd	Goldman Sachs	2,975
500	Kitanotatsujin Corp	Bank of America Merrill Lynch	(144)
(4,000)	Kiyo Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3,268
(8,500)	Kiyo Bank Ltd	Goldman Sachs	6,951
(400)	Koa Corp	Bank of America Merrill Lynch	409
6,100	Kobe Bussan Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,551)
1,900	Kobe Bussan Co Ltd	Goldman Sachs	(2,570)
3,400	Kobe Bussan Co Ltd	Morgan Stanley	2,543
(1,000)	Koei Tecmo Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	5,995
(100)	Koei Tecmo Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	280
800	Koito Manufacturing Co Ltd	Morgan Stanley	(5,044)
1,000	Kojima Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(89)
300	Kojima Co Ltd	Goldman Sachs	(14)
1,700	KOMEDA Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,615)
2,900	KOMEDA Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(2,756)
100	Komeri Co Ltd	Goldman Sachs	(174)
2,900	Komori Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,060)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益 / (損) (米ドル)
	日本 (続き)		
4,100	Komori Corp	Goldman Sachs	(2,913)
19,700	Konica Minolta Inc	Morgan Stanley	(20,796)
(300)	Konishi Co Ltd	Goldman Sachs	408
1,700	Konoike Transport Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,191)
1,900	Konoike Transport Co Ltd	Goldman Sachs	(1,350)
(600)	Kotobuki Spirits Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	5,542
(600)	Kotobuki Spirits Co Ltd	Goldman Sachs	5,542
(800)	Kotobuki Spirits Co Ltd	Morgan Stanley	7,318
(200)	Kubota Corp	Bank of America Merrill Lynch	(38)
100	Kumagai Gumi Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(175)
800	Kura Sushi Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,813)
700	Kura Sushi Inc	Goldman Sachs	(1,369)
7,900	Kuraray Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(7,670)
9,100	Kuraray Co Ltd	Goldman Sachs	(9,132)
8,800	Kuraray Co Ltd	Morgan Stanley	(5,851)
(100)	Kureha Corp	Goldman Sachs	326
(400)	KYB Corp	Bank of America Merrill Lynch	551
(200)	KYB Corp	Goldman Sachs	259
200	Kyokuto Kaihatsu Kogyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(95)
600	Kyokuto Kaihatsu Kogyo Co Ltd	Goldman Sachs	(339)
(900)	KYORIN Holdings Inc	Goldman Sachs	322
(900)	Kyowa Kirin Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4,276
(900)	Kyushu Railway Co	Morgan Stanley	1,447
(4)	LaSalle Logiport REIT (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	51
700	Lawson Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,487)
900	Lawson Inc	Goldman Sachs	(3,197)
100	Lawson Inc	Morgan Stanley	(275)
(1,200)	LEC Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,343
(12,000)	Leopalace21 Corp	Bank of America Merrill Lynch	4,156
(24,900)	Leopalace21 Corp	Goldman Sachs	8,624
100	Life Corp	Bank of America Merrill Lynch	(182)
700	Life Corp	Goldman Sachs	(1,027)
(100)	Lifenet Insurance Co	Bank of America Merrill Lynch	48
500	LITALICO Inc	Bank of America Merrill Lynch	999
900	LITALICO Inc	Goldman Sachs	1,720
(1,000)	M3 Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,281
(200)	Mabuchi Motor Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	203
400	Maeda Kosen Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(107)
300	Maeda Kosen Co Ltd	Goldman Sachs	(298)
1,600	Makino Milling Machine Co Ltd	Goldman Sachs	(6,323)
200	Mandom Corp	Bank of America Merrill Lynch	(288)
3,500	Mandom Corp	Goldman Sachs	(5,036)
200	Mani Inc	Goldman Sachs	(409)
5,300	Marubeni Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,531
11,500	Marubeni Corp	Goldman Sachs	(204)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
14,600	Marubeni Corp	Morgan Stanley	(3,825)
(1,300)	Marui Group Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,628
(100)	Maruwa Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	409
(500)	Maruwa Co Ltd	Goldman Sachs	2,043
500	Maruwa Unyu Kikan Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(608)
500	Maruwa Unyu Kikan Co Ltd	Goldman Sachs	(608)
400	Maruwa Unyu Kikan Co Ltd	Morgan Stanley	(444)
300	Maruzen Showa Unyu Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(773)
100	Maruzen Showa Unyu Co Ltd	Goldman Sachs	(258)
(1,000)	Marvelous Inc	Bank of America Merrill Lynch	346
(1,300)	Matsui Securities Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	369
(2,600)	Matsui Securities Co Ltd	Morgan Stanley	785
(1,300)	MatsukiyoCocokara & Co	Bank of America Merrill Lynch	4,984
(150)	MatsukiyoCocokara & Co	Goldman Sachs	249
(11,500)	Matsuya Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	13,583
(400)	Matsuyafoods Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	364
(200)	Matsuyafoods Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	314
100	Max Co Ltd	Goldman Sachs	(56)
300	Maxell Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(192)
(500)	MCJ Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	657
(1,100)	MCJ Co Ltd	Goldman Sachs	1,446
800	Medical Data Vision Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,208)
500	Medical Data Vision Co Ltd	Goldman Sachs	(755)
(1,000)	Medipal Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	17
(200)	Medipal Holdings Corp	Goldman Sachs	5
100	Medley Inc	Bank of America Merrill Lynch	(536)
200	Medley Inc	Goldman Sachs	(1,073)
(300)	MedPeer Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,319
(200)	MedPeer Inc	Goldman Sachs	879
100	Megmilk Snow Brand Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(114)
200	Megmilk Snow Brand Co Ltd	Goldman Sachs	(240)
(100)	Meidensha Corp	Bank of America Merrill Lynch	127
(300)	Meidensha Corp	Goldman Sachs	415
(600)	Meiko Electronics Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4,668)
2,900	Meisei Industrial Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	489
5,900	Meisei Industrial Co Ltd	Goldman Sachs	993
(100)	Melco Holdings Inc	Goldman Sachs	369
(8,400)	Mie Kotsu Group Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,940
200	Mimasu Semiconductor Industry Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(208)
300	Mimasu Semiconductor Industry Co Ltd	Goldman Sachs	(519)
(12,200)	MINEBEA MITSUMI Inc	Bank of America Merrill Lynch	17,294
(600)	MINEBEA MITSUMI Inc	Goldman Sachs	853
(1,300)	MINEBEA MITSUMI Inc	Morgan Stanley	2,425
(1,600)	Mitani Sekisan Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4,263
(200)	Mitani Sekisan Co Ltd	Goldman Sachs	533

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
500	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,210)
1,800	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Goldman Sachs	(4,356)
2,000	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Morgan Stanley	(4,805)
(100)	Mitsubishi Logisnext Co Ltd	Goldman Sachs	108
(100)	Mitsubishi Logistics Corp	Bank of America Merrill Lynch	218
44,200	Mitsubishi Motors Corp	Bank of America Merrill Lynch	(14,131)
61,000	Mitsubishi Motors Corp	Goldman Sachs	(19,503)
20,200	Mitsubishi Motors Corp	Morgan Stanley	(5,202)
100	Mitsubishi Pencil Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	11
600	Mitsubishi Pencil Co Ltd	Goldman Sachs	(210)
(9,200)	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	Morgan Stanley	2,280
2,100	Mitsuboshi Belting Ltd	Goldman Sachs	(1,343)
5,900	Mitsui DM Sugar Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(6,969)
(3,900)	Mitsui Fudosan Co Ltd	Goldman Sachs	10,928
(22)	Mitsui Fudosan Logistics Park Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	977
(5)	Mitsui Fudosan Logistics Park Inc (REIT)	Morgan Stanley	488
(400)	Mitsui High-Tec Inc	Bank of America Merrill Lynch	853
(700)	Mitsui High-Tec Inc	Morgan Stanley	870
300	Mitsui OSK Lines Ltd	Goldman Sachs	(266)
100	Mitsui-Soko Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(105)
(1,800)	Mitsuuroko Group Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	2,046
(200)	Mixi Inc	Goldman Sachs	369
100	Mizuho Leasing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(126)
100	Mizuno Corp	Bank of America Merrill Lynch	(214)
300	Mochida Pharmaceutical Co Ltd	Goldman Sachs	(759)
(1,400)	Modec Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,670
(1,300)	Modec Inc	Goldman Sachs	1,593
100	Money Forward Inc	Bank of America Merrill Lynch	(98)
100	Monogatari Corp	Goldman Sachs	(266)
(102)	Mori Hills Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	4,125
(6)	Mori Trust Hotel Reit Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	645
(4)	Mori Trust Hotel Reit Inc (REIT)	Goldman Sachs	430
(1)	Mori Trust Sogo Reit Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	34
(4)	Mori Trust Sogo Reit Inc (REIT)	Goldman Sachs	135
(200)	Morinaga Milk Industry Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,083
(4,300)	Morinaga Milk Industry Co Ltd	Morgan Stanley	12,602
4,200	Morita Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(5,312)
2,600	Morita Holdings Corp	Goldman Sachs	(3,325)
200	MOS Food Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(222)
1,900	MOS Food Services Inc	Goldman Sachs	(2,109)
3,300	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9,734)
7,600	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	Goldman Sachs	(22,170)
7,300	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	Morgan Stanley	(14,731)
(100)	MTI Ltd	Bank of America Merrill Lynch	49
(600)	Musashi Seimitsu Industry Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	743

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益 / (損) (米ドル)
	日本 (続き)		
(1,000)	Musashi Seimitsu Industry Co Ltd	Goldman Sachs	986
(500)	Musashino Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	485
(300)	Musashino Bank Ltd	Goldman Sachs	381
(100)	Nagase & Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	74
(1,300)	Nagatanien Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	808
(200)	Nagatanien Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	124
100	Nankai Electric Railway Co Ltd	Goldman Sachs	(141)
(300)	Nanto Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	274
200	NEC Corp	Goldman Sachs	(746)
800	NEC Corp	Morgan Stanley	(1,066)
(2,000)	NEC Networks & System Integration Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,029
(100)	Nexon Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	137
(200)	NH Foods Ltd	Bank of America Merrill Lynch	440
500	Nichicon Corp	Bank of America Merrill Lynch	22
900	Nichicon Corp	Goldman Sachs	40
(300)	Nichiden Corp	Goldman Sachs	288
100	Nichireki Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	41
(2,600)	Nidec Corp	Bank of America Merrill Lynch	3,002
(2,600)	Nidec Corp	Morgan Stanley	7,735
1,000	Nihon Kohden Corp	Bank of America Merrill Lynch	(710)
1,700	Nihon Kohden Corp	Goldman Sachs	(1,208)
1,200	Nihon Kohden Corp	Morgan Stanley	(1,545)
2,100	Nihon Nohyaku Co Ltd	Goldman Sachs	(727)
(100)	Nikkiso Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	69
100	Nikkon Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(104)
5,600	Nikon Corp	Bank of America Merrill Lynch	(746)
1,700	Nikon Corp	Goldman Sachs	(226)
8,700	Nikon Corp	Morgan Stanley	(2,936)
500	Nippon Corp	Goldman Sachs	(209)
(36)	Nippon Building Fund Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	4,796
(2)	Nippon Building Fund Inc (REIT)	Morgan Stanley	409
(400)	Nippon Carbon Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	784
(700)	Nippon Ceramic Co Ltd	Goldman Sachs	852
100	Nippon Densetsu Kogyo Co Ltd	Goldman Sachs	(79)
(3,600)	Nippon Electric Glass Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,399)
(800)	Nippon Electric Glass Co Ltd	Goldman Sachs	(1,385)
(500)	Nippon Electric Glass Co Ltd	Morgan Stanley	826
1,900	Nippon Gas Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(763)
12,100	Nippon Gas Co Ltd	Goldman Sachs	(3,881)
(23,800)	Nippon Kayaku Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	23,210
(1,500)	Nippon Kayaku Co Ltd	Goldman Sachs	1,465
(6,200)	Nippon Kayaku Co Ltd	Morgan Stanley	5,726
7,780	Nippon Light Metal Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(10,157)
400	Nippon Paint Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(98)
4,900	Nippon Paper Industries Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(5,232)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
5,100	Nippon Paper Industries Co Ltd	Goldman Sachs	(5,028)
(400)	Nippon Road Co Ltd	Goldman Sachs	959
(900)	Nippon Sanso Holdings Corp	Morgan Stanley	2,246
(800)	Nippon Sheet Glass Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	493
(400)	Nippon Sheet Glass Co Ltd	Goldman Sachs	295
(100)	Nippon Shokubai Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	400
(1,800)	Nippon Steel Corp	Bank of America Merrill Lynch	4,215
(600)	Nippon Steel Corp	Goldman Sachs	1,148
(2,100)	Nippon Steel Corp	Morgan Stanley	3,031
14,200	Nippon Television Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(19,799)
5,700	Nippon Television Holdings Inc	Goldman Sachs	(7,948)
15,400	Nippon Television Holdings Inc	Morgan Stanley	(14,771)
1,400	Nishimatsuya Chain Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	116
2,100	Nishimatsuya Chain Co Ltd	Goldman Sachs	(480)
(100)	Nishi-Nippon Financial Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	61
(8,500)	Nishi-Nippon Railroad Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	16,079
(700)	Nishi-Nippon Railroad Co Ltd	Goldman Sachs	1,324
(100)	Nishi-Nippon Railroad Co Ltd	Morgan Stanley	157
100	Nishio Rent All Co Ltd	Goldman Sachs	(185)
(100)	Nissan Chemical Corp	Bank of America Merrill Lynch	355
3,800	Nissan Shatai Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,194)
800	Nissan Shatai Co Ltd	Goldman Sachs	(462)
(300)	Nissha Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	429
(3,300)	Nissin Electric Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,202)
(3,900)	Nissin Electric Co Ltd	Goldman Sachs	2,286
600	Nitori Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(16,172)
200	Nitori Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(5,391)
900	Nitori Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(22,500)
900	Nitto Boseki Co Ltd	Goldman Sachs	(5,547)
1,600	Nitto Kogyo Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,731)
4,600	Nitto Kogyo Corp	Goldman Sachs	(4,918)
1,300	Nitto Kohki Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(866)
600	Nitto Kohki Co Ltd	Goldman Sachs	(400)
(1,900)	Nittoku Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4,978
(200)	Nittoku Co Ltd	Goldman Sachs	524
(100)	Noevir Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	311
2,700	NOK Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,973)
1,200	NOK Corp	Goldman Sachs	(1,321)
2,400	NOK Corp	Morgan Stanley	(2,217)
(6,100)	Nomura Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,408
(1,500)	Nomura Holdings Inc	Morgan Stanley	210
(28)	Nomura Real Estate Master Fund Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	1,690
(3)	Nomura Real Estate Master Fund Inc (REIT)	Goldman Sachs	183
(400)	Nomura Research Institute Ltd	Bank of America Merrill Lynch	180

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)	Nomura Research Institute Ltd	Morgan Stanley	142
(200)	Noritake Co Ltd	Goldman Sachs	222
300	Noritsu Koki Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,012
200	Noritsu Koki Co Ltd	Goldman Sachs	675
(42,800)	North Pacific Bank Ltd	Goldman Sachs	-
(100)	NS United Kaiun Kaisha Ltd	Bank of America Merrill Lynch	67
(200)	NSD Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	119
1,500	NSK Ltd	Bank of America Merrill Lynch	197
400	NSK Ltd	Goldman Sachs	(58)
(100)	NTT Data Corp	Bank of America Merrill Lynch	114
(600)	NTT Data Corp	Goldman Sachs	682
(1)	NTT UD Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	40
500	Obara Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,451)
1,600	Obara Group Inc	Goldman Sachs	(4,276)
24,000	Obayashi Corp	Goldman Sachs	(19,609)
10,800	Obayashi Corp	Morgan Stanley	(5,659)
400	Obic Co Ltd	Morgan Stanley	(3,446)
(1,700)	Odakyu Electric Railway Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,597
(800)	Ogaki Kyoritsu Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	657
(100)	Ogaki Kyoritsu Bank Ltd	Goldman Sachs	116
2,700	Oiles Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,415)
3,200	Oiles Corp	Goldman Sachs	(1,677)
(100)	Oisix ra daichi Inc	Goldman Sachs	144
(5,600)	Oji Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,089
(17,500)	Oji Holdings Corp	Goldman Sachs	10,413
(16,600)	Oji Holdings Corp	Morgan Stanley	6,339
(1,700)	Okamura Corp	Bank of America Merrill Lynch	4,605
(6,400)	Okamura Corp	Goldman Sachs	5,172
6,700	Oki Electric Industry Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(6,593)
9,100	Oki Electric Industry Co Ltd	Goldman Sachs	(7,182)
(1,300)	Okinawa Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,478
(2,300)	Okinawa Financial Group Inc	Goldman Sachs	2,615
400	Okuwa Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(150)
2,000	Omron Corp	Goldman Sachs	(6,128)
1,100	Omron Corp	Morgan Stanley	(3,224)
(400)	Open Door Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,401
(200)	Open House Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	906
(600)	Open House Co Ltd	Morgan Stanley	3,144
100	Optex Group Co Ltd	Goldman Sachs	2
300	Optim Corp	Bank of America Merrill Lynch	(722)
400	Optim Corp	Goldman Sachs	(963)
(100)	Organo Corp	Goldman Sachs	426
(6,300)	Orient Corp	Bank of America Merrill Lynch	659
(28,400)	Orient Corp	Goldman Sachs	4,792
(82,400)	Orient Corp	Morgan Stanley	8,041

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益 / (損) (米ドル)
	日本 (続き)		
(10,100)	ORIX Corp	Bank of America Merrill Lynch	8,272
(4,000)	ORIX Corp	Goldman Sachs	3,215
(2,500)	ORIX Corp	Morgan Stanley	2,476
(7)	Orix JREIT Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	248
(300)	Osaka Gas Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(5)
100	Osaka Organic Chemical Industry Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(249)
200	Osaka Soda Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(343)
200	Osaka Soda Co Ltd	Goldman Sachs	(343)
100	Pack Corp	Bank of America Merrill Lynch	(140)
100	PAL GROUP Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(52)
(100)	Pan Pacific International Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	239
(300)	Pasona Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	480
(500)	Pasona Group Inc	Goldman Sachs	799
900	PeptiDream Inc	Goldman Sachs	(552)
(1,800)	Pharma Foods International Co Ltd	Goldman Sachs	5,977
(200)	Pilot Corp	Bank of America Merrill Lynch	109
(100)	Pilot Corp	Goldman Sachs	83
3,600	Piolax Inc	Goldman Sachs	(4,444)
100	Plaid Inc	Bank of America Merrill Lynch	(329)
(100)	PR Times Inc	Goldman Sachs	329
(300)	Premier Anti-Aging Co Ltd	Goldman Sachs	5,441
(1,900)	Pressance Corp	Bank of America Merrill Lynch	(118)
(200)	Pressance Corp	Goldman Sachs	(12)
1,500	Prestige International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,146)
2,900	Prestige International Inc	Goldman Sachs	(2,215)
(1,900)	Prima Meat Packers Ltd	Goldman Sachs	3,527
(100)	Proto Corp	Bank of America Merrill Lynch	77
(3,800)	Qol Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4,691
(1,300)	Qol Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	1,605
(1,600)	Raito Kogyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(583)
(100)	Raksul Inc	Bank of America Merrill Lynch	861
500	Rakus Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,778)
500	Rakus Co Ltd	Goldman Sachs	(1,897)
2,300	Rakus Co Ltd	Morgan Stanley	(10,977)
(1,500)	Rakuten Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,166
(1,900)	Rakuten Group Inc	Goldman Sachs	670
2,300	Recruit Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(7,476)
5,400	Recruit Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(56,110)
5,800	Ricoh Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(7,753)
3,200	Ricoh Co Ltd	Goldman Sachs	(3,837)
4,400	Ricoh Co Ltd	Morgan Stanley	(1,680)
1,100	Ricoh Leasing Co Ltd	Goldman Sachs	(782)
(100)	Riken Keiki Co Ltd	Goldman Sachs	(1,652)
(400)	Ringer Hut Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	334
(700)	Riso Kagaku Corp	Bank of America Merrill Lynch	361

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(400)	Rohto Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	266
(300)	Rohto Pharmaceutical Co Ltd	Morgan Stanley	400
100	Roland Corp	Goldman Sachs	(502)
1,100	Round One Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,296)
1,100	Round One Corp	Goldman Sachs	(2,296)
(300)	RS Technologies Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	986
(200)	RS Technologies Co Ltd	Goldman Sachs	657
400	Ryobi Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(328)
1,800	Ryobi Ltd	Goldman Sachs	(1,806)
(6,300)	Ryohin Keikaku Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	24,838
(600)	Ryohin Keikaku Co Ltd	Goldman Sachs	1,359
(3,800)	Ryohin Keikaku Co Ltd	Morgan Stanley	6,783
(2,300)	Saibu Gas Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,206
(800)	Saibu Gas Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	767
600	Saizeriya Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(687)
300	Saizeriya Co Ltd	Goldman Sachs	(344)
300	Sakai Moving Service Co Ltd	Goldman Sachs	(946)
100	Sakata Seed Corp	Bank of America Merrill Lynch	(107)
600	SAMTY Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,092)
800	SAMTY Co Ltd	Goldman Sachs	(1,508)
(1)	Samty Residential Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	26
(3,500)	San-Ai Oil Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,953
(2,100)	SanBio Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3,070
200	Sanken Electric Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(142)
600	Sanken Electric Co Ltd	Goldman Sachs	(426)
(2,800)	Sansan Inc	Bank of America Merrill Lynch	9,512
100	Sanshin Electronics Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(112)
(5,200)	Sapporo Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	7,528
(1,600)	Sapporo Holdings Ltd	Goldman Sachs	2,316
(4,500)	Sapporo Holdings Ltd	Morgan Stanley	4,876
(100)	Sawai Group Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	240
200	Secom Co Ltd	Goldman Sachs	(572)
4,100	Sega Sammy Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,949)
2,200	Sega Sammy Holdings Inc	Goldman Sachs	(1,583)
400	Seiko Epson Corp	Goldman Sachs	(373)
2,100	Seiko Epson Corp	Morgan Stanley	(2,275)
300	Seino Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(198)
(700)	Seiren Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	155
(5,900)	Seiren Co Ltd	Goldman Sachs	1,310
(700)	Sekisui Chemical Co Ltd	Morgan Stanley	329
1,700	Sekisui House Ltd	Goldman Sachs	(3,027)
3,300	Sekisui House Ltd	Morgan Stanley	(5,407)
200	Sekisui Jushi Corp	Goldman Sachs	(216)
(2,600)	Septeni Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,801
(2,100)	Septeni Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	1,455

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
400	Seria Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(376)
300	Seria Co Ltd	Goldman Sachs	(369)
200	SG Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(345)
(2,500)	Sharp Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,622
(700)	Sharp Corp	Goldman Sachs	507
(100)	Shibaura Machine Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3
(100)	SHIFT Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,948
(100)	Shiga Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	116
(1,600)	Shima Seiki Manufacturing Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4,078
(300)	Shima Seiki Manufacturing Ltd	Goldman Sachs	765
2,900	Shimadzu Corp	Morgan Stanley	(5,151)
100	Shin-Etsu Polymer Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(60)
100	Shin-Etsu Polymer Co Ltd	Goldman Sachs	(66)
(6,600)	Shinko Electric Industries Co Ltd	Morgan Stanley	(586)
2,100	Shinnihonseiyaku Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(9,808)
3,000	Shinnihonseiyaku Co Ltd	Goldman Sachs	(5,562)
(1,200)	Shinsei Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(948)
(2,300)	Shionogi & Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4,799)
(700)	Shionogi & Co Ltd	Goldman Sachs	(2,773)
(200)	Shionogi & Co Ltd	Morgan Stanley	284
(300)	Ship Healthcare Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	425
(100)	Ship Healthcare Holdings Inc	Morgan Stanley	81
(3,400)	Shizuoka Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,869
(600)	Shizuoka Bank Ltd	Goldman Sachs	506
(300)	Shizuoka Bank Ltd	Morgan Stanley	128
(100)	Shizuoka Gas Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	236
(5,200)	Shizuoka Gas Co Ltd	Goldman Sachs	5,080
(400)	Shochiku Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4,689
(700)	Shochiku Co Ltd	Goldman Sachs	8,206
(500)	Shochiku Co Ltd	Morgan Stanley	3,153
100	Shoei Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(317)
100	Shoei Foods Corp	Bank of America Merrill Lynch	(253)
(1,000)	Showa Denko KK	Bank of America Merrill Lynch	2,860
(300)	Showa Sangyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	528
800	Skylark Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(412)
900	SoftBank Group Corp	Bank of America Merrill Lynch	(7,460)
1,800	SoftBank Group Corp	Goldman Sachs	(14,143)
600	SoftBank Group Corp	Morgan Stanley	(4,220)
400	Sohgo Security Services Co Ltd	Morgan Stanley	(853)
500	Sojitz Corp	Bank of America Merrill Lynch	(293)
(2,200)	Sony Group Corp	Bank of America Merrill Lynch	5,404
(700)	Sony Group Corp	Goldman Sachs	1,679
(3,000)	Sony Group Corp	Morgan Stanley	12,123
200	Sosei Group Corp	Bank of America Merrill Lynch	(237)
200	Sotetsu Holdings Inc	Morgan Stanley	(199)

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)	Sourcenext Corp	Goldman Sachs	40
(1,100)	Sparx Group Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	113
900	S-Pool Inc	Bank of America Merrill Lynch	64
1,400	S-Pool Inc	Goldman Sachs	(34)
(1,400)	Square Enix Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	6,714
(300)	Stanley Electric Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	845
(8)	Starts Proceed Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	597
(6)	Starts Proceed Investment Corp (REIT)	Goldman Sachs	448
600	Starzen Co Ltd	Goldman Sachs	(858)
500	Strike Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(133)
2,700	Strike Co Ltd	Goldman Sachs	(719)
5,200	Subaru Corp	Bank of America Merrill Lynch	(7,348)
11,000	Subaru Corp	Goldman Sachs	(6,838)
10,600	Subaru Corp	Morgan Stanley	(14,074)
5,600	Sumitomo Chemical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,586)
55,000	Sumitomo Chemical Co Ltd	Goldman Sachs	(25,400)
51,300	Sumitomo Chemical Co Ltd	Morgan Stanley	(14,579)
300	Sumitomo Densetsu Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(181)
200	Sumitomo Densetsu Co Ltd	Goldman Sachs	(121)
300	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(519)
100	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	Morgan Stanley	(159)
3,000	Sumitomo Mitsui Construction Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	93
1,800	Sumitomo Mitsui Construction Co Ltd	Goldman Sachs	64
14,800	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	Morgan Stanley	(15,302)
1,400	Sumitomo Osaka Cement Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(124)
2,400	Sumitomo Osaka Cement Co Ltd	Goldman Sachs	(213)
(4,400)	Sumitomo Realty & Development Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	16,060
(100)	Sumitomo Realty & Development Co Ltd	Goldman Sachs	365
(4,500)	Sumitomo Realty & Development Co Ltd	Morgan Stanley	13,908
(3,200)	Sumitomo Rubber Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,352
1,700	Sumitomo Seika Chemicals Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,038)
1,000	Sumitomo Seika Chemicals Co Ltd	Goldman Sachs	(1,199)
(2,100)	Sun Corp	Goldman Sachs	6,994
1,800	Sun Frontier Fudousan Co Ltd	Goldman Sachs	(1,439)
400	Sundrug Co Ltd	Morgan Stanley	(679)
4,600	Suntory Beverage & Food Ltd	Goldman Sachs	(21,039)
3,500	Suntory Beverage & Food Ltd	Morgan Stanley	(13,210)
(2,400)	Suruga Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3
(4,900)	Suruga Bank Ltd	Goldman Sachs	50
(1,700)	Suzuki Motor Corp	Bank of America Merrill Lynch	8,893
300	Systemex Corp	Bank of America Merrill Lynch	653
800	Systemex Corp	Goldman Sachs	1,741
500	Systemex Corp	Morgan Stanley	(3,508)
(1,500)	T Hasegawa Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4,170
(5,400)	T Hasegawa Co Ltd	Goldman Sachs	15,011

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
700	T&D Holdings Inc	Goldman Sachs	(615)
(1,600)	Tadano Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,044
(8,200)	Tadano Ltd	Goldman Sachs	10,497
200	Taikisha Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(162)
400	Taikisha Ltd	Goldman Sachs	(323)
(800)	Taiko Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	384
(4,100)	Taiko Pharmaceutical Co Ltd	Goldman Sachs	1,966
3,400	Taisei Corp	Bank of America Merrill Lynch	(11,685)
4,700	Taisei Corp	Goldman Sachs	(16,367)
800	Taisei Corp	Morgan Stanley	(1,670)
(300)	Taiyo Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	200
3,700	Takamatsu Construction Group Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,479)
(8)	Takara Leben Real Estate Investment Corp	Bank of America Merrill Lynch	102
300	Takara Standard Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(226)
200	Takara Standard Co Ltd	Goldman Sachs	(110)
(400)	Takasago International Corp	Bank of America Merrill Lynch	387
(300)	Taki Chemical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,732
(700)	Taki Chemical Co Ltd	Goldman Sachs	4,041
1,700	Takuma Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3,050)
3,700	Takuma Co Ltd	Goldman Sachs	(6,638)
(100)	Tama Home Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(24)
100	Tatsuta Electric Wire and Cable Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(27)
(100)	TechMatrix Corp	Bank of America Merrill Lynch	68
(100)	TechMatrix Corp	Goldman Sachs	15
(500)	TechnoPro Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,896
(100)	TechnoPro Holdings Inc	Morgan Stanley	361
(500)	Tenma Corp	Bank of America Merrill Lynch	937
(3,100)	Tenma Corp	Goldman Sachs	5,809
600	Toa Corp	Bank of America Merrill Lynch	(842)
200	Toa Corp	Goldman Sachs	(281)
(100)	Tocalo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	82
(400)	Tocalo Co Ltd	Goldman Sachs	362
200	Toei Animation Co Ltd	Goldman Sachs	(2,442)
(300)	Toei Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	8,792
(900)	Toei Co Ltd	Goldman Sachs	26,377
(1,800)	Toho Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	6,554
(1,200)	Toho Co Ltd	Goldman Sachs	4,369
100	Toho Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(22)
200	Toho Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(95)
1,100	Toho Titanium Co Ltd	Goldman Sachs	(1,417)
(14,000)	Tokai Carbon Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	22,658
(5,300)	Tokai Carbon Co Ltd	Goldman Sachs	7,531
(12,800)	Tokai Carbon Co Ltd	Morgan Stanley	11,368
100	Tokai Corp	Goldman Sachs	(102)
(300)	Token Corp	Goldman Sachs	1,439

