

## 【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 2023年4月14日

【発行者名】 ブラックロック・ジャパン株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 有田 浩之

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目8番3号

【事務連絡者氏名】 坂井 瑛美

【電話番号】 03-6703-7940

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

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

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

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

## 第一部【証券情報】

### (1)【ファンドの名称】

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

（以下「当ファンド」または「ファンド」という場合があります。）

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

### (2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

当初元本は、1口当たり1円です。

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

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

### (3)【発行（売出）価額の総額】

5,000億円を上限とします。

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

### (4)【発行（売出）価格】

購入受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額につきましては、販売会社または下記にお問い合わせください。

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

ホームページアドレス：www.blackrock.com/jp/

### (5)【申込手数料】

購入時の申込手数料（以下「購入時手数料」といいます。）は、購入受付日の翌営業日の基準価額に4.40%（税抜4.00%）を上限として、販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。詳細は、販売会社にお問い合わせください。

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

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

分配金の受取方法により、「一般コース」、「累積投資コース」の2つのコースがあります。「累積投資コース」を選択した投資者が、分配金を再投資する場合は、無手数料とします。

**(6)【申込単位】**

分配金の受取方法により、収益の分配時に分配金を受け取る「一般コース」と、分配金が税引き後、無手数料で再投資される「累積投資コース」の2つの購入方法があります。

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

**(7)【申込期間】**

2023年4月15日から2023年10月13日まで

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

**(8)【申込取扱場所】**

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

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

ホームページアドレス：www.blackrock.com/jp/

**(9)【払込期日】**

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

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

**(10)【払込取扱場所】**

上記「(8)申込取扱場所」で払い込みください。

**(11)【振替機関に関する事項】**

振替機関は、株式会社証券保管振替機構です。

**(12)【その他】**

購入代金の利息

購入代金には利息をつけません。

日本以外の地域における発行

行いません。

購入不可日

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

振替受益権について

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

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

## (参考)

投資信託振替制度とは、

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

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

##### <商品分類表>

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

##### <属性区分表>

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

## &lt; 各分類および区分の定義 &gt;

## ・ 商品分類

単位型投信・追加型投信の区分	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
投資対象地域による区分	内外	目論見書又は投資信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
投資対象資産による区分	資産複合	目論見書又は投資信託約款において、株式、債券、不動産投信（リート）等の資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
補足分類	特殊型（絶対収益追求型）	目論見書または投資信託約款において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

## ・ 属性区分

投資対象資産による属性区分	その他資産（投資信託証券）	目論見書又は投資信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいう。
決算頻度による属性区分	年1回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
投資対象地域による属性区分	グローバル（日本を含む）	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
投資形態による属性区分	ファミリーファンド	目論見書又は投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいう。
為替ヘッジによる属性区分	為替ヘッジあり（限定ヘッジ）	目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。なお、「為替ヘッジ」とは、対円での為替リスクに対するヘッジの有無をいう。
特殊型による属性区分	絶対収益追求型	目論見書または投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。

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

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

信託金の限度額は、5,000億円です。ただし、委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

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

## ファンドの特色

1

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

## 絶対収益追求とは

特定の市場(当ファンドにおいては内外の株式および債券に加え通貨市場を指します。)の動向に左右されにくい収益の追求を目指すことをいいます。ただし、必ず収益を得ることができるということの意味するものではありません。

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

＜主要投資対象ファンド＞…絶対収益を追求するファンド

ブラックロック・ストラテジック・ファンズ・ブラックロック・スタイル・アドバンテージ・ファンド・クラス投資証券

＜副次的投資対象ファンド＞…短期債券等に投資するファンド

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

※投資対象ファンドは、委託会社の判断により適宜見直しを行うことがあります。

- 主要投資対象ファンドへの投資割合を高位に保ちます。

※投資対象ファンドへの投資割合は、原則として市場動向および投資対象ファンドの収益性等を勘案して委託会社が決定します。

- 主要投資対象ファンドは、世界の株式、債券、通貨等の複数の資産に投資し、市場の変動に関わらない中長期的なリターンの獲得を目指します。

◆主要投資対象ファンドでは、スタイル・ファクター\*戦略を用い、様々な尺度から各銘柄の投資魅力度を測り、銘柄選定を行います。運用にあたっては、ブラックロック独自の運用テクノロジーを活用します。

\*このファンドでいう「スタイル・ファクター」とは、ブラックロックの検証により、法明性があり有効であると考えられる投資家の行動特性のことで、各資産および各銘柄の値動きに好影響を与えると考えられる要素をいいます。

◆運用にあたっては、ロングショート戦略\*によりポートフォリオの構築をします。

ロングショート戦略においては、値動きに好影響を与える要素をより多く含む銘柄(資産)を買い建て、その逆の銘柄(資産)を売り建てます。

\*後述の「ロングショート戦略について」を合わせてご参照ください。

2

米ドルに対する為替ヘッジを行い、為替リスクの低減を図ります。

- 主要投資対象ファンドにおいては、当該ファンドで保有する資産を米ドル換算し、米ドル換算した額に対して米ドル売り・円買いの為替取引(ヘッジ取引)を行うことによって、為替変動リスクの低減を図ります(また、米ドル金利が円金利より高い場合、ヘッジコストがかかります。)

主要投資対象ファンドが運用戦略上保有する米ドル建て以外の資産、および収益追求のために取得した通貨市場における米ドル以外のエクスポージャーについては、米ドルでの為替ヘッジを行っておりません。したがって、米ドル以外の通貨の為替変動の影響を受けます。

- 米ドル建ての副次的投資対象ファンドに対しては、マザーファンドにおいて為替ヘッジを行います。

## 運用プロセス(主要投資対象ファンドの運用プロセス)



※上記の投資候補銘柄数は、今後変更になる可能性があります。  
 ※資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。  
 ※主要投資対象ファンドの運用プロセスは変更となる場合があります。



(追加的記載事項)

## 主要投資対象ファンドの概要

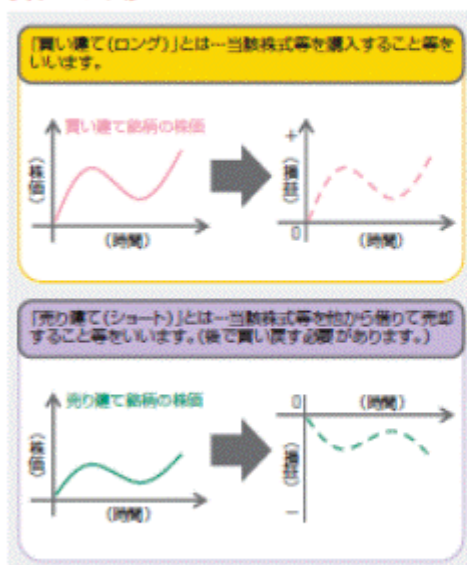
ファンド名	ブラックロック・ストラテジック・ファンズ ブラックロック・スタイル・アドバンテージ・ファンドクラス投資証券(円建て円ヘッジ)
形態	ルクセンブルグ籍(オープン・エンド型)会社型外国投資証券(円建て円ヘッジ)
投資目的および投資態度	当ファンドは、長期的に市場動向に左右されない絶対収益の追求を目指して運用を行います。 当ファンドは機動的にエクスポージャーを調整することで様々なスタイルファクター戦略からプレミアムを獲得することを目指します。 独自の計量化モデルを用いて銘柄の選定を行い投資目的の達成を目指します。 また、バリュー、モメンタム、キャリー、ディフェンシブといったスタイルファク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

## ロングショート戦略とは

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

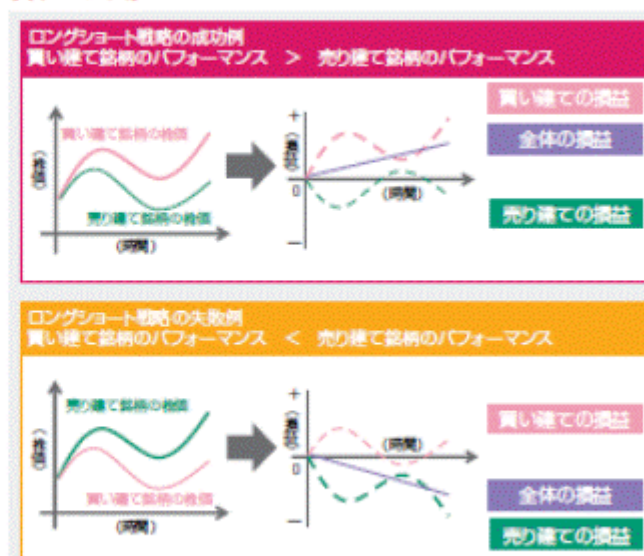
### 「買い建て」と「売り建て」について

[イメージ図]



### ロングショート戦略による損益

[イメージ図]



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

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

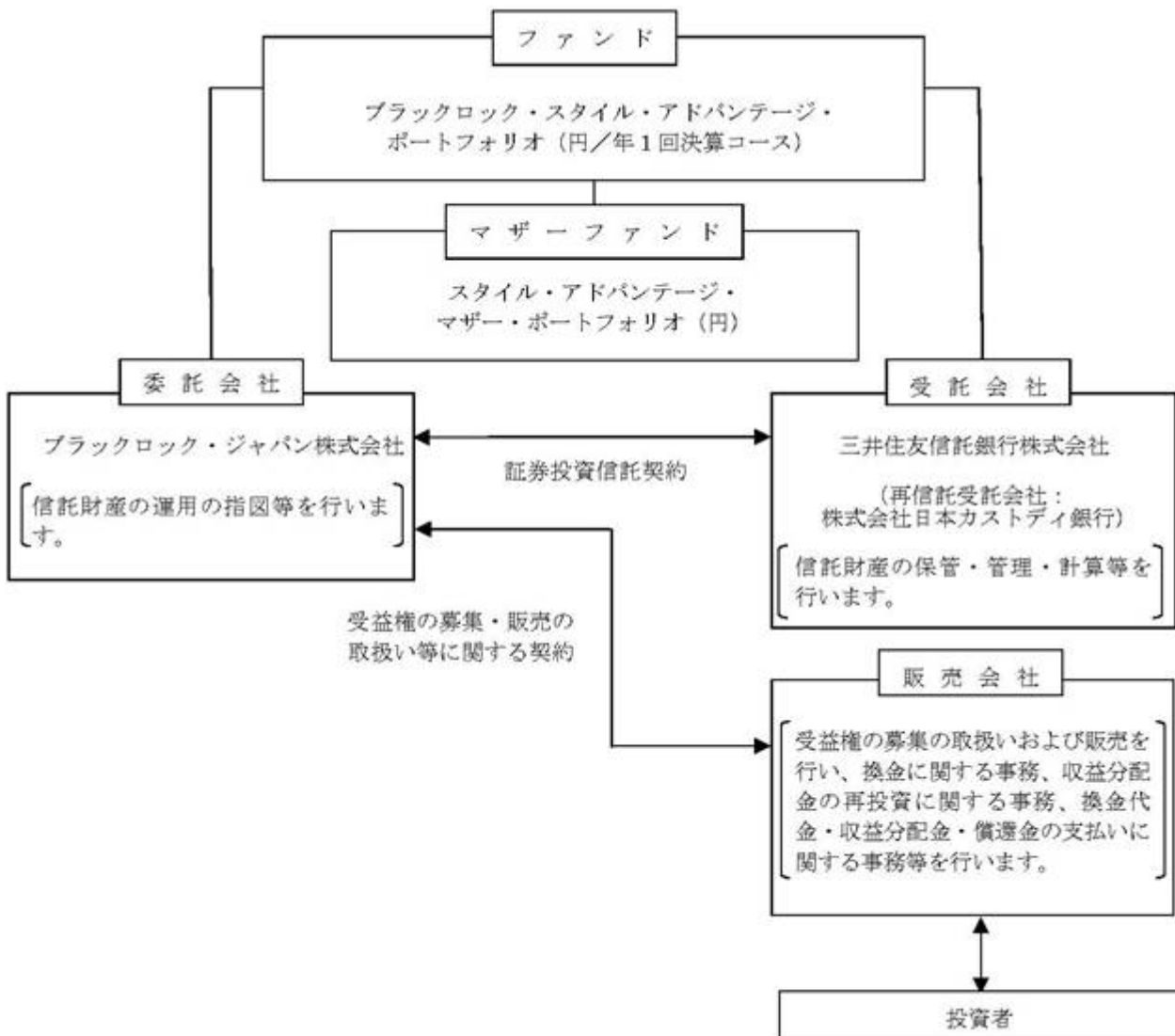
※ロングとショートの双方で損失した場合は、通常想定される以上に当ファンドの運用成果が影響を被る可能性があります。

## (2) 【ファンドの沿革】

2017年8月4日

信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】



## &lt; 契約等の概要 &gt;

## a. 「証券投資信託契約」

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

## b. 「受益権の募集・販売の取扱い等に関する契約」

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

## &lt;ファンドの仕組み&gt;

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



## &lt;委託会社の概況&gt;

2023年1月末現在の委託会社の概況は、以下のとおりです。

a．資本金 3,120百万円

## b．沿革

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

## c．大株主の状況

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

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

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

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

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

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

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

## &lt;参考&gt; マザーファンドの運用の基本方針

## スタイル・アドバンテージ・マザー・ポートフォリオ（円）

## - 運用の基本方針 -

## 1. 基本方針

この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を目標に運用を行います。

## 2. 運用方法

## (1) 投資対象

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

## (2) 投資態度

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

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

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

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

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

## (3) 投資制限

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

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

## (2)【投資対象】

## 投資対象とする資産の種類

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

- a．有価証券
- b．金銭債権（a．およびc．に掲げるものに該当するものを除きます。以下同じ。）
- c．約束手形

## 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主としてスタイル・アドバンテージ・マザー・ポートフォリオ（円）の受益証券のほか、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

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

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

## 投資対象とする金融商品

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

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

## マザーファンドの投資対象ファンドの概要

## a. ブラックロック・ストラテジック・ファンズ ブラックロック・スタイル・アドバンテージ・ファンド

形態	ルクセンブルグ籍（オープン・エンド型）会社型外国投資証券（円建て円ヘッジ）
投資目的および投資態度	当ファンドは、長期的に市場動向に左右されない絶対収益の追求を目指して運用を行います。当ファンドは機動的にエクスポージャーを調整することで様々なスタイルファクター戦略からプレミアムを獲得することを目指します。独自の定量化モデルを用いて銘柄の選定を行い投資目的の達成を目指します。またバリュー、モメンタム、キャリア、ディフェンシブといったファクターを活用し、幅広い投資資産に横断的に投資を行います。
設定日	2016年9月14日
存続期間	無期限
主な投資対象	世界の株式、株式関連証券、債券、債券関連証券、通貨、デリバティブ、ファンド、短期金融商品等の多様な資産に投資を行います。商品市場へのエクスポージャーを獲得する為にファンド、パフォーマンス・リンク債、上場投資信託、商品指数を原資産とするデリバティブ等を活用する場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>同一発行体の譲渡性のある証券への投資は、原則としてファンドの純資産総額の10%以下とします。</li> <li>純資産総額の5%を超えて投資しているすべての発行体について、ファンドが保有する譲渡性のある証券の総額は原則として純資産総額の40%を超えないものとします。</li> </ul>
管理報酬	年0.55%
その他費用	管理業務会社、保管会社および名義書換事務代行会社への報酬等および事務諸費に要する費用についてはファンドから差し引かれます。
決算日	年1回（原則として5月末日）に決算を行います。
収益分配方針	原則として、分配を行いません。
申込手数料	ありません。
管理会社	ブラックロック（ルクセンブルグ）エス・エー
投資顧問会社	ブラックロック・インベストメント・マネジメント・エル・エル・シー
保管会社	ステート・ストリート・バンク・インターナショナル GmbH

## b. ICS ブラックロック・ICS・USTレジャリー・ファンド

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

## (3) 【運用体制】

ファンドの運用・管理の各業務の役割分担を社内規程により定めております。

ファンドの運用については委託会社の運用部門が統括しています。

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

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

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

ブラックロック・グループ

ブラックロック・グループは、運用資産残高約8.59兆ドル<sup>\*</sup>（約1,134兆円）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。

<sup>\*</sup> 2022年12月末現在。（円換算レートは1ドル=131.945円を使用）

## (4) 【分配方針】

## 収益分配方針

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

## a．分配対象額の範囲

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

## b．分配対象収益についての分配方針

分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。

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



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

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

#### 収益分配金の支払い

a. 支払時期と支払場所

(a) 一般コースの場合

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

(b) 累積投資コースの場合

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

b. 時効

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

#### (5)【投資制限】

以下は当ファンドの約款で定める投資制限です。

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

#### 投資信託証券への投資制限

投資信託証券への実質投資割合には制限を設けません。

#### 外貨建資産への投資制限

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

#### 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

#### 公社債の借入れ

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

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

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

d. a. の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

#### 外国為替予約の指図および範囲

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

#### 資金の借入れ

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

#### 信用リスク集中回避のための投資制限

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

### 3【投資リスク】

#### (1) 投資リスク

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

当ファンドにかかる主なリスクは以下の通りです。

##### 基準価額の変動要因

##### a．ロングショート戦略によるリスク

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

##### b．株価変動リスク

世界各国の株式および株式関連の派生商品に投資を行います。世界各国の経済・市場動向または投資対象企業の経営・財務状況に応じて、株式あるいは株式関連の派生商品の価格等が変動し、当ファンドの運用成果に影響を与えます。

##### c．債券投資のリスク

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

##### d．デリバティブ取引のリスク

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

##### （レバレッジ・リスク）

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

##### （デリバティブ取引の取引先に関するリスク）

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

##### e．為替変動リスク

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

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

#### f．カントリーリスク

世界各国の有価証券等に投資します。投資先の国の政治・経済事情、通貨・資本規制等の要因により、有価証券の価格が変動することがあり、それに伴い当ファンドの運用成果に影響を与えます。

#### ファンド運営上のリスク

##### a．購入および換金の受付の中止・取消

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、主要投資対象ファンドの取引停止、その他やむを得ない事情があるときは、受益権の購入および換金の受付を中止する場合があります。また、この場合、既に受付けた受益権の購入および換金の受付を取り消す場合があります。

##### b．ファンドの繰上償還

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

##### c．法令・税制・会計等の変更

法令・税制・会計方法等は今後変更される可能性があります。

##### d．流動性リスクに関する事項

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

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

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

##### e．収益分配金に関する留意点

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

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

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

## (2) リスクの管理体制

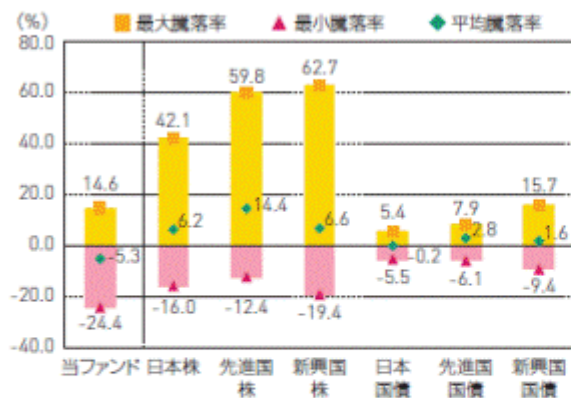
委託会社ではリスク管理を重視しており、独自開発のシステムを用いてリスク管理を行っております。具体的には、運用担当部門から独立したリスク管理担当部門においてファンドの投資リスクおよび流動性リスクの計測・分析、投資・流動性制限のモニタリングなどを行うことにより、ファンドの投資リスク（流動性リスクを含む）が運用方針に合致していることを確認し、その結果を運用担当部門にフィードバックするほか、社内関係者で共有しております。また、委託会社の業務に関するリスクについて社内規程を定めて管理を行っております。

リスクの管理体制は、変更となる場合があります。

(参考情報)

## 当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2018年2月～2023年1月)



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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

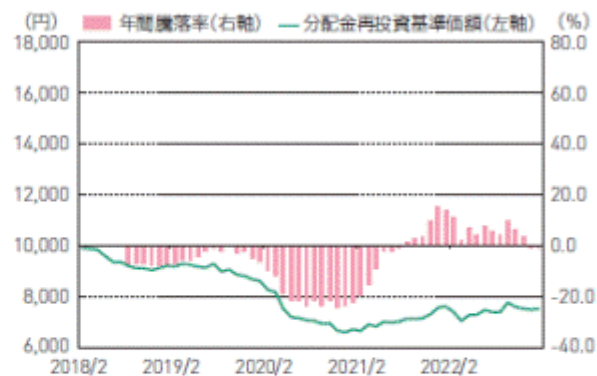
- ①年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。
- ②年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。

※各資産クラスの指数

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

## 当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

(2018年2月～2023年1月)



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

<各指数について>

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

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

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

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

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

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

購入時の申込手数料（以下「購入時手数料」といいます。）は、購入受付日の翌営業日の基準価額に4.40%（税抜4.00%）を上限として、販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。詳細は販売会社にお問い合わせください。

販売会社につきましては、下記にお問い合わせください。

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

ホームページアドレス：www.blackrock.com/jp/

なお、購入時手数料には消費税等相当額が含まれています（以下同じ。）。

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

「累積投資コース」を選択した投資者が、分配金を再投資する場合は、無手数料とします。

### (2)【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

### (3)【信託報酬等】

信託報酬の総額

ファンドの実質的な信託報酬（a + b）は、信託財産の純資産総額に対して年1.2859%（税抜1.219%）程度となります。

#### a．ファンドの信託報酬

計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.7359%（税抜0.669%）の率を乗じて得た金額とします。信託報酬に係る委託会社、販売会社、受託会社間の配分および当該報酬を対価とする役務の内容は次の通りとします。

	信託報酬の配分	役務の内容
委託会社	年0.0550% (税抜0.050%)	ファンドの運用、基準価額の計算、運用報告書等各種書類の作成等
販売会社	年0.6600% (税抜0.600%)	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等
受託会社	年0.0209% (税抜0.019%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行等

#### b．主要投資対象ファンドにかかる運用管理費用

年0.55%が投資対象ファンドから支払われます。

#### 信託報酬の支払時期と支払方法等

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

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

#### (4) 【その他の手数料等】

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

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

下記の諸費用（以下「諸費用」といいます。）は、投資者の負担とし、信託財産中から支弁することができます。

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

委託会社は、年0.11%（税抜0.10%）を上限とする、上記の諸費用の金額をあらかじめ合理的に見積もった上で算出する率を毎日純資産総額に対して乗じて得た額、または上記の諸費用の金額をあらかじめ合理的に見積もった上で算出する額を、上記の諸費用の支払の合計額とみなして、ファンドから受領することができます。諸費用および諸費用に係る消費税等相当額は、日々計上され、ファンドの基準価額に反映されます。なお、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（当該終了日が休業日の場合はその翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支払われるものとします。

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

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

主要投資対象ファンドに係る保管報酬および事務処理に要する諸費用等並びに副次的投資対象ファンドの報酬等が別途投資対象ファンドから支払われます。

#### (5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

個別元本方式について

- a. 追加型株式投資信託について、投資者毎の信託時の受益権の価額等（購入時手数料は含まれません。）が当該投資者の元本（「個別元本」といいます。）にあたります。



- b．投資者が同一ファンドの受益権を複数回購入した場合、個別元本は、当該投資者が追加信託を行うつど当該投資者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- c．同一ファンドを複数の販売会社で購入する場合には各販売会社毎に、個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを購入する場合は当該支店等毎に個別元本の算出が行われる場合があります。
- d．投資者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該投資者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記「収益分配金の課税について」を参照。）

#### 換金時および償還時の課税について

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

#### 収益分配金の課税について

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

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

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

#### 個人、法人の課税の取扱いについて

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

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

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

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

#### b．法人の投資者に対する課税

法人の投資者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含む）、地方税の源泉徴収はありません。）の税率による源泉徴収が行われます。なお、当ファンドについては、法人税の課税対象となりますが、益金不算入制度の適用はありません。

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

上記は2023年1月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 5 【運用状況】

以下の運用状況は2023年1月末現在のものです。

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

## (1) 【投資状況】

資産の種類	金額(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	7,667,009,099	100.03
内 日本	7,667,009,099	100.03
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,528,936	0.03
純資産総額	7,664,480,163	100.00

## (2) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

順位	銘柄	国/地域	種類	数量(口)	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
1	スタイル・アドバンテージ・マザー・ポートフォリオ(円)	日本	親投資信託受益証券	9,784,340,352	0.7712	7,545,683,281	0.7836	7,667,009,099	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】

2023年1月末現在、同日前1年以内における各月末および各計算期間末の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額(円)		1口当たりの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期(2018年1月15日)	26,606,655,103	(同左)	0.9910	(同左)
第2期(2019年1月15日)	21,207,097,954	(同左)	0.8968	(同左)
第3期(2020年1月15日)	12,865,922,909	(同左)	0.8658	(同左)
第4期(2021年1月15日)	5,467,430,556	(同左)	0.6644	(同左)
第5期(2022年1月17日)	7,463,918,044	(同左)	0.7495	(同左)
第6期(2023年1月16日)	7,559,849,931	(同左)	0.7382	(同左)
2022年1月末現在	7,561,883,049		0.7594	
2022年2月末現在	7,345,021,133		0.7376	
2022年3月末現在	6,639,057,339		0.7028	
2022年4月末現在	6,768,328,291		0.7253	
2022年5月末現在	6,736,109,095		0.7268	
2022年6月末現在	6,759,216,281		0.7451	
2022年7月末現在	6,684,201,475		0.7373	
2022年8月末現在	6,717,864,024		0.7366	
2022年9月末現在	7,237,880,960		0.7746	
2022年10月末現在	7,313,481,790		0.7578	
2022年11月末現在	7,473,871,393		0.7504	
2022年12月末現在	7,656,303,980		0.7470	
2023年1月末現在	7,664,480,163		0.7498	

## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1期	
第2期	
第3期	
第4期	
第5期	
第6期	

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1期	0.9
第2期	9.5
第3期	3.5
第4期	23.3
第5期	12.8
第6期	1.5

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

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第1期	26,923,816,773	76,558,715	26,847,258,058
第2期	5,356,776,069	8,556,726,598	23,647,307,529
第3期	546,810,054	9,333,232,291	14,860,885,292
第4期	186,127	6,631,910,102	8,229,161,317
第5期	3,971,381,798	2,242,031,337	9,958,511,778
第6期	2,004,265,980	1,721,514,128	10,241,263,630

(参考情報)

「スタイル・アドバンテージ・マザー・ポートフォリオ(円)」

## (1) 投資状況

資産の種類	金額(円)	投資比率(%)
投資証券	7,637,310,451	99.61
内 ルクセンブルグ	7,567,860,733	98.70
内 アイルランド	69,449,718	0.91
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	29,992,836	0.39
純資産総額	7,667,303,287	100.00

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

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

順位	銘柄	国/地域	種類	投資口数	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	ブラックロック・ストラテジック・ファンズ ブラックロック・スタイル・アドバンテージ・ファンド クラスI投資証券	ルクセンブルグ	投資証券	874,583	8,513.44	7,445,725,111	8,653.09	7,567,860,733	98.70
2	インスティテューショナル・キャッシュ・シリーズplc ブラックロック・ICS・USトレジャリー・ファンド エージェンシークラス投資証券	アイルランド	投資証券	4,922	14,087.64	69,342,470	14,109.42	69,449,718	0.91

(注) 投資比率は、純資産総額に対する評価金額の比率です。

## 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.61

(注)投資比率は、純資産総額に対する評価金額の比率です。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