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(17,500)	Tokyo Electric Power Co Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	155
(87,900)	Tokyo Electric Power Co Holdings Inc	Morgan Stanley	3,903
100	Tokyo Electron Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,465
400	Tokyo Gas Co Ltd	Goldman Sachs	(174)
(4,300)	Tokyo Tatemono Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,750
(200)	Tokyo Tatemono Co Ltd	Goldman Sachs	128
(11,500)	Tokyo Tatemono Co Ltd	Morgan Stanley	8,885
(12,000)	Tokyu Corp	Bank of America Merrill Lynch	8,599
(1,000)	Tokyu Corp	Goldman Sachs	1,292
(1,200)	Tokyu Corp	Morgan Stanley	1,375
(23,300)	Tokyu Fudosan Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	19,865
(10,000)	Tokyu Fudosan Holdings Corp	Goldman Sachs	5,950
(7)	Tokyu Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	427
(15,900)	TOMONY Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,412
(7,500)	TOMONY Holdings Inc	Goldman Sachs	666
(2,600)	Tomy Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,749
(700)	Tomy Co Ltd	Goldman Sachs	479
(100)	Topcon Corp	Goldman Sachs	196
(200)	Toppan Forms Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	-
(800)	Toppan Forms Co Ltd	Goldman Sachs	-
700	Toppan Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,660)
3,300	Toppan Inc	Goldman Sachs	(4,159)
1,100	Toppan Inc	Morgan Stanley	(1,241)
(400)	Torii Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	757
(500)	Torii Pharmaceutical Co Ltd	Goldman Sachs	946
300	Tosei Corp	Bank of America Merrill Lynch	(219)
(2,500)	Tosoh Corp	Bank of America Merrill Lynch	3,308
(400)	Tosoh Corp	Goldman Sachs	529
(500)	Tosoh Corp	Morgan Stanley	577
(200)	Towa Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	320
(600)	Toyo Tanso Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	799
(200)	Toyo Tire Corp	Bank of America Merrill Lynch	419
100	Toyobo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(121)
1,800	Toyobo Co Ltd	Goldman Sachs	(2,174)
(1,200)	Toyota Boshoku Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,146
3,000	TPR Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3,757)
4,500	TPR Co Ltd	Goldman Sachs	(5,635)
(100)	Transcosmos Inc	Bank of America Merrill Lynch	55
4,300	Trend Micro Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,783)
3,600	Trend Micro Inc	Goldman Sachs	(7,353)
100	Tri Chemical Laboratories Inc	Bank of America Merrill Lynch	(89)
400	Tri Chemical Laboratories Inc	Goldman Sachs	(355)
1,600	Trusco Nakayama Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,407)
1,900	Trusco Nakayama Corp	Goldman Sachs	(1,671)
(100)	Tsugami Corp	Bank of America Merrill Lynch	140

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(2,100)	Tsugami Corp	Goldman Sachs	2,126
400	Tsukishima Kikai Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(391)
300	Tsukishima Kikai Co Ltd	Goldman Sachs	(293)
(100)	Tsumura & Co	Bank of America Merrill Lynch	409
200	TV Asahi Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(440)
300	TV Asahi Holdings Corp	Goldman Sachs	(661)
300	TV Asahi Holdings Corp	Morgan Stanley	(370)
400	UACJ Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,261)
700	UACJ Corp	Goldman Sachs	(2,207)
(200)	Uchida Yoko Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	595
(300)	Uchida Yoko Co Ltd	Goldman Sachs	893
(100)	Ulvac Inc	Bank of America Merrill Lynch	185
(600)	Union Tool Co	Goldman Sachs	1,785
1,000	Unipres Corp	Bank of America Merrill Lynch	(702)
6,400	Unipres Corp	Goldman Sachs	(4,490)
700	United Arrows Ltd	Goldman Sachs	(1,013)
100	UT Group Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(226)
1,300	Uzabase Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,140)
4,100	Uzabase Inc	Goldman Sachs	(9,574)
(400)	V Cube Inc	Bank of America Merrill Lynch	682
(5,600)	V-Cube Inc	Goldman Sachs	9,549
300	Vector Inc	Goldman Sachs	(140)
2,100	Wacoal Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,985)
4,400	Wacoal Holdings Corp	Goldman Sachs	(6,587)
500	Wakita & Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(66)
300	Wakita & Co Ltd	Goldman Sachs	(35)
(800)	WealthNavi Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,444
1,400	Welcia Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(3,730)
400	Welcia Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(1,048)
900	World Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,008)
(200)	World Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	426
(200)	World Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	426
400	Xebio Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(291)
3,700	Xebio Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(2,694)
13,900	Yamada Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3,454)
8,200	Yamada Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(2,055)
21,700	Yamada Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(2,313)
300	Yamaguchi Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(96)
4,000	Yamaguchi Financial Group Inc	Goldman Sachs	(675)
9,800	Yamaguchi Financial Group Inc	Morgan Stanley	(2,089)
100	YA-MAN Ltd	Goldman Sachs	(139)
(600)	Yamashin-Filter Corp	Bank of America Merrill Lynch	453
(5,200)	Yamato Kogyo Co Ltd	Morgan Stanley	10,391
500	Yaskawa Electric Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,496)
800	Yaskawa Electric Corp	Morgan Stanley	(1,649)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
日本(続き)			
(200)	Yodogawa Steel Works Ltd	Bank of America Merrill Lynch	233
(100)	Yodogawa Steel Works Ltd	Goldman Sachs	143
100	Yokogawa Bridge Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(44)
(1,900)	Yokowo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,025)
(1,000)	Yokowo Co Ltd	Goldman Sachs	(1,066)
200	Yondoshi Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(86)
200	Yondoshi Holdings Inc	Goldman Sachs	(123)
(5,200)	Yonex Co Ltd	Goldman Sachs	(1,108)
1,100	Yuasa Trading Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,335)
800	Yuasa Trading Co Ltd	Goldman Sachs	(954)
3,500	Yurtec Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,609)
11,100	Yurtec Corp	Goldman Sachs	(5,202)
(2,700)	Z Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	863
(600)	Zeon Corp	Bank of America Merrill Lynch	676
4,500	ZIGExN Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3,037)
6,600	ZIGExN Co Ltd	Goldman Sachs	(4,455)
100	Zuken Inc	Goldman Sachs	(353)
			(51,628)
オランダ			
4,340	ABN AMRO Bank NV - CVA	Bank of America Merrill Lynch	(2,812)
1,949	ABN AMRO Bank NV - CVA	Goldman Sachs	(871)
3,103	ABN AMRO Bank NV - CVA	Morgan Stanley	(1,624)
(44)	Accell Group NV	Bank of America Merrill Lynch	(11)
(270)	Alfen Beheer BV	Bank of America Merrill Lynch	(353)
(33)	Alfen Beheer BV	Goldman Sachs	(43)
(53)	Alfen Beheer BV	Morgan Stanley	(27)
428	Arcadis NV	Goldman Sachs	257
(9,345)	ArcelorMittal SA	Bank of America Merrill Lynch	29,560
(1,102)	ArcelorMittal SA	Goldman Sachs	3,486
231	ASML Holding NV	Morgan Stanley	3,699
783	ASR Nederland NV	Bank of America Merrill Lynch	(1,867)
1,017	ASR Nederland NV	Goldman Sachs	(2,135)
291	ASR Nederland NV	Morgan Stanley	(643)
(139)	B&S Group Sarl	Bank of America Merrill Lynch	67
217	Basic-Fit NV	Bank of America Merrill Lynch	(220)
267	Basic-Fit NV	Goldman Sachs	(897)
(55)	BE Semiconductor Industries NV	Bank of America Merrill Lynch	(78)
(1,452)	Boskalis Westminster	Goldman Sachs	2,313
188	Brunel International NV	Bank of America Merrill Lynch	(84)
(53)	CM.com NV	Goldman Sachs	(29)
(52)	Flow Traders	Bank of America Merrill Lynch	(42)
(317)	Flow Traders	Goldman Sachs	(195)
213	ForFarmers NV	Goldman Sachs	(42)
226	Galapagos NV	Goldman Sachs	(978)
339	Galapagos NV	Morgan Stanley	(656)

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)			
41	IMCD NV	Bank of America Merrill Lynch	(124)
90	IMCD NV	Goldman Sachs	(271)
114	IMCD NV	Morgan Stanley	(746)
(2,727)	ING Groep NV	Bank of America Merrill Lynch	3,337
(420)	ING Groep NV	Goldman Sachs	16
26,266	ING Groep NV	Morgan Stanley	-
(7,522)	InPost SA	Bank of America Merrill Lynch	39,157
(277)	Intertrust NV	Bank of America Merrill Lynch	(986)
1,728	JDE Peet's NV	Bank of America Merrill Lynch	(1,423)
144	JDE Peet's NV	Morgan Stanley	(247)
(2,790)	Koninklijke Ahold Delhaize NV	Morgan Stanley	3,270
18,636	Koninklijke KPN NV	Bank of America Merrill Lynch	(997)
12,740	Koninklijke KPN NV	Goldman Sachs	(681)
64,352	Koninklijke KPN NV	Morgan Stanley	(5,052)
2,403	Koninklijke Vopak NV	Bank of America Merrill Lynch	876
728	Koninklijke Vopak NV	Goldman Sachs	(422)
1,953	Koninklijke Vopak NV	Morgan Stanley	948
2,736	Majorel Group Luxembourg SA	Goldman Sachs	12,390
(252)	NSI NV	Bank of America Merrill Lynch	87
(9,162)	Pharming Group NV	Goldman Sachs	618
489	PostNL NV	Bank of America Merrill Lynch	12
3,175	PostNL NV	Goldman Sachs	(419)
630	PostNL NV	Morgan Stanley	(11)
(669)	Prosus NV	Bank of America Merrill Lynch	1,159
(2,257)	Prosus NV	Morgan Stanley	10,581
104	Randstad NV	Goldman Sachs	(914)
918	Randstad NV	Morgan Stanley	(6,309)
(455)	SBM Offshore NV	Bank of America Merrill Lynch	129
(61)	SIF Holding NV	Bank of America Merrill Lynch	97
(1,822)	SIF Holding NV	Goldman Sachs	2,902
472	Unibail-Rodamco-Westfield (REIT)	Morgan Stanley	(2,487)
680	Unilever Plc	Morgan Stanley	(815)
(57)	Vastned Retail NV	Bank of America Merrill Lynch	55
(34)	Vastned Retail NV	Goldman Sachs	55
(60)	Wereldhave NV	Bank of America Merrill Lynch	46
203	Wolters Kluwer NV	Goldman Sachs	608
1,290	Wolters Kluwer NV	Morgan Stanley	(1,027)
			79,187
ニュージーランド			
701	a2 Milk Co Ltd	Goldman Sachs	(187)
(10,811)	Fletcher Building Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,736
(6,867)	Fletcher Building Ltd	Goldman Sachs	1,112
(4,819)	Fletcher Building Ltd	Morgan Stanley	574
32	Mainfreight Ltd	Morgan Stanley	(4)
1,159	Mercury NZ Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(55)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
ニュージーランド(続き)			
1,789	Mercury NZ Ltd	Morgan Stanley	330
(701)	Pushpay Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(13)
(4,249)	Spark New Zealand Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(320)
226	Summerset Group Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(107)
(18,941)	Synlait Milk Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4,145
			8,211
ノルウェー			
(2,561)	Adevinta ASA	Goldman Sachs	6,199
(1,361)	Adevinta ASA	Morgan Stanley	2,933
(2,373)	Aker BioMarine ASA	Bank of America Merrill Lynch	(144)
(460)	Aker BioMarine ASA	Goldman Sachs	(25)
582	Aker Carbon Capture ASA	Goldman Sachs	6
(26,156)	Aker Horizons Holding AS	Bank of America Merrill Lynch	9,121
8,208	Aker Horizons Holding AS	Goldman Sachs	(2,862)
(2,486)	Aker Horizons Holding AS	Goldman Sachs	867
21,821	AutoStore Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	15,436
269	Bakkafrost P	Bank of America Merrill Lynch	(1,299)
375	Bakkafrost P	Goldman Sachs	(776)
(425)	Bonheur ASA	Bank of America Merrill Lynch	1,198
(116)	Bonheur ASA	Goldman Sachs	327
240	Borregaard ASA	Bank of America Merrill Lynch	(193)
84	Borregaard ASA	Goldman Sachs	(23)
(1,473)	BW LPG Ltd	Bank of America Merrill Lynch	74
(892)	DNO ASA	Goldman Sachs	28
266	Elkem ASA	Bank of America Merrill Lynch	(50)
962	Elkem ASA	Goldman Sachs	(254)
58	Entra ASA	Bank of America Merrill Lynch	(4)
5,547	Equinor ASA	Goldman Sachs	1,533
7,541	Equinor ASA	Morgan Stanley	3,626
280	Fjordkraft Holding ASA	Bank of America Merrill Lynch	(178)
1,614	Fjordkraft Holding ASA	Goldman Sachs	(1,028)
662	FLEX LNG Ltd	Goldman Sachs	2,781
(1,100)	Frontline Ltd	Goldman Sachs	400
(191)	Gjensidige Forsikring ASA	Bank of America Merrill Lynch	38
2,187	Golden Ocean Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,998
3,913	Golden Ocean Group Ltd	Goldman Sachs	5,060
(740)	Hexagon Purus ASA	Bank of America Merrill Lynch	168
(13,879)	Kahoot! ASA	Bank of America Merrill Lynch	384
854	LINK Mobility Group Holding ASA	Bank of America Merrill Lynch	(46)
220	LINK Mobility Group Holding ASA	Goldman Sachs	(40)
417	Meltwater Holding BV	Bank of America Merrill Lynch	(205)
1,237	Mowi ASA	Bank of America Merrill Lynch	(4,070)
1,381	Mowi ASA	Goldman Sachs	(3,824)
1,111	Mowi ASA	Morgan Stanley	(2,566)
(8,222)	NEL ASA	Goldman Sachs	741

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)			
(59,310)	NEL ASA	Morgan Stanley	262
161	Nordic Semiconductor ASA	Morgan Stanley	(18)
(2)	Norway Royal Salmon ASA	Goldman Sachs	2
1	Protector Forsikring ASA	Bank of America Merrill Lynch	1
(525)	Quantafuel ASA	Bank of America Merrill Lynch	(173)
(2,143)	Salmar ASA	Bank of America Merrill Lynch	14,591
(279)	Salmar ASA	Morgan Stanley	1,221
(2,857)	Sbanken ASA	Bank of America Merrill Lynch	2,116
(4,240)	Sbanken ASA	Goldman Sachs	3,140
290	Selvaag Bolig ASA	Bank of America Merrill Lynch	(157)
1,382	Selvaag Bolig ASA	Goldman Sachs	(748)
56	SpareBank 1 Nord Norge	Bank of America Merrill Lynch	(16)
212	SpareBank 1 Nord Norge	Goldman Sachs	(43)
501	Sparebank 1 Oestlandet	Bank of America Merrill Lynch	78
2,655	Sparebank 1 Oestlandet	Goldman Sachs	411
258	SpareBank 1 SMN	Goldman Sachs	(75)
(161)	SpareBank 1 SR-Bank ASA	Bank of America Merrill Lynch	104
(632)	SpareBank 1 SR-Bank ASA	Goldman Sachs	481
2,402	Subsea 7 SA	Bank of America Merrill Lynch	(3,037)
868	TGS ASA	Goldman Sachs	(497)
(219)	Vaccibody AS	Goldman Sachs	(186)
(1,242)	Veidekke ASA	Goldman Sachs	(412)
(466)	Wallenius Wilhelmsen ASA	Bank of America Merrill Lynch	(51)
			53,325
ポルトガル			
(38,112)	Banco Comercial Portugues SA 'R'	Goldman Sachs	785
3,071	CTT-Correios de Portugal SA	Goldman Sachs	(437)
(1,371)	EDP Renovaveis SA	Goldman Sachs	(487)
2,787	Galp Energia SGPS SA	Morgan Stanley	(1,294)
(4,982)	NOS SGPS SA	Bank of America Merrill Lynch	145
(6,105)	NOS SGPS SA	Goldman Sachs	(35)
			(1,323)
シンガポール			
1,700	AEM Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	163
800	AEM Holdings Ltd	Goldman Sachs	48
700	AIMS APAC REIT (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	-
(16,117)	CapitaLand Integrated Commercial Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	827
(1,778)	CapitaLand Integrated Commercial Trust (REIT)	Goldman Sachs	91
(4,934)	CapitaLand Integrated Commercial Trust (REIT)	Morgan Stanley	289
(6,500)	CDL Hospitality Trusts (Unit)	Goldman Sachs	715
(3,600)	City Developments Ltd	Bank of America Merrill Lynch	480
(16,300)	City Developments Ltd	Goldman Sachs	2,151
(16,300)	City Developments Ltd	Morgan Stanley	1,912

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)		
(200)	DBS Group Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	323
(2,500)	DBS Group Holdings Ltd	Goldman Sachs	4,253
(29,200)	DBS Group Holdings Ltd	Morgan Stanley	56,508
(4,700)	Frasers Hospitality Trust (Unit)	Goldman Sachs	138
10,800	Genting Singapore Ltd	Goldman Sachs	(470)
15,000	Genting Singapore Ltd	Morgan Stanley	(715)
(167,300)	Golden Agri-Resources Ltd	Morgan Stanley	1,227
(16,900)	Hongkong Land Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	5,528
(2,100)	Hongkong Land Holdings Ltd	Morgan Stanley	735
92,700	Hutchison Port Holdings Trust 'U'	Bank of America Merrill Lynch	(463)
65,300	Hutchison Port Holdings Trust 'U'	Goldman Sachs	(326)
2,400	iFAST Corp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(933)
600	iFAST Corp Ltd	Goldman Sachs	(225)
(148,100)	Japfa Ltd	Goldman Sachs	2,172
2,000	Jardine Cycle & Carriage Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,401)
2,300	Jardine Cycle & Carriage Ltd	Goldman Sachs	(2,749)
1,300	Jardine Cycle & Carriage Ltd	Morgan Stanley	(1,592)
(100)	Jardine Matheson Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	348
(3,801)	Jardine Matheson Holdings Ltd	Goldman Sachs	13,228
(34,600)	Keppel DC REIT (REIT)	Goldman Sachs	-
13,800	Keppel Pacific Oak US (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(138)
34,000	Keppel Pacific Oak US (REIT)	Goldman Sachs	(340)
(3,300)	Mapletree North Asia Commercial Trust (REIT)	Goldman Sachs	48
(29,300)	OUE Commercial Real Estate Investment Trust (REIT)	Goldman Sachs	(107)
(13,500)	OUE Ltd	Goldman Sachs	-
2,100	Raffles Medical Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(61)
2,500	Raffles Medical Group Ltd	Goldman Sachs	(64)
(105,300)	Sembcorp Industries Ltd	Goldman Sachs	12,354
2,200	Sheng Siong Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(53)
4,400	Sheng Siong Group Ltd	Goldman Sachs	(133)
2,300	SIA Engineering Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(320)
10,600	SIA Engineering Co Ltd	Morgan Stanley	(1,244)
98,400	Singapore Post Ltd	Goldman Sachs	(721)
165,400	Singapore Post Ltd	Morgan Stanley	(2,426)
39,600	Singapore Telecommunications Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(6,281)
22,300	Singapore Telecommunications Ltd	Goldman Sachs	(3,597)
46,700	Singapore Telecommunications Ltd	Morgan Stanley	(4,794)
(49,300)	Starhill Global (REIT)	Goldman Sachs	904
(2,900)	Venture Corp Ltd	Goldman Sachs	1,340
(17,900)	Wilmar International Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3,150
(12,200)	Wilmar International Ltd	Goldman Sachs	2,147
(5,100)	Wilmar International Ltd	Morgan Stanley	748
(5,000)	Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(37)

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)			
(44,900)	Yanlord Land Group Ltd	Goldman Sachs	659
			82,296
スペイン			
(6,583)	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	Goldman Sachs	2,099
(3,196)	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	Morgan Stanley	3,425
86	Aena SME SA	Goldman Sachs	(1,825)
(1,991)	Amadeus IT Group SA	Bank of America Merrill Lynch	4,710
(140)	Amadeus IT Group SA	Goldman Sachs	399
(533)	Applus Services SA	Bank of America Merrill Lynch	(105)
41,500	Banco de Sabadell SA	Bank of America Merrill Lynch	(4,250)
21,390	Banco de Sabadell SA	Goldman Sachs	(2,190)
181,153	Banco de Sabadell SA	Morgan Stanley	(5,936)
(426)	Cia de Distribucion Integral Logista Holdings SA	Bank of America Merrill Lynch	447
(2,943)	Cia de Distribucion Integral Logista Holdings SA	Goldman Sachs	1,496
(106)	CIE Automotive SA	Bank of America Merrill Lynch	93
(188)	Construcciones y Auxiliar de Ferrocarriles SA	Bank of America Merrill Lynch	14
(784)	eDreams ODIGEO SA	Bank of America Merrill Lynch	874
(2,901)	Endesa SA	Bank of America Merrill Lynch	(376)
(3,492)	Ferrovial SA	Morgan Stanley	1,431
283	Gestamp Automocion SA	Bank of America Merrill Lynch	(79)
(837)	Global Dominion Access SA	Bank of America Merrill Lynch	168
(1,734)	Grupo Empresarial San Jose SA	Goldman Sachs	957
(2,092)	Indra Sistemas SA	Bank of America Merrill Lynch	416
(1,416)	Indra Sistemas SA	Goldman Sachs	(12)
3,382	Industria de Diseno Textil SA	Bank of America Merrill Lynch	(14,662)
4,873	Industria de Diseno Textil SA	Goldman Sachs	(17,101)
12,957	Industria de Diseno Textil SA	Morgan Stanley	(44,796)
480	Inmobiliaria Colonial Socimi SA	Goldman Sachs	(131)
140	Laboratorios Farmaceuticos Rovi SA	Bank of America Merrill Lynch	908
672	Laboratorios Farmaceuticos Rovi SA	Goldman Sachs	4,358
(12,917)	Mapfre SA	Bank of America Merrill Lynch	672
(1,265)	Mapfre SA	Morgan Stanley	186
1,579	Melia Hotels International SA	Bank of America Merrill Lynch	(795)
219	Melia Hotels International SA	Goldman Sachs	(115)
(606)	Metrovacesa SA	Goldman Sachs	207
(2,417)	Naturgy Energy Group SA	Bank of America Merrill Lynch	(707)
(1,959)	Repsol SA	Bank of America Merrill Lynch	508
(6,217)	Sacyr SA	Goldman Sachs	1,061
(1,938)	Solaria Energia y Medio Ambiente SA	Bank of America Merrill Lynch	(1,654)
(720)	Solaria Energia y Medio Ambiente SA	Goldman Sachs	(614)
(131)	Solaria Energia y Medio Ambiente SA	Morgan Stanley	(45)
(86)	Soltec Power Holdings SA	Bank of America Merrill Lynch	95

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)			
(18,989)	Telefonica SA	Bank of America Merrill Lynch	(1,579)
(47,722)	Telefonica SA	Morgan Stanley	12,706
60	Viscofan SA	Bank of America Merrill Lynch	(137)
280	Viscofan SA	Goldman Sachs	(465)
			(60,344)
スウェーデン			
3,203	AcadeMedia AB	Bank of America Merrill Lynch	(1,200)
953	AcadeMedia AB	Goldman Sachs	(360)
474	Acast AB	Bank of America Merrill Lynch	(151)
1,229	AddTech AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	545
2,003	AddTech AB 'B'	Goldman Sachs	885
58	Alfa Laval AB	Bank of America Merrill Lynch	(126)
615	Alfa Laval AB	Goldman Sachs	(923)
524	Alfa Laval AB	Morgan Stanley	(1,377)
314	Arjo AB	Bank of America Merrill Lynch	52
117	Arjo AB	Goldman Sachs	29
442	Assa Abloy AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(384)
2,675	Assa Abloy AB 'B'	Morgan Stanley	(3,649)
490	Attendo AB	Goldman Sachs	(67)
(53)	Bactiguard Holding AB	Goldman Sachs	123
(24)	Beijer Alma AB	Bank of America Merrill Lynch	(17)
1,422	Betsson AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(897)
95	Betsson AB 'B'	Goldman Sachs	(59)
(1,686)	BHG Group AB	Goldman Sachs	(19)
(49)	BICO Group AB	Bank of America Merrill Lynch	(10)
(203)	BillerudKorsnas AB	Bank of America Merrill Lynch	(8)
(547)	BillerudKorsnas AB	Goldman Sachs	36
42	Biotage AB	Bank of America Merrill Lynch	(43)
20	Biotage AB	Goldman Sachs	27
(1,446)	Boozt AB	Bank of America Merrill Lynch	(2,276)
(742)	Boozt AB	Goldman Sachs	(1,605)
(1,787)	Bravida Holding AB	Goldman Sachs	971
(136)	Bure Equity AB	Bank of America Merrill Lynch	17
(1,179)	Calliditas Therapeutics AB 'B'	Goldman Sachs	(920)
(1,080)	Camurus AB	Goldman Sachs	1,533
574	Castellum AB	Bank of America Merrill Lynch	431
1,999	Castellum AB	Morgan Stanley	1,345
27	Cellavision AB	Bank of America Merrill Lynch	(78)
44	Cellavision AB	Goldman Sachs	(130)
(236)	Cibus Nordic Real Estate AB	Goldman Sachs	(252)
(705)	Cint Group AB	Bank of America Merrill Lynch	93
(745)	Cint Group AB	Morgan Stanley	118
(135)	Coor Service Management Holding AB	Bank of America Merrill Lynch	(1)
(1,034)	Corem Property Group AB	Bank of America Merrill Lynch	(78)
(51)	Creades AB 'A'	Goldman Sachs	5

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	スウェーデン(続き)		
(1,751)	Desenio Group AB	Bank of America Merrill Lynch	(188)
(261)	Desenio Group AB	Goldman Sachs	(51)
(194)	Duni AB	Bank of America Merrill Lynch	383
(1,051)	Duni AB	Goldman Sachs	2,075
8,331	Elekta AB 'B'	Morgan Stanley	1,478
(4,907)	Embracer Group AB	Bank of America Merrill Lynch	(4,447)
(2,387)	Embracer Group AB	Morgan Stanley	(3,275)
5,936	Fingerprint Cards AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(547)
4,931	Fingerprint Cards AB 'B'	Goldman Sachs	(515)
117	GARO AB	Bank of America Merrill Lynch	(43)
59	GARO AB	Goldman Sachs	(36)
(758)	Granges AB	Bank of America Merrill Lynch	340
(115)	Granges AB	Goldman Sachs	43
26	Hexatronic Group AB	Bank of America Merrill Lynch	48
105	Hexatronic Group AB	Goldman Sachs	334
(863)	Hexpol AB	Bank of America Merrill Lynch	6
289	Holmen AB 'B'	Morgan Stanley	(9)
(536)	Implantica AG SDR	Goldman Sachs	508
945	Industrivarden AB 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(32)
368	Industrivarden AB 'C'	Bank of America Merrill Lynch	(160)
319	Industrivarden AB 'C'	Goldman Sachs	(431)
697	Indutrade AB	Goldman Sachs	412
73	Intrum AB	Bank of America Merrill Lynch	(31)
(58)	Investment AB Oresund	Bank of America Merrill Lynch	27
2,028	Investor AB 'B'	Goldman Sachs	169
(135)	Inwido AB	Bank of America Merrill Lynch	(28)
(163)	JM AB	Bank of America Merrill Lynch	(126)
(827)	JM AB	Goldman Sachs	97
(64)	Kambi Group Plc	Goldman Sachs	158
(3,907)	Karo Pharma AB	Bank of America Merrill Lynch	1,300
(4,961)	Karo Pharma AB	Goldman Sachs	1,651
(92)	K-fast Holding AB	Goldman Sachs	(72)
(994)	Kinnevik AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	1,667
(1,439)	LeoVegas AB	Bank of America Merrill Lynch	504
(278)	Lindab International AB	Bank of America Merrill Lynch	(122)
128	Loomis AB	Bank of America Merrill Lynch	(206)
310	Lundin Energy AB	Morgan Stanley	(427)
180	Mekonomen AB	Bank of America Merrill Lynch	(50)
123	Millicom International Cellular SA	Bank of America Merrill Lynch	(33)
(16,247)	Modern Times Group MTG AB 'B'	Goldman Sachs	20,056
132	Munters Group AB	Goldman Sachs	(11)
27	Mycronic AB	Bank of America Merrill Lynch	10
203	New Wave Group AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	126
824	New Wave Group AB 'B'	Goldman Sachs	512
694	Nobina AB	Bank of America Merrill Lynch	(194)