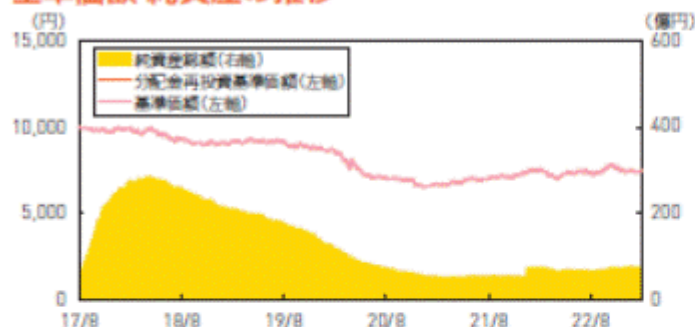
該当事項はありません。

(参考情報)

## 運用実績

2023年1月末現在

## 基準価額・純資産の推移



※ 基準価額および分配金再投資基準価額は価額調整後の値です。価額調整等については、後述の「ファンドの費用」をご覧ください。

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

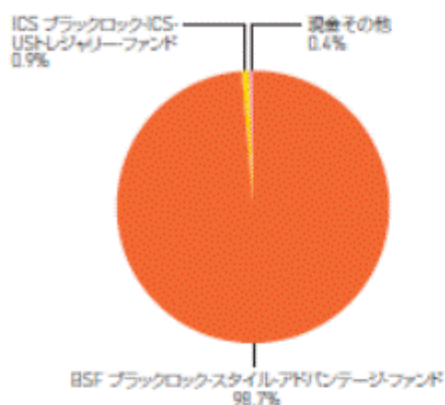
## 分配の推移

	設定来累計	0円
第2期	2019年1月	0円
第3期	2020年1月	0円
第4期	2021年1月	0円
第5期	2022年1月	0円
第6期	2023年1月	0円

※ 分配金は税引前、1万口当たり

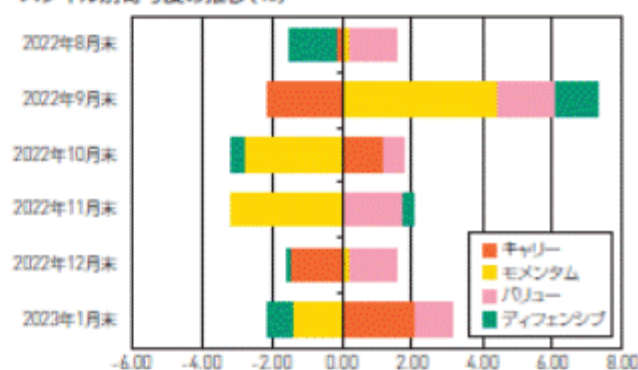
## 主要な資産の状況

## 資産構成比率



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

## スタイル別寄与度の推移(%)



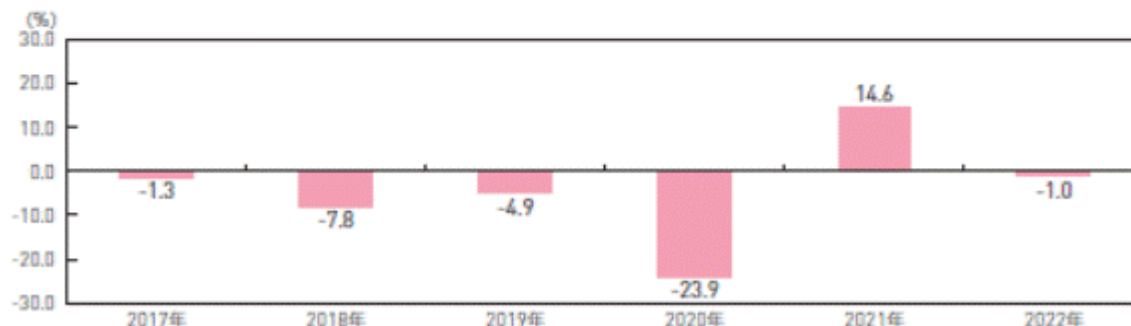
※ 実質的な主要投資対象ファンドの運用状況です。比率は実質的な主要投資対象ファンドのモデル建てのリターンを要因別に分解した数値です。品質料、為替ヘッジコストおよび運用報酬等は、比率には含まれておりません。比率は概算値であり、実際の要因を正確に示すものではありません。

## 年間収益率の推移

※ 2017年は設定日(8月4日)から年末までの収益率を表示しています。

※ ファンドの年間収益率は、決算時の分配金を非課税で再投資したものととして算出しています。

※ 当ファンドにベンチマークはありません。



※ 運用実績・データ等は作成日現在および過去のものであり、今後の運用成果を保証するものではありません。

※ ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページにて開示しております。



## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### (1) 申込方法

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

分配金の受取方法により、収益の分配時に分配金を受け取る「一般コース」と分配金が税引き後無手数料で再投資される「累積投資コース」の2つの申込方法があります。

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

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

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

#### (2) 申込期間

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

#### (3) 受付時間

購入の受付は、申込期間中の午後3時までに受付けたものを当日のお申込みとします。ただし、受付時間は販売会社によって異なることがあります。詳細は販売会社にお問い合わせください。受付時間を過ぎての購入は翌営業日の取扱いとします。

販売会社につきましては、下記にお問い合わせください。

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

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

#### (4) 購入不可日

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

#### (5) 購入単位

分配金の受取方法により、収益の分配時に分配金を受け取る「一般コース」と、分配金が税引き後、無手数料で再投資される「累積投資コース」の2つの購入方法があります。

取扱いを行うコースおよび購入単位は、各販売会社により異なりますので、詳細は、販売会社にお問い合わせください。

## (6) 購入価額

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

## (7) 購入時手数料

購入受付日の翌営業日の基準価額に4.40%（税抜4.00%）を上限として、販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。詳細は、販売会社にお問い合わせください。

なお、購入時手数料には消費税等相当額が含まれています。

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

## (8) 購入代金のお支払い

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

## (9) 購入の受付の中止、既に受付けた購入の受付の取消

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

## 2【換金（解約）手続等】

### (1) 換金の申込と受付

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

### (2) 換金単位

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

### (3) 換金不可日

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

### (4) 換金価額

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

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

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

### (5) 換金受付の制限

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

### (6) 換金代金の支払い

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

### (7) 換金の申込の受付中止および取消

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

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

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

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

当ファンドの主たる投資対象の評価方法は以下の通りです。

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

（参考）マザーファンドの主たる投資対象の評価方法

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

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

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

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

#### (3)【信託期間】

この信託の期間は、2017年8月4日から2027年8月4日までとします。ただし、委託会社は、信託期間満了前に信託期間の延長が投資者に有利であると認めるときは、受託会社と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

#### (4)【計算期間】

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

#### (5)【その他】

ファンドの償還条件等

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

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

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

#### 信託約款の変更

- a . 委託会社は、投資者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。 )を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は以下に定める以外の方法によって変更することができないものとし、
- b . 委託会社は、 a . の事項( a . の変更事項にあつては、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 . において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている投資者が議決権を行使しないときは、当該知っている投資者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d . b . の書面決議は議決権を行使することができる投資者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e . 書面決議の効力は、この信託のすべての投資者に対してその効力を生じます。
- f . b . ~ e . までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての投資者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- g . a . ~ f . までの規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあって、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
- h . 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときはa . ~ f . の規定にしたがいます。

#### 信託事務の委託

受託会社は、当ファンドにかかる信託事務の処理の一部について株式会社日本カストディ銀行と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託にかかる契約書類に基づいて所定の事務を行います。

#### 運用報告書の作成

毎決算時および償還時に、委託会社が期間中の運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した「交付運用報告書」を作成し、購入いただいた販売会社からあらかじめお申し出いただいた方法にて知っている受益者にお届けいたします。

#### 関係法人との契約の更改等に関する手続

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

#### 公告

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

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

但し、当該公告方法に支障がある場合には、日本経済新聞による公告を行います。

#### 4【受益者の権利等】

ファンドの受益者（投資者）の有する主な権利は次の通りです。

##### (1) 収益分配金受領権

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

<一般コース>

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

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

<累積投資コース>

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

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

##### (2) 償還金受領権

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

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

償還金の支払いは、販売会社において行います。

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

##### (3) 受益権の換金請求権

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

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

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

##### (4) 反対受益者の買取請求の不適用

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

##### (5) 帳簿書類の閲覧または謄写の請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期計算期間(2022年1月18日から2023年1月16日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

(3) 当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行っておりますので、参考情報として「スタイル・アドバンテージ・マザー・ポートフォリオ(円)」の貸借対照表、注記表及び附属明細表を記載しております。

なお、当該参考情報は監査意見の対象外となっております。



## 1【財務諸表】

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

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第5期 (2022年1月17日現在)	第6期 (2023年1月16日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
親投資信託受益証券	7,488,651,625	7,588,873,231
未収入金	11,374	-
流動資産合計	7,488,662,999	7,588,873,231
資産合計	7,488,662,999	7,588,873,231
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	11,374	-
未払受託者報酬	620,789	745,099
未払委託者報酬	21,238,946	25,491,506
その他未払費用	2,873,846	2,786,695
流動負債合計	24,744,955	29,023,300
負債合計	24,744,955	29,023,300
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	9,958,511,778	10,241,263,630
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ） （分配準備積立金）	2,494,593,734 -	2,681,413,699 -
元本等合計	7,463,918,044	7,559,849,931
純資産合計	7,463,918,044	7,559,849,931
負債純資産合計	7,488,662,999	7,588,873,231

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第5期 (自 2021年1月16日 至 2022年1月17日)	第6期 (自 2022年1月18日 至 2023年1月16日)
営業収益		
有価証券売買等損益	737,611,199	94,801,586
営業収益合計	737,611,199	94,801,586
営業費用		
受託者報酬	1,176,215	1,475,019
委託者報酬	40,241,738	50,464,043
その他費用	5,797,298	5,661,574
営業費用合計	47,215,251	57,600,636
営業利益又は営業損失( )	690,395,948	152,402,222
経常利益又は経常損失( )	690,395,948	152,402,222
当期純利益又は当期純損失( )	690,395,948	152,402,222
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( )	77,711,314	31,328,052
期首剰余金又は期首欠損金( )	2,761,730,761	2,494,593,734
剰余金増加額又は欠損金減少額	743,971,598	431,318,157
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	743,971,598	431,318,157
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,089,519,205	497,063,952
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,089,519,205	497,063,952
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金( )	2,494,593,734	2,681,413,699

## (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6期計算期間は前計算期間末及び当計算期間末が休業日であったため、2022年1月18日から2023年1月16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。

## (会計方針の変更に関する注記)

## (時価の算定に関する会計基準等の適用)

「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。)等を当計算期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19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、財務諸表への影響は軽微であります。

また、金融商品に関する注記に記載の通り、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は行っておりません。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第5期 (2022年1月17日現在)	第6期 (2023年1月16日現在)
1 当該計算期間の末日における受益権総数	9,958,511,778口	10,241,263,630口
2 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 2,494,593,734円	元本の欠損 2,681,413,699円
3 1口当たり純資産額	0.7495円	0.7382円

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第5期 (自 2021年1月16日 至 2022年1月17日)	第6期 (自 2022年1月18日 至 2023年1月16日)
分配金の計算過程	当計算期末における、費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(0円)、分配準備積立金(0円)により、分配対象収益は0円となり、当期は分配ができませんでした。	当計算期末における、費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(0円)、分配準備積立金(0円)により、分配対象収益は0円となり、当期は分配ができませんでした。

## （金融商品に関する注記）

### 金融商品の状況に関する事項

#### 1 金融商品に対する取組方針

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

#### 2 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク

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

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

#### 3 金融商品に係るリスク管理体制

##### (1) 市場リスクの管理

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

##### (2) 信用リスクの管理

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

##### (3) 取引先リスクの管理

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

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

## 金融商品の時価等に関する事項

第5期 (2022年1月17日現在)	第6期 (2023年1月16日現在)
<p>1 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2 時価の算定方法 (1) 有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p> <p>3 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>4 金銭債権の計算期間末日後の償還予定額 金銭債権については全て1年以内に償還予定であります。</p>	<p>1 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2 時価の算定方法 (1) 有価証券 同左  (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左</p> <p>3 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 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>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5期 (2022年1月17日現在)	第6期 (2023年1月16日現在)
期首元本額	8,229,161,317円	9,958,511,778円
期中追加設定元本額	3,971,381,798円	2,004,265,980円
期中一部解約元本額	2,242,031,337円	1,721,514,128円

2 有価証券関係

第5期(2022年1月17日現在)

売買目的有価証券

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

第6期(2023年1月16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	66,937,541
合計	66,937,541

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

## (4)【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	スタイル・アドバンテージ・マザー・ ポートフォリオ(円)	9,840,343,920	7,588,873,231	
親投資信託受益証券	合計	9,840,343,920	7,588,873,231	
合計		9,840,343,920	7,588,873,231	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考情報)

当ファンドは、「スタイル・アドバンテージ・マザー・ポートフォリオ（円）」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。同マザーファンドの2023年1月16日現在(以下「計算日」という)の状況は次の通りであります。

なお、以下に記載した情報は監査意見の対象外であります。

## 「スタイル・アドバンテージ・マザー・ポートフォリオ（円）」の状況

## (1) 貸借対照表

項目	(2023年1月16日現在)
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	72,650,044
投資証券	7,513,712,302
派生商品評価勘定	2,112,532
流動資産合計	7,588,474,878
資産合計	7,588,474,878
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	9,840,343,920
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,251,869,042
元本等合計	7,588,474,878
純資産合計	7,588,474,878
負債純資産合計	7,588,474,878

(注)親投資信託の計算期間は、原則として、毎年1月16日から翌年1月15日までであります。



## (2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

## 1 有価証券の評価基準及び評価方法

投資証券は移動平均法に基づき、原則として以下の通り時価評価しております。

## (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券

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

## (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券

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

## (3) 時価が入手できなかった有価証券

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

(会計方針の変更に関する注記)