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)		
(676)	Nolato AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	315
(1,705)	Nolato AB 'B'	Goldman Sachs	946
(174)	Nordic Entertainment Group AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	1,100
(123)	Nordic Entertainment Group AB 'B'	Goldman Sachs	778
(240)	Nyfosa AB	Bank of America Merrill Lynch	(63)
(40)	Paradox Interactive AB	Bank of America Merrill Lynch	(18)
(363)	Peab AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	239
(1,508)	PowerCell Sweden AB	Goldman Sachs	1,099
(1,245)	Re: NewCell AB	Goldman Sachs	(1,188)
(1,004)	Resurs Holding AB	Bank of America Merrill Lynch	573
(2,423)	Resurs Holding AB	Goldman Sachs	1,413
620	Saab AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(550)
859	Saab AB 'B'	Goldman Sachs	(762)
3,474	Saab AB 'B'	Morgan Stanley	(4,316)
98	Sagax AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(59)
573	Sagax AB 'B'	Goldman Sachs	(424)
164	Sagax AB 'B'	Morgan Stanley	(156)
493	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB	Goldman Sachs	115
2,928	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB	Morgan Stanley	(175)
(6,966)	SAS AB	Bank of America Merrill Lynch	54
145	Scandi Standard AB	Bank of America Merrill Lynch	12
7,125	Scandic Hotels Group AB	Bank of America Merrill Lynch	(4,501)
7,273	Scandic Hotels Group AB	Goldman Sachs	(4,109)
15	Sdiptech AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(17)
(515)	Sedana Medical AB	Bank of America Merrill Lynch	206
(88)	Sedana Medical AB	Goldman Sachs	35
(11,733)	Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A'	Bank of America Merrill Lynch	9,119
(3,708)	Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A'	Morgan Stanley	2,406
38	SkiStar AB	Bank of America Merrill Lynch	4
43	SkiStar AB	Goldman Sachs	7
(100)	Solid Forsakring AB	Bank of America Merrill Lynch	(348)
(242)	Solid Forsakring AB	Goldman Sachs	(843)
492	SSAB AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(35)
17,187	SSAB AB 'B'	Goldman Sachs	(452)
(6,415)	Stillfront Group AB	Bank of America Merrill Lynch	(2,391)
(734)	Stillfront Group AB	Morgan Stanley	(202)
14,201	Storskogen Group AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	2,520
34	Storytel AB	Bank of America Merrill Lynch	62
126	Storytel AB	Goldman Sachs	(10)
7,422	Svenska Handelsbanken AB 'A'	Morgan Stanley	(278)
10,485	Swedish Match AB	Bank of America Merrill Lynch	(848)
(545)	Swedish Orphan Biovitrum AB	Bank of America Merrill Lynch	(121)
1,345	Telia Co AB	Goldman Sachs	(49)
(1,831)	Thule Group AB	Morgan Stanley	609
1,487	Tobii AB	Bank of America Merrill Lynch	650

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
スウェーデン(続き)			
2,509	Tobii AB	Goldman Sachs	1,323
446	Troax Group AB	Bank of America Merrill Lynch	792
1,719	Troax Group AB	Goldman Sachs	3,051
754	Vitrolife AB	Goldman Sachs	3,650
(2,337)	Volvo AB 'A'	Bank of America Merrill Lynch	2,696
(415)	Volvo AB 'A'	Morgan Stanley	552
(262)	Wallenstam AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(86)
(367)	Wallenstam AB 'B'	Goldman Sachs	(297)
			24,478
スイス			
(29)	Allreal Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	57
(3)	ALSO Holding AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	54
(49)	Ascom Holding AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	96
(35)	Autoneum Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	562
(26)	Bachem Holding AG 'B'	Bank of America Merrill Lynch	33
13	Basilea Pharmaceutica AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(33)
138	BV Holding AG	Goldman Sachs	(75)
49	Cembra Money Bank AG	Bank of America Merrill Lynch	(27)
1,183	Cembra Money Bank AG	Goldman Sachs	(646)
5	Comet Holding AG 'G'	Bank of America Merrill Lynch	46
(6)	Conzzeta AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	320
(164)	COSMO Pharmaceuticals NV	Goldman Sachs	1,027
1,091	Credit Suisse Group AG Reg	Goldman Sachs	(364)
1,672	Credit Suisse Group AG Reg	Morgan Stanley	(219)
(189)	DKSH Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	238
(4)	Emmi AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	4
(62)	Emmi AG Reg	Goldman Sachs	68
(135)	Flughafen Zurich AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(10)
(8)	Forbo Holding AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	821
(44)	Forbo Holding AG Reg	Goldman Sachs	4,515
649	GAM Holding AG	Goldman Sachs	(11)
(194)	Georg Fischer AG Reg	Morgan Stanley	13,555
2	Givaudan SA Reg	Bank of America Merrill Lynch	20
29	Givaudan SA Reg	Goldman Sachs	53
3	Gurit Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	(301)
5	Gurit Holding AG	Goldman Sachs	(723)
245	Holcim Ltd	Goldman Sachs	(927)
719	Holcim Ltd	Morgan Stanley	(1,656)
(775)	Implenia AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	2,191
(1,216)	Implenia AG Reg	Goldman Sachs	3,438
11	Inficon Holding AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	408
14	Inficon Holding AG Reg	Goldman Sachs	520
(1)	Intershop Holding AG	Goldman Sachs	4
45	Komax Holding AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(324)
19	Komax Holding AG Reg	Goldman Sachs	(137)

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)		
12	Landis+ Gyr Group AG	Bank of America Merrill Lynch	(105)
880	Landis+ Gyr Group AG	Goldman Sachs	(7,734)
(2)	Liechtensteinische Landesbank AG	Bank of America Merrill Lynch	2
(115)	Liechtensteinische Landesbank AG	Goldman Sachs	113
68	Lonza Group AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	970
7	Lonza Group AG Reg	Goldman Sachs	26
27	Lonza Group AG Reg	Morgan Stanley	1,261
94	Medacta Group SA	Bank of America Merrill Lynch	(2,545)
302	Medacta Group SA	Goldman Sachs	(8,176)
33	Medartis Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	(216)
15	Medartis Holding AG	Goldman Sachs	(98)
(36,130)	Meyer Burger Technology AG	Bank of America Merrill Lynch	299
(14,673)	Meyer Burger Technology AG	Goldman Sachs	125
(1,770)	Mobilezone Holding AG Reg	Goldman Sachs	386
(2,196)	Novartis AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	6,209
9	Rieter Holding AG Reg	Goldman Sachs	(105)
45	Sensirion Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	(481)
590	Sensirion Holding AG	Goldman Sachs	(7,343)
(68)	Siegfried Holding AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	1,753
(145)	Siegfried Holding AG Reg	Goldman Sachs	4,116
(130)	Siegfried Holding AG Reg	Morgan Stanley	(993)
7	Sika AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	64
559	Sika AG Reg	Goldman Sachs	(724)
1,234	Sika AG Reg	Morgan Stanley	(1,857)
74	Softwareone Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	(19)
(2)	St Galler Kantonalbank AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(3)
166	Swatch Group AG	Bank of America Merrill Lynch	(2,012)
227	Swatch Group AG	Morgan Stanley	(5,179)
(1,967)	Swatch Group AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	3,436
(349)	Swatch Group AG Reg	Goldman Sachs	610
(131)	Swatch Group AG Reg	Morgan Stanley	450
(430)	Swiss Re AG	Bank of America Merrill Lynch	378
(39)	Swisscom AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	592
(156)	Temenos AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	3,540
306	u-blox Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	(1,219)
338	u-blox Holding AG	Goldman Sachs	(1,347)
193	Zehnder Group AG	Bank of America Merrill Lynch	(684)
49	Zehnder Group AG	Goldman Sachs	(162)
(117)	Zur Rose Group AG	Goldman Sachs	(958)
			<u>4,947</u>
	英国		
(9,626)	3i Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	3,615
(214)	3i Group Plc	Morgan Stanley	119
7,363	888 Holdings Plc	Goldman Sachs	(3,600)
(139)	Advanced Medical Solutions Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	43

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	英国(続き)		
106	AG Barr Plc	Bank of America Merrill Lynch	83
113	AG Barr Plc	Goldman Sachs	63
1,542	Ashmore Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(279)
8,677	Ashmore Group Plc	Goldman Sachs	(1,510)
17,984	Ashmore Group Plc	Morgan Stanley	(1,490)
1,040	Ashtead Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1,945)
113	Ashtead Group Plc	Goldman Sachs	(374)
1,571	Ashtead Group Plc	Morgan Stanley	(2,966)
67	ASOS Plc	Goldman Sachs	(5)
7,594	Associated British Foods Plc	Morgan Stanley	(1,613)
(10,693)	Assura Plc	Bank of America Merrill Lynch	206
(19,724)	Assura Plc	Goldman Sachs	473
1,570	Aston Martin Lagonda Global Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2,527)
3,921	Aston Martin Lagonda Global Holdings Plc	Goldman Sachs	(6,312)
606	Aston Martin Lagonda Global Holdings Plc	Morgan Stanley	(907)
(569)	AstraZeneca Plc	Bank of America Merrill Lynch	741
402	Auction Technology Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(354)
100	Auction Technology Group Plc	Goldman Sachs	(7)
(3,381)	Auto Trader Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(407)
(487)	Avacta Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	8
(14,614)	Avast Plc	Bank of America Merrill Lynch	(742)
(9,306)	Avast Plc	Morgan Stanley	(771)
58	Avon Protection Plc	Bank of America Merrill Lynch	3
368	Avon Protection Plc	Goldman Sachs	(95)
(20,061)	B&M European Value Retail SA	Bank of America Merrill Lynch	(10,253)
(9,056)	B&M European Value Retail SA	Goldman Sachs	(177)
(14,817)	B&M European Value Retail SA	Morgan Stanley	(2,869)
953	Babcock International Group Plc	Goldman Sachs	(270)
7,767	Babcock International Group Plc	Morgan Stanley	(1,598)
(7,828)	BAE Systems Plc	Bank of America Merrill Lynch	68
(393)	Balfour Beatty Plc	Bank of America Merrill Lynch	19
(7,175)	Barratt Developments Plc	Bank of America Merrill Lynch	(839)
(3,361)	Barratt Developments Plc	Morgan Stanley	(359)
180	Bellway Plc	Goldman Sachs	(118)
143	Bellway Plc	Morgan Stanley	(220)
(2,877)	Berkeley Group Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	215
(148)	Berkeley Group Holdings Plc	Morgan Stanley	184
(883)	Biffa Plc	Bank of America Merrill Lynch	41
(1,248)	Blue Prism Group Plc	Goldman Sachs	(2,934)
(1,800)	Bodycote Plc	Bank of America Merrill Lynch	252
12,814	boohoo Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(6,058)
15,670	boohoo Group Plc	Goldman Sachs	(7,409)
12,765	boohoo Group Plc	Morgan Stanley	(2,215)
1,509	Brewin Dolphin Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	(736)
5,446	Brewin Dolphin Holdings Plc	Goldman Sachs	(2,955)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	英国(続き)		
349	British Land Co Plc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(60)
676	Britvic Plc	Bank of America Merrill Lynch	(23)
7,677	Britvic Plc	Goldman Sachs	134
1,966	Burberry Group Plc	Goldman Sachs	(637)
(4,447)	Burford Capital Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3,511
(5,140)	Burford Capital Ltd	Goldman Sachs	4,154
(8,764)	Cairn Energy Plc	Bank of America Merrill Lynch	559
(855)	Cairn Homes Plc	Bank of America Merrill Lynch	10
(497)	Cairn Homes Plc	Goldman Sachs	6
2,346	Capita Plc	Bank of America Merrill Lynch	(36)
(20,271)	Capital & Counties Properties Plc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	838
(13,525)	Capital & Counties Properties Plc (REIT)	Goldman Sachs	524
(286)	Carnival Plc	Goldman Sachs	189
77,473	Centamin Plc	Goldman Sachs	(7,474)
133,326	Centrica Plc	Morgan Stanley	(4,631)
(6,496)	Ceres Power Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	4,600
337	Chemring Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(3)
9,066	Cineworld Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1,292)
(112)	Clinigen Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(12)
53	Clipper Logistics Plc	Bank of America Merrill Lynch	9
4,188	Clipper Logistics Plc	Goldman Sachs	(2,294)
372	Close Brothers Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	6
3,115	CMC Markets Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1,615)
2,606	CMC Markets Plc	Goldman Sachs	(1,045)
(132)	Coats Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	12
(14,656)	Coats Group Plc	Goldman Sachs	1,331
2,371	Compass Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(887)
(2,125)	Computacenter Plc	Goldman Sachs	(669)
(2,824)	ContourGlobal Plc	Bank of America Merrill Lynch	54
3,136	ConvaTec Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(152)
(2,493)	Countryside Properties Plc	Morgan Stanley	1,412
471	Craneware Plc	Bank of America Merrill Lynch	(126)
395	Craneware Plc	Goldman Sachs	(106)
89	Cranswick Plc	Goldman Sachs	(19)
1,432	Croda International Plc	Bank of America Merrill Lynch	4,818
699	Croda International Plc	Goldman Sachs	2,221
178	Croda International Plc	Morgan Stanley	542
(542)	Custodian REIT Plc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	1
347	CVS Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(849)
1,805	CVS Group Plc	Goldman Sachs	(3,296)
(3,534)	Darktrace Plc	Bank of America Merrill Lynch	(335)
159	Dechra Pharmaceuticals Plc	Goldman Sachs	41
96	Dechra Pharmaceuticals Plc	Morgan Stanley	(205)
(2,335)	Deliveroo Plc	Bank of America Merrill Lynch	475
4,768	dotdigital group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2,931)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	英国(続き)		
4,378	dotdigital group Plc	Goldman Sachs	(3,031)
1,480	Dr. Martens Plc	Bank of America Merrill Lynch	(44)
2,690	Dr. Martens Plc	Goldman Sachs	(183)
(113)	Dunelm Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	45
(1,786)	Dunelm Group Plc	Goldman Sachs	453
(428)	Elementis Plc	Bank of America Merrill Lynch	(6)
(3,332)	Energean Plc	Bank of America Merrill Lynch	80
(7,359)	Energean Plc	Goldman Sachs	(49)
(2,699)	Essentra Plc	Bank of America Merrill Lynch	82
(104,162)	Eurasia Mining Plc	Bank of America Merrill Lynch	9,136
(1,681)	Evraz Plc	Bank of America Merrill Lynch	112
(22,238)	Evraz Plc	Goldman Sachs	5,407
(3,289)	Evraz Plc	Morgan Stanley	413
1,712	Experian Plc	Goldman Sachs	(129)
471	Experian Plc	Morgan Stanley	(50)
(12,042)	Ferrexpo Plc	Bank of America Merrill Lynch	547
(8,582)	Ferrexpo Plc	Goldman Sachs	390
(2,798)	Firstgroup Plc	Goldman Sachs	323
(1)	Frasers Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	-
(8,451)	Frasers Group Plc	Goldman Sachs	395
(2,432)	Fresnillo Plc	Bank of America Merrill Lynch	(188)
(178)	Frontier Developments Plc	Bank of America Merrill Lynch	1,918
(77)	Frontier Developments Plc	Goldman Sachs	838
1,055	Future Plc	Bank of America Merrill Lynch	5,131
353	Future Plc	Goldman Sachs	1,056
1,134	Future Plc	Morgan Stanley	4,427
60	GB Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(71)
(1,327)	GCP Student Living Plc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(9)
(21,148)	GCP Student Living Plc (REIT)	Goldman Sachs	(150)
210	Genus Plc	Goldman Sachs	(234)
(491)	GlaxoSmithKline Plc	Bank of America Merrill Lynch	361
(2,372)	GlaxoSmithKline Plc	Goldman Sachs	1,743
(7,986)	GlaxoSmithKline Plc	Morgan Stanley	(661)
(161,683)	Greatland Gold Plc	Bank of America Merrill Lynch	3,840
9,435	Greencore Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(763)
5,950	Greencore Group Plc	Goldman Sachs	(315)
(1,039)	Halfords Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	118
39,682	Hammerson Plc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(770)
56,206	Hammerson Plc (REIT)	Goldman Sachs	(886)
7	Hammerson Plc (REIT)	Morgan Stanley	-
(3,128)	Harbour Energy Plc	Bank of America Merrill Lynch	(611)
(682)	Harbour Energy Plc	Goldman Sachs	183
(785)	Hill & Smith Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	1,641
(184)	Hill & Smith Holdings Plc	Goldman Sachs	379
979	Hiscox Ltd	Goldman Sachs	(212)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益 / (損) (米ドル)
	英国 (続き)		
4,293	Hiscox Ltd	Morgan Stanley	(688)
(2,684)	Hochschild Mining Plc	Bank of America Merrill Lynch	(142)
1,848	HomeServe Plc	Bank of America Merrill Lynch	1,049
3,917	HomeServe Plc	Goldman Sachs	2,224
27,719	HomeServe Plc	Morgan Stanley	(7,777)
184	Hotel Chocolat Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(13)
747	Hotel Chocolat Group Ltd	Goldman Sachs	(142)
(53,957)	HSBC Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	14,238
(8,237)	HSBC Holdings Plc	Goldman Sachs	2,084
(13,645)	HSBC Holdings Plc	Morgan Stanley	4,092
7,030	Hunting Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1,095)
5,676	Hunting Plc	Goldman Sachs	(863)
(164)	IG Design Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(26)
(4,892)	Imperial Brands Plc	Morgan Stanley	622
70	Inchcape Plc	Goldman Sachs	(7)
238	Inchcape Plc	Morgan Stanley	(41)
22,747	Indivior Plc	Goldman Sachs	(514)
1,043	InterContinental Hotels Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(6,964)
442	InterContinental Hotels Group Plc	Goldman Sachs	(2,714)
526	InterContinental Hotels Group Plc	Morgan Stanley	(2,923)
(22,352)	International Consolidated Airlines Group SA	Bank of America Merrill Lynch	1,605
(1,525)	Investec Plc	Bank of America Merrill Lynch	(426)
(5,625)	Investec Plc	Goldman Sachs	(1,751)
303	iomart Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(13)
(6,227)	IP Group Plc	Goldman Sachs	349
(2,950)	IQE Plc	Bank of America Merrill Lynch	37
180	J D Wetherspoon Plc	Bank of America Merrill Lynch	(95)
(17,199)	J Sainsbury Plc	Goldman Sachs	3,470
(6,095)	JD Sports Fashion Plc	Bank of America Merrill Lynch	383
(980)	JD Sports Fashion Plc	Goldman Sachs	83
(1,083)	JET2 Plc	Bank of America Merrill Lynch	2,375
1,633	John Wood Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(85)
17,455	John Wood Group Plc	Goldman Sachs	15
434	Johnson Matthey Plc	Goldman Sachs	(1,284)
92	Judges Scientific Plc	Goldman Sachs	(621)
(11,687)	Just Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	1,895
(20,496)	Just Group Plc	Goldman Sachs	3,395
627	Kainos Group Plc	Goldman Sachs	335
(1,433)	Kape Technologies Plc	Bank of America Merrill Lynch	417
(605)	Keller Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	101
(49)	Keller Group Plc	Goldman Sachs	20
(53)	Keywords Studios Plc	Bank of America Merrill Lynch	69
1,770	Lancashire Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(121)
9,056	Lancashire Holdings Ltd	Goldman Sachs	(629)
(35,180)	Land Securities Group Plc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(10,058)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	英国(続き)		
(3,011)	Land Securities Group Plc (REIT)	Goldman Sachs	(861)
(2,080)	Land Securities Group Plc (REIT)	Morgan Stanley	400
24	Liontrust Asset Management Plc	Bank of America Merrill Lynch	(32)
84	Liontrust Asset Management Plc	Goldman Sachs	(98)
2,582	Luceco Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1,569)
6,586	Luceco Plc	Goldman Sachs	(4,003)
129	Marshall's Plc	Goldman Sachs	(13)
(14,358)	Marston's Plc	Goldman Sachs	2,561
6,101	Melrose Industries Plc	Bank of America Merrill Lynch	(186)
23,830	Micro Focus International Plc	Goldman Sachs	(19,388)
(1,301)	Mitie Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	20
12,073	Moneysupermarket.com Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1,024)
26,017	Moneysupermarket.com Group Plc	Goldman Sachs	(2,380)
2	Moneysupermarket.com Group Plc	Morgan Stanley	-
1,216	Moonpig Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(123)
1,394	Morgan Advanced Materials Plc	Bank of America Merrill Lynch	(45)
1,551	Morgan Advanced Materials Plc	Goldman Sachs	(21)
343	Naked Wines Plc	Bank of America Merrill Lynch	(31)
8,592	Network International Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	(6,057)
17,224	Network International Holdings Plc	Goldman Sachs	(11,951)
1,689	Next Plc	Bank of America Merrill Lynch	(7,441)
131	Next Plc	Goldman Sachs	(543)
1,771	Next Plc	Morgan Stanley	(4,542)
14,343	Ninety One Plc	Goldman Sachs	(77)
(450)	Ocado Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(114)
(5,437)	Ocado Group Plc	Morgan Stanley	4,358
514	On the Beach Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(293)
(2,030)	OSB Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	111
(8,697)	OSB Group Plc	Goldman Sachs	476
4,725	Oxford Nanopore Technologies Plc	Goldman Sachs	4,924
502	Pennon Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	44
1,052	Pennon Group Plc	Goldman Sachs	31
4,234	Petropavlovsk Plc	Goldman Sachs	(67)
9,650	Pets at Home Group Plc	Goldman Sachs	774
2,242	Phoenix Group Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	(395)
4,447	Phoenix Group Holdings Plc	Goldman Sachs	(784)
17,630	Phoenix Group Holdings Plc	Morgan Stanley	(3,721)
74	Polar Capital Holdings Plc	Goldman Sachs	(29)
(359)	Provident Financial Plc	Bank of America Merrill Lynch	72
(1,451)	Provident Financial Plc	Goldman Sachs	337
1,229	PZ Cussons Plc	Goldman Sachs	16
(2,630)	Quilter Plc	Bank of America Merrill Lynch	422
(949)	Reach Plc	Bank of America Merrill Lynch	919
(4,815)	Reach Plc	Goldman Sachs	4,664

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	英国(続き)		
(1,264)	Reckitt Benckiser Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	1,070
(1,445)	Reckitt Benckiser Group Plc	Goldman Sachs	1,125
(3,028)	Reckitt Benckiser Group Plc	Morgan Stanley	2,393
(1,978)	Redrow Plc	Goldman Sachs	118
7,838	RELX Plc	Morgan Stanley	(8)
(129)	Renalytix Plc	Bank of America Merrill Lynch	168
(371)	Renalytix Plc	Goldman Sachs	483
(1,646)	Restaurant Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(18)
(16,384)	Restaurant Group Plc	Goldman Sachs	(175)
36	RHI Magnesita NV	Bank of America Merrill Lynch	(128)
1,017	Rightmove Plc	Goldman Sachs	236
14,052	Rightmove Plc	Morgan Stanley	(1,277)
(1,512)	Rio Tinto Plc	Goldman Sachs	(755)
(10,878)	Rolls-Royce Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	(113)
566	RWS Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	71
2,238	RWS Holdings Plc	Goldman Sachs	160
6	S4 Capital Plc	Bank of America Merrill Lynch	(8)
2,798	S4 Capital Plc	Goldman Sachs	(1,924)
8,707	Sabre Insurance Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(768)
6,065	Sabre Insurance Group Plc	Goldman Sachs	(535)
(841)	Saga Plc	Bank of America Merrill Lynch	355
(6,651)	Saga Plc	Goldman Sachs	3,163
422	Senior Plc	Bank of America Merrill Lynch	(65)
(3,632)	Serco Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	37
(1,181)	Serica Energy Plc	Bank of America Merrill Lynch	(183)
(9,091)	Shaftesbury Plc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	3,063
(4,552)	Shaftesbury Plc (REIT)	Goldman Sachs	1,520
11,021	SIG Plc	Bank of America Merrill Lynch	-
24,225	SIG Plc	Goldman Sachs	-
(1,101)	Silence Therapeutics Plc	Bank of America Merrill Lynch	192
(1,543)	Sirius Real Estate Ltd	Bank of America Merrill Lynch	128
902	Sirius Real Estate Ltd	Goldman Sachs	(75)
(8,832)	Sirius Real Estate Ltd	Goldman Sachs	732
1,366	Smiths Group Plc	Morgan Stanley	(885)
618	Softcat Plc	Bank of America Merrill Lynch	(149)
1,001	Softcat Plc	Goldman Sachs	(241)
(35,074)	SolGold Plc	Bank of America Merrill Lynch	1,312
(5,047)	SolGold Plc	Goldman Sachs	189
476	Spirax-Sarco Engineering Plc	Bank of America Merrill Lynch	(6,879)
714	Spirax-Sarco Engineering Plc	Goldman Sachs	(10,726)
1,757	Spirax-Sarco Engineering Plc	Morgan Stanley	(13,421)
(2,207)	Synthomer Plc	Bank of America Merrill Lynch	1,055
(1,585)	Synthomer Plc	Goldman Sachs	730
40,946	Taylor Wimpey Plc	Morgan Stanley	(1,285)
(80,549)	Tesco Plc	Bank of America Merrill Lynch	9,366

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	英国(続き)		
(88,271)	Tesco Plc	Morgan Stanley	4,599
(182)	TI Fluid Systems Plc	Bank of America Merrill Lynch	66
959	TP ICAP Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(160)
7,562	TP ICAP Group Plc	Goldman Sachs	(1,492)
4,353	Trainline Plc	Bank of America Merrill Lynch	(783)
6,596	Trainline Plc	Goldman Sachs	(1,354)
329	Travis Perkins Plc	Goldman Sachs	(413)
3,629	Travis Perkins Plc	Morgan Stanley	(3,394)
(887)	Unilever Plc	Bank of America Merrill Lynch	166
(2,016)	Unilever Plc	Goldman Sachs	169
(4,117)	Unilever Plc	Morgan Stanley	1,067
(13,662)	UNITE Group Plc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	5,543
(2,057)	UNITE Group Plc (REIT)	Goldman Sachs	907
(9,263)	UNITE Group Plc (REIT)	Morgan Stanley	990
330	Victoria Plc	Bank of America Merrill Lynch	165
13,199	Virgin Money UK Plc	Goldman Sachs	(2,108)
(159)	Vistry Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	131
882	Volex Plc	Bank of America Merrill Lynch	(330)
643	Volex Plc	Goldman Sachs	(241)
(184)	Watkin Jones Plc	Bank of America Merrill Lynch	(15)
(5,218)	Weir Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	7,133
(189)	Weir Group Plc	Morgan Stanley	174
(179)	WH Smith Plc	Goldman Sachs	164
2,090	Whitbread Plc	Bank of America Merrill Lynch	(7,583)
3,227	Whitbread Plc	Goldman Sachs	(11,577)
955	Whitbread Plc	Morgan Stanley	(1,978)
(12,170)	Wise Plc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(13,047)
(686)	Workspace Group Plc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	244
(2,465)	WPP Plc	Bank of America Merrill Lynch	1,813
			(110,264)
	米国		
(111)	10X Genomics Inc 'A'	Goldman Sachs	763
(101)	10X Genomics Inc 'A'	Morgan Stanley	(341)
192	1-800-Flowers.com Inc 'A'	Goldman Sachs	(414)
(49)	2seventy bio Inc	Bank of America Merrill Lynch	519
(1,314)	2seventy bio Inc	Goldman Sachs	10,191
172	2U Inc	Bank of America Merrill Lynch	(371)
1,492	2U Inc	Goldman Sachs	(3,617)
(114)	3D Systems Corp	Goldman Sachs	(16)
106	4D Molecular Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(222)
(122)	8x8 Inc	Goldman Sachs	(39)
89	908 Devices Inc	Bank of America Merrill Lynch	(35)
106	908 Devices Inc	Goldman Sachs	38
544	A10 Networks Inc	Bank of America Merrill Lynch	(138)
831	AAR Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4,090)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
1,445	AAR Corp	Goldman Sachs	(7,219)
407	AbbVie Inc	Morgan Stanley	(337)
177	AbCellera Biologics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(211)
(2,715)	Abercrombie & Fitch Co 'A'	Goldman Sachs	25,358
(1,355)	ABM Industries Inc	Goldman Sachs	4,214
246	Academy Sports & Outdoors Inc	Goldman Sachs	(763)
1,594	ACADIA Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,084)
639	ACADIA Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(435)
225	Acadia Realty Trust (REIT)	Goldman Sachs	(296)
1,632	Accel Entertainment Inc	Goldman Sachs	(310)
(2,759)	Accelerate Diagnostics Inc	Goldman Sachs	4,856
2,648	ACCO Brands Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,377)
7,347	ACCO Brands Corp	Goldman Sachs	(3,820)
1,306	ACI Worldwide Inc	Goldman Sachs	(6,100)
109	Aclaris Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	5
114	ACM Research Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(220)
243	ACM Research Inc 'A'	Goldman Sachs	(3,683)
(4,747)	Activision Blizzard Inc	Morgan Stanley	1,253
(836)	Acushnet Holdings Corp	Goldman Sachs	296
(472)	AdaptHealth Corp	Goldman Sachs	2,641
(29)	Addus HomeCare Corp	Goldman Sachs	430
406	Adobe Inc	Morgan Stanley	2,463
(5,761)	Adtalem Global Education Inc	Goldman Sachs	17,182
(1,946)	ADTRAN Inc	Goldman Sachs	1,226
1,427	Advanced Micro Devices Inc	Bank of America Merrill Lynch	21,712
316	Advanced Micro Devices Inc	Goldman Sachs	4,124
901	Advanced Micro Devices Inc	Morgan Stanley	4,050
460	Advantage Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	(540)
354	Advantage Solutions Inc	Goldman Sachs	(225)
(12,145)	Adverum Biotechnologies Inc	Goldman Sachs	3,765
(875)	AECOM	Goldman Sachs	641
(664)	AerCap Holdings NV	Goldman Sachs	3,986
(2,377)	AerCap Holdings NV	Morgan Stanley	15,677
(1,409)	Aerie Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	2,466
(16)	AeroVironment Inc	Goldman Sachs	82
(172)	Affirm Holdings Inc	Morgan Stanley	(1,799)
158	Agilent Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(868)
1,591	Agilent Technologies Inc	Goldman Sachs	(5,234)
1,560	Agilent Technologies Inc	Morgan Stanley	(12,932)
(2,030)	Air Lease Corp	Goldman Sachs	13,236
(4,554)	Air Lease Corp	Morgan Stanley	20,675
28	Akero Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(136)
154	Akouos Inc	Bank of America Merrill Lynch	(220)
3,515	Akouos Inc	Goldman Sachs	(5,026)
(16)	Alamo Group Inc	Goldman Sachs	8

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
65	Alarm.com Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(103)
157	Alarm.com Holdings Inc	Goldman Sachs	(470)
2,113	Alaska Air Group Inc	Morgan Stanley	(9,509)
(265)	Albemarle Corp	Goldman Sachs	(226)
(866)	Albemarle Corp	Morgan Stanley	2,943
(1,843)	Albertsons Cos Inc	Morgan Stanley	903
(37)	Albireo Pharma Inc	Goldman Sachs	169
611	Alcoa Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,393)
893	Alcoa Corp	Goldman Sachs	(2,036)
1,610	Alcoa Corp	Morgan Stanley	(258)
100	Alector Inc	Goldman Sachs	(184)
(7)	Alexander's Inc (REIT)	Goldman Sachs	75
(3,317)	Alight Inc 'A'	Goldman Sachs	1,476
78	Align Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	57
(65)	Allakos Inc	Goldman Sachs	61
(78)	Allakos Inc	Morgan Stanley	(186)
(2,660)	Allegheny Technologies Inc	Goldman Sachs	7,778
(1,708)	Alliant Energy Corp	Goldman Sachs	(662)
(1,207)	Alliant Energy Corp	Morgan Stanley	1,448
46	Allogene Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(27)
539	Allogene Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(134)
97	Allovir Inc	Bank of America Merrill Lynch	(420)
648	Ally Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(594)
738	Ally Financial Inc	Goldman Sachs	(1,882)
957	Ally Financial Inc	Morgan Stanley	(1,560)
(1,637)	Alpha & Omega Semiconductor Ltd	Goldman Sachs	(7,759)
88	Altair Engineering Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(15)
333	Altair Engineering Inc 'A'	Goldman Sachs	(219)
244	Alteryx Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	912
411	Alteryx Inc 'A'	Goldman Sachs	566
309	Alteryx Inc 'A'	Morgan Stanley	1,208
1,253	Altice USA Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,704)
9,633	Altice USA Inc 'A'	Morgan Stanley	(9,633)
(276)	Altria Group Inc	Goldman Sachs	676
(5,268)	Altria Group Inc	Morgan Stanley	6,532
151	ALX Oncology Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(167)
(54)	Amazon.com Inc	Goldman Sachs	163
(8,015)	Ambac Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	13,486
918	AMC Entertainment Holdings Inc 'A'	Morgan Stanley	(5,168)
(68)	AMERCO	Goldman Sachs	1,945
(123)	AMERCO	Morgan Stanley	1,877
393	American Airlines Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,191)
4,289	American Airlines Group Inc	Goldman Sachs	(12,996)
271	American Airlines Group Inc	Morgan Stanley	(634)
(1,331)	American Eagle Outfitters Inc	Goldman Sachs	2,473

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(91)	American Eagle Outfitters Inc	Morgan Stanley	228
(34)	American Financial Group Inc	Goldman Sachs	300
3,000	American Homes 4 Rent 'A' (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	1,680
3,058	American Homes 4 Rent 'A' (REIT)	Goldman Sachs	1,712
5,090	American Homes 4 Rent 'A' (REIT)	Morgan Stanley	4,021
690	American International Group Inc	Morgan Stanley	(2,339)
(177)	American National Group Inc	Goldman Sachs	33
(342)	American Public Education Inc	Goldman Sachs	623
91	American Woodmark Corp	Bank of America Merrill Lynch	(533)
1,026	American Woodmark Corp	Goldman Sachs	(10,001)
40	America's Car-Mart Inc	Bank of America Merrill Lynch	(635)
109	America's Car-Mart Inc	Goldman Sachs	(1,408)
(1,781)	Americold Realty Trust (REIT)	Goldman Sachs	(243)
(1,963)	Americold Realty Trust (REIT)	Morgan Stanley	(235)
(177)	Ameriprise Financial Inc	Goldman Sachs	3,178
(377)	Ameriprise Financial Inc	Morgan Stanley	4,426
(90)	AMERISAFE Inc	Goldman Sachs	242
10	Amgen Inc	Goldman Sachs	(8)
226	Amgen Inc	Morgan Stanley	23
1,771	Amicus Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(974)
38	Amphastar Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(55)
(733)	Amphenol Corp 'A'	Goldman Sachs	2,052
(7,936)	Amphenol Corp 'A'	Morgan Stanley	16,666
(272)	Amplitude Inc 'A'	Morgan Stanley	(928)
1,496	Amyris Inc	Bank of America Merrill Lynch	76
(732)	Analog Devices Inc	Goldman Sachs	1,763
(62)	Analog Devices Inc	Morgan Stanley	(169)
1,255	Anaplan Inc	Morgan Stanley	1,826
167	Andersons Inc	Bank of America Merrill Lynch	(426)
569	Andersons Inc	Goldman Sachs	(1,451)
436	Annexon Inc	Bank of America Merrill Lynch	(114)
677	Annexon Inc	Goldman Sachs	34
1,308	Antares Pharma Inc	Bank of America Merrill Lynch	(484)
4,671	Antares Pharma Inc	Goldman Sachs	(1,728)
(366)	Antero Resources Corp	Goldman Sachs	622
(2,799)	Antero Resources Corp	Morgan Stanley	252
4,884	Apartment Investment and Management Co 'A' (REIT)	Goldman Sachs	(1,829)
(97)	Apogee Enterprises Inc	Goldman Sachs	213
170	Apollo Commercial Real Estate Finance Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(21)
(607)	Apollo Medical Holdings Inc	Goldman Sachs	15,612
199	Appian Corp	Goldman Sachs	304
2,849	Apple Inc	Morgan Stanley	3,081
(267)	Applied Materials Inc	Goldman Sachs	(1,071)
194	Applied Molecular Transport Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,230)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益 / (損) (米ドル)
	米国 (続き)		
282	Applied Molecular Transport Inc	Goldman Sachs	(1,788)
(131)	AppLovin Corp ' A '	Morgan Stanley	588
191	Apria Inc	Bank of America Merrill Lynch	(363)
404	Apria Inc	Goldman Sachs	(768)
(560)	Aptiv Plc	Morgan Stanley	1,030
(54)	Aramark	Goldman Sachs	221
(1,228)	Aramark	Morgan Stanley	2,959
(49)	ArcBest Corp	Goldman Sachs	321
(732)	Archer-Daniels-Midland Co	Goldman Sachs	2,134
381	Arconic Corp	Goldman Sachs	(1,323)
(1,045)	Arcturus Therapeutics Holdings Inc	Goldman Sachs	(4,243)
70	Arcutis Biotherapeutics Inc	Goldman Sachs	(13)
(32,333)	Ardelyx Inc	Goldman Sachs	8,038
(37)	Arena Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	36
367	Ares Management Corp ' A '	Goldman Sachs	(36)
112	Arista Networks Inc	Bank of America Merrill Lynch	(77)
363	Arista Networks Inc	Goldman Sachs	(1,585)
868	Arista Networks Inc	Morgan Stanley	(1,388)
133	Armada Hoffler Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	(90)
(3,948)	ARMOUR Residential Inc (REIT)	Goldman Sachs	846
(189)	Armstrong World Industries Inc	Goldman Sachs	729
(41)	Armstrong World Industries Inc	Morgan Stanley	167
(5,020)	Arrival Group	Morgan Stanley	(297)
(37)	Arrowhead Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(248)
(623)	Arrowhead Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(1,196)
(418)	Aspen Technology Inc	Goldman Sachs	(125)
(419)	Aspen Technology Inc	Morgan Stanley	2,488
2,188	AssetMark Financial Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,785)
2,745	AssetMark Financial Holdings Inc	Goldman Sachs	(4,749)
48	Associated Banc-Corp	Goldman Sachs	(36)
(367)	Assurant Inc	Goldman Sachs	2,726
(90)	Assurant Inc	Morgan Stanley	870
187	Assured Guaranty Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(236)
286	Astec Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,062)
243	Astec Industries Inc	Goldman Sachs	(1,641)
(1,242)	Atara Biotherapeutics Inc	Goldman Sachs	(397)
(9,375)	Athersys Inc	Goldman Sachs	516
(364)	Atkore Inc	Goldman Sachs	1,154
(92)	Atkore Inc	Morgan Stanley	327
1,960	Atlantica Sustainable Infrastructure Plc	Morgan Stanley	(2,038)
(1,222)	Atlas Air Worldwide Holdings Inc	Goldman Sachs	(1,051)
(625)	Atlas Corp Marshall Islands	Goldman Sachs	143
321	Atlassian Corp Plc ' A '	Bank of America Merrill Lynch	(1,246)
19	Atlassian Corp Plc ' A '	Goldman Sachs	(686)
187	Atlassian Corp Plc ' A '	Morgan Stanley	773

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益 / (損) (米ドル)
	米国 (続き)		
308	Atmos Energy Corp	Morgan Stanley	(476)
156	Atreca Inc ' A '	Bank of America Merrill Lynch	(143)
20	AtriCure Inc	Bank of America Merrill Lynch	(23)
(103)	Aurinia Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	55
(448)	Aurinia Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	266
(359)	Autoliv Inc	Morgan Stanley	(400)
373	AutoNation Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,093)
306	AutoNation Inc	Goldman Sachs	(897)
45	AutoNation Inc	Morgan Stanley	6
447	Avantor Inc	Bank of America Merrill Lynch	845
(20)	Avid Bioservices Inc	Bank of America Merrill Lynch	37
(1,101)	Avid Bioservices Inc	Goldman Sachs	1,707
(432)	AvidXchange Holdings Inc	Goldman Sachs	120
(1,851)	Avient Corp	Goldman Sachs	6,280
727	Avista Corp	Bank of America Merrill Lynch	(260)
2,309	Avnet Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,620)
3,047	Avnet Inc	Goldman Sachs	(10,064)
4,798	Avnet Inc	Morgan Stanley	(14,106)
850	Avrobio Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,097)
513	Avrobio Inc	Goldman Sachs	(662)
(129)	Axcelis Technologies Inc	Goldman Sachs	177
323	Axon Enterprise Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,292
2,017	Axon Enterprise Inc	Goldman Sachs	25,676
534	Axon Enterprise Inc	Morgan Stanley	(449)
(286)	Axsome Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	488
(535)	AZEK Co Inc	Goldman Sachs	735
(1,483)	AZEK Co Inc	Morgan Stanley	1,720
95	AZZ Inc	Bank of America Merrill Lynch	(97)
(2,075)	B Riley Financial Inc	Goldman Sachs	1,369
193	B&G Foods Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3)
(915)	Balchem Corp	Goldman Sachs	3,361
(1,225)	Ball Corp	Morgan Stanley	2,024
(938)	Bancorp Inc	Goldman Sachs	2,092
205	Bandwidth Inc ' A '	Bank of America Merrill Lynch	(1,006)
1,561	Bandwidth Inc ' A '	Goldman Sachs	(8,820)
(2,478)	Bank of New York Mellon Corp	Morgan Stanley	7,062
(440)	Bank OZK	Goldman Sachs	1,055
(876)	BankUnited Inc	Goldman Sachs	2,770
(1,137)	BankUnited Inc	Morgan Stanley	3,444
(49)	Banner Corp	Bank of America Merrill Lynch	248
95	Beacon Roofing Supply Inc	Goldman Sachs	(106)
(75)	Beam Therapeutics Inc	Morgan Stanley	146
(17)	Becton Dickinson and Co	Goldman Sachs	57
(702)	Belden Inc	Goldman Sachs	3,017
856	BellRing Brands Inc ' A '	Bank of America Merrill Lynch	(3,861)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益 / (損) (米ドル)
	米国 (続き)		
403	BellRing Brands Inc ' A '	Goldman Sachs	(1,818)
(208)	Benchmark Electronics Inc	Goldman Sachs	411
(552)	Berkshire Hathaway Inc ' B '	Goldman Sachs	2,067
(149)	Berkshire Hathaway Inc ' B '	Morgan Stanley	1,288
(92)	Berkshire Hills Bancorp Inc	Goldman Sachs	59
(258)	Berry Global Group Inc	Morgan Stanley	(1,305)
(1,918)	BGC Partners Inc ' A '	Goldman Sachs	575
312	BioAtla Inc	Bank of America Merrill Lynch	(954)
449	BioAtla Inc	Goldman Sachs	(1,251)
(228)	BioDelivery Sciences International Inc	Goldman Sachs	90
8	Biogen Inc	Bank of America Merrill Lynch	(149)
176	Biogen Inc	Goldman Sachs	(5,524)
11	Biogen Inc	Morgan Stanley	(151)
(293)	Biohaven Pharmaceutical Holding Co Ltd	Goldman Sachs	1,582
(61)	Biohaven Pharmaceutical Holding Co Ltd	Morgan Stanley	(151)
(199)	BioLife Solutions Inc	Goldman Sachs	1,489
(410)	BioMarin Pharmaceutical Inc	Morgan Stanley	143
(721)	Bionano Genomics Inc	Bank of America Merrill Lynch	753
(2,602)	Bionano Genomics Inc	Goldman Sachs	2,719
736	BJ ' s Restaurants Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,523)
787	BJ ' s Restaurants Inc	Goldman Sachs	(3,952)
38	BJ ' s Wholesale Club Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(47)
189	BJ ' s Wholesale Club Holdings Inc	Goldman Sachs	(737)
257	Black Diamond Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(317)
1,042	Black Diamond Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(1,431)
215	Black Hills Corp	Bank of America Merrill Lynch	(287)
170	Black Hills Corp	Goldman Sachs	(287)
72	Bloom Energy Corp ' A '	Bank of America Merrill Lynch	(224)
1,629	Bloomin ' Brands Inc	Goldman Sachs	(3,137)
(865)	Blue Bird Corp	Goldman Sachs	2,155
(602)	Bluebird Bio Inc	Goldman Sachs	620
(414)	Blueprint Medicines Corp	Goldman Sachs	7,357
(42)	Blueprint Medicines Corp	Morgan Stanley	329
(24)	Boise Cascade Co	Goldman Sachs	180
(27)	Boot Barn Holdings Inc	Goldman Sachs	29
74	BorgWarner Inc	Bank of America Merrill Lynch	(335)
1,485	BorgWarner Inc	Goldman Sachs	(6,727)
1,128	BorgWarner Inc	Morgan Stanley	(3,790)
7,334	Box Inc ' A '	Goldman Sachs	(12,032)
263	Brandywine Realty Trust (REIT)	Goldman Sachs	(81)
95	Bridgebio Pharma Inc	Goldman Sachs	36
(120)	Bright Horizons Family Solutions Inc	Morgan Stanley	(48)
3,032	Brighthouse Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(17,658)
3,124	Brighthouse Financial Inc	Goldman Sachs	(14,894)
2,115	Brighthouse Financial Inc	Morgan Stanley	(7,297)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益 / (損) (米ドル)
	米国 (続き)		
(882)	BrightSphere Investment Group Inc	Goldman Sachs	55
335	BrightView Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(948)
1,086	BrightView Holdings Inc	Goldman Sachs	(3,073)
(222)	Brinker International Inc	Goldman Sachs	233
(255)	Brink ' s Co	Goldman Sachs	381
(1,310)	Bristow Group Inc	Goldman Sachs	6,783
4,739	Brixmor Property Group Inc (REIT)	Goldman Sachs	(7,914)
87	Brixmor Property Group Inc (REIT)	Morgan Stanley	(177)
(475)	Broadcom Inc	Goldman Sachs	1,052
(517)	Broadcom Inc	Morgan Stanley	(5,537)
(355)	Brookdale Senior Living Inc	Goldman Sachs	24
(450)	Brooks Automation Inc	Goldman Sachs	(563)
(444)	Brooks Automation Inc	Morgan Stanley	408
1,911	Brown & Brown Inc	Goldman Sachs	152
5,140	Brown & Brown Inc	Morgan Stanley	(822)
664	BRP Group Inc ' A '	Bank of America Merrill Lynch	(3,652)
1,142	BRP Group Inc ' A '	Goldman Sachs	(6,281)
61	Bruker Corp	Bank of America Merrill Lynch	161
174	Bruker Corp	Goldman Sachs	329
96	Bruker Corp	Morgan Stanley	406
(488)	Brunswick Corp	Goldman Sachs	3,676
(772)	Brunswick Corp	Morgan Stanley	5,142
872	BTRS Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,164)
408	BTRS Holdings Inc	Goldman Sachs	(243)
(400)	Buckle Inc	Goldman Sachs	1,499
680	Builders FirstSource Inc	Bank of America Merrill Lynch	(923)
2,314	Builders FirstSource Inc	Goldman Sachs	(501)
416	Builders FirstSource Inc	Morgan Stanley	(830)
(411)	Bumble Inc ' A '	Goldman Sachs	1,106
(109)	Bumble Inc ' A '	Morgan Stanley	(98)
(440)	Burlington Stores Inc	Goldman Sachs	(8,552)
(878)	Burlington Stores Inc	Morgan Stanley	(24,637)
(5,246)	Butterfly Network Inc	Goldman Sachs	1,512
540	BWX Technologies Inc	Goldman Sachs	(1,615)
282	Byline Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(327)
251	Byline Bancorp Inc	Goldman Sachs	(291)
1,618	C3.ai Inc ' A '	Bank of America Merrill Lynch	1,181
443	C3.ai Inc ' A '	Goldman Sachs	(1,835)
1,563	C3.ai Inc ' A '	Morgan Stanley	1,516
373	C4 Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,973)
565	C4 Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(2,989)
(1,462)	Caesars Entertainment Inc	Goldman Sachs	17,682
4,231	Caesarstone Ltd	Goldman Sachs	(2,496)
(103)	Caleres Inc	Goldman Sachs	102
(300)	California Water Service Group	Goldman Sachs	(30)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
38	Calix Inc	Bank of America Merrill Lynch	(41)
(1,365)	Callaway Golf Co	Morgan Stanley	1,966
169	Callon Petroleum Co	Bank of America Merrill Lynch	(331)
146	Callon Petroleum Co	Goldman Sachs	(1,161)
(2,782)	Cal-Maine Foods Inc	Goldman Sachs	1,964
109	Camden Property Trust (REIT)	Morgan Stanley	(129)
5,046	Campbell Soup Co	Goldman Sachs	(3,431)
6,470	Campbell Soup Co	Morgan Stanley	(65)
90	Canada Goose Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(541)
391	Canada Goose Holdings Inc	Goldman Sachs	(2,350)
215	Cannae Holdings Inc	Goldman Sachs	(235)
(5,063)	Canoo Inc	Bank of America Merrill Lynch	(19,268)
(526)	Cantaloupe Inc	Goldman Sachs	747
3,384	Capital City Bank Group Inc	Goldman Sachs	(4,535)
368	Capital One Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(858)
(142)	Cara Therapeutics Inc	Goldman Sachs	186
351	Cardiovascular Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,089)
844	Cardiovascular Systems Inc	Goldman Sachs	(3,384)
(447)	CareTrust Inc (REIT)	Goldman Sachs	334
(12,160)	CarLotz Inc	Bank of America Merrill Lynch	6,323
(1,738)	CarLotz Inc	Goldman Sachs	904
93	CarMax Inc	Bank of America Merrill Lynch	(192)
103	CarParts.com Inc	Bank of America Merrill Lynch	(35)
642	CarParts.com Inc	Goldman Sachs	(598)
(140)	Carriage Services Inc	Goldman Sachs	274
(2,113)	Cars.com Inc	Goldman Sachs	(8,756)
(20)	Carvana Co	Morgan Stanley	(66)
81	Casella Waste Systems Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(40)
(209)	Cass Information Systems Inc	Goldman Sachs	811
40	Castle Biosciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	(269)
36	Castle Biosciences Inc	Goldman Sachs	(113)
30	Catalent Inc	Bank of America Merrill Lynch	108
83	Catalent Inc	Goldman Sachs	85
90	Catalent Inc	Morgan Stanley	(305)
(1,627)	Catalyst Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	346
(838)	CatchMark Timber Trust Inc 'A' (REIT)	Goldman Sachs	479
(121)	Cathay General Bancorp	Goldman Sachs	383
(370)	Cavco Industries Inc	Goldman Sachs	(4,980)
(2,164)	Celanese Corp	Goldman Sachs	23,074
(1,694)	Celanese Corp	Morgan Stanley	15,565
(1,760)	CEL-SCI Corp	Goldman Sachs	2,171
(62)	Celsius Holdings Inc	Goldman Sachs	437
(313)	Celsius Holdings Inc	Morgan Stanley	851
4,406	Centennial Resource Development Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(5,309)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益 / (損) (米ドル)
	米国 (続き)		
9,168	Centennial Resource Development Inc ' A '	Goldman Sachs	(11,047)
382	Centerspace (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(542)
575	Centerspace (REIT)	Goldman Sachs	(426)
372	Central Garden & Pet Co ' A '	Bank of America Merrill Lynch	(1,856)
279	Central Garden & Pet Co ' A '	Goldman Sachs	(885)
1,449	Century Aluminum Co	Goldman Sachs	(2,318)
104	Century Communities Inc	Bank of America Merrill Lynch	25
431	Century Communities Inc	Goldman Sachs	(89)
(410)	Ceridian HCM Holding Inc	Goldman Sachs	3,005
(659)	Certara Inc	Goldman Sachs	6,775
(1,141)	CF Industries Holdings Inc	Goldman Sachs	216
(851)	CF Industries Holdings Inc	Morgan Stanley	1,781
556	CH Robinson Worldwide Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,188)
258	CH Robinson Worldwide Inc	Goldman Sachs	(355)
665	CH Robinson Worldwide Inc	Morgan Stanley	(1,251)
67	ChannelAdvisor Corp	Goldman Sachs	(122)
(2,233)	ChargePoint Holdings Inc	Goldman Sachs	(537)
(2,639)	ChargePoint Holdings Inc	Morgan Stanley	2,270
22	Charles River Laboratories International Inc	Bank of America Merrill Lynch	94
52	Charles River Laboratories International Inc	Goldman Sachs	(234)
26	Charter Communications Inc ' A '	Morgan Stanley	(87)
234	Chefs ' Warehouse Inc	Bank of America Merrill Lynch	(452)
239	Chefs ' Warehouse Inc	Goldman Sachs	(386)
1,212	Chegg Inc	Morgan Stanley	1,452
88	ChemoCentryx Inc	Bank of America Merrill Lynch	(178)
19	ChemoCentryx Inc	Goldman Sachs	(40)
(117)	Children ' s Place Inc	Goldman Sachs	334
(11,297)	Chimera Investment Corp (REIT)	Goldman Sachs	4,971
(810)	Choice Hotels International Inc	Morgan Stanley	4,414
(210)	Churchill Downs Inc	Morgan Stanley	2,029
26	Chuy ' s Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(98)
40	Cimpress Plc	Bank of America Merrill Lynch	(63)
542	Cimpress Plc	Goldman Sachs	(4,519)
(137)	Cincinnati Financial Corp	Goldman Sachs	358
(2,379)	Cinemark Holdings Inc	Goldman Sachs	7,996
(871)	CIRCOR International Inc	Goldman Sachs	2,265
150	Cirrus Logic Inc	Bank of America Merrill Lynch	190
171	Cirrus Logic Inc	Goldman Sachs	122
361	Cirrus Logic Inc	Morgan Stanley	442
31	Citi Trends Inc	Bank of America Merrill Lynch	(402)
575	Citi Trends Inc	Goldman Sachs	(6,738)
571	Citigroup Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,406)
5,354	Citigroup Inc	Goldman Sachs	(17,954)
4,099	Citigroup Inc	Morgan Stanley	(11,313)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(712)	Citrix Systems Inc	Goldman Sachs	(603)
(1,097)	Citrix Systems Inc	Morgan Stanley	2,842
(15)	City Holding Co	Goldman Sachs	74
(2,822)	Civitas Resources Inc	Goldman Sachs	9,006
(3,605)	Civitas Resources Inc	Morgan Stanley	(1,944)
(1,102)	Clarivate Plc	Goldman Sachs	782
(1,549)	Clarivate Plc	Morgan Stanley	(217)
4,434	Clear Channel Outdoor Holdings Inc	Goldman Sachs	(2,394)
(1,153)	Clearwater Paper Corp	Goldman Sachs	30
75	Clearway Energy Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(76)
384	Clearway Energy Inc 'A'	Goldman Sachs	(129)
564	Clearway Energy Inc 'C'	Goldman Sachs	(294)
(1,495)	Cleveland-Cliffs Inc	Goldman Sachs	750
(1,944)	Clover Health Investments Corp	Bank of America Merrill Lynch	446
326	Clovis Oncology Inc	Goldman Sachs	(3)
139	CNO Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(76)
1,659	CNX Resources Corp	Goldman Sachs	(1,311)
1,529	Coca-Cola Co	Goldman Sachs	(3,034)
7,257	Coca-Cola Co	Morgan Stanley	(16,276)
(11)	Coca-Cola Consolidated Inc	Goldman Sachs	169
729	Coca-Cola Europacific Partners Plc	Bank of America Merrill Lynch	(667)
1,062	Cogent Communications Holdings Inc	Goldman Sachs	(2,804)
(646)	Cognizant Technology Solutions Corp 'A'	Goldman Sachs	713
(673)	Cognizant Technology Solutions Corp 'A'	Morgan Stanley	755
(105)	Cognyte Software Ltd	Goldman Sachs	15
(92)	Cohen & Steers Inc	Goldman Sachs	521
(245)	Coherent Inc	Goldman Sachs	(423)
(418)	Coherent Inc	Morgan Stanley	(541)
(143)	Coinbase Global Inc 'A'	Goldman Sachs	886
(338)	Coinbase Global Inc 'A'	Morgan Stanley	(4,881)
(964)	Colfax Corp	Goldman Sachs	4,251
(2,118)	Colfax Corp	Morgan Stanley	5,762
6,322	Colgate-Palmolive Co	Morgan Stanley	(2,971)
(3,807)	Collegium Pharmaceutical Inc	Goldman Sachs	9,118
(678)	Columbia Sportswear Co	Goldman Sachs	4,454
(1,260)	Columbia Sportswear Co	Morgan Stanley	6,476
(29)	Columbus McKinnon Corp	Goldman Sachs	40
1,308	Comcast Corp 'A'	Goldman Sachs	(1,523)
725	Comcast Corp 'A'	Morgan Stanley	(522)
(343)	Comerica Inc	Morgan Stanley	2,137
12	Comfort Systems USA Inc	Bank of America Merrill Lynch	(65)
(384)	Community Bank System Inc	Goldman Sachs	1,209
107	Community Health Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(195)
(191)	Compass Minerals International Inc	Goldman Sachs	723