(時価の算定に関する会計基準等の適用)

「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。)等を開示対象ファンドの当計算期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19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、財務諸表への影響は軽微であります。

また、金融商品に関する注記に記載の通り、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は行っておりません。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2023年1月16日現在)
1 当該計算日における受益権総数	9,840,343,920口
2 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 2,251,869,042円
3 1口当たり純資産額	0.7712円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

## 1 金融商品に対する取組方針

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

## 2 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク

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

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

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

## 3 金融商品に係るリスク管理体制

## (1) 市場リスクの管理

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

## (2) 信用リスクの管理

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

## (3) 取引先リスクの管理

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

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

## 金融商品の時価等に関する事項

(2023年1月16日現在)

- |                |  |
|----------------|--|
| (2023年1月16日現在) |  |
| 1              | 貸借対照表計上額、時価及び差額<br>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。  |
| 2              | 時価の算定方法<br>(1) 有価証券<br>「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。<br>(2) デリバティブ取引<br>デリバティブ取引については、「(その他の注記)」の「3 デリバティブ取引関係」に記載しております。<br>(3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br>これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。 |
| 3              | 金融商品の時価等に関する事項の補足説明<br>金融商品の時価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。<br>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。                       |
| 4              | 金銭債権の計算日後の償還予定額<br>金銭債権はすべて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

(2023年1月16日現在)	
同計算期間の期首元本額	9,641,626,916円
同計算期間中の追加設定元本額	1,906,445,942円
同計算期間中の一部解約元本額	1,707,728,938円
同計算期間末日の元本額	9,840,343,920円
当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託の元本額は次の通りです。	
ブラックロック・スタイル・アドバンテージ・ポートフォリオ（円/年 1回決算コース）	9,840,343,920円
合計	9,840,343,920円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	(2023年1月16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	68,253,814
合計	68,253,814

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

## 3 デリバティブ取引関係

## 取引の時価等に関する事項

## 通貨関連

区分	種類	(2023年1月16日現在)			
		契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 アメリカドル	69,266,297	-	67,153,765	2,112,532
合計		69,266,297	-	67,153,765	2,112,532

## (注1) 時価の算定方法

## 為替予約取引

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

## (3) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	日本円	ブラックロック・ストラテジック・ファンズ ブラックロック・スタイル・アドバンテ ー ジ・ファンド クラスI投資証券	874,583	7,445,725,111	
	日本円	小計	874,583	7,445,725,111	
	アメリカドル	インスティテューショナル・キャッシュ・シ リーズplc ブラックロック・ICS・USト レジャーリー・ファンド エージェンシークラ ス投資証券	4,922.220	531,482.110	
	アメリカドル	小計	4,922.220	531,482.110 (67,987,191)	
投資証券	合計		7,513,712,302 (67,987,191)		
合計			7,513,712,302 (67,987,191)		

(注1)投資証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

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

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

3 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入投資証券時価比率	合計金額に対する比率
アメリカドル	投資証券 1 銘柄	100.0%	100.0%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

当該事項はデリバティブ取引関係の注記事項として記載しております。

## (参考情報)

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

なお、以下に記載した情報は監査意見の対象外です。

## 同ファンドの状況

(1)「ブラックロック・ストラテジック・ファンズ ブラックロック・スタイル・アドバンテージ・ファンド クラスI投資証券」は、ルクセンブルグにおいて設立されたオープンエンド型投資法人が発行するファンドであり、当該ファンドの現時点で日本語に翻訳された直近の情報は、2022年5月31日に終了する計算期間(2021年6月1日から2022年5月31日まで)に係る財務書類であります。

当該財務書類は、当該ファンドを含む「ブラックロック・ストラテジック・ファンズ」の2022年5月31日現在の財務書類のうち、当該ファンドにかかる部分を、委託会社において抜粋し、その原文を翻訳したものです。なお、財務書類に含まれる「投資有価証券明細表」の銘柄については原文通り英語表記で行っております。

(2)「インスティテューショナル・キャッシュ・シリーズplc ブラックロック・ICS・USTレジャーリー・ファンド エージェンシークラス投資証券」は、アイルランドにおいて設立されたオープンエンド型投資法人が発行するファンドであり、当該ファンドの現時点で日本語に翻訳された直近の情報は、2022年3月31日に終了する中間計算期間(2021年10月1日から2022年3月31日まで)に係る中間財務書類であります。

当該中間財務書類は、当該ファンドを含む「インスティテューショナル・キャッシュ・シリーズplc」の2022年3月31日現在の中間財務書類のうち、当該ファンドにかかる部分を、委託会社において抜粋し、その原文を翻訳したものです。なお、中間財務書類に含まれる「投資有価証券明細表」の銘柄については原文通り英語表記で行っております。なお、アイルランドにおける独立監査人の監査を受けておりません。

純資産計算書 2022年5月31日現在

	注記	ブラックロック・スタイル ・アドバンテージ・ ファンド 米ドル
<b>資産</b>		
投資有価証券 - 取得原価		91,021,121
未実現評価損		(91,071)
投資有価証券 - 時価	2 (a)	90,930,050
銀行預金	2 (a)	15,056,264
ブローカーに対する債権	15	13,251,129
未収利息および未収配当金	2 (a)、2 (d)	544,977
売却投資有価証券未収金	2 (a)、2 (d)	13,508,408
販売投資証券未収金	2 (a)	3,674
以下に係る未実現評価益：		
先物取引	2 (d)	2,174,691
未決済先渡為替予約	2 (d)	7,221,055
差金決済契約	2 (d)	4,961,698
スワップの時価	2 (d)	5,786,477
その他の資産	2 (a)	2,327,991
資産合計		155,766,414
<b>負債</b>		
銀行からの借入金	2 (a)	78,045
ブローカーに対する債務	15	2,812,833
未払利息および未払配当金	2 (a)、2 (d)	207,198
購入投資有価証券未払金	2 (a)、2 (d)	11,316,481
買戻し投資証券未払金	2 (a)	201,646
以下に係る未実現評価損：		
先物取引	2 (d)	3,134,806
未決済先渡為替予約	2 (d)	5,938,154
差金決済契約	2 (d)	5,815,001
スワップの時価	2 (d)	4,963,563
未払費用およびその他の負債	2 (a)、4、5、6、7、8	300,650
負債合計		34,768,377
純資産合計		120,998,037

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 2022年5月31日現在

	通貨	ブラックロック・スタイル・アドバンテージ・ファンド		
		2022年 5月31日現在	2021年 5月31日現在	2020年 5月31日現在
純資産合計	米ドル	120,998,037	176,150,611	2,150,166,004
以下の1口当たり純資産価額：				
クラスA分配型投資証券	米ドル	87.42	83.40	86.16
クラスAユーロ・ヘッジ分配型投資証券	ユーロ	78.72	75.62	78.78
クラスA無分配投資証券	米ドル	86.03	82.07	84.79
クラスAユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	69.65	66.82	69.57
クラスAスウェーデン・クローナ・ヘッジ無分配投資証券	スウェーデン・クローナ	71.95	68.74	71.25
クラスDスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	スイス・フラン	72.06	68.93	71.55
クラスD無分配投資証券（ユーロ）	ユーロ	93.16	77.56	87.23
クラスD無分配英国報告型投資証券	米ドル	90.15	85.52	87.73
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	80.72	77.10	79.82
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	78.28	74.14	76.20
クラスE無分配投資証券（ユーロ）	ユーロ	86.83	73.07	83.25
クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	75.51	72.91	76.34
クラスIスイス・フラン・ヘッジPF無分配投資証券	スイス・フラン	74.74	71.19	73.69
クラスIユーロ・ヘッジPF無分配投資証券	ユーロ	81.94	78.66	81.13
クラスIブラジル・リアル・ヘッジ無分配投資証券	米ドル	66.09	52.21	50.61
クラスIスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	スイス・フラン	72.85	69.47	71.90
クラスI無分配英国報告型投資証券	米ドル	80.01	76.09	77.97
クラスIユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	ユーロ	81.70	77.84	80.42
クラスI英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	英ポンド	78.48	74.20	76.24
クラスI日本円ヘッジ無分配英国報告型投資証券	日本円	8,331.96	7,918.17	8,162.20
クラスX無分配投資証券	米ドル	95.02	89.48	91.12
クラスX豪ドル・ヘッジ無分配投資証券 <sup>(1)</sup>	豪ドル	95.44	89.80	91.81
クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	77.59	73.46	75.30
クラスXニュージーランド・ドル・ヘッジ無分配投資証券	ニュージーランド・ドル	97.60	90.03	91.00
クラスX英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	英ポンド	92.93	87.26	86.47
クラスZ無分配投資証券	米ドル	90.96	86.16	88.28
クラスZユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	81.62	77.84	80.39

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

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

損益および純資産変動計算書 2022年5月31日に終了した会計年度

	注記	ブラックロック・スタイル・ アドバンテージ・ファンド 米ドル
期首純資産		176,150,611
収益		
預金利息	2 (c)	9,015
債券利息	2 (c)	262,578
差金決済契約に係る受取利息	2 (c)、2 (d)	18,111
スワップに係る受取利息および受取配当金	2 (c)	447,395
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)	3,776,246
収益合計		4,513,345
費用		
銀行利息	2 (c)	337,552
差金決済契約に係る支払利息	2 (c)、2 (d)	767,875
スワップに係る支払利息および支払配当金	2 (c)	164,488
金融資産のネガティブ・イールド	2 (c)	44,996
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)	3,073,075
年間サービス費用	5	89,799
預託報酬	2 (i)、6	191,813
税金	8	17,962
販売報酬	4	2,281
ローン・コミットメント・フィー	14	3,857
投資運用報酬および投資運用再委託報酬	4	713,240
費用合計		5,406,938
投資純損失		(893,593)
以下に係る実現純利益 / (損失) :		
投資有価証券	2 (a)、2 (b)	(110,500)
差金決済契約	2 (d)	11,401,184
先物取引	2 (d)	(5,988,522)
外貨および先渡為替予約	2 (d)、2 (e)、2 (j)	(13,324,627)
スワップ取引	2 (d)	4,902,102
当期実現純損失		(3,120,363)
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)	(98,446)
差金決済契約	2 (d)	(256,533)
先物取引	2 (d)	(1,086,623)
外貨および先渡為替予約	2 (d)、2 (e)、2 (j)	(2,963,509)
スワップ取引	2 (d)	(789,575)
当期末実現評価益 / (損) の純変動		(5,194,686)
運用成績による純資産の減少		(9,208,642)
資本の変動		
投資証券発行による正味受取額		46,822,484
投資証券買戻しによる正味支払額		(92,766,416)
資本の変動による純資産の減少		(45,943,932)
期末純資産		120,998,037

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 2022年5月31日に終了した会計年度

## ブラックロック・スタイル・アドバンテージ・ファンド

	期首発行済 投資証券口数	当期発行 投資証券口数	当期買戻し 投資証券口数	期末発行済 投資証券口数
クラスA 分配型投資証券	463	868	709	622
クラスA ユーロ・ヘッジ分配型投資証券	1,769	87	88	1,768
クラスA 無分配投資証券	4,859	5,575	2,969	7,465
クラスA ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	45	-	-	45
クラスA スウェーデン・クローナ・ヘッジ 無分配投資証券	440	-	-	440
クラスD スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	5,369	-	70	5,299
クラスD 無分配投資証券（ユーロ）	46	434	-	480
クラスD 無分配英国報告型投資証券	11,477	9,545	14,740	6,282
クラスD ユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証 証券	29,800	959	5,155	25,604
クラスD 英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資 証券	2,680	183	641	2,222
クラスE 無分配投資証券（ユーロ）	3,564	2,114	2,230	3,448
クラスE ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	1,875	890	617	2,148
クラスI スイス・フラン・ヘッジPF無分配投資証 証券	50	-	-	50
クラスI ユーロ・ヘッジPF無分配投資証券	2,601	-	2,556	45
クラスI ブラジル・リアル・ヘッジ無分配投資証 証券	50	-	-	50
クラスI スイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	48	-	-	48
クラスI 無分配英国報告型投資証券	467,037	-	466,987	50
クラスI ユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証 証券	145,625	-	145,440	185
クラスI 英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資 証券	161,198	171	157,265	4,104
クラスI 日本円ヘッジ無分配英国報告型投資証券	1,135,933	254,235	123,936	1,266,232
クラスX 無分配投資証券	659	2,259	247	2,671
クラスX 豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	348,139	346,263	204,533	489,869
クラスX ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	42	-	-	42
クラスX ニュージーランド・ドル・ヘッジ 無分配投資証券	2	-	-	2
クラスX 英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資 証券	35	-	-	35
クラスZ 無分配投資証券	50	-	-	50
クラスZ ユーロ・ヘッジ無分配投資証券	46	-	-	46