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	Compugen Ltd	Bank of America Merrill Lynch	9
2,338	Comstock Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,315)
6,779	Comstock Resources Inc	Goldman Sachs	(6,672)
(412)	Conduent Inc	Goldman Sachs	243
(535)	Confluent Inc ' A '	Morgan Stanley	(3,857)
(313)	CONMED Corp	Goldman Sachs	5,775
(1,380)	ConocoPhillips	Goldman Sachs	1,819
36	Consensus Cloud Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	50
170	Consolidated Communications Holdings Inc	Goldman Sachs	(130)
(918)	Constellation Brands Inc ' A '	Goldman Sachs	4,302
(976)	Constellation Brands Inc ' A '	Morgan Stanley	6,800
693	Constellium SE	Goldman Sachs	(1,545)
4,937	Constellium SE	Morgan Stanley	(6,566)
(3,776)	Container Store Group Inc	Goldman Sachs	4,229
(17,140)	Contango Oil & Gas Co	Goldman Sachs	4,958
12	Continental Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	(35)
173	Continental Resources Inc	Goldman Sachs	(428)
527	Continental Resources Inc	Morgan Stanley	(306)
376	Corcept Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(666)
228	Corcept Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(404)
30	Core Laboratories NV	Goldman Sachs	(62)
(436)	CoreCivic Inc (REIT)	Goldman Sachs	117
524	Cornerstone Building Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	(517)
722	Cornerstone Building Brands Inc	Goldman Sachs	(834)
(3,780)	Corning Inc	Morgan Stanley	2,722
272	CoStar Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(325)
271	CoStar Group Inc	Goldman Sachs	(1,031)
397	Costco Wholesale Corp	Morgan Stanley	1,510
10,609	Coterra Energy Inc	Morgan Stanley	(2,864)
431	Coty Inc ' A '	Goldman Sachs	(56)
247	Coupa Software Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,136)
203	Coupa Software Inc	Morgan Stanley	(290)
541	Covetrus Inc	Goldman Sachs	(465)
91	Cowen Inc ' A '	Bank of America Merrill Lynch	(319)
223	Cowen Inc ' A '	Goldman Sachs	(783)
(226)	Cracker Barrel Old Country Store Inc	Goldman Sachs	4,189
(166)	Crane Co	Goldman Sachs	817
(89)	Crane Co	Morgan Stanley	553
(6)	Credit Acceptance Corp	Morgan Stanley	96
(238)	CRISPR Therapeutics AG	Goldman Sachs	1,058
(364)	CRISPR Therapeutics AG	Morgan Stanley	129
(862)	Crown Holdings Inc	Goldman Sachs	4,749
(2,038)	Crown Holdings Inc	Morgan Stanley	11,738
641	CryoLife Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,840)
916	CryoLife Inc	Goldman Sachs	(2,392)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益 / (損) (米ドル)
	米国 (続き)		
(90)	CryoPort Inc	Goldman Sachs	866
(55)	CTS Corp	Goldman Sachs	107
552	CubeSmart (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	21
354	CubeSmart (REIT)	Goldman Sachs	(181)
971	CubeSmart (REIT)	Morgan Stanley	239
36	Curtiss-Wright Corp	Bank of America Merrill Lynch	(223)
(2,622)	CytomX Therapeutics Inc	Goldman Sachs	1,966
(1,215)	Dana Inc	Goldman Sachs	2,716
(3,631)	Danimer Scientific Inc	Goldman Sachs	12,657
(394)	Darling Ingredients Inc	Morgan Stanley	605
3,794	Dave & Buster 's Entertainment Inc	Goldman Sachs	(21,565)
(156)	DaVita Inc	Goldman Sachs	1,340
(771)	DaVita Inc	Morgan Stanley	4,318
452	Deciphera Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	27
(32)	Deckers Outdoor Corp	Goldman Sachs	220
(192)	Deckers Outdoor Corp	Morgan Stanley	3,884
(28)	Deere & Co	Goldman Sachs	20
(173)	Deere & Co	Morgan Stanley	(197)
1,560	Dell Technologies Inc ' C '	Morgan Stanley	4
579	Delta Air Lines Inc	Morgan Stanley	(2,316)
438	Deluxe Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,336)
930	Deluxe Corp	Goldman Sachs	(2,837)
(335)	Denbury Inc	Goldman Sachs	410
122	DENTSPLY SIRONA Inc	Bank of America Merrill Lynch	(781)
478	DENTSPLY SIRONA Inc	Goldman Sachs	(3,044)
(291)	DermTech Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,120
(607)	DermTech Inc	Goldman Sachs	2,337
126	Designer Brands Inc ' A '	Bank of America Merrill Lynch	(383)
1,020	Designer Brands Inc ' A '	Goldman Sachs	(1,974)
(1,442)	Desktop Metal Inc ' A '	Bank of America Merrill Lynch	2,127
125	DexCom Inc	Morgan Stanley	(1,236)
(1,542)	Diamondback Energy Inc	Morgan Stanley	1,434
385	DiamondRock Hospitality Co (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(508)
335	DiamondRock Hospitality Co (REIT)	Goldman Sachs	(442)
(219)	Diebold Nixdorf Inc	Goldman Sachs	37
212	Digital Landscape Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(190)
(787)	Digital Turbine Inc	Goldman Sachs	8,417
(1,105)	Digital Turbine Inc	Morgan Stanley	2,429
323	DigitalOcean Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,483)
208	DigitalOcean Holdings Inc	Goldman Sachs	20
70	DigitalOcean Holdings Inc	Morgan Stanley	334
(82)	Dillard 's Inc ' A '	Goldman Sachs	2,717
(127)	Dillard 's Inc ' A '	Morgan Stanley	7,482
(159)	Diodes Inc	Goldman Sachs	(32)
3,337	Discovery Inc ' A '	Bank of America Merrill Lynch	(12,811)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
2,423	Discovery Inc 'A'	Morgan Stanley	(4,604)
1,496	Discovery Inc 'C'	Bank of America Merrill Lynch	(5,797)
1,512	Discovery Inc 'C'	Goldman Sachs	(5,632)
1,229	Discovery Inc 'C'	Morgan Stanley	(2,289)
(4,309)	DISH Network Corp 'A'	Morgan Stanley	5,380
(2,294)	Diversified Healthcare Trust (REIT)	Goldman Sachs	1,537
345	Dolby Laboratories Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,251)
106	Dolby Laboratories Inc 'A'	Goldman Sachs	(207)
195	Dollar General Corp	Bank of America Merrill Lynch	(750)
262	Dollar General Corp	Goldman Sachs	(1,436)
25	Dollar General Corp	Morgan Stanley	(93)
(1,535)	Dominion Energy Inc	Morgan Stanley	940
16	Domo Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(173)
693	Donaldson Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,674)
216	Donaldson Co Inc	Goldman Sachs	(829)
380	Donaldson Co Inc	Morgan Stanley	(1,098)
5,360	Donegal Group Inc 'A'	Goldman Sachs	(2,841)
(133)	Douglas Dynamics Inc	Goldman Sachs	509
(1,775)	Dow Inc	Goldman Sachs	1,856
165	DR Horton Inc	Goldman Sachs	469
436	DR Horton Inc	Morgan Stanley	(13)
1,221	Dril-Quip Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,894)
1,148	Dril-Quip Inc	Goldman Sachs	(1,625)
1,054	DTE Energy Co	Bank of America Merrill Lynch	(1,387)
(485)	Duck Creek Technologies Inc	Goldman Sachs	252
907	Duke Realty Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	1,235
1,345	Duke Realty Corp (REIT)	Goldman Sachs	2,009
1,423	Duke Realty Corp (REIT)	Morgan Stanley	667
(3,316)	Dun & Bradstreet Holdings Inc	Goldman Sachs	1,843
(6,864)	Dun & Bradstreet Holdings Inc	Morgan Stanley	(1,991)
(72)	Duolingo Inc	Morgan Stanley	752
(6)	Dutch Bros Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	8
(2,510)	Dutch Bros Inc 'A'	Morgan Stanley	(3,062)
(1,640)	DXC Technology Co	Goldman Sachs	796
845	DXP Enterprises Inc	Goldman Sachs	(4,242)
25	Dycom Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(69)
945	Dyne Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(217)
1,385	Dyne Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(319)
(8,796)	Dynex Capital Inc	Goldman Sachs	7,916
360	E2open Parent Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	22
60	E2open Parent Holdings Inc	Goldman Sachs	10
(87)	Eagle Materials Inc	Goldman Sachs	401
(220)	Eagle Materials Inc	Morgan Stanley	783
129	Eargo Inc	Bank of America Merrill Lynch	13
593	Easterly Government Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	(42)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(696)	Eastern Bankshares Inc	Goldman Sachs	566
209	EastGroup Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	(468)
(266)	Eastman Chemical Co	Morgan Stanley	1,111
(1,722)	Eastman Kodak Co	Bank of America Merrill Lynch	1,688
(705)	eBay Inc	Goldman Sachs	3,114
(2,658)	eBay Inc	Morgan Stanley	8,681
(1,137)	Ebix Inc	Goldman Sachs	3,929
26	EchoStar Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(49)
414	EchoStar Corp 'A'	Goldman Sachs	(753)
208	Ecolab Inc	Goldman Sachs	(1,068)
414	Ecovyst Inc	Bank of America Merrill Lynch	(41)
544	Ecovyst Inc	Goldman Sachs	(164)
(226)	Edgewell Personal Care Co	Goldman Sachs	(6)
113	Editas Medicine Inc	Goldman Sachs	116
116	eGain Corp	Bank of America Merrill Lynch	(64)
889	eHealth Inc	Goldman Sachs	(765)
(441)	El Pollo Loco Holdings Inc	Goldman Sachs	295
651	Elanco Animal Health Inc	Goldman Sachs	(1,657)
327	Elanco Animal Health Inc	Morgan Stanley	(742)
(5,680)	Element Solutions Inc	Goldman Sachs	12,357
(4,379)	Element Solutions Inc	Morgan Stanley	6,612
2,372	elf Beauty Inc	Goldman Sachs	(2,538)
204	Emergent BioSolutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,027
404	Emergent BioSolutions Inc	Goldman Sachs	2,608
(235)	Encompass Health Corp	Goldman Sachs	806
(962)	Encompass Health Corp	Morgan Stanley	3,646
(215)	Encore Capital Group Inc	Goldman Sachs	18
(34)	Encore Wire Corp	Goldman Sachs	45
(2,033)	Endo International Plc	Goldman Sachs	1,748
34	Energizer Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(76)
1,784	Energizer Holdings Inc	Goldman Sachs	(2,891)
344	Enova International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(818)
634	Enova International Inc	Goldman Sachs	(1,335)
(522)	Enovix Corp	Goldman Sachs	(441)
11	Ensign Group Inc	Goldman Sachs	(69)
327	Entercom Communications Corp	Goldman Sachs	(245)
489	Entergy Corp	Morgan Stanley	(683)
1,090	EOG Resources Inc	Morgan Stanley	1,395
(179)	Epizyme Inc	Goldman Sachs	193
(206)	EPR Properties (REIT)	Goldman Sachs	625
1,942	EQT Corp	Goldman Sachs	(2,835)
333	Equifax Inc	Bank of America Merrill Lynch	(773)
54	Equifax Inc	Goldman Sachs	34
266	Equifax Inc	Morgan Stanley	(126)
155	Equinix Inc (REIT)	Goldman Sachs	4,264

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益 / (損) (米ドル)
	米国(続き)		
158	Equinix Inc (REIT)	Morgan Stanley	7,606
192	Equity Commonwealth (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(51)
2,328	Equity Commonwealth (REIT)	Goldman Sachs	(293)
1,990	Equity Residential (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(3,519)
2,705	Equity Residential (REIT)	Goldman Sachs	(4,711)
4,015	Equity Residential (REIT)	Morgan Stanley	3,051
389	Erie Indemnity Co 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(9,881)
161	Erie Indemnity Co 'A'	Goldman Sachs	(4,089)
59	Erie Indemnity Co 'A'	Morgan Stanley	(822)
111	ESCO Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(899)
98	ESCO Technologies Inc	Goldman Sachs	(774)
(2,149)	Esperion Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	752
250	Essential Properties Realty Trust Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(302)
303	Essential Properties Realty Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	(529)
64	Essex Property Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	(206)
44	Establishment Labs Holdings Inc	Goldman Sachs	(12)
204	Estee Lauder Cos Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(2,177)
366	Estee Lauder Cos Inc 'A'	Goldman Sachs	(4,561)
688	Estee Lauder Cos Inc 'A'	Morgan Stanley	(9,377)
(456)	Ethan Allen Interiors Inc	Goldman Sachs	1,027
463	Etsy Inc	Goldman Sachs	4,809
190	Etsy Inc	Morgan Stanley	1,115
476	Euronet Worldwide Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,074)
281	Euronet Worldwide Inc	Goldman Sachs	(3,555)
406	Euronet Worldwide Inc	Morgan Stanley	(2,265)
274	Everbridge Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,949
246	Everbridge Inc	Goldman Sachs	1,161
226	Everbridge Inc	Morgan Stanley	1,252
(1,526)	Evercore Inc 'A'	Goldman Sachs	15,516
(583)	Evercore Inc 'A'	Morgan Stanley	3,335
35	Everest Re Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(662)
196	Everi Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(729)
1,135	EverQuote Inc 'A'	Goldman Sachs	(2,508)
(1,660)	Eversource Energy	Morgan Stanley	365
137	Evolent Health Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(293)
555	Evolent Health Inc 'A'	Goldman Sachs	(993)
157	Evoqua Water Technologies Corp	Goldman Sachs	268
92	Evoqua Water Technologies Corp	Morgan Stanley	29
1,949	EW Scripps Co 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(3,411)
1,540	EW Scripps Co 'A'	Goldman Sachs	(2,637)
(898)	Exelon Corp	Goldman Sachs	1,060
1,575	Expedia Group Inc	Morgan Stanley	(18,727)
6	Exponent Inc	Bank of America Merrill Lynch	(44)
46	Exponent Inc	Goldman Sachs	(137)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益 / (損) (米ドル)
	米国 (続き)		
843	Expro Group Holdings NV	Bank of America Merrill Lynch	(3,296)
1,190	Expro Group Holdings NV	Goldman Sachs	(4,653)
(90)	Fabrinet	Goldman Sachs	167
827	FactSet Research Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	8,448
93	FactSet Research Systems Inc	Goldman Sachs	969
199	FactSet Research Systems Inc	Morgan Stanley	3,465
222	Fair Isaac Corp	Bank of America Merrill Lynch	543
(81)	Farfetch Ltd ' A '	Morgan Stanley	60
(2,877)	Fastenal Co	Goldman Sachs	432
(1,172)	Fastenal Co	Morgan Stanley	645
(1,693)	Fastly Inc ' A '	Bank of America Merrill Lynch	11,486
(29)	Federal Signal Corp	Goldman Sachs	22
154	FedEx Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,585)
750	FedEx Corp	Goldman Sachs	(9,133)
225	FedEx Corp	Morgan Stanley	(2,077)
782	Fidelity National Financial Inc	Goldman Sachs	(970)
1,578	Fidelity National Financial Inc	Morgan Stanley	(3,977)
(8,367)	Fifth Third Bancorp	Morgan Stanley	15,395
41	First Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	(124)
142	First Bancshares Inc	Goldman Sachs	(245)
405	First Busey Corp	Bank of America Merrill Lynch	(668)
2,142	First Busey Corp	Goldman Sachs	(3,534)
3,470	First Financial Corp	Goldman Sachs	(4,858)
64	First Foundation Inc	Goldman Sachs	(41)
423	First Horizon Corp	Goldman Sachs	(197)
2,032	First Interstate BancSystem Inc ' A '	Goldman Sachs	(6,462)
528	First Republic Bank	Bank of America Merrill Lynch	(1,891)
333	First Republic Bank	Goldman Sachs	(1,879)
945	First Republic Bank	Morgan Stanley	(4,029)
(180)	FirstCash Inc	Goldman Sachs	90
(482)	Fiserv Inc	Goldman Sachs	(65)
(6,457)	Fiserv Inc	Morgan Stanley	(11,816)
(3,535)	Fisker Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,074)
42	Fiverr International Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(769)
141	Fiverr International Ltd	Goldman Sachs	754
146	Fiverr International Ltd	Morgan Stanley	1,018
(868)	FleetCor Technologies Inc	Goldman Sachs	10,322
(840)	FleetCor Technologies Inc	Morgan Stanley	11,134
1,788	Fluor Corp	Goldman Sachs	(2,199)
56	Flushing Financial Corp	Goldman Sachs	(17)
2,749	FNB Corp	Goldman Sachs	(1,666)
3,133	Foot Locker Inc	Morgan Stanley	(17,419)
728	Forma Therapeutics Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,184)
393	Forma Therapeutics Holdings Inc	Goldman Sachs	(1,179)
466	Forrester Research Inc	Bank of America Merrill Lynch	(598)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
1,212	Forrester Research Inc	Goldman Sachs	(1,451)
145	Forterra Inc	Goldman Sachs	(8)
836	Fortune Brands Home & Security Inc	Goldman Sachs	(496)
232	Fox Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,114)
2,694	Fox Corp 'A'	Goldman Sachs	(12,114)
871	Fox Corp 'A'	Morgan Stanley	(1,977)
481	Fox Corp 'B'	Goldman Sachs	(254)
2,531	Franklin Street Properties Corp (REIT)	Goldman Sachs	(506)
1,158	Frequency Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(1,216)
(889)	Fresh Del Monte Produce Inc	Goldman Sachs	2,756
3,178	frontdoor Inc	Goldman Sachs	(10,392)
(2,529)	Frontier Communications Parent Inc	Morgan Stanley	(278)
525	FRP Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,625)
350	FRP Holdings Inc	Goldman Sachs	(1,083)
63	FTI Consulting Inc	Bank of America Merrill Lynch	(100)
239	FTI Consulting Inc	Goldman Sachs	(91)
204	FTI Consulting Inc	Morgan Stanley	(1,467)
(147)	Fulgent Genetics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(744)
(407)	Fulgent Genetics Inc	Goldman Sachs	(2,059)
(35)	Futu Holdings Ltd ADR	Bank of America Merrill Lynch	421
(1,019)	Futu Holdings Ltd ADR	Morgan Stanley	6,016
(30)	GameStop Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	151
(326)	GameStop Corp 'A'	Morgan Stanley	4,891
259	GAN Ltd	Goldman Sachs	(26)
(518)	Gannett Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	47
1,777	Gap Inc	Bank of America Merrill Lynch	(13,878)
1,403	Gap Inc	Goldman Sachs	(10,957)
5,062	Gap Inc	Morgan Stanley	(34,978)
(74)	Garmin Ltd	Morgan Stanley	430
697	Gates Industrial Corp Plc	Bank of America Merrill Lynch	(225)
2,697	Gates Industrial Corp Plc	Goldman Sachs	(890)
(422)	GCP Applied Technologies Inc	Goldman Sachs	(734)
660	Genco Shipping & Trading Ltd	Goldman Sachs	370
(53)	Generac Holdings Inc	Morgan Stanley	522
(9,850)	General Motors Co	Morgan Stanley	47,263
(516)	Genesco Inc	Goldman Sachs	4,200
(1,010)	Gentherm Inc	Goldman Sachs	(283)
(531)	GEO Group Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	366
(661)	Geron Corp	Goldman Sachs	56
229	Gevo Inc	Bank of America Merrill Lynch	(14)
5,555	Gevo Inc	Goldman Sachs	(7,928)
32	G-III Apparel Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(78)
131	G-III Apparel Group Ltd	Goldman Sachs	(318)
(98)	Glacier Bancorp Inc	Goldman Sachs	139
(83)	Gladstone Commercial Corp (REIT)	Goldman Sachs	66

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(1,002)	Glatfelter Corp	Bank of America Merrill Lynch	711
(6,747)	Glatfelter Corp	Goldman Sachs	4,644
17	Glaukos Corp	Bank of America Merrill Lynch	(76)
856	Glaukos Corp	Goldman Sachs	(4,345)
11	Global Indemnity Group LLC 'A'	Goldman Sachs	-
(1,009)	Global Industrial Co	Goldman Sachs	2,784
473	Global Medical Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(12)
(2,180)	Globalstar Inc	Goldman Sachs	425
(250)	Globus Medical Inc 'A'	Goldman Sachs	539
(42)	Globus Medical Inc 'A'	Morgan Stanley	141
96	GMS Inc	Bank of America Merrill Lynch	(296)
85	GMS Inc	Goldman Sachs	(37)
113	Golden Entertainment Inc	Bank of America Merrill Lynch	(603)
(20)	Gorman-Rupp Co	Goldman Sachs	39
(7,022)	GrafTech International Ltd	Goldman Sachs	4,593
94	Grand Canyon Education Inc	Bank of America Merrill Lynch	(83)
(800)	Granite Construction Inc	Goldman Sachs	1,472
(11,655)	Graphic Packaging Holding Co	Morgan Stanley	7,925
114	Gray Television Inc	Bank of America Merrill Lynch	(87)
(6,266)	Great Lakes Dredge & Dock Corp	Goldman Sachs	5,890
(146)	Greif Inc 'A'	Goldman Sachs	667
77	Griffon Corp	Goldman Sachs	7
2,029	Grocery Outlet Holding Corp	Goldman Sachs	1,704
(22)	Group 1 Automotive Inc	Goldman Sachs	29
(1,050)	Groupon Inc	Goldman Sachs	5,506
(1,061)	GrowGeneration Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,557
(696)	Guardant Health Inc	Goldman Sachs	(756)
(1,233)	Guess? Inc	Bank of America Merrill Lynch	(481)
(690)	GXO Logistics Inc	Goldman Sachs	106
(1,769)	GXO Logistics Inc	Morgan Stanley	8,133
232	H&R Block Inc	Bank of America Merrill Lynch	(282)
345	Haemonetics Corp	Goldman Sachs	(946)
(257)	Hamilton Lane Inc 'A'	Goldman Sachs	1,555
(61)	Hanger Inc	Goldman Sachs	28
243	Hanover Insurance Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,145)
401	Hanover Insurance Group Inc	Goldman Sachs	(1,921)
1,375	Harley-Davidson Inc	Bank of America Merrill Lynch	(398)
353	Harmony Biosciences Holdings Inc	Goldman Sachs	(354)
(212)	Hasbro Inc	Morgan Stanley	166
105	Haverty Furniture Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	(59)
1,763	Hawaiian Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,026)
1,024	Hawaiian Holdings Inc	Goldman Sachs	(3,120)
(296)	HB Fuller Co	Goldman Sachs	917
(359)	HCA Healthcare Inc	Morgan Stanley	4,466
(1,944)	Healthcare Services Group Inc	Goldman Sachs	3,441

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(4,112)	Healthcare Trust of America Inc 'A' (REIT)	Goldman Sachs	2,335
(2,287)	Healthcare Trust of America Inc 'A' (REIT)	Morgan Stanley	788
316	Heartland Express Inc	Goldman Sachs	(107)
203	Heartland Financial USA Inc	Goldman Sachs	(875)
1,598	Hecla Mining Co	Bank of America Merrill Lynch	(520)
5,688	Hecla Mining Co	Goldman Sachs	(2,593)
230	HEICO Corp	Bank of America Merrill Lynch	(92)
(61)	Heidrick & Struggles International Inc	Goldman Sachs	74
(2,083)	Helios Technologies Inc	Goldman Sachs	12,436
(1,530)	Helmerich & Payne Inc	Goldman Sachs	3,431
432	Hemisphere Media Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,495)
1,408	Hemisphere Media Group Inc	Goldman Sachs	(4,872)
268	Herbalife Nutrition Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(673)
434	Herbalife Nutrition Ltd	Goldman Sachs	(1,460)
498	Herbalife Nutrition Ltd	Morgan Stanley	(981)
54	Heritage Commerce Corp	Bank of America Merrill Lynch	(52)
203	Heritage Commerce Corp	Goldman Sachs	(147)
90	Heritage Insurance Holdings Inc	Goldman Sachs	37
25	Heron Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(44)
1,260	Heron Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(2,205)
(1,387)	Hershey Co	Morgan Stanley	5,118
454	Hess Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3,105)
366	Hess Corp	Goldman Sachs	(2,347)
352	Hess Corp	Morgan Stanley	(785)
3,444	Hewlett Packard Enterprise Co	Bank of America Merrill Lynch	(593)
1,941	Hewlett Packard Enterprise Co	Goldman Sachs	(692)
3,053	Hewlett Packard Enterprise Co	Morgan Stanley	(794)
22	Hibbett Inc	Bank of America Merrill Lynch	(371)
898	Highwoods Properties Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(3,691)
168	Highwoods Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	(690)
1,310	Highwoods Properties Inc (REIT)	Morgan Stanley	(3,485)
(1,554)	Hillenbrand Inc	Goldman Sachs	5,487
(2,213)	Hilltop Holdings Inc	Goldman Sachs	5,643
(704)	Hilton Worldwide Holdings Inc	Morgan Stanley	6,171
396	Hims & Hers Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	43
(38)	HNI Corp	Goldman Sachs	95
(1,340)	Home BancShares Inc	Goldman Sachs	2,021
391	Houghton Mifflin Harcourt Co	Bank of America Merrill Lynch	(266)
995	Houghton Mifflin Harcourt Co	Goldman Sachs	(677)
9	Howard Hughes Corp	Goldman Sachs	(20)
(7,503)	Howmet Aerospace Inc	Goldman Sachs	9,702
(398)	Howmet Aerospace Inc	Morgan Stanley	788
860	HP Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,658
730	HP Inc	Morgan Stanley	1,454

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
41	HubSpot Inc	Bank of America Merrill Lynch	380
6	HubSpot Inc	Morgan Stanley	430
202	Huron Consulting Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,269)
218	Huron Consulting Group Inc	Goldman Sachs	(1,369)
(2,606)	Hyllion Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,202
(3,670)	Hyllion Holdings Corp	Goldman Sachs	3,101
17	Hyster-Yale Materials Handling Inc	Goldman Sachs	(55)
1,181	I3 Verticals Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(4,177)
901	I3 Verticals Inc 'A'	Goldman Sachs	(3,262)
(525)	IAC Holdings Inc	Goldman Sachs	(680)
(2,988)	IAC Holdings Inc	Morgan Stanley	(10,035)
(73)	Ichor Holdings Ltd	Goldman Sachs	(41)
(10,055)	Ideanomics Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,793
(15,129)	Ideanomics Inc	Goldman Sachs	5,900
4,000	iHeartMedia Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(11,960)
892	iHeartMedia Inc 'A'	Goldman Sachs	(2,667)
92	Illinois Tool Works Inc	Bank of America Merrill Lynch	(381)
66	Illinois Tool Works Inc	Goldman Sachs	(471)
8	Illumina Inc	Goldman Sachs	(45)
23	Illumina Inc	Morgan Stanley	(89)
(322)	IMAX Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,069
(2,641)	IMAX Corp	Goldman Sachs	8,396
(3,041)	ImmunoGen Inc	Goldman Sachs	(1,368)
39	Impinj Inc	Bank of America Merrill Lynch	8
(174)	Inari Medical Inc	Goldman Sachs	703
(260)	Inari Medical Inc	Morgan Stanley	208
245	Incyte Corp	Goldman Sachs	1,022
299	Incyte Corp	Morgan Stanley	1,800
(127)	Independence Holding Co	Goldman Sachs	9
796	Independence Realty Trust Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(665)
4,228	Independence Realty Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	(3,375)
(37)	Industrial Logistics Properties Trust (REIT)	Goldman Sachs	27
(53)	Ingersoll Rand Inc	Goldman Sachs	14
(1,279)	Ingersoll Rand Inc	Morgan Stanley	(39)
(266)	Inmode Ltd	Goldman Sachs	3,919
(259)	Inmode Ltd	Morgan Stanley	1,886
(253)	Innovative Industrial Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	5,690
(19)	Innovative Industrial Properties Inc (REIT)	Morgan Stanley	4
(2,161)	Innoviva Inc	Goldman Sachs	777
116	Inogen Inc	Bank of America Merrill Lynch	(327)
511	Inogen Inc	Goldman Sachs	(1,357)
(4,592)	Inovio Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	505
(4,920)	Inseego Corp	Bank of America Merrill Lynch	984
(165)	Insight Enterprises Inc	Goldman Sachs	142