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

## ブラックロック・スタイル・アドバンテージ・ファンド

投資有価証券明細表 2022年5月31日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品 債券			
ドイツ			
USD 9,000,000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1.625% 15/2/2023	8,967,870	7.41
		8,967,870	7.41
国際機関 (Supranational)			
USD 12,573,000	Asian Development Bank 1.875% 19/7/2022	12,580,206	10.40
USD 3,673,000	Asian Development Bank 1.625% 24/1/2023	3,660,647	3.03
USD 5,000,000	Asian Development Bank 2.75% 17/3/2023	5,024,629	4.15
USD 5,019,000	European Investment Bank 2.50% 15/3/2023	5,035,590	4.16
USD 13,000,000	International Bank for Reconstruction & Development 2.125% 1/7/2022	13,009,217	10.75
USD 12,168,000	International Bank for Reconstruction & Development 1.75% 19/4/2023	12,121,431	10.02
		51,431,720	42.51
米国			
USD 5,500,000	United States Treasury Bill 16/6/2022 (Zero Coupon)	5,499,856	4.54
USD 3,800,000	United States Treasury Bill 8/9/2022 (Zero Coupon)	3,796,215	3.14
USD 6,410,000	United States Treasury Bill 3/11/2022 (Zero Coupon)	6,403,807	5.29
USD 5,000,000	United States Treasury Bill 26/1/2023 (Zero Coupon)	4,947,984	4.09
USD 5,000,000	United States Treasury Bill 23/2/2023 (Zero Coupon)	4,951,309	4.09
USD 5,000,000	United States Treasury Bill 23/3/2023 (Zero Coupon)	4,931,289	4.08
		30,530,460	25.23
債券合計			
		90,930,050	75.15
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			
		90,930,050	75.15
投資有価証券(時価)合計			
		90,930,050	75.15
その他の純資産			
		30,067,987	24.85
純資産合計(米ドル)			
		120,998,037	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			
588	Ampol Ltd	Barclays Bank	(51)
1,445	Ampol Ltd	BNP Paribas	(332)
454	Ampol Ltd	Citibank	(39)
1,517	Ampol Ltd	Goldam Sachs	(349)
532	Ampol Ltd	HSBC	46
(1,265)	APA Group (Unit)	Barclays Bank	427
(14,570)	APA Group (Unit)	BNP Paribas	(628)
(11,618)	APA Group (Unit)	Goldam Sachs	(500)
(3,018)	APA Group (Unit)	HSBC	(585)
1,060	Aristocrat Leisure Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,628
1,878	Aristocrat Leisure Ltd	Barclays Bank	(2,723)
4,883	Aristocrat Leisure Ltd	BNP Paribas	7,501
269	Aristocrat Leisure Ltd	Citibank	(390)
10,337	Aristocrat Leisure Ltd	Goldam Sachs	15,880
421	Aristocrat Leisure Ltd	HSBC	728
1,265	Aristocrat Leisure Ltd	JP Morgan	2,188
581	ASX Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(442)
150	ASX Ltd	Barclays Bank	(298)
556	ASX Ltd	BNP Paribas	(423)
650	ASX Ltd	Goldam Sachs	(495)
27,681	Aurizon Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	795
23,419	Aurizon Holdings Ltd	Barclays Bank	336
48,522	Aurizon Holdings Ltd	BNP Paribas	1,393
38,593	Aurizon Holdings Ltd	Goldam Sachs	1,108
10,429	Aurizon Holdings Ltd	HSBC	75
18,911	Aurizon Holdings Ltd	JP Morgan	136
1,137	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(365)
939	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	Barclays Bank	(388)
552	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	BNP Paribas	(214)
1,619	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	Citibank	(314)
674	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	Goldam Sachs	(261)
840	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	HSBC	(181)
5,849	BlueScope Steel Ltd	Barclays Bank	168
657	BlueScope Steel Ltd	BNP Paribas	297
1,482	BlueScope Steel Ltd	Citibank	43
3,582	BlueScope Steel Ltd	Goldam Sachs	1,620
1,056	BlueScope Steel Ltd	JP Morgan	68
32,594	Brambles Ltd	BNP Paribas	(16,846)
257	Cochlear Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,967
1,461	Cochlear Ltd	Barclays Bank	3,818
561	Cochlear Ltd	BNP Paribas	4,293
197	Cochlear Ltd	Citibank	515
139	Cochlear Ltd	Goldam Sachs	1,064

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)		
170	Cochlear Ltd	HSBC	792
1,205	Coles Group Ltd	Barclays Bank	(199)
6,717	Coles Group Ltd	BNP Paribas	(5,208)
10,694	Coles Group Ltd	Goldam Sachs	(8,291)
4,212	Coles Group Ltd	HSBC	(3,810)
(1,176)	Commonwealth Bank of Australia	BNP Paribas	(870)
(2,470)	Computershare Ltd	Barclays Bank	2,074
(2,791)	Computershare Ltd	BNP Paribas	1,422
(2,704)	Computershare Ltd	Goldam Sachs	1,378
(2,343)	Computershare Ltd	HSBC	1,598
(900)	Computershare Ltd	JP Morgan	614
(951)	Crown Resorts Ltd	Barclays Bank	14
(9,362)	Crown Resorts Ltd	BNP Paribas	(874)
(107)	CSL Ltd	BNP Paribas	416
(249)	CSL Ltd	Goldam Sachs	969
(1)	Deterra Royalties Ltd	Bank of America Merrill Lynch	-
(199)	Domino's Pizza Enterprises Ltd	Bank of America Merrill Lynch	255
(1,012)	Domino's Pizza Enterprises Ltd	BNP Paribas	930
(763)	Domino's Pizza Enterprises Ltd	Goldam Sachs	701
(551)	Domino's Pizza Enterprises Ltd	HSBC	(487)
3,201	Endeavour Group Ltd	Citibank	(666)
2,023	Endeavour Group Ltd	Goldam Sachs	(712)
(25,611)	Evolution Mining Ltd	BNP Paribas	(6,986)
1,771	Fortescue Metals Group Ltd	Barclays Bank	(763)
3,836	Fortescue Metals Group Ltd	BNP Paribas	1,053
526	IDP Education Ltd	Barclays Bank	102
1,585	IDP Education Ltd	BNP Paribas	978
518	IDP Education Ltd	Citibank	100
1,949	IDP Education Ltd	Goldam Sachs	1,203
546	IDP Education Ltd	HSBC	(86)
(2)	Iluka Resources Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2)
(49,865)	Insurance Australia Group Ltd	Barclays Bank	8,233
6,258	James Hardie Industries Plc - CDI	Barclays Bank	(9,658)
4,594	James Hardie Industries Plc - CDI	BNP Paribas	(9,069)
4,094	James Hardie Industries Plc - CDI	Goldam Sachs	(8,082)
(6,494)	Lendlease Corp Ltd (Unit)	Goldam Sachs	3,077
111	Lottery Corp Ltd	BNP Paribas	378
39,646	Lottery Corp Ltd	Citibank	134,900
24,907	Lottery Corp Ltd	HSBC	84,749
18,451	Lottery Corp Ltd	JP Morgan	62,781
(124)	Macquarie Group Ltd	Barclays Bank	(727)
(257)	Macquarie Group Ltd	BNP Paribas	(1,166)
(147)	Macquarie Group Ltd	Goldam Sachs	(620)
(234)	Macquarie Group Ltd	HSBC	(885)
(75,654)	Medibank Pvt Ltd	Goldam Sachs	-

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	オーストラリア(続き)		
(1,365)	Mineral Resources Ltd	BNP Paribas	(8,652)
(511)	National Australia Bank Ltd	Barclays Bank	(176)
(6,554)	National Australia Bank Ltd	BNP Paribas	282
(4,094)	Newcrest Mining Ltd	BNP Paribas	(764)
(6,029)	Newcrest Mining Ltd	Goldam Sachs	(1,125)
(1,603)	Newcrest Mining Ltd	HSBC	1,116
(2,687)	Northern Star Resources Ltd	Barclays Bank	193
(7,133)	Northern Star Resources Ltd	BNP Paribas	(1,587)
(3,902)	Northern Star Resources Ltd	Goldam Sachs	(868)
(10,481)	Orica Ltd	BNP Paribas	1,204
(2,772)	Qantas Airways Ltd	HSBC	(259)
(3,410)	QBE Insurance Group Ltd	JP Morgan	955
(1,117)	Ramsay Health Care Ltd	Barclays Bank	778
(3,256)	Ramsay Health Care Ltd	BNP Paribas	257
(1,419)	Ramsay Health Care Ltd	Goldam Sachs	220
(207)	Ramsay Health Care Ltd	HSBC	86
1,034	REA Group Ltd	BNP Paribas	(935)
2,111	REA Group Ltd	Goldam Sachs	(1,909)
119	REA Group Ltd	HSBC	455
83	REA Group Ltd	JP Morgan	318
(3,477)	Reece Ltd	BNP Paribas	225
(2,455)	Reece Ltd	HSBC	846
115	Rio Tinto Ltd	Bank of America Merrill Lynch	830
39	Rio Tinto Ltd	Barclays Bank	139
1,719	Rio Tinto Ltd	BNP Paribas	12,402
72	Rio Tinto Ltd	Goldam Sachs	519
162	Rio Tinto Ltd	JP Morgan	890
(28,262)	Santos Ltd	Barclays Bank	(406)
(4,666)	Santos Ltd	BNP Paribas	(368)
(16,424)	Santos Ltd	Goldam Sachs	(1,297)
(6,177)	SEEK Ltd	Barclays Bank	5,188
(670)	Sonic Healthcare Ltd	Barclays Bank	43
1,550	South32 Ltd	Bank of America Merrill Lynch	668
17,280	South32 Ltd	Barclays Bank	4,093
3,393	South32 Ltd	BNP Paribas	1,461
21,603	Suncorp Group Ltd	Barclays Bank	(12,406)
111	Tabcorp Holdings Ltd	BNP Paribas	(333)
39,646	Tabcorp Holdings Ltd	Citibank	(125,508)
24,907	Tabcorp Holdings Ltd	HSBC	(74,558)
18,451	Tabcorp Holdings Ltd	JP Morgan	(55,232)
(3,695)	Telstra Corp Ltd	Barclays Bank	106
(34,381)	Telstra Corp Ltd	BNP Paribas	1,273
(9,285)	Telstra Corp Ltd	Goldam Sachs	350
(8,238)	Telstra Corp Ltd	HSBC	112
(3,316)	Telstra Corp Ltd	JP Morgan	238

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)			
(33,649)	Transurban Group (Unit)	Bank of America Merrill Lynch	(6,763)
(14,517)	Transurban Group (Unit)	BNP Paribas	(2,918)
(5,379)	Transurban Group (Unit)	Goldam Sachs	(1,081)
(4,075)	Treasury Wine Estates Ltd	Goldam Sachs	(2,135)
737	Wesfarmers Ltd	Goldam Sachs	(1,307)
(28,016)	Westpac Banking Corp	BNP Paribas	10,257
(1,198)	WiseTech Global Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(851)
(1,855)	Woolworths Group Ltd	BNP Paribas	3,742
(1,294)	Woolworths Group Ltd	Goldam Sachs	2,610
(217)	Woolworths Group Ltd	HSBC	578
(590)	Xero Ltd	Barclays Bank	504
(1,369)	Xero Ltd	BNP Paribas	(1,386)
(475)	Xero Ltd	Goldam Sachs	(481)
(76)	Xero Ltd	JP Morgan	(270)
			19,189
オーストリア			
(1,752)	Erste Group Bank AG	BNP Paribas	(2,872)
(615)	Erste Group Bank AG	Goldam Sachs	(1,008)
56	OMV AG	Barclays Bank	204
2,571	OMV AG	BNP Paribas	21,428
699	OMV AG	Citibank	2,546
800	OMV AG	Goldam Sachs	6,667
311	OMV AG	JP Morgan	3,295
2,424	Raiffeisen Bank International AG	BNP Paribas	935
(1,369)	Verbund AG	Barclays Bank	(11,219)
(350)	Verbund AG	BNP Paribas	(3,112)
(670)	Verbund AG	Citibank	(5,491)
(238)	Verbund AG	HSBC	(2,473)
1,077	voestalpine AG	Barclays Bank	231
875	voestalpine AG	BNP Paribas	2,475
277	voestalpine AG	Goldam Sachs	783
			12,389
ベルギー			
392	Ageas SA	Bank of America Merrill Lynch	949
641	Ageas SA	BNP Paribas	1,552
186	Ageas SA	Goldam Sachs	450
215	Ageas SA	JP Morgan	792
(2,096)	Anheuser-Busch InBev SA	Barclays Bank	(1,280)
(3,874)	Anheuser-Busch InBev SA	BNP Paribas	6,599
(770)	Anheuser-Busch InBev SA	Citibank	(470)
(1,032)	Anheuser-Busch InBev SA	Goldam Sachs	1,758
(460)	Anheuser-Busch InBev SA	HSBC	(774)
(571)	Argenx SE	Barclays Bank	4,098
(131)	Argenx SE	Goldam Sachs	590
(837)	Colruyt SA	Barclays Bank	565



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)			
(2,009)	Colruyt SA	Goldam Sachs	7,210
(2,118)	Colruyt SA	HSBC	8,440
379	Elia Group SA	Barclays Bank	(1,421)
77	Elia Group SA	HSBC	767
513	Groupe Bruxelles Lambert SA	Bank of America Merrill Lynch	923
556	Groupe Bruxelles Lambert SA	Barclays Bank	620
2,056	Groupe Bruxelles Lambert SA	BNP Paribas	3,700
796	Groupe Bruxelles Lambert SA	Goldam Sachs	1,433
203	Groupe Bruxelles Lambert SA	HSBC	892
393	Groupe Bruxelles Lambert SA	JP Morgan	1,726
6,284	Proximus SADP	BNP Paribas	(2,390)
(167)	Solvay SA	Barclays Bank	(68)
(138)	Solvay SA	BNP Paribas	263
(566)	Solvay SA	Goldam Sachs	1,079
2,664	UCB SA	BNP Paribas	(18,436)
245	Umicore SA	Bank of America Merrill Lynch	407
629	Umicore SA	Citibank	788
680	Umicore SA	JP Morgan	2,324
			23,086
カナダ			
(162)	Agnico Eagle Mines Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(275)
(819)	Agnico Eagle Mines Ltd	BNP Paribas	(1,393)
(777)	Agnico Eagle Mines Ltd	Goldam Sachs	(1,321)
(3,845)	Air Canada	Bank of America Merrill Lynch	(4,588)
(7,995)	Air Canada	BNP Paribas	(9,736)
(348)	Air Canada	Goldam Sachs	(427)
(1,206)	Air Canada	JP Morgan	(1,488)
(16,056)	Algonquin Power & Utilities Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3,810)
(3,650)	Algonquin Power & Utilities Corp	BNP Paribas	(866)
(1,004)	Algonquin Power & Utilities Corp	Citibank	222
(8,825)	Algonquin Power & Utilities Corp	HSBC	(5,165)
4,532	AltaGas Ltd	Goldam Sachs	4,140
4,220	AltaGas Ltd	HSBC	6,191
(8,844)	Ballard Power Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,345)
(718)	Ballard Power Systems Inc	BNP Paribas	(596)
(1,329)	Ballard Power Systems Inc	HSBC	(578)
422	Bank of Montreal	BNP Paribas	1,412
1,120	Bank of Montreal	Goldam Sachs	3,747
823	Bank of Nova Scotia	Bank of America Merrill Lynch	2,402
1,109	Bank of Nova Scotia	BNP Paribas	2,281
411	Bank of Nova Scotia	Citibank	700
757	Bank of Nova Scotia	Goldam Sachs	2,605
892	Bank of Nova Scotia	HSBC	3,099
339	Bank of Nova Scotia	JP Morgan	1,003
(3,430)	Bausch Health Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,313