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
109	Insmed Inc	Goldman Sachs	(383)
20	Insperty Inc	Bank of America Merrill Lynch	(130)
(38)	Insteel Industries Inc	Goldman Sachs	72
(69)	Inter Parfums Inc	Goldman Sachs	58
696	Intercept Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(738)
325	Intercept Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(239)
(1,466)	InterDigital Inc	Bank of America Merrill Lynch	6,260
(904)	Interface Inc	Goldman Sachs	1,180
(2,776)	International Business Machines Corp	Goldman Sachs	(611)
(3,768)	International Business Machines Corp	Morgan Stanley	(9,872)
(308)	International Flavors & Fragrances Inc	Goldman Sachs	1,396
(767)	International Flavors & Fragrances Inc	Morgan Stanley	2,715
2,872	International Game Technology Plc	Bank of America Merrill Lynch	(7,115)
198	International Game Technology Plc	Goldman Sachs	(411)
2,136	International Game Technology Plc	Morgan Stanley	(2,478)
(499)	Intra-Cellular Therapies Inc	Goldman Sachs	(523)
413	Intuit Inc	Goldman Sachs	9,799
413	Intuit Inc	Morgan Stanley	6,212
796	Invitation Homes Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	350
2,557	Invitation Homes Inc (REIT)	Goldman Sachs	1,507
6,326	Invitation Homes Inc (REIT)	Morgan Stanley	2,427
(219)	Iovance Biotherapeutics Inc	Goldman Sachs	(45)
(42)	iRhythm Technologies Inc	Goldman Sachs	110
420	Iridium Communications Inc	Bank of America Merrill Lynch	(397)
1,607	Iridium Communications Inc	Goldman Sachs	(2,380)
1,098	Iridium Communications Inc	Morgan Stanley	476
187	Itron Inc	Goldman Sachs	(710)
283	Itron Inc	Morgan Stanley	(535)
(65)	Ituran Location and Control Ltd	Goldman Sachs	29
(954)	IVERIC bio Inc	Goldman Sachs	637
604	J & J Snack Foods Corp	Goldman Sachs	(10,987)
(224)	Jack in the Box Inc	Goldman Sachs	1,580
(205)	Jacobs Engineering Group Inc	Goldman Sachs	462
(219)	Jacobs Engineering Group Inc	Morgan Stanley	(324)
(1,321)	Jamf Holding Corp	Goldman Sachs	(1,651)
(488)	Janus Henderson Group Plc	Goldman Sachs	1,078
(988)	Janus Henderson Group Plc	Morgan Stanley	2,496
234	Jazz Pharmaceuticals Plc	Bank of America Merrill Lynch	(3,971)
136	Jazz Pharmaceuticals Plc	Goldman Sachs	(2,489)
424	Jazz Pharmaceuticals Plc	Morgan Stanley	(4,189)
(305)	JBG SMITH Properties (REIT)	Goldman Sachs	288
(4,436)	Jefferies Financial Group Inc	Goldman Sachs	13,316
(2,804)	Jefferies Financial Group Inc	Morgan Stanley	5,888
1,632	JetBlue Airways Corp	Morgan Stanley	(593)
1,080	JFrog Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4,012)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
100	JFrog Ltd	Goldman Sachs	(372)
6	JFrog Ltd	Morgan Stanley	(13)
(52)	John B Sanfilippo & Son Inc	Goldman Sachs	148
(4)	John Bean Technologies Corp	Goldman Sachs	8
(1,545)	John Wiley & Sons Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	3,770
(581)	Johnson Controls International Plc	Morgan Stanley	1,073
66	Johnson Outdoors Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(290)
29	Johnson Outdoors Inc 'A'	Goldman Sachs	(128)
(60)	Jones Lang LaSalle Inc	Goldman Sachs	1,254
(151)	Jones Lang LaSalle Inc	Morgan Stanley	1,886
(35)	Kadant Inc	Goldman Sachs	73
(112)	Kaman Corp	Goldman Sachs	111
2,627	KAR Auction Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	-
5,231	KAR Auction Services Inc	Goldman Sachs	-
448	Karyopharm Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(287)
60	KB Home	Bank of America Merrill Lynch	2
217	Kelly Services Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(261)
147	Kelly Services Inc 'A'	Goldman Sachs	(106)
84	Kemper Corp	Bank of America Merrill Lynch	(221)
283	Kemper Corp	Goldman Sachs	(855)
(67)	Kennametal Inc	Goldman Sachs	57
845	Keurig Dr Pepper Inc	Bank of America Merrill Lynch	(360)
127	KeyCorp	Bank of America Merrill Lynch	(49)
510	Keysight Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,840
1,375	Keysight Technologies Inc	Goldman Sachs	8,303
1,298	Keysight Technologies Inc	Morgan Stanley	4,906
(1,085)	Kimball Electronics Inc	Goldman Sachs	2,431
(97)	Kimberly-Clark Corp	Morgan Stanley	140
5,542	Kimco Realty Corp (REIT)	Morgan Stanley	(7,537)
380	Kinnate Biopharma Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,030)
16	Kinsale Capital Group Inc	Goldman Sachs	(66)
50	Kirby Corp	Bank of America Merrill Lynch	(212)
1,101	Kirby Corp	Goldman Sachs	(5,632)
(117)	Kodiak Sciences Inc	Goldman Sachs	1,350
(69)	Kodiak Sciences Inc	Morgan Stanley	386
1,391	Kohl's Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4,834)
847	Kohl's Corp	Goldman Sachs	(5,668)
876	Kohl's Corp	Morgan Stanley	(5,187)
229	Kontoor Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,131)
223	Kontoor Brands Inc	Goldman Sachs	(1,153)
(610)	Koppers Holdings Inc	Goldman Sachs	2,690
(1,691)	Korn Ferry	Goldman Sachs	12,666
995	Kratos Defense & Security Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	(633)
699	Kratos Defense & Security Solutions Inc	Goldman Sachs	(1,255)
312	Kronos Bio Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,098)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
56	Kronos Bio Inc	Goldman Sachs	(126)
(154)	Kronos Worldwide Inc	Goldman Sachs	76
24	Krystal Biotech Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,019
(360)	Kulicke & Soffa Industries Inc	Goldman Sachs	588
1,434	Kura Oncology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,861)
1,223	Kura Oncology Inc	Goldman Sachs	(4,146)
50	Kymera Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(2)
(3,238)	Kyndryl Holdings Inc	Goldman Sachs	7,900
416	Lamb Weston Holdings Inc	Morgan Stanley	(775)
(1,958)	Landec Corp	Goldman Sachs	3,172
(252)	Lantheus Holdings Inc	Goldman Sachs	188
(2,122)	Las Vegas Sands Corp	Goldman Sachs	7,119
(2,420)	Las Vegas Sands Corp	Morgan Stanley	9,532
(60)	Laureate Education Inc 'A'	Goldman Sachs	45
(511)	LCI Industries	Goldman Sachs	2,004
122	LeMaitre Vascular Inc	Goldman Sachs	(939)
(483)	Lemonade Inc	Morgan Stanley	60
223	LendingClub Corp	Goldman Sachs	(170)
112	LendingTree Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,091)
884	LendingTree Inc	Goldman Sachs	(22,173)
122	Lennox International Inc	Goldman Sachs	212
(5,804)	Lexicon Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	2,659
(132)	Liberty Broadband Corp	Goldman Sachs	1,143
(248)	Liberty Broadband Corp	Morgan Stanley	504
(1,104)	Liberty Broadband Corp 'A'	Goldman Sachs	10,351
(185)	Liberty Broadband Corp 'A'	Morgan Stanley	443
133	Liberty Latin America Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(297)
214	Liberty Latin America Ltd 'A'	Goldman Sachs	(412)
(857)	Liberty Latin America Ltd 'C'	Goldman Sachs	1,894
(638)	Liberty Media Corp-Liberty Braves 'C'	Goldman Sachs	1,908
442	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	Bank of America Merrill Lynch	24
567	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(136)
167	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C'	Morgan Stanley	(33)
1	Liberty TripAdvisor Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	(1)
332	Life Storage Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	70
505	Life Storage Inc (REIT)	Goldman Sachs	46
45	Life Storage Inc (REIT)	Morgan Stanley	32
(86)	Ligand Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	855
(86)	Lindblad Expeditions Holdings Inc	Goldman Sachs	48
2,651	Lions Gate Entertainment Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(9,491)
2,832	Lions Gate Entertainment Corp 'A'	Goldman Sachs	(10,139)
(68)	Littelfuse Inc	Goldman Sachs	329
(265)	LivaNova Plc	Goldman Sachs	356
(584)	Livent Corp	Goldman Sachs	(975)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(231)	Livent Corp	Morgan Stanley	(178)
512	LivePerson Inc	Goldman Sachs	105
78	LiveRamp Holdings Inc	Goldman Sachs	(37)
(47)	LKQ Corp	Goldman Sachs	105
(1,214)	LKQ Corp	Morgan Stanley	1,841
(1,883)	Loews Corp	Goldman Sachs	2,890
(11,590)	Loews Corp	Morgan Stanley	24,455
(2,675)	Lordstown Motors Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	2,806
(11,621)	Lordstown Motors Corp 'A'	Goldman Sachs	12,667
18	Loyalty Ventures Inc	Morgan Stanley	(57)
(1,034)	LTC Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	2,251
(510)	Lucid Group Inc	Goldman Sachs	(2,452)
(882)	Lucid Group Inc	Morgan Stanley	(4,728)
(68)	Lululemon Athletica Inc	Morgan Stanley	(334)
(66)	Lumber Liquidators Holdings Inc	Goldman Sachs	99
(1,509)	Lumen Technologies Inc	Goldman Sachs	2,460
(2,995)	Luminar Technologies Inc	Goldman Sachs	10,780
(799)	Luminar Technologies Inc	Morgan Stanley	1,103
1,488	Luther Burbank Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,607)
1,244	Luther Burbank Corp	Goldman Sachs	(1,344)
1,620	Lyft Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(7,045)
619	Lyft Inc 'A'	Morgan Stanley	(241)
(750)	LyondellBasell Industries NV 'A'	Goldman Sachs	5,110
(151)	LyondellBasell Industries NV 'A'	Morgan Stanley	781
218	M&T Bank Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,417)
649	M&T Bank Corp	Goldman Sachs	(7,566)
185	M&T Bank Corp	Morgan Stanley	(2,325)
214	M/I Homes Inc	Bank of America Merrill Lynch	(503)
652	M/I Homes Inc	Goldman Sachs	(1,516)
(450)	Madison Square Garden Entertainment Corp	Goldman Sachs	2,684
(1,096)	Madison Square Garden Sports Corp	Goldman Sachs	22,336
(1,972)	Madison Square Garden Sports Corp	Morgan Stanley	10,925
(55)	Madrigal Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	16
361	Malibu Boats Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(445)
541	Malibu Boats Inc 'A'	Goldman Sachs	(1,183)
142	Manhattan Associates Inc	Morgan Stanley	(870)
(227)	Manitowoc Co Inc	Goldman Sachs	234
1,006	ManpowerGroup Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11,730)
1,095	ManpowerGroup Inc	Goldman Sachs	(12,768)
727	ManpowerGroup Inc	Morgan Stanley	(6,783)
(1,015)	Marathon Digital Holdings Inc	Goldman Sachs	(1,832)
(702)	Marathon Digital Holdings Inc	Morgan Stanley	(2,001)
(1,690)	Marathon Petroleum Corp	Morgan Stanley	3,500
341	Marcus Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,200)
227	Marcus Corp	Goldman Sachs	(699)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
270	MarineMax Inc	Goldman Sachs	(872)
5	Markel Corp	Bank of America Merrill Lynch	(276)
10	Markel Corp	Goldman Sachs	(553)
23	Markel Corp	Morgan Stanley	(905)
1,164	Marqeta Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(771)
1,200	Marqeta Inc 'A'	Morgan Stanley	(1,410)
16	Marsh & McLennan Cos Inc	Goldman Sachs	(17)
3,005	Marsh & McLennan Cos Inc	Morgan Stanley	(9,045)
934	Marten Transport Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,373)
307	Marten Transport Ltd	Goldman Sachs	(451)
159	Masco Corp	Bank of America Merrill Lynch	(309)
2,333	Masco Corp	Goldman Sachs	(4,315)
2,993	Masco Corp	Morgan Stanley	(3,814)
227	MasTec Inc	Morgan Stanley	(506)
(1,148)	Match Group Inc	Goldman Sachs	11,993
(742)	Match Group Inc	Morgan Stanley	2,725
(73)	Materion Corp	Goldman Sachs	594
(1,910)	Matson Inc	Goldman Sachs	20,997
(150)	Matthews International Corp 'A'	Goldman Sachs	78
192	Maxar Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(18)
(506)	MAXIMUS Inc	Morgan Stanley	499
(1,128)	MBIA Inc	Goldman Sachs	1,816
48	McDonald's Corp	Bank of America Merrill Lynch	(211)
(1,385)	McEwen Mining Inc	Bank of America Merrill Lynch	193
740	McKesson Corp	Goldman Sachs	(1,221)
1,818	McKesson Corp	Morgan Stanley	(3,254)
293	MDC Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(737)
1,718	MDC Holdings Inc	Goldman Sachs	(4,073)
686	Media General Inc*	Bank of America Merrill Lynch	-
(135)	MediaAlpha Inc 'A'	Goldman Sachs	(153)
(43)	MEDNAX Inc	Goldman Sachs	3
(168)	MeiraGTX Holdings Plc	Goldman Sachs	222
(26)	MercadoLibre Inc	Goldman Sachs	3,048
(70)	MercadoLibre Inc	Morgan Stanley	5,271
(1,661)	Mercer International Inc	Goldman Sachs	(166)
25	Merchants Bancorp	Goldman Sachs	(72)
613	Mercury Systems Inc	Goldman Sachs	(1,606)
(2,246)	Meridian Bioscience Inc	Goldman Sachs	(953)
118	Merit Medical Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(438)
212	Merit Medical Systems Inc	Goldman Sachs	(787)
603	Meritor Inc	Bank of America Merrill Lynch	(538)
1,182	Meritor Inc	Goldman Sachs	(2,077)
(1,274)	Meta Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	6,701
(314)	Meta Platforms Inc 'A'	Goldman Sachs	3,723
(515)	Meta Platforms Inc 'A'	Morgan Stanley	2,506

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(263)	Method Electronics Inc	Goldman Sachs	127
(1,242)	MetroMile Inc	Bank of America Merrill Lynch	671
(8,717)	MetroMile Inc	Goldman Sachs	3,846
17	Mettler-Toledo International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(247)
113	Mettler-Toledo International Inc	Goldman Sachs	(1,848)
50	Mettler-Toledo International Inc	Morgan Stanley	(866)
452	MFA Financial Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(18)
(1,450)	MGIC Investment Corp	Goldman Sachs	1,450
(271)	MGIC Investment Corp	Morgan Stanley	225
(945)	MGM Growth Properties LLC 'A' (REIT)	Goldman Sachs	557
(3,267)	MGM Resorts International	Goldman Sachs	17,544
(3,334)	MGM Resorts International	Morgan Stanley	13,636
21	MGP Ingredients Inc	Bank of America Merrill Lynch	111
16	MGP Ingredients Inc	Goldman Sachs	69
1,555	Michael Kors Holdings Ltd	Morgan Stanley	(7,106)
(524)	Microchip Technology Inc	Morgan Stanley	(1,520)
882	Micron Technology Inc	Morgan Stanley	2,196
(5,382)	MicroVision Inc	Bank of America Merrill Lynch	10,387
91	Midland States Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(156)
94	Midland States Bancorp Inc	Goldman Sachs	(110)
(19)	MillerKnoll Inc	Goldman Sachs	11
(254)	Mirati Therapeutics Inc	Morgan Stanley	516
2,055	Mitek Systems Inc	Goldman Sachs	(575)
(196)	MKS Instruments Inc	Morgan Stanley	(336)
720	Model N Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,766)
2,136	Model N Inc	Goldman Sachs	(11,171)
(55)	ModivCare Inc	Bank of America Merrill Lynch	644
(761)	ModivCare Inc	Goldman Sachs	8,894
(2,579)	Moelis & Co 'A'	Goldman Sachs	16,436
(3,433)	Moelis & Co 'A'	Morgan Stanley	10,679
(460)	Mohawk Industries Inc	Goldman Sachs	2,769
(988)	Mohawk Industries Inc	Morgan Stanley	11,145
465	Molson Coors Beverage Co 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(1,694)
352	Molson Coors Beverage Co 'B'	Goldman Sachs	(996)
2,287	Molson Coors Beverage Co 'B'	Morgan Stanley	(6,404)
144	Momentive Global Inc	Goldman Sachs	24
(212)	Monarch Casino & Resort Inc	Bank of America Merrill Lynch	939
(257)	Monarch Casino & Resort Inc	Goldman Sachs	1,139
(96)	MongoDB Inc	Goldman Sachs	2,972
29	Moog Inc 'A'	Goldman Sachs	(177)
92	Morningstar Inc	Bank of America Merrill Lynch	(26)
266	Morningstar Inc	Goldman Sachs	(74)
162	Morningstar Inc	Morgan Stanley	(439)
(213)	Movado Group Inc	Goldman Sachs	(386)
(466)	MP Materials Corp	Goldman Sachs	(603)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益 / (損) (米ドル)
	米国 (続き)		
114	Mr Cooper Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(106)
1,179	MRC Global Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,292)
7,159	MRC Global Inc	Goldman Sachs	(8,090)
67	MSCI Inc	Bank of America Merrill Lynch	-
(182)	Mueller Industries Inc	Goldman Sachs	192
313	Multiplan Corp	Bank of America Merrill Lynch	(42)
3,707	Multiplan Corp	Goldman Sachs	(1,780)
(1,329)	Murphy Oil Corp	Goldman Sachs	1,341
(271)	Myers Industries Inc	Goldman Sachs	282
(96)	Myovant Sciences Ltd	Goldman Sachs	110
(252)	MYR Group Inc	Goldman Sachs	(305)
337	N-able Inc	Goldman Sachs	(119)
320	N-Able Inc	Bank of America Merrill Lynch	(228)
84	Nabors Industries Ltd	Goldman Sachs	(1,000)
(6,898)	Nano Dimension Ltd ADR	Bank of America Merrill Lynch	4,863
(1,639)	Nano Dimension Ltd ADR	Goldman Sachs	1,155
777	NanoString Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,186)
1,684	NanoString Technologies Inc	Goldman Sachs	(8,959)
36	Napco Security Technologies Inc	Goldman Sachs	(97)
(15)	National Bank Holdings Corp ' A '	Goldman Sachs	48
(404)	National Beverage Corp	Goldman Sachs	3,895
(22)	National HealthCare Corp	Goldman Sachs	12
2,868	National Retail Properties Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(3,541)
56	National Retail Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	(93)
401	National Retail Properties Inc (REIT)	Morgan Stanley	(672)
579	National Storage Affiliates Trust (REIT)	Morgan Stanley	(110)
116	Natus Medical Inc	Bank of America Merrill Lynch	(254)
24	Natus Medical Inc	Goldman Sachs	(47)
(2,954)	Nautilus Inc	Goldman Sachs	3,290
(12)	Neenah Inc	Goldman Sachs	19
500	Nektar Therapeutics	Bank of America Merrill Lynch	(220)
39	Nelnet Inc ' A '	Goldman Sachs	(42)
(764)	Netflix Inc	Morgan Stanley	(10,171)
42	NETGEAR Inc	Bank of America Merrill Lynch	(18)
(362)	NetScout Systems Inc	Goldman Sachs	61
222	New Jersey Resources Corp	Bank of America Merrill Lynch	(144)
(519)	New Residential Investment Corp (REIT)	Morgan Stanley	171
(637)	New York Times Co ' A '	Goldman Sachs	(26)
(211)	Newmark Group Inc ' A '	Goldman Sachs	191
170	NexPoint Residential Trust Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(465)
188	NexPoint Residential Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	(425)
118	Nexstar Media Group Inc ' A '	Bank of America Merrill Lynch	(2,099)
839	NextGen Healthcare Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,170)
3,101	NextGen Healthcare Inc	Goldman Sachs	(4,298)
1,325	NGM Biopharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,211)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益 / (損) (米ドル)
	米国 (続き)		
1,061	NGM Biopharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(2,432)
(533)	NIKE Inc ' B '	Morgan Stanley	2,142
(886)	Nikola Corp	Goldman Sachs	566
(2,701)	Nikola Corp	Morgan Stanley	1,405
1,134	NiSource Inc	Goldman Sachs	(672)
1,990	NiSource Inc	Morgan Stanley	(561)
594	Nkarta Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,755)
433	Nkarta Inc	Goldman Sachs	(1,303)
84	NMI Holdings Inc ' A '	Bank of America Merrill Lynch	(124)
760	Nordstrom Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,932)
3,558	Nordstrom Inc	Goldman Sachs	(39,364)
5,999	Nordstrom Inc	Morgan Stanley	(54,209)
195	Northern Oil and Gas Inc	Bank of America Merrill Lynch	(125)
(354)	Northfield Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	464
(2,757)	Northfield Bancorp Inc	Goldman Sachs	3,612
121	Northwest Natural Holding Co	Bank of America Merrill Lynch	(110)
59	NorthWestern Corp	Bank of America Merrill Lynch	(187)
428	NorthWestern Corp	Goldman Sachs	(684)
1,688	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(10,010)
2,480	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	Goldman Sachs	(12,405)
1,732	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	Morgan Stanley	(5,923)
(11)	Novanta Inc	Bank of America Merrill Lynch	25
(339)	Novanta Inc	Goldman Sachs	762
(218)	Novavax Inc	Goldman Sachs	2,961
(252)	Novocure Ltd	Goldman Sachs	2,926
(347)	Novocure Ltd	Morgan Stanley	(1,319)
(3,499)	Novume Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	13,786
336	NOW Inc	Bank of America Merrill Lynch	(386)
920	NOW Inc	Goldman Sachs	(984)
(611)	Nu Skin Enterprises Inc ' A '	Goldman Sachs	1,797
(1,974)	Nucor Corp	Goldman Sachs	(2,068)
(1,703)	Nucor Corp	Morgan Stanley	14,322
2,126	Nutanix Inc ' A '	Morgan Stanley	5,039
215	NuVasive Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,545)
49	NV5 Global Inc	Bank of America Merrill Lynch	141
134	NV5 Global Inc	Goldman Sachs	1,755
356	NVIDIA Corp	Goldman Sachs	11,616
180	NVIDIA Corp	Morgan Stanley	2,398
1	NVR Inc	Bank of America Merrill Lynch	(55)
4	NVR Inc	Goldman Sachs	172
(2,190)	Oak Street Health Inc	Goldman Sachs	13,201
(124)	Oak Street Health Inc	Morgan Stanley	171
(705)	Oceanering International Inc	Goldman Sachs	358
(3,023)	Ocugen Inc	Bank of America Merrill Lynch	5,411
(2,050)	Ocugen Inc	Goldman Sachs	3,669

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益 / (損) (米ドル)
	米国 (続き)		
(776)	ODP Corp	Goldman Sachs	1,731
61	O-I Glass Inc	Bank of America Merrill Lynch	(25)
115	Okta Inc	Goldman Sachs	662
1,046	Okta Inc	Morgan Stanley	(577)
(148)	Olaplex Holdings Inc	Goldman Sachs	(131)
(274)	Olaplex Holdings Inc	Morgan Stanley	(238)
(255)	Olin Corp	Morgan Stanley	391
410	Ollie 's Bargain Outlet Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,974)
217	Ollie 's Bargain Outlet Holdings Inc	Goldman Sachs	(993)
457	Ollie 's Bargain Outlet Holdings Inc	Morgan Stanley	(2,432)
(464)	Omnicom Group Inc	Morgan Stanley	274
(71)	On Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	111
(1,802)	On Holding AG	Morgan Stanley	3,288
(359)	ON Semiconductor Corp	Morgan Stanley	(388)
57	ON24 Inc	Bank of America Merrill Lynch	10
(32)	One Liberty Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	68
(820)	OneSpan Inc	Goldman Sachs	1,870
(655)	OneSpaWorld Holdings Ltd	Goldman Sachs	1,893
(27)	Onto Innovation Inc	Goldman Sachs	(127)
(4,086)	Ontrak Inc	Goldman Sachs	5,802
(131)	Open Lending Corp ' A '	Goldman Sachs	964
(2,352)	Open Lending Corp ' A '	Morgan Stanley	7,040
(229)	Opendoor Technologies Inc	Goldman Sachs	949
(8,426)	Opendoor Technologies Inc	Morgan Stanley	10,292
(3,308)	OPKO Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	328
(796)	OPKO Health Inc	Goldman Sachs	(48)
(489)	Option Care Health Inc	Goldman Sachs	(67)
(532)	Oracle Corp	Goldman Sachs	234
(1,375)	Organon & Co	Morgan Stanley	457
1,434	Origin Bancorp Inc	Goldman Sachs	(5,750)
(272)	Orion Engineered Carbons SA	Goldman Sachs	75
4	Orion Office Inc (REIT)	Goldman Sachs	(14)
98	Orion Office Inc (REIT)	Morgan Stanley	(69)
1,425	Ortho Clinical Diagnostics Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1,550)
1,149	Ortho Clinical Diagnostics Holdings Plc	Goldman Sachs	(1,177)
90	Orthofix Medical Inc	Bank of America Merrill Lynch	(124)
3,331	Otis Worldwide Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4,633)
1,817	Otis Worldwide Corp	Goldman Sachs	(2,526)
3,752	Otis Worldwide Corp	Morgan Stanley	(5,365)
4,808	Outfront Media Inc (REIT)	Goldman Sachs	(13,510)
190	Overstock.com Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,327)
254	Overstock.com Inc	Goldman Sachs	(3,958)
51	Overstock.com Inc	Morgan Stanley	(630)
818	Ovintiv Inc	Goldman Sachs	(573)
(878)	Owens & Minor Inc	Goldman Sachs	1,949

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(3,589)	PACCAR Inc	Morgan Stanley	12,131
(62)	Pacific Premier Bancorp Inc	Goldman Sachs	51
(210)	Pacira BioSciences Inc	Goldman Sachs	(199)
(40)	Packaging Corp of America	Goldman Sachs	113
(90)	Packaging Corp of America	Morgan Stanley	179
(916)	Pactiv Evergreen Inc	Goldman Sachs	1,255
1,554	PagerDuty Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,935)
1,414	PagerDuty Inc	Goldman Sachs	(3,486)
3,094	PagerDuty Inc	Morgan Stanley	2,514
(5,077)	Palantir Technologies Inc 'A'	Goldman Sachs	10,791
179	Papa John's International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,106)
253	Papa John's International Inc	Goldman Sachs	(1,677)
273	Papa John's International Inc	Morgan Stanley	(1,728)
388	Par Pacific Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(63)
69	Par Pacific Holdings Inc	Goldman Sachs	(18)
694	Paramount Group Inc (REIT)	Goldman Sachs	(902)
(87)	Parker-Hannifin Corp	Goldman Sachs	2,149
(31)	Parsons Corp	Goldman Sachs	16
1,138	Passage Bio Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,456)
4,642	Passage Bio Inc	Goldman Sachs	(6,406)
38	Patrick Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(60)
350	Patterson Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	(430)
315	Patterson Cos Inc	Goldman Sachs	(397)
(530)	Paya Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	1,007
6	Paycom Software Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11)
93	Paycom Software Inc	Goldman Sachs	(1,977)
33	Paycom Software Inc	Morgan Stanley	80
293	Paylocity Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	(448)
461	Paylocity Holding Corp	Goldman Sachs	(1,297)
589	Paylocity Holding Corp	Morgan Stanley	(1,076)
629	PBF Energy Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,162)
543	PBF Energy Inc 'A'	Goldman Sachs	(562)
31	PC Connection Inc	Bank of America Merrill Lynch	(134)
(63)	PDC Energy Inc	Goldman Sachs	216
(225)	PDC Energy Inc	Morgan Stanley	379
876	Peloton Interactive Inc 'A'	Goldman Sachs	(2,229)
1,360	Peloton Interactive Inc 'A'	Morgan Stanley	1,442
102	Pennant Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(192)
(160)	PennyMac Financial Services Inc	Goldman Sachs	(302)
(681)	PennyMac Financial Services Inc	Morgan Stanley	129
161	Penumbra Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,227)
11	Penumbra Inc	Goldman Sachs	(152)
59	Penumbra Inc	Morgan Stanley	(949)
3,920	Peoples Bancorp Inc	Goldman Sachs	(9,251)
(361)	PepsiCo Inc	Goldman Sachs	216

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益 / (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(966)	PepsiCo Inc	Morgan Stanley	1,056
(2,194)	Perdoceo Education Corp	Goldman Sachs	1,621
139	Perficient Inc	Goldman Sachs	(163)
1,327	Personalis Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,879)
186	Personalis Inc	Goldman Sachs	(41)
370	PET Acquisition LLC 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(2,099)
98	PET Acquisition LLC 'A'	Goldman Sachs	(251)
1,029	PET Acquisition LLC 'A'	Morgan Stanley	(1,461)
731	PetIQ Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,573)
333	PetIQ Inc	Goldman Sachs	(759)
677	Pfizer Inc	Morgan Stanley	1,293
(11,519)	PG&E Corp	Morgan Stanley	(922)
69	PGT Innovations Inc	Bank of America Merrill Lynch	(22)
761	Phathom Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,331)
398	Phathom Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(816)
66	Phibro Animal Health Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(123)
170	Phibro Animal Health Corp 'A'	Goldman Sachs	(316)
790	Philip Morris International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,501)
1,648	Phillips 66	Bank of America Merrill Lynch	(12,785)
1,211	Phillips 66	Goldman Sachs	(6,765)
1,309	Phillips 66	Morgan Stanley	(4,267)
252	Phreesia Inc	Goldman Sachs	(102)
1,018	Physicians Realty Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(306)
2,753	Ping Identity Holding Corp	Goldman Sachs	(9,470)
(285)	Pinterest Inc 'A'	Goldman Sachs	(106)
(935)	Pinterest Inc 'A'	Morgan Stanley	1,393
(19)	Pioneer Natural Resources Co	Goldman Sachs	193
(375)	Pioneer Natural Resources Co	Morgan Stanley	1,603
(131)	Piper Sandler Cos	Goldman Sachs	1,242
(12)	PJT Partners Inc 'A'	Goldman Sachs	43
590	Planet Fitness Inc 'A'	Goldman Sachs	(2,557)
(703)	Plantronics Inc	Goldman Sachs	1,694
(965)	PLBY Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,910)
(1,268)	PLBY Group Inc	Goldman Sachs	(11,881)
(1,868)	Plexus Corp	Goldman Sachs	14,963
155	Pliant Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(173)
(1,162)	Plug Power Inc	Goldman Sachs	3,337
547	PMV Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,378)
693	PMV Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(1,797)
(36)	Polaris Inc	Goldman Sachs	291
(571)	Polaris Inc	Morgan Stanley	5,461
354	Poshmark Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(292)
58	Poshmark Inc 'A'	Goldman Sachs	(108)
(387)	Post Holdings Inc	Goldman Sachs	1,816
(179)	Post Holdings Inc	Morgan Stanley	861

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(243)	PotlatchDeltic Corp (REIT)	Goldman Sachs	728
271	PPD Inc	Goldman Sachs	(19)
(1,920)	PPL Corp	Goldman Sachs	932
176	PRA Group Inc	Goldman Sachs	115
701	Precigen Inc	Goldman Sachs	151
163	Premier Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(283)
84	Prestige Consumer Healthcare Inc	Goldman Sachs	(65)
38	Procure Technologies Inc	Goldman Sachs	166
1,237	Procter & Gamble Co	Goldman Sachs	742
1,007	Procter & Gamble Co	Morgan Stanley	(591)
12	PROG Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(13)
155	PROG Holdings Inc	Goldman Sachs	(147)
653	Progress Software Corp	Goldman Sachs	(2,129)
(3,037)	Progressive Corp	Goldman Sachs	55
(3,496)	Progressive Corp	Morgan Stanley	(5,034)
608	Prologis Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(66)
204	Prologis Inc (REIT)	Goldman Sachs	571
193	Prologis Inc (REIT)	Morgan Stanley	155
998	ProPetro Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	(514)
1,211	ProPetro Holding Corp	Goldman Sachs	(680)
306	PROS Holdings Inc	Goldman Sachs	(46)
272	Protagonist Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(183)
(33)	Prothena Corp Plc	Goldman Sachs	149
63	Proto Labs Inc	Bank of America Merrill Lynch	(486)
2,093	Proto Labs Inc	Goldman Sachs	(15,709)
(131)	Provention Bio Inc	Goldman Sachs	(76)
93	PTC Inc	Bank of America Merrill Lynch	(929)
81	PTC Inc	Morgan Stanley	(475)
305	PTC Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(436)
893	PTC Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(1,277)
164	PubMatic Inc 'A'	Goldman Sachs	643
(217)	Pulse Evolution Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(55)
300	PulteGroup Inc	Bank of America Merrill Lynch	(254)
592	PulteGroup Inc	Morgan Stanley	(437)
2,521	Pure Storage Inc 'A'	Morgan Stanley	11,143
(1,230)	Purple Innovation Inc	Goldman Sachs	653
(113)	Q2 Holdings Inc	Morgan Stanley	253
11	Quaker Chemical Corp	Bank of America Merrill Lynch	(40)
51	Quaker Chemical Corp	Goldman Sachs	(1,096)
182	Qualtrics International Inc 'A'	Goldman Sachs	(620)
62	Qualtrics International Inc 'A'	Morgan Stanley	(25)
104	Quanterix Corp	Goldman Sachs	(79)
(161)	QuantumScape Corp	Goldman Sachs	569
(1,959)	QuantumScape Corp	Morgan Stanley	8,262
(425)	Quidel Corp	Goldman Sachs	(3,190)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益 / (損) (米ドル)
	米国 (続き)		
(70)	Quidel Corp	Morgan Stanley	(543)
2,630	QuinStreet Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,313)
2,355	QuinStreet Inc	Goldman Sachs	(4,757)
(213)	Quotient Ltd	Goldman Sachs	(13)
2,042	Quotient Technology Inc	Goldman Sachs	(1,041)
(416)	Rackspace Technology Inc	Goldman Sachs	43
215	RadNet Inc	Goldman Sachs	(952)
320	Radware Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(830)
4,531	Radware Ltd	Goldman Sachs	(11,708)
1,955	Ralph Lauren Corp	Morgan Stanley	(13,665)
(1,480)	Range Resources Corp	Morgan Stanley	1,628
103	Ranpak Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(89)
427	Ranpak Holdings Corp	Goldman Sachs	(367)
434	Rapid7 Inc	Goldman Sachs	361
(256)	Rayonier Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	443
(1,709)	Rayonier Inc (REIT)	Goldman Sachs	1,480
29	RE/MAX Holdings Inc ' A '	Bank of America Merrill Lynch	10
63	RE/MAX Holdings Inc ' A '	Goldman Sachs	(241)
69	Realogy Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(36)
907	Realogy Holdings Corp	Goldman Sachs	(444)
1,260	RealReal Inc	Bank of America Merrill Lynch	(683)
1,782	RealReal Inc	Goldman Sachs	(702)
134	Realty Income Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(286)
47	Realty Income Corp (REIT)	Goldman Sachs	(89)
1,500	Realty Income Corp (REIT)	Morgan Stanley	(1,966)
(590)	Reata Pharmaceuticals Inc ' A '	Morgan Stanley	3,062
(283)	Redfin Corp	Morgan Stanley	572
1,007	Redwood Trust Inc	Goldman Sachs	(99)
504	Regency Centers Corp (REIT)	Morgan Stanley	(1,523)
(659)	REGENXBIO Inc	Goldman Sachs	837
1,420	Reinsurance Group of America Inc	Bank of America Merrill Lynch	(23,146)
1,589	Reinsurance Group of America Inc	Goldman Sachs	(25,901)
1,059	Reinsurance Group of America Inc	Morgan Stanley	(11,840)
242	Reliance Steel & Aluminum Co	Morgan Stanley	(682)
(1,290)	Rent-A-Center Inc	Goldman Sachs	295
(317)	Resideo Technologies Inc	Goldman Sachs	105
(88)	Retail Opportunity Investments Corp (REIT)	Goldman Sachs	11
(1,107)	REV Group Inc	Goldman Sachs	1,970
361	REVOLUTION Medicines Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,617)
376	REVOLUTION Medicines Inc	Goldman Sachs	(1,684)
90	REX American Resources Corp	Bank of America Merrill Lynch	277
11	REX American Resources Corp	Goldman Sachs	34
(404)	Rigel Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	10
(120)	Rimini Street Inc	Goldman Sachs	9
1,010	RingCentral Inc ' A '	Bank of America Merrill Lynch	(10,733)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
269	RingCentral Inc 'A'	Goldman Sachs	(7,168)
149	RingCentral Inc 'A'	Morgan Stanley	905
(251)	Riskified Ltd 'A'	Goldman Sachs	1,985
(2,010)	Rite Aid Corp	Goldman Sachs	2,050
22	RLI Corp	Bank of America Merrill Lynch	(32)
691	RLJ Lodging Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(895)
3,899	RLJ Lodging Trust (REIT)	Goldman Sachs	(3,714)
(25)	RMR Group Inc 'A'	Goldman Sachs	101
(559)	ROBLOX Corp 'A'	Morgan Stanley	(4,783)
(127)	Rocket Cos Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	74
(4,237)	Rocket Cos Inc 'A'	Goldman Sachs	2,457
(224)	Rocket Cos Inc 'A'	Morgan Stanley	(110)
(3,151)	Rocket Lab USA Inc	Morgan Stanley	(1,345)
628	Rocket Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,153)
166	Rocket Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(205)
181	Roku Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,699)
431	Roku Inc	Goldman Sachs	(14,004)
436	Roku Inc	Morgan Stanley	1,366
405	Rollins Inc	Bank of America Merrill Lynch	(523)
234	Rollins Inc	Goldman Sachs	(263)
330	Rollins Inc	Morgan Stanley	(303)
(8,849)	Romeo Power Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,540
(10,449)	Romeo Power Inc	Goldman Sachs	4,180
(145)	Ross Stores Inc	Goldman Sachs	934
(3,917)	Ross Stores Inc	Morgan Stanley	11,193
42	Royal Gold Inc	Bank of America Merrill Lynch	(131)
312	Royal Gold Inc	Goldman Sachs	265
40	Royal Gold Inc	Morgan Stanley	(25)
466	RPT Realty (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(399)
567	RPT Realty (REIT)	Goldman Sachs	(560)
(51)	Rubius Therapeutics Inc	Goldman Sachs	38
661	Rush Enterprises Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(830)
538	Rush Enterprises Inc 'B'	Goldman Sachs	(675)
(620)	Ruth's Hospitality Group Inc	Goldman Sachs	58
103	Ryder System Inc	Bank of America Merrill Lynch	(221)
237	Ryder System Inc	Goldman Sachs	(561)
1,255	Ryder System Inc	Morgan Stanley	(2,535)
317	S&P Global Inc	Morgan Stanley	2,140
(20)	Saia Inc	Goldman Sachs	102
(38)	Saia Inc	Morgan Stanley	590
37	Sailpoint Technologies Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(55)
2,424	Sailpoint Technologies Holdings Inc	Morgan Stanley	(2,279)
250	Sally Beauty Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(361)
(33)	Sandy Spring Bancorp Inc	Goldman Sachs	127
(138)	Sanmina Corp	Goldman Sachs	95

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益 / (損) (米ドル)
	米国 (続き)		
52	SBA Communications Corp (REIT)	Morgan Stanley	(9)
351	Schlumberger NV	Goldman Sachs	(314)
1,026	Schrodinger Inc	Goldman Sachs	1,305
(3,351)	Schweitzer-Mauduit International Inc	Goldman Sachs	16,753
(47)	Science Applications International Corp	Morgan Stanley	69
(122)	Scotts Miracle-Gro Co	Goldman Sachs	1,725
(414)	Scotts Miracle-Gro Co	Morgan Stanley	3,635
(18)	Seaboard Corp	Goldman Sachs	630
(1,373)	SeaWorld Entertainment Inc	Goldman Sachs	5,816
(1,019)	Seer Inc	Goldman Sachs	8,100
(113)	SEI Investments Co	Morgan Stanley	92
249	Semtech Corp	Bank of America Merrill Lynch	(532)
445	Semtech Corp	Goldman Sachs	(878)
382	Semtech Corp	Morgan Stanley	(944)
(6,216)	Senseonics Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,040
(2,363)	Senseonics Holdings Inc	Goldman Sachs	1,536
(237)	SentinelOne Inc ' A '	Goldman Sachs	2,359
(190)	SentinelOne Inc ' A '	Morgan Stanley	960
287	Seres Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	471
924	Seres Therapeutics Inc	Goldman Sachs	1,464
628	Service Corp International	Morgan Stanley	(496)
14	ServiceNow Inc	Bank of America Merrill Lynch	(88)
251	ServiceNow Inc	Goldman Sachs	1,139
206	ServiceNow Inc	Morgan Stanley	4,101
(28)	ServisFirst Bancshares Inc	Goldman Sachs	48
1,448	Shake Shack Inc ' A '	Goldman Sachs	(15,570)
54	Shattuck Labs Inc	Goldman Sachs	(214)
13	Sherwin-Williams Co	Bank of America Merrill Lynch	7
(1,364)	Shift4 Payments Inc ' A '	Morgan Stanley	2,946
(827)	Shoals Technologies Group Inc ' A '	Goldman Sachs	5,621
(2,498)	Shoals Technologies Group Inc ' A '	Morgan Stanley	5,757
(158)	Shoe Carnival Inc	Goldman Sachs	126
19	Shutterstock Inc	Bank of America Merrill Lynch	14
(40)	Shyft Group Inc	Goldman Sachs	18
(4,525)	SIGA Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,122)
(3,715)	SIGA Technologies Inc	Goldman Sachs	(2,563)
(1,275)	Signet Jewelers Ltd	Goldman Sachs	3,731
(653)	Signet Jewelers Ltd	Morgan Stanley	6,667
90	Signify Health Inc ' A '	Bank of America Merrill Lynch	(30)
1,202	Signify Health Inc ' A '	Goldman Sachs	(102)
(2,676)	Silgan Holdings Inc	Goldman Sachs	1,739
490	Silicon Laboratories Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,646)
327	Silicon Laboratories Inc	Goldman Sachs	(2,433)
316	Silicon Laboratories Inc	Morgan Stanley	186
29	Silk Road Medical Inc	Goldman Sachs	(36)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益 / (損) (米ドル)
	米国 (続き)		
37	Silverback Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(61)
46	Silverback Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(76)
(61)	Silvergate Capital Corp ' A '	Goldman Sachs	(1,054)
(416)	Silvergate Capital Corp ' A '	Morgan Stanley	(10,553)
47	Simply Good Foods Co	Bank of America Merrill Lynch	(89)
29	Simply Good Foods Co	Goldman Sachs	(21)
(6,374)	Sinclair Broadcast Group Inc ' A '	Bank of America Merrill Lynch	22,763
1,009	Sirius XM Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	78
6,256	Sirius XM Holdings Inc	Goldman Sachs	(2,409)
15,752	Sirius XM Holdings Inc	Morgan Stanley	2,599
223	SiteOne Landscape Supply Inc	Bank of America Merrill Lynch	(537)
57	SiteOne Landscape Supply Inc	Goldman Sachs	(44)
608	SiteOne Landscape Supply Inc	Morgan Stanley	(2,346)
(53)	SiTime Corp	Morgan Stanley	(2,867)
158	SJW Group	Goldman Sachs	(15)
(417)	Skyline Champion Corp	Goldman Sachs	(2,252)
(768)	Skyworks Solutions Inc	Goldman Sachs	3,493
(1,253)	Skyworks Solutions Inc	Morgan Stanley	2,143
908	SL Green Realty Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(2,542)
318	SL Green Realty Corp (REIT)	Goldman Sachs	(1,871)
160	SL Green Realty Corp (REIT)	Morgan Stanley	(723)
206	SM Energy Co	Bank of America Merrill Lynch	(259)
190	Smartsheet Inc ' A '	Bank of America Merrill Lynch	(1,147)
429	Smartsheet Inc ' A '	Goldman Sachs	(2,606)
40	Smartsheet Inc ' A '	Morgan Stanley	91
(5,882)	SoFi Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	25,121
(3,255)	SoFi Technologies Inc	Goldman Sachs	4,615
(58)	SolarEdge Technologies Inc	Goldman Sachs	1,969
(386)	SolarEdge Technologies Inc	Morgan Stanley	6,617
(1,268)	SolarWinds Corp	Goldman Sachs	2,929
1,086	Sonic Automotive Inc ' A '	Goldman Sachs	(5,712)
(231)	Sonoco Products Co	Goldman Sachs	385
(2,085)	Sorrento Therapeutics Inc	Goldman Sachs	250
740	South Jersey Industries Inc	Goldman Sachs	(925)
(39)	Southside Bancshares Inc	Goldman Sachs	26
204	Southwest Gas Holdings Inc	Goldman Sachs	(243)
697	Southwestern Energy Co	Bank of America Merrill Lynch	(439)
423	Southwestern Energy Co	Morgan Stanley	(68)
171	SpartanNash Co	Bank of America Merrill Lynch	(95)
57	SpartanNash Co	Goldman Sachs	(1)
(714)	Spectrum Brands Holdings Inc	Goldman Sachs	3,263
(1,104)	Spirit AeroSystems Holdings Inc ' A '	Goldman Sachs	4,040
(1,536)	Spirit AeroSystems Holdings Inc ' A '	Morgan Stanley	7,085
4,304	Spirit Airlines Inc	Goldman Sachs	(12,266)
304	Spirit Realty Capital Inc (REIT)	Morgan Stanley	(502)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益 / (損) (米ドル)
	米国 (続き)		
1,985	Sprouts Farmers Market Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,370
4,464	Sprouts Farmers Market Inc	Goldman Sachs	8,839
261	SPS Commerce Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,191)
541	SPS Commerce Inc	Goldman Sachs	(2,691)
(81)	SPX Corp	Goldman Sachs	392
(10)	St Joe Co	Bank of America Merrill Lynch	34
(885)	St Joe Co	Goldman Sachs	3,003
(219)	STAAR Surgical Co	Goldman Sachs	2,498
(21)	STAAR Surgical Co	Morgan Stanley	177
(948)	Starbucks Corp	Morgan Stanley	2,980
(883)	Starwood Property Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	599
(796)	State Street Corp	Goldman Sachs	2,570
(198)	Steel Dynamics Inc	Goldman Sachs	831
(47)	Steel Dynamics Inc	Morgan Stanley	295
545	Steelcase Inc ' A '	Goldman Sachs	(654)
(53)	StepStone Group Inc ' A '	Goldman Sachs	14
110	Stericycle Inc	Goldman Sachs	(125)
(30)	STERIS Plc	Goldman Sachs	204
(384)	STERIS Plc	Morgan Stanley	2,062
(104)	Sterling Construction Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	236
(3,082)	Sterling Construction Co Inc	Goldman Sachs	6,996
(32)	Steven Madden Ltd	Goldman Sachs	22
400	Stitch Fix Inc ' A '	Goldman Sachs	(2,692)
499	Stitch Fix Inc ' A '	Morgan Stanley	(1,198)
(105)	Stock Yards Bancorp Inc	Goldman Sachs	399
744	Stoke Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,262)
793	Stoke Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(2,411)
(141)	Stoneridge Inc	Goldman Sachs	134
(17)	StoneX Group Inc	Goldman Sachs	244
51	Strategic Education Inc	Goldman Sachs	(110)
(776)	Stride Inc	Goldman Sachs	1,021
(743)	Summit Hotel Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	706
746	Sun Communities Inc (REIT)	Morgan Stanley	1,947
1,370	Sunnova Energy International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,742)
3,090	Sunnova Energy International Inc	Goldman Sachs	(12,263)
669	Sunnova Energy International Inc	Morgan Stanley	(555)
83	Sunrun Inc	Bank of America Merrill Lynch	(729)
471	Sunrun Inc	Goldman Sachs	(5,148)
1,097	Sunrun Inc	Morgan Stanley	(3,423)
(183)	Supernus Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	103
35	Surgery Partners Inc	Bank of America Merrill Lynch	(179)
353	Surgery Partners Inc	Goldman Sachs	(1,507)
66	Sutro Biopharma Inc	Bank of America Merrill Lynch	19
(985)	Switch Inc ' A '	Goldman Sachs	(250)
(256)	Switch Inc ' A '	Morgan Stanley	(240)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益 / (損) (米ドル)
	米国 (続き)		
1,083	Synchrony Financial	Goldman Sachs	(1,188)
(72)	Syndax Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	143
350	Tabula Rasa HealthCare Inc	Goldman Sachs	(19)
623	Tactile Systems Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,118)
559	Tactile Systems Technology Inc	Goldman Sachs	(5,489)
819	Talos Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(803)
1,154	Talos Energy Inc	Goldman Sachs	(1,131)
16	Tandem Diabetes Care Inc	Bank of America Merrill Lynch	(127)
55	Tandem Diabetes Care Inc	Goldman Sachs	(442)
72	Tandem Diabetes Care Inc	Morgan Stanley	(236)
327	Tanger Factory Outlet Centers Inc (REIT)	Goldman Sachs	(156)
693	Tapestry Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,717)
2,404	Tapestry Inc	Goldman Sachs	(9,442)
1,721	Tapestry Inc	Morgan Stanley	(8,984)
152	Targa Resources Corp	Bank of America Merrill Lynch	(214)
227	Targa Resources Corp	Goldman Sachs	(775)
(298)	Taro Pharmaceutical Industries Ltd	Goldman Sachs	429
(798)	TaskUS Inc ' A '	Morgan Stanley	(1,301)
40	Taylor Morrison Home Corp	Goldman Sachs	10
492	Taysha Gene Therapies Inc	Goldman Sachs	(881)
446	TCR2 Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(669)
1,256	TCR2 Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(1,389)
(346)	TD SYNEX Corp	Goldman Sachs	1,913
(497)	TD SYNEX Corp	Morgan Stanley	2,873
986	TechnipFMC Plc	Goldman Sachs	(1,094)
364	TechTarget Inc	Goldman Sachs	(3,833)
(43)	Tejon Ranch Co	Goldman Sachs	7
1,298	Teladoc Health Inc	Goldman Sachs	1,054
313	Telephone and Data Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(541)
466	Telephone and Data Systems Inc	Goldman Sachs	(417)
(219)	Telesat Corp	Bank of America Merrill Lynch	3,171
(538)	Telesat Corp	Goldman Sachs	7,790
(5,725)	Tellurian Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,558
(130)	Telos Corp	Goldman Sachs	347
69	Tenable Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(17)
(830)	Tennant Co	Goldman Sachs	3,517
(1,547)	Tenneco Inc ' A '	Goldman Sachs	3,759
325	Terminix Global Holdings Inc	Goldman Sachs	(364)
388	Terminix Global Holdings Inc	Morgan Stanley	(307)
80	Terreno Realty Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(20)
261	Terreno Realty Corp (REIT)	Goldman Sachs	(465)
565	Texas Capital Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,016)
1,125	Texas Capital Bancshares Inc	Goldman Sachs	(5,618)
(34)	Texas Pacific Land Corp	Goldman Sachs	1,889
(76)	Texas Pacific Land Corp	Morgan Stanley	1,375

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(350)	Texas Roadhouse Inc	Morgan Stanley	260
(372)	TFS Financial Corp	Goldman Sachs	479
(1,151)	TG Therapeutics Inc	Goldman Sachs	14,399
(768)	TG Therapeutics Inc	Morgan Stanley	7,073
(24,135)	TherapeuticsMD Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,545
(2,108)	TherapeuticsMD Inc	Goldman Sachs	135
(106)	Theravance Biopharma Inc	Goldman Sachs	20
8	Thermo Fisher Scientific Inc	Bank of America Merrill Lynch	67
73	Thermo Fisher Scientific Inc	Goldman Sachs	970
28	Thermo Fisher Scientific Inc	Morgan Stanley	435
(339)	Thor Industries Inc	Goldman Sachs	1,777
(318)	Thor Industries Inc	Morgan Stanley	1,934
274	Tivity Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	(544)
23	Tivity Health Inc	Goldman Sachs	(40)
(74)	Toast Inc 'A'	Goldman Sachs	386
(1,422)	Toast Inc 'A'	Morgan Stanley	1,379
(40)	TopBuild Corp	Goldman Sachs	(232)
(8)	TopBuild Corp	Morgan Stanley	14
456	TPI Composites Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,283)
33	TPI Composites Inc	Goldman Sachs	(53)
(97)	Trade Desk Inc 'A'	Goldman Sachs	(412)
(896)	Trade Desk Inc 'A'	Morgan Stanley	(6,129)
1,452	Transocean Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(99)
67	TransUnion	Goldman Sachs	(65)
1,462	Travel + Leisure Co	Bank of America Merrill Lynch	(9,864)
327	Travel + Leisure Co	Goldman Sachs	(2,152)
1,196	Travel + Leisure Co	Morgan Stanley	(5,585)
819	Travelers Cos Inc	Goldman Sachs	(2,622)
(4,731)	Tredegar Corp	Goldman Sachs	6,436
(343)	TreeHouse Foods Inc	Goldman Sachs	226
203	Trex Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	522
131	Trex Co Inc	Goldman Sachs	439
312	Trex Co Inc	Morgan Stanley	1,076
3,146	Tri Pointe Homes Inc	Goldman Sachs	1,038
1,113	TriCo Bancshares	Bank of America Merrill Lynch	(4,652)
2,864	TriCo Bancshares	Goldman Sachs	(11,972)
(67)	TriMas Corp	Goldman Sachs	117
116	Trinity Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(118)
545	Trinity Industries Inc	Goldman Sachs	(568)
(431)	Trinseo Plc	Goldman Sachs	1,937
(9)	Triple-S Management Corp	Goldman Sachs	-
(2,373)	Triton International Ltd	Goldman Sachs	11,664
(170)	Triumph Bancorp Inc	Goldman Sachs	425
(1,308)	Triumph Group Inc	Goldman Sachs	3,843
(1,862)	TrueBlue Inc	Goldman Sachs	1,657

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
1,079	TrueCar Inc	Bank of America Merrill Lynch	(701)
7,526	TrueCar Inc	Goldman Sachs	(4,892)
159	Trupanion Inc	Bank of America Merrill Lynch	(703)
353	Trupanion Inc	Goldman Sachs	(1,560)
269	Trupanion Inc	Morgan Stanley	(1,775)
(116)	TTEC Holdings Inc	Goldman Sachs	8
(22)	Tucows Inc 'A'	Goldman Sachs	28
(3,537)	Tupperware Brands Corp	Goldman Sachs	8,489
(1,840)	TuSimple Holdings Inc 'A'	Morgan Stanley	(8,547)
2,212	Twitter Inc	Morgan Stanley	(3,241)
(1,961)	Tyson Foods Inc 'A'	Goldman Sachs	3,264
(1,382)	Tyson Foods Inc 'A'	Morgan Stanley	2,306
1,170	UDR Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	723
3,086	UDR Inc (REIT)	Goldman Sachs	1,582
8,171	UDR Inc (REIT)	Morgan Stanley	14,708
322	UGI Corp	Bank of America Merrill Lynch	(143)
308	UGI Corp	Morgan Stanley	(502)
868	UiPath Inc 'A'	Morgan Stanley	575
(233)	Ultra Clean Holdings Inc	Goldman Sachs	564
151	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	Goldman Sachs	(1,036)
(64)	UMB Financial Corp	Goldman Sachs	34
468	UMH Properties Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(154)
552	UMH Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	(182)
(1,050)	uniQure NV	Goldman Sachs	1,303
(3,731)	Unisys Corp	Goldman Sachs	6,374
(281)	United Community Banks Inc	Goldman Sachs	336
653	United Fire Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(747)
1,240	United Fire Group Inc	Goldman Sachs	(1,401)
(2,706)	United Natural Foods Inc	Goldman Sachs	3,328
313	United Rentals Inc	Morgan Stanley	(2,081)
476	United States Cellular Corp	Bank of America Merrill Lynch	(746)
999	United States Cellular Corp	Goldman Sachs	(2,046)
(1,949)	Uniti Group Inc (REIT)	Goldman Sachs	846
107	Unitil Corp	Bank of America Merrill Lynch	(21)
(404)	Unity Software Inc	Morgan Stanley	3,014
(3,858)	Universal Corp	Goldman Sachs	12,339
73	Universal Electronics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(222)
17	Universal Electronics Inc	Goldman Sachs	(39)
(80)	Universal Health Realty Income Trust (REIT)	Goldman Sachs	197
(213)	Universal Health Services Inc 'B'	Goldman Sachs	2,190
(121)	Universal Health Services Inc 'B'	Morgan Stanley	994
40	Univest Financial Corp	Goldman Sachs	(104)
255	Unum Group	Bank of America Merrill Lynch	(813)
505	Unum Group	Goldman Sachs	(1,611)
1,008	Unum Group	Morgan Stanley	(1,463)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益 / (損) (米ドル)
	米国 (続き)		
284	Upwork Inc	Goldman Sachs	(1,361)
2,445	Urban Outfitters Inc	Goldman Sachs	(12,592)
901	Urstadt Biddle Properties Inc ' A ' (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(1,694)
654	Urstadt Biddle Properties Inc ' A ' (REIT)	Goldman Sachs	(1,230)
(53)	US Ecology Inc	Goldman Sachs	35
23	US Physical Therapy Inc	Goldman Sachs	(149)
(453)	US Silica Holdings Inc	Goldman Sachs	191
(39)	USANA Health Sciences Inc	Goldman Sachs	95
(2,494)	Utz Brands Inc	Goldman Sachs	5,636
(2,783)	UWM Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(680)
(743)	Vail Resorts Inc	Morgan Stanley	9,295
(250)	Valley National Bancorp	Goldman Sachs	266
(683)	Valley National Bancorp	Morgan Stanley	203
9,763	Valvoline Inc	Bank of America Merrill Lynch	(19,428)
3,203	Valvoline Inc	Goldman Sachs	(6,374)
4,172	Valvoline Inc	Morgan Stanley	(7,885)
1,063	Varex Imaging Corp	Goldman Sachs	3,149
130	Varonis Systems Inc	Goldman Sachs	(978)
666	Varonis Systems Inc	Morgan Stanley	(1,012)
(1,195)	Vaxart Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,542)
(4,315)	Vaxart Inc	Goldman Sachs	(5,566)
(2,856)	Vector Group Ltd	Goldman Sachs	3,007
132	Vectrus Inc	Bank of America Merrill Lynch	(821)
137	Vectrus Inc	Goldman Sachs	(852)
(3,029)	Velodyne Lidar Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,817
(9,405)	Velodyne Lidar Inc	Goldman Sachs	11,850
136	Ventas Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(714)
180	Ventas Inc (REIT)	Goldman Sachs	(123)
388	Ventas Inc (REIT)	Morgan Stanley	(640)
114	Veracyte Inc	Goldman Sachs	111
2,922	Verint Systems Inc	Goldman Sachs	(23)
(312)	Veritone Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,462
(1,887)	Veritone Inc	Goldman Sachs	14,693
(5,964)	Verizon Communications Inc	Morgan Stanley	3,787
932	Verra Mobility Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,501)
352	Verra Mobility Corp	Goldman Sachs	(567)
825	Vertex Inc ' A '	Bank of America Merrill Lynch	(2,624)
876	Vertex Inc ' A '	Goldman Sachs	(2,702)
(4,104)	Vertiv Holdings Co	Goldman Sachs	4,596
(5,670)	Vertiv Holdings Co	Morgan Stanley	4,363
(3,104)	Veru Inc	Bank of America Merrill Lynch	5,556
83	Viad Corp	Goldman Sachs	(336)
(116)	Viasat Inc	Goldman Sachs	135
4,406	Viavi Solutions Inc	Goldman Sachs	(2,115)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(725)	Vicor Corp	Goldman Sachs	9,860
(471)	Victoria's Secret & Co	Goldman Sachs	1,361
(51)	Victoria's Secret & Co	Morgan Stanley	243
2,098	Victory Capital Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(9,250)
4,830	Victory Capital Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	(21,445)
(723)	ViewRay Inc	Goldman Sachs	231
(874)	Vimeo Inc	Goldman Sachs	501
(1,743)	Vimeo Inc	Morgan Stanley	531
(210)	Virgin Galactic Holdings Inc	Goldman Sachs	573
(1,349)	Virgin Galactic Holdings Inc	Morgan Stanley	1,093
(585)	Virtu Financial Inc 'A'	Goldman Sachs	217
(149)	Virtu Financial Inc 'A'	Morgan Stanley	39
(4)	Virtus Investment Partners Inc	Goldman Sachs	123
231	Visa Inc 'A'	Goldman Sachs	(1,010)
489	Visa Inc 'A'	Morgan Stanley	(538)
55	Vishay Precision Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(178)
97	Vishay Precision Group Inc	Goldman Sachs	(173)
81	Vista Outdoor Inc	Bank of America Merrill Lynch	(281)
233	Vista Outdoor Inc	Goldman Sachs	(986)
(627)	Vivint Smart Home Inc	Goldman Sachs	201
493	VMware Inc 'A'	Morgan Stanley	473
486	Vocera Communications Inc	Bank of America Merrill Lynch	739
1,711	Vocera Communications Inc	Goldman Sachs	2,167
828	Voya Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,661)
1,182	Voya Financial Inc	Goldman Sachs	(3,137)
1,188	Voya Financial Inc	Morgan Stanley	(5,634)
344	Vroom Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,171)
167	Vroom Inc	Goldman Sachs	(396)
431	Vulcan Materials Co	Goldman Sachs	(2,560)
388	Vulcan Materials Co	Morgan Stanley	(838)
(2,814)	Vuzix Corp	Goldman Sachs	9,905
797	W R Berkley Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,462)
588	W R Berkley Corp	Goldman Sachs	(1,658)
639	W R Berkley Corp	Morgan Stanley	(2,869)
(2,272)	Wabash National Corp	Goldman Sachs	2,688
2,774	Walgreens Boots Alliance Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,910)
820	Walgreens Boots Alliance Inc	Goldman Sachs	(1,047)
6,374	Walgreens Boots Alliance Inc	Morgan Stanley	(9,021)
249	Walmart Inc	Goldman Sachs	(368)
(245)	Warby Parker Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1,073
(521)	Warby Parker Inc 'A'	Morgan Stanley	1,420
322	Warrior Met Coal Inc	Goldman Sachs	(258)
(40)	Washington Federal Inc	Goldman Sachs	18
(153)	Washington Real Estate Investment Trust (REIT)	Goldman Sachs	80
109	Waterstone Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(30)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益 / (損) (米ドル)
	米国 (続き)		
(457)	Watts Water Technologies Inc ' A '	Goldman Sachs	4,639
(127)	Wayfair Inc ' A '	Morgan Stanley	(690)
7	WD-40 Co	Goldman Sachs	(17)
279	Werner Enterprises Inc	Bank of America Merrill Lynch	(384)
384	Werner Enterprises Inc	Goldman Sachs	(198)
216	WesBanco Inc	Bank of America Merrill Lynch	(450)
151	WesBanco Inc	Goldman Sachs	(527)
(693)	WESCO International Inc	Goldman Sachs	6,108
(563)	WESCO International Inc	Morgan Stanley	4,890
(116)	Westamerica BanCorp	Goldman Sachs	74
60	Western Digital Corp	Goldman Sachs	(36)
161	Western Digital Corp	Morgan Stanley	225
(121)	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	Goldman Sachs	504
(2,538)	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	Morgan Stanley	11,523
(1,597)	Weyerhaeuser Co (REIT)	Goldman Sachs	(744)
(8,291)	Weyerhaeuser Co (REIT)	Morgan Stanley	203
(151)	White Mountains Insurance Group Ltd	Goldman Sachs	10,347
(310)	Whiting Petroleum Corp	Goldman Sachs	1,371
35	WideOpenWest Inc	Bank of America Merrill Lynch	4
547	WideOpenWest Inc	Goldman Sachs	(241)
536	Williams Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	(574)
144	Williams Cos Inc	Goldman Sachs	(154)
572	Williams Cos Inc	Morgan Stanley	(34)
385	Willis Towers Watson Plc	Bank of America Merrill Lynch	(42)
306	Willis Towers Watson Plc	Goldman Sachs	(34)
572	Willis Towers Watson Plc	Morgan Stanley	(2,397)
43	Wingstop Inc	Bank of America Merrill Lynch	(83)
203	Winnebago Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(453)
143	Wintrust Financial Corp	Morgan Stanley	(768)
204	Wix.com Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4,017)
209	Wix.com Ltd	Goldman Sachs	(3,041)
616	Wix.com Ltd	Morgan Stanley	459
(578)	Wolfspeed Inc	Morgan Stanley	581
95	Wolverine World Wide Inc	Bank of America Merrill Lynch	(323)
3,285	Wolverine World Wide Inc	Goldman Sachs	(11,169)
9	Workday Inc ' A '	Bank of America Merrill Lynch	(121)
626	Workday Inc ' A '	Goldman Sachs	(3,284)
30	Workday Inc ' A '	Morgan Stanley	221
(7,143)	Workhorse Group Inc	Goldman Sachs	4,245
259	Workiva Inc	Goldman Sachs	261
(2,287)	World Fuel Services Corp	Goldman Sachs	8,142
141	World Wrestling Entertainment Inc ' A '	Bank of America Merrill Lynch	(803)
167	World Wrestling Entertainment Inc ' A '	Goldman Sachs	(979)
202	World Wrestling Entertainment Inc ' A '	Morgan Stanley	(184)
(658)	WW International Inc	Goldman Sachs	3,362