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
カナダ(続き)			
(3,693)	Bausch Health Cos Inc	BNP Paribas	4,644
(894)	Bausch Health Cos Inc	Citibank	(255)
(5,652)	Bausch Health Cos Inc	Goldam Sachs	7,108
(1,439)	Bausch Health Cos Inc	HSBC	5,144
(745)	BCE Inc	Bank of America Merrill Lynch	112
(4,206)	BCE Inc	BNP Paribas	632
(1,136)	BCE Inc	Citibank	(602)
(2,448)	BCE Inc	Goldam Sachs	368
(17)	BCE Inc	HSBC	13
(1,486)	BlackBerry Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(752)
(4,761)	BlackBerry Ltd	BNP Paribas	(2,410)
(1,917)	BlackBerry Ltd	HSBC	(1,941)
(3,683)	Brookfield Asset Management Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(7,719)
(837)	Brookfield Asset Management Inc 'A'	BNP Paribas	(1,754)
(3,341)	Brookfield Renewable Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(7,082)
(907)	Brookfield Renewable Corp 'A'	BNP Paribas	(1,923)
(580)	Brookfield Renewable Corp 'A'	Goldam Sachs	(1,229)
(2,049)	Brookfield Renewable Corp 'A'	JP Morgan	(1,912)
(3,468)	CAE Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,678)
(3,022)	CAE Inc	BNP Paribas	(4,948)
(2,737)	Cameco Corp	Goldam Sachs	(6,018)
574	Canadian Apartment Properties (REIT)	BNP Paribas	222
166	Canadian Apartment Properties (REIT)	Citibank	(63)
23	Canadian Apartment Properties (REIT)	Goldam Sachs	9
2,706	Canadian Imperial Bank of Commerce	BNP Paribas	813
3,446	Canadian Imperial Bank of Commerce	Goldam Sachs	1,036
92	Canadian Imperial Bank of Commerce	HSBC	6
148	Canadian National Railway Co	Bank of America Merrill Lynch	(61)
363	Canadian National Railway Co	BNP Paribas	(149)
204	Canadian National Railway Co	Citibank	465
419	Canadian National Railway Co	Goldam Sachs	(172)
154	Canadian National Railway Co	HSBC	(16)
584	Canadian National Railway Co	JP Morgan	23
397	Canadian Pacific Railway Ltd	BNP Paribas	53
125	Canadian Tire Corp Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(396)
29	Canadian Tire Corp Ltd 'A'	BNP Paribas	(92)
729	Canadian Tire Corp Ltd 'A'	Citibank	4,861
518	Canadian Tire Corp Ltd 'A'	Goldam Sachs	(1,643)
200	Canadian Tire Corp Ltd 'A'	HSBC	272
24	Canadian Tire Corp Ltd 'A'	JP Morgan	33
(5,013)	Canadian Utilities Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(396)
(851)	CCL Industries Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	404
(3,094)	CCL Industries Inc 'B'	BNP Paribas	1,468
(936)	CCL Industries Inc 'B'	Goldam Sachs	444
(275)	CCL Industries Inc 'B'	HSBC	(1,164)

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)		
(400)	CGI Inc	BNP Paribas	(1,035)
(153)	CGI Inc	Goldam Sachs	(396)
(366)	CGI Inc	HSBC	(1,589)
31	Constellation Software Inc	Bank of America Merrill Lynch	967
113	Constellation Software Inc	BNP Paribas	3,524
491	Constellation Software Inc	Goldam Sachs	15,312
537	Dollarama Inc	JP Morgan	388
400	Empire Co Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(275)
373	Empire Co Ltd 'A'	BNP Paribas	(257)
10,811	Empire Co Ltd 'A'	Goldam Sachs	(7,439)
(4,146)	Enbridge Inc	BNP Paribas	(4,788)
(3,444)	Enbridge Inc	Goldam Sachs	(3,977)
(57)	Fairfax Financial Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(782)
(38)	Fairfax Financial Holdings Ltd	BNP Paribas	(521)
(271)	Fairfax Financial Holdings Ltd	Goldam Sachs	(3,717)
(59)	Fairfax Financial Holdings Ltd	JP Morgan	(1,584)
(1,992)	First Quantum Minerals Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3,608)
(1,302)	First Quantum Minerals Ltd	BNP Paribas	(2,358)
(1,216)	First Quantum Minerals Ltd	Citibank	(866)
(141)	FirstService Corp	BNP Paribas	151
(1,311)	Fortis Inc	Bank of America Merrill Lynch	(726)
(1,908)	Fortis Inc	BNP Paribas	(1,056)
(8,074)	Fortis Inc	Goldam Sachs	(4,470)
(531)	Fortis Inc	JP Morgan	248
734	Franco-Nevada Corp	BNP Paribas	4,052
197	Franco-Nevada Corp	Goldam Sachs	1,088
1,193	Franco-Nevada Corp	HSBC	(1,717)
171	Franco-Nevada Corp	JP Morgan	(246)
2,614	George Weston Ltd	Bank of America Merrill Lynch	827
(7,995)	GFL Environmental Inc	Bank of America Merrill Lynch	(13,153)
(7,697)	GFL Environmental Inc	BNP Paribas	(12,662)
(1,413)	GFL Environmental Inc	Citibank	(1,173)
(8,190)	GFL Environmental Inc	HSBC	(15,546)
1,691	Gildan Activewear Inc	Bank of America Merrill Lynch	(629)
344	Gildan Activewear Inc	BNP Paribas	(25)
2,362	Gildan Activewear Inc	Goldam Sachs	(878)
83	Gildan Activewear Inc	HSBC	51
1,032	Gildan Activewear Inc	JP Morgan	629
(328)	Great-West Lifeco Inc	Bank of America Merrill Lynch	(350)
(1,339)	Great-West Lifeco Inc	BNP Paribas	(1,430)
10,119	Hydro One Ltd	BNP Paribas	(240)
17,028	Hydro One Ltd	Goldam Sachs	(404)
10,232	Hydro One Ltd	HSBC	(2,266)
2,792	iA Financial Corp Inc	Bank of America Merrill Lynch	508
218	iA Financial Corp Inc	BNP Paribas	40

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)		
693	iA Financial Corp Inc	Citibank	(378)
214	iA Financial Corp Inc	HSBC	(300)
(5,748)	IGM Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,729)
884	Intact Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	3,307
66	Intact Financial Corp	HSBC	258
(1,956)	Ivanhoe Mines Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	464
(3,047)	Ivanhoe Mines Ltd 'A'	BNP Paribas	723
(886)	Ivanhoe Mines Ltd 'A'	Citibank	119
(19,024)	Ivanhoe Mines Ltd 'A'	Goldam Sachs	4,514
(3,778)	Ivanhoe Mines Ltd 'A'	HSBC	(1,375)
(1,531)	Keyera Corp	Bank of America Merrill Lynch	(569)
(1,369)	Keyera Corp	BNP Paribas	(509)
(930)	Keyera Corp	Citibank	(662)
(480)	Keyera Corp	Goldam Sachs	(178)
32,544	Kinross Gold Corp	Bank of America Merrill Lynch	5,920
(645)	Lightspeed Commerce Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,872)
(1,280)	Lightspeed Commerce Inc	BNP Paribas	(7,684)
(2,697)	Lightspeed Commerce Inc	Goldam Sachs	(16,190)
(933)	Lightspeed Commerce Inc	HSBC	(7,040)
1,006	Loblaw Cos Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,766
391	Loblaw Cos Ltd	BNP Paribas	687
1,295	Loblaw Cos Ltd	Goldam Sachs	2,274
1,304	Lundin Mining Corp	Bank of America Merrill Lynch	(176)
1,355	Lundin Mining Corp	Citibank	289
2,438	Magna International Inc	BNP Paribas	8,774
14,665	Manulife Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	8,351
385	Manulife Financial Corp	BNP Paribas	219
5,820	Manulife Financial Corp	Citibank	3,544
745	Manulife Financial Corp	Goldam Sachs	424
1,490	Manulife Financial Corp	HSBC	(1,544)
2,576	Manulife Financial Corp	JP Morgan	(2,669)
(823)	Metro Inc	Goldam Sachs	872
759	National Bank of Canada	Bank of America Merrill Lynch	3,548
589	National Bank of Canada	BNP Paribas	2,753
982	National Bank of Canada	Citibank	1,880
1,862	National Bank of Canada	Goldam Sachs	8,704
345	National Bank of Canada	JP Morgan	2,028
(545)	Northland Power Inc	Bank of America Merrill Lynch	121
(7,799)	Northland Power Inc	BNP Paribas	1,727
(3,342)	Northland Power Inc	Goldam Sachs	740
(519)	Nutrien Ltd	HSBC	(805)
(202)	Nutrien Ltd	JP Morgan	(313)
285	Nuvei Corp	Bank of America Merrill Lynch	(283)
168	Onex Corp	Bank of America Merrill Lynch	278
157	Onex Corp	Citibank	456

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)		
1,822	Onex Corp	Goldam Sachs	3,012
786	Onex Corp	HSBC	1,952
5,386	Open Text Corp	Bank of America Merrill Lynch	11,417
1,229	Open Text Corp	BNP Paribas	2,605
1,169	Open Text Corp	Goldam Sachs	2,478
1,005	Open Text Corp	HSBC	1,836
3,225	Open Text Corp	JP Morgan	5,892
(9,989)	Pan American Silver Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,923)
(1,555)	Pan American Silver Corp	BNP Paribas	(455)
1,031	Parkland Corp	Citibank	709
6,990	Parkland Corp	Goldam Sachs	6,579
405	Parkland Corp	HSBC	974
652	Parkland Corp	JP Morgan	1,568
(2,661)	Pembina Pipeline Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,589)
(2,818)	Pembina Pipeline Corp	BNP Paribas	(2,741)
(1,154)	Pembina Pipeline Corp	Citibank	(794)
(2,652)	Quebecor Inc 'B'	BNP Paribas	(860)
(1,421)	Quebecor Inc 'B'	Citibank	(11)
(2,707)	Quebecor Inc 'B'	Goldam Sachs	(878)
(935)	Restaurant Brands International Inc	Bank of America Merrill Lynch	274
(1,421)	Restaurant Brands International Inc	BNP Paribas	416
(147)	Restaurant Brands International Inc	Citibank	(207)
(402)	Restaurant Brands International Inc	Goldam Sachs	118
(882)	Restaurant Brands International Inc	HSBC	(14)
(497)	Restaurant Brands International Inc	JP Morgan	(8)
318	Ritchie Bros Auctioneers Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,210)
169	Ritchie Bros Auctioneers Inc	BNP Paribas	(643)
377	Ritchie Bros Auctioneers Inc	Goldam Sachs	(1,434)
(1,607)	Rogers Communications Inc 'B'	BNP Paribas	(64)
(2,743)	Rogers Communications Inc 'B'	Goldam Sachs	(108)
562	Royal Bank of Canada	BNP Paribas	2,182
1,351	Royal Bank of Canada	Goldam Sachs	5,246
(4,388)	Saputo Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,839
4,054	Shaw Communications Inc 'B'	BNP Paribas	3,928
(138)	Shopify Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(789)
(254)	Shopify Inc 'A'	BNP Paribas	(1,452)
(101)	Shopify Inc 'A'	Goldam Sachs	(2,708)
(138)	Shopify Inc 'A'	HSBC	(1,932)
(232)	Sun Life Financial Inc	BNP Paribas	(50)
(480)	Sun Life Financial Inc	Citibank	524
(1,021)	Sun Life Financial Inc	Goldam Sachs	(218)
(4,369)	TC Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3,490)
(1,298)	TC Energy Corp	BNP Paribas	(1,037)
(1,400)	TC Energy Corp	Citibank	642
(887)	TELUS Corp	Bank of America Merrill Lynch	126