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益 / (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(234)	Wyndham Hotels & Resorts Inc	Morgan Stanley	1,633
(56)	XBiotech Inc	Goldman Sachs	69
(302)	Xencor Inc	Goldman Sachs	303
1,777	Xerox Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,154)
1,038	Xerox Holdings Corp	Goldman Sachs	(1,545)
1,958	Xerox Holdings Corp	Morgan Stanley	(2,459)
(9,996)	XL Fleet Corp	Bank of America Merrill Lynch	7,397
(5,453)	XL Fleet Corp	Goldman Sachs	3,926
50	XPEL Inc	Bank of America Merrill Lynch	(88)
645	XPEL Inc	Goldman Sachs	(1,129)
(2,088)	Xperi Holding Corp	Goldman Sachs	2,901
(83)	XPO Logistics Inc	Goldman Sachs	164
(236)	Xylem Inc	Goldman Sachs	1,428
(578)	Xylem Inc	Morgan Stanley	2,422
(472)	Yelp Inc	Goldman Sachs	279
164	Yext Inc	Bank of America Merrill Lynch	23
35	Y-mAbs Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9)
51	Y-mAbs Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(34)
32	Yum! Brands Inc	Goldman Sachs	(96)
124	Yum! Brands Inc	Morgan Stanley	(152)
240	Zendesk Inc	Goldman Sachs	(569)
545	Zendesk Inc	Morgan Stanley	708
(534)	ZIOPHARM Oncology Inc	Goldman Sachs	27
(173)	Zogenix Inc	Goldman Sachs	576
(2,334)	Zomedica Corp	Bank of America Merrill Lynch	223
(13,663)	Zomedica Corp	Goldman Sachs	795
(496)	ZoomInfo Technologies Inc 'A'	Goldman Sachs	2,995
(236)	Zumiez Inc	Goldman Sachs	642
148	Zuora Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(405)
1,708	Zuora Inc 'A'	Goldman Sachs	(2,185)
165	Zymeworks Inc	Bank of America Merrill Lynch	68
175	Zymeworks Inc	Goldman Sachs	72
(115)	Zynex Inc	Goldman Sachs	44
			(57,209)
合計			(184,892)

* 注記2(a)に記載のとおり、公正価値調整の対象である有価証券。

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。

契約数	契約通貨	契約 / 摘要	満期日	未実現純評価益 / (損) (米ドル)
デリバティブ金融商品				
先物取引				
7	EUR	Amsterdam Index Futures December 2021	2021年12月	(68,351)
(40)	EUR	CAC 40 Index Futures December 2021	2021年12月	182,193
9	USD	E-Mini S&P 500 Index Futures December 2021	2021年12月	40,919
(29)	EUR	EURO STOXX 50 Index Futures December 2021	2021年12月	66,932
10	GBP	FTSE 100 Index Futures December 2021	2021年12月	(26,383)
18	EUR	FTSE MIB Index Futures December 2021	2021年12月	(26,156)
17	EUR	IBEX 35 Index Futures December 2021	2021年12月	(110,485)
(17)	EUR	Mini-DAX Futures December 2021	2021年12月	71,950
25	SGD	MSCI Singapore Index Futures December 2021	2021年12月	(36,068)
2	USD	NASDAQ 100 E-Mini Stock Index Futures December 2021	2021年12月	41,412
10	SEK	OMX Stockholm 30 Index Futures December 2021	2021年12月	(12,333)
9	CAD	S&P/TSX 60 Index Futures December 2021	2021年12月	99
5	AUD	SPI 200 Index Futures December 2021	2021年12月	(14,145)
(16)	CHF	Swiss Market Index Futures December 2021	2021年12月	17,830
1	JPY	Topix Index Futures December 2021	2021年12月	(13,544)
合計				113,870

契約数	コール / プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益 / (損) (米ドル)	時価 (米ドル)
デリバティブ金融商品							
買建オプション							
16	プット	E-Mini S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 4,400.00	17/12/2021	(26,637)	46,400
16	コール	E-Mini S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 4,775.00	30/11/2021	(18,160)	80
18	プット	Russell 2000 Index	Exchange Traded	USD 2,200.00	17/12/2021	32,472	96,192
合計						(12,325)	142,672

契約数	コール / プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現評価 益 / (損) (米ドル)	時価 (米ドル)
デリバティブ金融商品							
売建オプション							
(16)	プット	E-Mini S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 4,250.00	17/12/2021	20,969	(24,912)
(16)	コール	E-Mini S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 4,800.00	30/11/2021	11,280	(80)
(18)	プット	Russell 2000 Index	Exchange Traded	USD 2,120.00	17/12/2021	(16,304)	(54,522)
合計						15,945	(79,514)

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)
デリバティブ金融商品						
未決済先渡為替予約						
AUD	1,067,000	USD	775,321	Deutsche Bank	19/1/2022	(10,713)
AUD	2,160,000	USD	1,556,703	JP Morgan	19/1/2022	(8,856)
EUR	1,020,493	CHF	1,074,000	Bank of America Merrill Lynch	19/1/2022	(11,530)
EUR	2,197,852	NOK	22,133,000	Deutsche Bank	19/1/2022	59,857
EUR	2,461,686	SEK	25,008,000	Deutsche Bank	19/1/2022	27,443
EUR	1,250,000	USD	1,404,339	Deutsche Bank	19/1/2022	20,537
EUR	2,442,000	USD	2,767,432	JP Morgan	19/1/2022	16,205
EUR	753,670	USD	854,679	Royal Bank of Canada	19/1/2022	4,430
GBP	829,000	USD	1,117,181	JP Morgan	19/1/2022	(8,724)
JPY	481,633,000	USD	4,181,956	Bank of America Merrill Lynch	19/1/2022	99,256
JPY	22,922,000	USD	200,479	Goldman Sachs	19/1/2022	3,273
NOK	12,352,000	EUR	1,245,974	Bank of America Merrill Lynch	19/1/2022	(55,514)
NOK	12,237,000	EUR	1,220,115	Deutsche Bank	19/1/2022	(38,744)
NZD	405,000	USD	276,172	Morgan Stanley	19/1/2022	631
SEK	39,311,000	EUR	3,908,895	Bank of America Merrill Lynch	19/1/2022	(87,912)
SEK	7,544,000	EUR	740,543	Morgan Stanley	19/1/2022	(5,932)
SGD	14,000	USD	10,319	Goldman Sachs	19/1/2022	(56)
USD	2,426,820	AUD	3,316,000	BNP Paribas	19/1/2022	50,588
USD	443,279	CAD	556,000	Goldman Sachs	19/1/2022	7,677
USD	1,184,032	CAD	1,503,000	JP Morgan	19/1/2022	6,498
USD	157,791	CAD	199,000	Royal Bank of Canada	19/1/2022	1,883
USD	1,101,074	EUR	976,000	BNP Paribas	19/1/2022	(11,468)
USD	553,308	EUR	488,000	Deutsche Bank	19/1/2022	(2,964)
USD	4,945,345	EUR	4,404,000	Morgan Stanley	19/1/2022	(74,775)
USD	9,457	GBP	7,043	BNP Paribas	19/1/2022	39
USD	1,200,716	GBP	898,000	Deutsche Bank	19/1/2022	(1)
USD	2,394,932	JPY	274,057,000	Morgan Stanley	19/1/2022	(41,147)
USD	112,526	NZD	161,000	Bank of America Merrill Lynch	19/1/2022	2,488
USD	1,788,629	NZD	2,586,000	Morgan Stanley	19/1/2022	21,189
						<u>(36,342)</u>
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	38,277,663	USD	44,318,976	State Street Bank & Trust Company	15/12/2021	(745,327)
USD	684,694	EUR	602,831	State Street Bank & Trust Company	15/12/2021	(1,540)
						<u>(746,867)</u>
ヘッジを使用した英ポンド建投資証券クラス						
GBP	357,735	USD	483,572	State Street Bank & Trust Company	15/12/2021	(5,559)
USD	6,449	GBP	4,784	State Street Bank & Trust Company	15/12/2021	56
						<u>(5,503)</u>

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)
ヘッジを使用したスウェーデン・コロナ建投資証券クラス						
SEK	719,680	USD	79,284	State Street Bank & Trust Company	15/12/2021	574
USD	4,009	SEK	36,389	State Street Bank & Trust Company	15/12/2021	(29)
						545
合計						(788,167)

業種別内訳 2021年11月30日現在

	純資産比率(%)
政府債	93.82
技術	0.55
多角化事業	0.48
消費財、非循環型	0.41
エネルギー	0.15
消費財、循環型	0.06
金融	0.02
投資有価証券 - 時価	95.49
その他の純資産	4.51
	100.00

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】(2022年7月末現在)

「ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド(為替ヘッジあり)」

資産総額	30,214,682円
負債総額	8,438,769円
純資産総額(-)	21,775,913円
発行済数量	24,487,690口
1単位当たり純資産額(/)	0.8893円

「ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド(為替ヘッジなし)」

資産総額	786,905,447円
負債総額	253,283円
純資産総額(-)	786,652,164円
発行済数量	680,145,906口
1単位当たり純資産額(/)	1.1566円

(参考情報)

「世界株式絶対収益追求マザーファンド」

資産総額	816,599,312円
負債総額	8,185,416円
純資産総額(-)	808,413,896円
発行済数量	572,611,618口
1単位当たり純資産額(/)	1.4118円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

1 受益証券の名義書換え等
該当事項はありません。

2 受益者名簿の閉鎖の時期
受益者名簿は作成していません。

3 投資者に対する特典
該当事項はありません。

4 内国投資信託受益証券の譲渡制限の内容
譲渡制限は設けておりません。

5 受益証券の再発行
投資者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行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7月末現在、以下の通りです(親投資信託を除きます。)

種類	本数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	188	10,295,053
単位型株式投資信託	73	474,546
合計	261	10,769,599

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	527
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	981
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	789
器具備品	1	575
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

【中間財務諸表】

1．中間財務諸表の作成方法について

委託会社であるブラックロック・ジャパン株式会社(以下「当社」という。)の中間財務諸表すなわち中間貸借対照表、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(1977年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条及び第57条の規定により「金融商品取引業等に関する内閣府令」(2007年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。

2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、中間会計期間(自2022年1月1日 至2022年6月30日)の中間財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

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

(1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

	中間会計期間末 (2022年6月30日)	
資産の部		
流動資産		
現金・預金	2	13,423
立替金		42
前払費用		232
未収入金		2
未収委託者報酬		1,953
未収運用受託報酬		2,425
未収収益		765
流動資産計		18,845
固定資産		
有形固定資産		
建物附属設備	1	668
器具備品	1	539
有形固定資産計		1,207
無形固定資産		
ソフトウェア		16
無形固定資産計		16
投資その他の資産		
投資有価証券		62
長期差入保証金		1,121
前払年金費用		1,033
長期前払費用		12
繰延税金資産		464
投資その他の資産計		2,694
固定資産計		3,918
資産合計		22,764

(単位：百万円)

	中間会計期間末 (2022年6月30日)
負債の部	
流動負債	
預り金	166
未払金	
未払収益分配金	4
未払償還金	70
未払手数料	448
その他未払金	669
未払費用	847
未払消費税等	222
未払法人税等	272
前受金	280
賞与引当金	867
役員賞与引当金	55
為替予約	0
流動負債計	3,907
固定負債	
退職給付引当金	91
資産除去債務	784
固定負債計	876
負債合計	4,783
純資産の部	
株主資本	
資本金	3,120
資本剰余金	
資本準備金	3,001
その他資本剰余金	3,846
資本剰余金合計	6,847
利益剰余金	
利益準備金	336
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	7,679
利益剰余金合計	8,015
株主資本合計	17,983
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	2
評価・換算差額等合計	2
純資産合計	17,981
負債・純資産合計	22,764

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

	中間会計期間 (自 2022年1月1日 至 2022年6月30日)
営業収益	
委託者報酬	3,329
運用受託報酬	4,777
その他営業収益	7,878
営業収益計	15,985
営業費用	
支払手数料	782
広告宣伝費	70
調査費	
調査費	178
委託調査費	2,791
調査費計	2,970
委託計算費	47
営業雑経費	
通信費	38
印刷費	39
諸会費	22
営業雑経費計	100
営業費用計	3,972
一般管理費	
給料	
役員報酬	662
給料・手当	2,927
賞与	1,528
給料計	5,118
退職給付費用	239
福利厚生費	544
事務委託費	1,868
交際費	13
寄付金	1
旅費交通費	32
租税公課	141
不動産賃借料	451
水道光熱費	33
固定資産減価償却費	1 214
資産除去債務利息費用	0
諸経費	205
一般管理費計	8,863
営業利益	3,150

(単位：百万円)

	中間会計期間 (自 2022年1月1日 至 2022年6月30日)
営業外収益	
受取配当金	0
受取利息	0
為替差益	105
雑益	0
その他	2
営業外収益計	108
営業外費用	
有価証券売却損	2
固定資産除却損	0
雑損	0
営業外費用計	2
経常利益	3,255
税引前中間純利益	3,255
法人税、住民税及び事業税	819
法人税等調整額	427
中間純利益	2,008

(3) 中間株主資本等変動計算書

中間会計期間 (自 2022年1月1日 至 2022年6月30日)

(単位:百万円)

	株主資本							評価・換算差額等		純資産 合計	
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			株主資本 合計	その他有価 証券評価 差額金		評価・換算 差額等合計
		資本 準備金	その他資本 剰余金	資本 剰余金 合計	利益 準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計				
当期首残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	9,470	9,807	19,775	3	3	19,778
当中間期変動額											
剰余金の配当						3,800	3,800	3,800	0	0	3,800
中間純利益						2,008	2,008	2,008			2,008
株主資本以外の項目の当 中間期変動額(純額)									5	5	5
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	1,791	1,791	1,791	5	5	1,797
当中間期末残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	7,679	8,015	17,983	2	2	17,981

注 記 事 項

(重要な会計方針)

項 目	中間会計期間 自 2022年1月 1日 至 2022年6月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>その他有価証券 時価のあるもの 決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定）を採用しております。</p>
2. デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	<p>時価法を採用しております。</p>
3. 固定資産の減価償却方法	<p>(1) 有形固定資産 定額法により償却しております。なお、主な耐用年数は建物附属設備5～18年、器具備品3～15年であります。</p> <p>(2) 無形固定資産 自社利用のソフトウェアの減価償却方法については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
4. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金の計上方法 債権の貸倒損失に備えるため、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 退職給付引当金の計上方法 旧退職金制度 適格退職年金制度移行日現在在籍していた従業員については、旧退職制度に基づく給付額を保証しているため、中間会計期間未現在の当該給付額と年金制度に基づく給付額との差額を引当て計上しております。</p> <p>確定拠出年金制度 確定拠出年金制度（DC）については拠出額を費用計上しております。</p> <p>確定給付年金制度 キャッシュ・バランス型の年金制度（CB）の退職年金制度を有しております。CBには、一定の利回り保証を付しており、これの将来の支払に備えるため、確定給付型の会計基準に準じた会計処理方法により引当金を計上しております。</p> <p>退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当期までの期間に帰属させる方法については、ポイント基準によっております。</p> <p>過去勤務債務は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（9年）による定額法により費用処理しております。</p> <p>数理計算上の差異は各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（9年）による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理または費用から控除することとしております。</p> <p>(3) 賞与引当金の計上方法 従業員の賞与の支払に備えて、賞与支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。</p>

項 目	中間会計期間 自 2022年1月 1日 至 2022年6月30日
5. 外貨建の資産又は負債の本邦通貨への換算基準	<p>(4) 役員賞与引当金の計上方法 役員の賞与の支払に備えて、賞与支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(5) 早期退職慰労引当金の計上方法 早期退職慰労金の支払に備えて、早期退職慰労金支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>外貨建金銭債権債務は、中間会計期間末の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p>
6. 収益及び費用の計上基準	<p>当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬、その他営業収益および成功報酬を稼得しております。当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主要な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。</p> <p>委託者報酬：当社は投資信託の信託約款に基づき、投資信託の運用について履行義務を負っております。委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産価額に対する一定割合として計算され、投資信託の運用期間にわたり収益認識しております。</p> <p>運用受託報酬：当社は顧客との投資一任契約及び投資助言契約に基づき運用及び助言について履行義務を負っております。運用受託報酬は、対象顧客との投資一任契約等に基づき純資産価額に対する一定割合として計算され、対象口座の運用期間にわたり収益認識しております。</p> <p>その他営業収益：当社はグループ会社との契約に基づき委託された業務について履行義務を負っております。グループ会社から受領する収益は、当社のグループ会社との契約で定められた算式に基づき、当社がグループ会社にオフショアファンド関連のサービス等を提供する期間にわたり月次で収益認識しております。</p> <p>成功報酬：成功報酬は対象となるファンドまたは口座の運用益に対する一定割合、もしくは特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として計算されます。当該報酬は契約上支払われることが確定した時点で収益認識しております。</p>
7. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 連結納税制度の適用 親会社であるブラックロック・ジャパン・ホールディングス合同会社を連結納税親会社として、連結納税制度を適用しております。</p> <p>(2) 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用 当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。</p>

(会計方針の変更)

中間会計期間 自 2022年1月 1日 至 2022年6月30日
<p>(収益認識に関する会計基準等の適用)</p> <p>「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。以下「収益認識会計基準」という。)等を当中間会計期間の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することといたしました。</p> <p>収益認識会計基準等の適用については、収益認識会計基準第84項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っており、当中間会計期間の期首より前に新たな会計方針を遡及適用した場合の累積的影響額を、当中間会計期間の期首の繰越利益剰余金に反映させ、当該期首残高から新たな会計方針を適用しております。</p> <p>これによる中間財務諸表に与える影響はありません。</p>
<p>(時価の算定に関する会計基準等の適用)</p> <p>「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。以下「時価算定会計基準」という。)等を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「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)第44 - 2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしました。これによる中間財務諸表に与える影響はありません。</p> <p>また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項の注記を行うこととしました。</p>

(中間貸借対照表関係)

中間会計期間 2022年6月30日						
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="padding-left: 20px;">建物附属設備</td> <td style="text-align: right;">2,367百万円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">器具備品</td> <td style="text-align: right;">1,561百万円</td> </tr> </table>	建物附属設備	2,367百万円	器具備品	1,561百万円		
建物附属設備	2,367百万円					
器具備品	1,561百万円					
<p>2 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行2行と当座貸越契約を締結しております。これら契約に基づく当中間会計期間末の借入未実行残高は次のとおりであります。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="padding-left: 20px;">当座貸越極度額</td> <td style="text-align: right;">1,000百万円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">借入実行残高</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">差引額</td> <td style="text-align: right;">1,000百万円</td> </tr> </table>	当座貸越極度額	1,000百万円	借入実行残高	-	差引額	1,000百万円
当座貸越極度額	1,000百万円					
借入実行残高	-					
差引額	1,000百万円					

(中間損益計算書関係)

中間会計期間 自 2022年1月 1日 至 2022年6月30日				
<p>1 減価償却実施額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="padding-left: 20px;">有形固定資産</td> <td style="text-align: right;">212百万円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">無形固定資産</td> <td style="text-align: right;">2百万円</td> </tr> </table>	有形固定資産	212百万円	無形固定資産	2百万円
有形固定資産	212百万円			
無形固定資産	2百万円			

(中間株主資本等変動計算書関係)

中間会計期間
自 2022年1月 1日
至 2022年6月30日

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項

該当事項はありません。

3. 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

該当事項はありません。

4. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2022年3月31日 株主総会決議	普通株式	3,800	253,333	2021年12月31日	2022年3月31日

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

該当事項はありません。

(リース取引関係)

中間会計期間
自 2022年1月 1日
至 2022年6月30日

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

1年以内	835百万円
1年超	-
合計	835百万円

(注) 上記未経過リース料には、解約損害金を含めております。

(金融商品関係)

中間会計期間
自 2022年1月 1日
至 2022年6月30日

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

営業債務である未払手数料はその全てが1年以内の支払期日となっております。

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

2022年6月30日（中間期の決算日）における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりです。なお、金額的重要性が低いと判断するものは含めておりません。

（単位：百万円）

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
長期差入保証金	1,121	1,117	3

（注 1）

現金・預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未収収益、未払手数料、未払費用、その他未払金は、短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記述を省略しています。

（注 2）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することもあります。

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価等の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：同一の資産又は負債の活発な市場における（無調整の）相場価格により算定した時価

レベル2の時価：レベル1のインプット以外の直接又は間接的に観察可能なインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：重要な観察できないインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

（単位：百万円）

	レベル1	レベル2	レベル3	合計
長期差入保証金	-	1,117	-	1,117

（注）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

長期差入保証金

長期差入保証金の時価については、当該保証金の回収までの期間を基にリスクフリーレートで割り引いた現在価値により算定しているため、レベル2の時価に分類しております。

なお、当該時価は帳簿価額と近似していることから長期差入保証金は当該帳簿価額によって計上しております。

(資産除去債務関係)

中間会計期間 自 2022年1月 1日 至 2022年6月30日	
資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの	
1. 当該資産除去債務の概要	当事業所の定期建物賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。
2. 当該資産除去債務の金額の算定方法	使用見込期間を合理的に見積り、割引率は0.16%～0.18%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。
3. 当中間会計期間における当該資産除去債務の総額の増減	
期首残高	784 百万円
有形固定資産の取得に伴う増加額	- 百万円
時の経過による調整額	0 百万円
中間会計期間末残高	<u>784</u> 百万円

(収益認識関係)

中間会計期間 自 2022年1月 1日 至 2022年6月30日	
1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報	
委託者報酬	3,329 百万円
運用受託者報酬	3,735 百万円
成功報酬（注）	1,042 百万円
その他営業収益	7,878 百万円
合計	<u>15,985</u> 百万円
(注) 成功報酬は、中間損益計算書において運用受託報酬に含めて表示しております。	
2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報 (重要な会計方針) 6. 収益及び費用の計上基準に記載のとおりです。	
3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに中間会計期間末において存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報 重要性が乏しいため、記載を省略しています。	

(セグメント情報等)

中間会計期間
自 2022年1月 1日
至 2022年6月30日

1. セグメント情報

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

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスに関する情報

(単位：百万円)

	委託者 報酬	運用受託 報酬	その他	合計
外部顧客 営業収益	3,329	4,777	7,878	15,985

(2) 地域に関する情報

売上高

(単位：百万円)

日本	北米	その他	合計
7,896	6,843	1,246	15,985

(注) 売上高は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客に関する情報

営業収益の10%以上を占める主要な顧客は以下のとおりです。

(単位：百万円)

相手先	営業収益	関連する セグメント名
ブラックロック・ファイナンシャル・ マネジメント・インク	3,372	投資運用業
ブラックロック・ファンド・アドバイ ザーズ	2,052	投資運用業

(1株当たり情報)

中間会計期間	
自	2022年1月 1日
至	2022年6月30日
1株当たり純資産額	1,198,751円05銭
1株当たり中間純利益	133,905円30銭
<p>なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。</p>	
<p>1株当たり中間純利益の算定上の基礎</p>	
損益計算書上の中間純利益	2,008百万円
<p>1株当たり中間純利益の算定に</p>	
用いられた普通株式に係る中間純利益	2,008百万円
期中平均株式数	15,000株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役若しくは執行役との間における取引を行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、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (2) 運用財産相互間において取引を行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、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして金融商品取引業等に関する内閣府令で定めるものを除きます。)
- (3) 通常の見積りの条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の委託会社と密接な関係を有する法人その他の団体として金融商品取引法施行令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の委託会社と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行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、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして金融商品取引業等に関する内閣府令で定める行為。

5【その他】

定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

変更年月日	変更事項
2007年9月18日	証券業登録に伴う商号変更(「パークレイズ・グローバル・インベスターズ証券投資顧問株式会社」に変更)のため、定款変更を行いました。
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 : みずほ信託銀行株式会社
- ・資本金の額 : 247,369百万円(2022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(2022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) (2022年3月末現在)	事業の内容
みずほ証券株式会社	125,167	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

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

(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。

2022年4月15日

有価証券報告書

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9月28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 鶴田 光夫指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 榊原 康太

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド（為替ヘッジあり）の2022年1月18日から2022年7月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド（為替ヘッジあり）の2022年7月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2022年9月28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 鶴田 光夫指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 榊原 康太

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド（為替ヘッジなし）の2022年1月18日から2022年7月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド（為替ヘッジなし）の2022年7月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2022年8月31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 水野 龍也

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているブラックロック・ジャパン株式会社の2022年1月1日から2022年12月31日までの第36期事業年度の中間会計期間（2022年1月1日から2022年6月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ブラックロック・ジャパン株式会社の2022年6月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2022年1月1日から2022年6月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査役の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。