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
カナダ(続き)			
(3,304)	TELUS Corp	BNP Paribas	470
(1,599)	TELUS Corp	HSBC	177
1,022	TFI International Inc	BNP Paribas	(622)
(194)	Thomson Reuters Corp	Bank of America Merrill Lynch	(122)
(637)	Thomson Reuters Corp	Goldam Sachs	(494)
675	TMX Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	486
315	TMX Group Ltd	BNP Paribas	227
285	TMX Group Ltd	Goldam Sachs	205
860	Toromont Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	340
760	Toromont Industries Ltd	BNP Paribas	301
457	Toromont Industries Ltd	Citibank	846
236	Toromont Industries Ltd	Goldam Sachs	93
279	Toromont Industries Ltd	HSBC	651
(171)	Toronto-Dominion Bank	BNP Paribas	(548)
(897)	Tourmaline Oil Corp	BNP Paribas	(6,520)
(53)	Tourmaline Oil Corp	Citibank	(150)
443	West Fraser Timber Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	920
223	West Fraser Timber Co Ltd	BNP Paribas	(186)
113	West Fraser Timber Co Ltd	Citibank	473
470	West Fraser Timber Co Ltd	HSBC	(877)
134	West Fraser Timber Co Ltd	JP Morgan	(250)
1,467	Wheaton Precious Metals Corp	BNP Paribas	2,611
772	Wheaton Precious Metals Corp	Citibank	(812)
2,256	Wheaton Precious Metals Corp	Goldam Sachs	4,015
675	Wheaton Precious Metals Corp	HSBC	(1,009)
1,474	Wheaton Precious Metals Corp	JP Morgan	(2,203)
233	WSP Global Inc	Citibank	529
			<u>(50,379)</u>
ケイマン諸島			
(70)	Sea Ltd ADR	Barclays Bank	(558)
(2,097)	Sea Ltd ADR	BNP Paribas	(31,224)
(282)	Sea Ltd ADR	Goldam Sachs	(4,199)
(167)	Sea Ltd ADR	HSBC	(3,440)
			<u>(39,421)</u>
デンマーク			
(4,328)	Ambu A/S 'B'	Barclays Bank	(337)
(5,119)	Ambu A/S 'B'	BNP Paribas	(6,442)
(4,353)	Ambu A/S 'B'	Goldam Sachs	(5,478)
49	AP Moller - Maersk A/S 'B'	BNP Paribas	1,835
25	AP Moller - Maersk A/S 'B'	HSBC	1,728
(273)	Carlsberg A/S 'B'	Citibank	(1,085)
(2,904)	Chr Hansen Holding A/S	BNP Paribas	2,844
661	Coloplast A/S 'B'	Barclays Bank	476
2,508	Coloplast A/S 'B'	BNP Paribas	(9,968)
100	Coloplast A/S 'B'	Goldam Sachs	(397)

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)			
665	Danske Bank A/S	Barclays Bank	177
726	Danske Bank A/S	BNP Paribas	523
619	Danske Bank A/S	Citibank	165
897	Danske Bank A/S	Goldam Sachs	646
2,155	Danske Bank A/S	HSBC	2,777
(1,120)	Demant A/S	Bank of America Merrill Lynch	(1,758)
(1,254)	Demant A/S	Barclays Bank	(3,323)
(972)	Demant A/S	BNP Paribas	(1,526)
(484)	Demant A/S	Goldam Sachs	(760)
(194)	Demant A/S	HSBC	(782)
(253)	Demant A/S	JP Morgan	(1,020)
84	DSV PANALPINA A/S	Bank of America Merrill Lynch	641
515	DSV PANALPINA A/S	Barclays Bank	1,112
548	DSV PANALPINA A/S	BNP Paribas	4,182
63	DSV PANALPINA A/S	Goldam Sachs	481
57	DSV PANALPINA A/S	HSBC	767
470	Genmab A/S	BNP Paribas	288
102	Genmab A/S	Goldam Sachs	147
67	Genmab A/S	HSBC	186
(416)	GN Store Nord A/S	Bank of America Merrill Lynch	(1,881)
(2,256)	GN Store Nord A/S	Barclays Bank	(13,806)
(802)	GN Store Nord A/S	BNP Paribas	(3,626)
(179)	GN Store Nord A/S	Citibank	(1,095)
(1,107)	GN Store Nord A/S	Goldam Sachs	(5,005)
4,049	Novo Nordisk A/S 'B'	BNP Paribas	19,357
6,212	Novozymes A/S 'B'	BNP Paribas	6,262
(115)	Orsted A/S	Bank of America Merrill Lynch	(1,058)
(665)	Orsted A/S	Barclays Bank	(910)
(896)	Orsted A/S	BNP Paribas	(8,245)
(236)	Orsted A/S	Citibank	(323)
(26)	Orsted A/S	Goldam Sachs	(239)
(358)	Orsted A/S	HSBC	(4,665)
935	Pandora A/S	BNP Paribas	700
205	Pandora A/S	Goldam Sachs	153
(348)	ROCKWOOL A/S 'B'	Barclays Bank	(2,781)
(163)	ROCKWOOL A/S 'B'	BNP Paribas	(3,345)
(8,655)	Tryg A/S	BNP Paribas	(6,730)
(937)	Tryg A/S	Citibank	(702)
(1,911)	Vestas Wind Systems A/S	Barclays Bank	(4,254)
(7,860)	Vestas Wind Systems A/S	BNP Paribas	(33,909)
			<u>(80,003)</u>
フィンランド			
570	Elisa Oyj	Bank of America Merrill Lynch	(659)
742	Elisa Oyj	Barclays Bank	(636)
1,260	Elisa Oyj	BNP Paribas	(1,458)

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)			
232	Elisa Oyj	Goldam Sachs	(268)
674	Elisa Oyj	HSBC	(375)
410	Elisa Oyj	JP Morgan	(228)
(4,987)	Fortum Oyj	Barclays Bank	1,015
(4,350)	Fortum Oyj	BNP Paribas	(1,747)
(1,625)	Fortum Oyj	Citibank	331
(4,863)	Fortum Oyj	Goldam Sachs	(1,954)
1,720	Kesko Oyj 'B'	Barclays Bank	(2,598)
7,355	Kesko Oyj 'B'	BNP Paribas	(17,964)
969	Kesko Oyj 'B'	Goldam Sachs	(2,367)
(959)	Kone Oyj 'B'	Barclays Bank	(2,209)
(1,050)	Kone Oyj 'B'	BNP Paribas	(4,499)
(148)	Kone Oyj 'B'	Citibank	(341)
(136)	Kone Oyj 'B'	Goldam Sachs	(583)
(296)	Kone Oyj 'B'	HSBC	(1,728)
2,955	Neste Oyj	BNP Paribas	8,800
198	Neste Oyj	HSBC	912
1,931	Nokia Oyj	Bank of America Merrill Lynch	8
2,336	Nokia Oyj	Barclays Bank	176
1,892	Nokia Oyj	Goldam Sachs	8
2,110	Nokia Oyj	HSBC	340
1,784	Orion Oyj 'B'	BNP Paribas	2,828
88	Orion Oyj 'B'	HSBC	268
(518)	Sampo Oyj 'A'	Bank of America Merrill Lynch	2,253
(626)	Sampo Oyj 'A'	Barclays Bank	(148)
(756)	Sampo Oyj 'A'	BNP Paribas	3,288
1,565	Stora Enso Oyj 'R'	Bank of America Merrill Lynch	754
4,053	Stora Enso Oyj 'R'	Barclays Bank	(1,085)
2,609	Stora Enso Oyj 'R'	BNP Paribas	1,258
4,011	Stora Enso Oyj 'R'	Goldam Sachs	1,934
1,719	Stora Enso Oyj 'R'	HSBC	856
1,597	Stora Enso Oyj 'R'	JP Morgan	796
(1,752)	UPM-Kymmene Oyj	Goldam Sachs	(2,290)
(3,231)	Wartsila Oyj Abp	BNP Paribas	(2,049)
			<u>(19,361)</u>
フランス			
(2,447)	Accor SA	Bank of America Merrill Lynch	734
(7,933)	Accor SA	Goldam Sachs	2,380
(1,945)	Accor SA	HSBC	(3,688)
(1,407)	Aeroports de Paris	Barclays Bank	1,959
(11)	Aeroports de Paris	Goldam Sachs	(81)
(35)	Aeroports de Paris	HSBC	(291)
(1,995)	Air Liquide SA	Barclays Bank	727
(279)	Air Liquide SA	Goldam Sachs	(765)
(413)	Air Liquide SA	HSBC	(2,416)



保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
フランス(続き)			
(1,483)	Alstom SA	Bank of America Merrill Lynch	(3,876)
(2,462)	Alstom SA	Barclays Bank	(2,506)
(394)	Alstom SA	Citibank	(401)
(703)	Alstom SA	Goldam Sachs	(1,838)
(3,146)	Alstom SA	HSBC	(8,493)
286	Amundi SA	Bank of America Merrill Lynch	(184)
274	Amundi SA	Barclays Bank	704
288	Amundi SA	Goldam Sachs	(185)
725	Amundi SA	HSBC	738
670	Arkema SA	Bank of America Merrill Lynch	(3,194)
433	Arkema SA	Barclays Bank	(348)
321	Arkema SA	Citibank	(258)
87	Arkema SA	Goldam Sachs	(415)
1,352	Arkema SA	HSBC	(217)
125	Arkema SA	JP Morgan	(20)
(6,645)	AXA SA	Goldam Sachs	(2,598)
177	BioMerieux	Bank of America Merrill Lynch	1,707
579	BioMerieux	Barclays Bank	4,391
600	BioMerieux	Goldam Sachs	5,785
1,102	BioMerieux	HSBC	11,215
1,091	BNP Paribas SA	HSBC	3,985
(8,348)	Bollere SE	Barclays Bank	(429)
(3,525)	Bollere SE	Citibank	(181)
(5,042)	Bollere SE	Goldam Sachs	(1,037)
(2,342)	Bouygues SA	Goldam Sachs	(1,179)
(3,572)	Bouygues SA	HSBC	(5,855)
2,035	Bureau Veritas SA	Goldam Sachs	480
1,657	Bureau Veritas SA	HSBC	2,379
389	Capgemini SE	HSBC	1,604
(623)	Carrefour SA	Citibank	390
(558)	Carrefour SA	Goldam Sachs	1,432
(2,753)	Carrefour SA	HSBC	5,382
1,730	Cie de Saint-Gobain	HSBC	6,449
(73)	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	Barclays Bank	(285)
(948)	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	Goldam Sachs	(762)
(260)	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	HSBC	(2,200)
(3,604)	Credit Agricole SA	Citibank	1,691
(656)	Danone SA	HSBC	780
962	Dassault Systemes SE	Barclays Bank	881
1,075	Dassault Systemes SE	Goldam Sachs	1,710
2,973	Dassault Systemes SE	HSBC	5,319
197	Dassault Systemes SE	JP Morgan	352
544	Edenred	Goldam Sachs	659
228	Edenred	JP Morgan	352
138	Eiffage SA	Bank of America Merrill Lynch	151

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)		
346	Eiffage SA	Barclays Bank	230
104	Eiffage SA	Citibank	69
754	Eiffage SA	Goldam Sachs	824
104	Eiffage SA	HSBC	40
166	Eiffage SA	JP Morgan	(256)
(4,776)	Electricite de France SA	Barclays Bank	1,044
(6,672)	Electricite de France SA	Goldam Sachs	2,344
3,350	Engie SA	Barclays Bank	(1,557)
5,263	Engie SA	Goldam Sachs	4,499
(118)	EssilorLuxottica SA	Bank of America Merrill Lynch	(63)
(392)	EssilorLuxottica SA	Barclays Bank	(357)
(176)	EssilorLuxottica SA	Goldam Sachs	(94)
(71)	EssilorLuxottica SA	HSBC	156
(550)	EssilorLuxottica SA	JP Morgan	1,208
4,249	Eurazeo SE	HSBC	27,310
(146)	Eurofins Scientific SE	Bank of America Merrill Lynch	(369)
(982)	Eurofins Scientific SE	Barclays Bank	(2,167)
(141)	Eurofins Scientific SE	Citibank	(311)
(195)	Eurofins Scientific SE	Goldam Sachs	(493)
(1,335)	Eurofins Scientific SE	HSBC	(3,175)
(1,952)	Euronext NV	Goldam Sachs	(14,721)
(2,786)	Faurecia SE	Bank of America Merrill Lynch	(10,565)
(1,673)	Faurecia SE	Barclays Bank	(3,835)
(4,336)	Faurecia SE	HSBC	(26,406)
(2,443)	Getlink SE	Barclays Bank	916
(1,638)	Getlink SE	Goldam Sachs	(544)
(21,129)	Getlink SE	HSBC	(21,050)
22	Hermes International	Bank of America Merrill Lynch	778
101	Hermes International	Barclays Bank	6,329
15	Hermes International	Citibank	940
7	Hermes International	Goldam Sachs	247
9	Hermes International	HSBC	800
1,677	Ipsen SA	HSBC	2,335
54	Kering SA	Barclays Bank	2,817
25	Kering SA	Citibank	1,304
86	Kering SA	Goldam Sachs	3,957
142	La Francaise des Jeux SAEM	Bank of America Merrill Lynch	(99)
71	La Francaise des Jeux SAEM	Barclays Bank	(36)
43	La Francaise des Jeux SAEM	Citibank	(22)
258	La Francaise des Jeux SAEM	Goldam Sachs	(180)
7,006	La Francaise des Jeux SAEM	HSBC	16,962
1,863	La Francaise des Jeux SAEM	JP Morgan	4,510
(65)	Legrand SA	Barclays Bank	(70)
(270)	Legrand SA	HSBC	(914)
(362)	L' Oreal SA	Bank of America Merrill Lynch	(1,319)

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)			
(163)	L'Oreal SA	Barclays Bank	(2,863)
(33)	L'Oreal SA	Citibank	(546)
(60)	L'Oreal SA	Goldam Sachs	(80)
(35)	L'Oreal SA	HSBC	(28)
(129)	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	Citibank	(5,099)
(16)	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	Goldam Sachs	(391)
(20)	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	HSBC	(1,183)
7,671	Orange SA	Bank of America Merrill Lynch	(625)
19,014	Orange SA	Barclays Bank	(1,018)
3,021	Orange SA	Citibank	(162)
12,128	Orange SA	Goldam Sachs	(987)
15,239	Orange SA	HSBC	65
4,070	Orange SA	JP Morgan	17
(2,972)	Orpea SA	HSBC	15,600
171	Pernod Ricard SA	Bank of America Merrill Lynch	(1,493)
165	Pernod Ricard SA	Barclays Bank	415
69	Pernod Ricard SA	Citibank	174
607	Pernod Ricard SA	Goldam Sachs	(5,300)
187	Pernod Ricard SA	HSBC	1,382
128	Pernod Ricard SA	JP Morgan	946
2,589	Publicis Groupe SA	Barclays Bank	(8,875)
98	Publicis Groupe SA	Citibank	(336)
2,610	Publicis Groupe SA	Goldam Sachs	(11,240)
6,253	Publicis Groupe SA	HSBC	(9,110)
799	Publicis Groupe SA	JP Morgan	(1,164)
(1,089)	Remy Cointreau SA	HSBC	(10,266)
(40)	Renault SA	Barclays Bank	(45)
(4,080)	Renault SA	Goldam Sachs	(7,561)
(3,685)	Renault SA	HSBC	(11,310)
708	Sanofi	Barclays Bank	(3,603)
286	Sanofi	HSBC	763
(38)	Sartorius Stedim Biotech	Bank of America Merrill Lynch	(957)
(241)	Sartorius Stedim Biotech	Goldam Sachs	(6,067)
(25)	Sartorius Stedim Biotech	HSBC	(1,050)
(832)	Schneider Electric SE	Bank of America Merrill Lynch	(1,426)
(315)	Schneider Electric SE	Barclays Bank	(567)
(917)	Schneider Electric SE	Goldam Sachs	(1,572)
(212)	Schneider Electric SE	HSBC	(1,662)
207	SEB SA	Bank of America Merrill Lynch	(1,020)
108	SEB SA	Barclays Bank	(185)
33	SEB SA	Citibank	(57)
347	SEB SA	HSBC	(2,267)
920	Societe Generale SA	HSBC	3,016
(263)	Sodexo SA	HSBC	621
363	STMicroelectronics NV	Bank of America Merrill Lynch	78

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
フランス(続き)			
1,590	STMicroelectronics NV	Barclays Bank	852
444	STMicroelectronics NV	Citibank	238
1,041	STMicroelectronics NV	Goldam Sachs	223
1,365	STMicroelectronics NV	HSBC	5,769
187	Teleperformance	Barclays Bank	581
203	Teleperformance	Goldam Sachs	(413)
484	Teleperformance	HSBC	2,230
(434)	TotalEnergies SE	Goldam Sachs	(1,776)
(28)	Ubisoft Entertainment SA	Goldam Sachs	(131)
(1,438)	Ubisoft Entertainment SA	HSBC	(7,024)
(12,008)	Universal Music Group BV	BNP Paribas	(8,233)
(886)	Universal Music Group BV	Goldam Sachs	(607)
(1,108)	Universal Music Group BV	HSBC	(1,183)
(1,774)	Valeo SA	Bank of America Merrill Lynch	(4,817)
(854)	Veolia Environnement SA	Bank of America Merrill Lynch	(549)
(2,166)	Veolia Environnement SA	Barclays Bank	(557)
(755)	Veolia Environnement SA	Goldam Sachs	(485)
(1,086)	Veolia Environnement SA	HSBC	(1,338)
(709)	Veolia Environnement SA	JP Morgan	(873)
(744)	Vinci SA	Barclays Bank	(104)
(258)	Vinci SA	Citibank	(36)
3,102	Vivendi SE	Bank of America Merrill Lynch	66
7,525	Vivendi SE	Barclays Bank	(766)
6,031	Vivendi SE	Citibank	(614)
6,645	Vivendi SE	Goldam Sachs	142
2,544	Vivendi SE	JP Morgan	26
2,580	Wendel SE	Barclays Bank	15,339
(342)	Worldline SA	Bank of America Merrill Lynch	(747)
(935)	Worldline SA	Barclays Bank	(120)
(77)	Worldline SA	Citibank	(10)
(850)	Worldline SA	Goldam Sachs	(1,858)
(3,503)	Worldline SA	HSBC	(9,119)
			<u>(81,282)</u>
ドイツ			
(300)	adidas AG	Bank of America Merrill Lynch	(1,543)
(557)	adidas AG	Barclays Bank	(5,597)
(329)	adidas AG	BNP Paribas	(1,692)
(182)	adidas AG	Goldam Sachs	(936)
(84)	Adidas AG	Citibank	(844)
126	Allianz SE Reg	BNP Paribas	(545)
(3,529)	Aroundtown SA	Barclays Bank	1,671
(9,547)	Aroundtown SA	BNP Paribas	3,477
(1,795)	Aroundtown SA	HSBC	219
181	BASF SE	Goldam Sachs	(80)
(188)	Bayerische Motoren Werke AG (Pref)	Bank of America Merrill Lynch	(816)

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)		
(1,166)	Bayerische Motoren Werke AG (Pref)	BNP Paribas	(5,059)
(143)	Bechtle AG	Bank of America Merrill Lynch	(158)
(493)	Bechtle AG	BNP Paribas	(544)
(148)	Bechtle AG	Citibank	(21)
(274)	Bechtle AG	Goldam Sachs	(302)
161	Beiersdorf AG	Bank of America Merrill Lynch	(48)
533	Beiersdorf AG	Barclays Bank	11
253	Beiersdorf AG	BNP Paribas	(76)
212	Beiersdorf AG	Citibank	5
467	Beiersdorf AG	Goldam Sachs	(140)
183	Beiersdorf AG	HSBC	1,274
507	Beiersdorf AG	JP Morgan	3,530
77	Brenntag SE	Bank of America Merrill Lynch	180
802	Brenntag SE	Barclays Bank	687
644	Brenntag SE	BNP Paribas	1,504
635	Brenntag SE	Goldam Sachs	1,483
247	Brenntag SE	HSBC	1,773
164	Brenntag SE	JP Morgan	1,177
327	Carl Zeiss Meditec AG	Goldam Sachs	1,699
88	Carl Zeiss Meditec AG	JP Morgan	297
(11,125)	Commerzbank AG	BNP Paribas	(18,544)
(2,796)	Continental AG	BNP Paribas	(18,630)
1,969	Covestro AG	Barclays Bank	3,101
2,698	Covestro AG	BNP Paribas	8,237
178	Covestro AG	Citibank	280
272	Covestro AG	Goldam Sachs	830
(1,140)	Daimler Truck Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	(2,626)
(2,288)	Daimler Truck Holding AG	Barclays Bank	(1,667)
(461)	Daimler Truck Holding AG	BNP Paribas	(1,062)
(703)	Daimler Truck Holding AG	Citibank	(512)
(2,285)	Daimler Truck Holding AG	Goldam Sachs	(5,263)
(798)	Daimler Truck Holding AG	HSBC	(2,752)
(522)	Delivery Hero SE	Bank of America Merrill Lynch	(3,355)
(1,421)	Delivery Hero SE	BNP Paribas	(9,133)
(79)	Delivery Hero SE	Citibank	(506)
2,926	Deutsche Bank AG Reg	BNP Paribas	3,896
995	Deutsche Bank AG Reg	Citibank	473
1,386	Deutsche Boerse AG	BNP Paribas	(9,428)
(16,152)	Deutsche Lufthansa AG Reg	Barclays Bank	1,782
(11,544)	Deutsche Lufthansa AG Reg	BNP Paribas	(1,286)
749	Deutsche Post AG Reg	Barclays Bank	132
13,851	Deutsche Post AG Reg	BNP Paribas	(3,116)
4,439	Deutsche Post AG Reg	Goldam Sachs	(999)
1,897	Deutsche Post AG Reg	HSBC	4,054
208	Deutsche Post AG Reg	JP Morgan	445

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)		
(6,043)	Deutsche Telekom AG Reg	Barclays Bank	(3,923)
(5,847)	Deutsche Telekom AG Reg	BNP Paribas	(6,376)
(2,144)	Deutsche Telekom AG Reg	Citibank	(1,392)
12,412	E.ON SE	BNP Paribas	(6,037)
10,230	E.ON SE	Goldam Sachs	(4,975)
950	Evonik Industries AG	Bank of America Merrill Lynch	(570)
1,595	Evonik Industries AG	Barclays Bank	(1,042)
3,767	Evonik Industries AG	BNP Paribas	(2,260)
301	Evonik Industries AG	Citibank	(197)
292	Evonik Industries AG	Goldam Sachs	(175)
348	Evonik Industries AG	HSBC	93
283	Evonik Industries AG	JP Morgan	76
(282)	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	Bank of America Merrill Lynch	30
(2,895)	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	Barclays Bank	(2,357)
(1,725)	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	BNP Paribas	185
(626)	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	Citibank	(510)
(1,052)	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	Goldam Sachs	113
(667)	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	HSBC	515
494	Fresenius SE & Co KGaA	Goldam Sachs	(667)
(344)	FUCHS PETROLUB SE (Pref)	Barclays Bank	(845)
8,008	GEA Group AG	BNP Paribas	16,814
(140)	Hannover Rueck SE	Barclays Bank	(112)
(154)	Hannover Rueck SE	BNP Paribas	520
(56)	Hannover Rueck SE	Citibank	(45)
(59)	Hannover Rueck SE	HSBC	(297)
476	HeidelbergCement AG	Barclays Bank	551
1,212	HeidelbergCement AG	BNP Paribas	2,103
749	HeidelbergCement AG	HSBC	(32)
173	HelloFresh SE	Goldam Sachs	(747)
336	HelloFresh SE	HSBC	61
809	Henkel AG & Co KGaA (Pref)	BNP Paribas	(520)
470	Henkel AG & Co KGaA (Pref)	Goldam Sachs	(302)
301	Henkel AG & Co KGaA (Pref)	HSBC	464
145	Henkel AG & Co KGaA (Pref)	JP Morgan	224
(626)	Infineon Technologies AG	BNP Paribas	(463)
(494)	KION Group AG	Barclays Bank	(132)
(389)	KION Group AG	BNP Paribas	104
(1,788)	KION Group AG	HSBC	1,877
(150)	KION Group AG	JP Morgan	158
(1,577)	Knorr-Bremse AG	BNP Paribas	5,372
(1,002)	LANXESS AG	Barclays Bank	(6,956)
(304)	LANXESS AG	BNP Paribas	(2,446)
(279)	LANXESS AG	Goldam Sachs	(2,245)
(383)	LANXESS AG	JP Morgan	(3,807)
452	LEG Immobilien AG	BNP Paribas	(2,063)

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)		
(388)	Mercedes-Benz Group AG	BNP Paribas	(973)
(174)	Mercedes-Benz Group AG	Citibank	(250)
(329)	Mercedes-Benz Group AG	Goldam Sachs	(825)
(1,300)	Mercedes-Benz Group AG	HSBC	(7,437)
(82)	Merck KGaA	Barclays Bank	163
(273)	Merck KGaA	BNP Paribas	(3,816)
49	MTU Aero Engines AG	Bank of America Merrill Lynch	(318)
77	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen Reg	Barclays Bank	379
260	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen Reg	BNP Paribas	334
127	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen Reg	Goldam Sachs	163
102	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen Reg	HSBC	1,519
552	Nemetschek SE	Bank of America Merrill Lynch	1,644
1,938	Nemetschek SE	BNP Paribas	5,772
(196)	Porsche Automobil Holding SE (Pref)	Barclays Bank	(542)
(1,400)	Porsche Automobil Holding SE (Pref)	BNP Paribas	(450)
(323)	Porsche Automobil Holding SE (Pref)	Goldam Sachs	(104)
(214)	Porsche Automobil Holding SE (Pref)	HSBC	(234)
(1,239)	Puma SE	BNP Paribas	(4,725)
(194)	Puma SE	Citibank	(1,197)
(55)	Puma SE	Goldam Sachs	(210)
(3,147)	QIAGEN NV	Goldam Sachs	2,596
13	Rational AG	Bank of America Merrill Lynch	905
16	Rational AG	Barclays Bank	986
14	Rational AG	BNP Paribas	975
8	Rational AG	Goldam Sachs	557
41	Rational AG	HSBC	4,304
43	Rational AG	JP Morgan	4,514
1,731	SAP SE	BNP Paribas	(1,187)
187	SAP SE	Goldam Sachs	(128)
(321)	Sartorius AG (Pref)	BNP Paribas	(11,313)
(188)	Scout24 AG	Bank of America Merrill Lynch	(334)
(1,142)	Scout24 AG	Barclays Bank	(489)
(279)	Scout24 AG	BNP Paribas	(496)
(331)	Scout24 AG	Goldam Sachs	(589)
(150)	Scout24 AG	HSBC	103
431	Siemens AG Reg	Barclays Bank	3,001
1,465	Siemens AG Reg	BNP Paribas	15,066
326	Siemens AG Reg	Goldam Sachs	3,353
(5,595)	Siemens Energy AG	Barclays Bank	(7,132)
(3,566)	Siemens Energy AG	BNP Paribas	(5,482)
(1,747)	Siemens Energy AG	Citibank	(2,227)
(13)	Siemens Energy AG	Goldam Sachs	(20)
(4,013)	Siemens Healthineers AG	BNP Paribas	(3,611)

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)			
500	Symrise AG	Barclays Bank	(54)
787	Symrise AG	BNP Paribas	(126)
452	Symrise AG	Citibank	(48)
(1,095)	Telefonica Deutschland Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	52
(15,702)	Telefonica Deutschland Holding AG	Barclays Bank	(1,581)
(9,337)	Telefonica Deutschland Holding AG	BNP Paribas	440
(9,062)	Telefonica Deutschland Holding AG	Goldam Sachs	427
(484)	Uniper SE	Bank of America Merrill Lynch	187
(484)	Uniper SE	BNP Paribas	187
(431)	Uniper SE	Citibank	471
(85)	Uniper SE	Goldam Sachs	33
(454)	Uniper SE	HSBC	(1,196)
(267)	United Internet AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	60
(1,268)	United Internet AG Reg	Barclays Bank	(1,576)
(733)	United Internet AG Reg	BNP Paribas	165
(533)	United Internet AG Reg	Goldam Sachs	120
(520)	United Internet AG Reg	HSBC	(217)
(416)	Volkswagen AG (Pref)	Citibank	(2,638)
(402)	Vonovia SE	Barclays Bank	(215)
(293)	Vonovia SE	BNP Paribas	(390)
(317)	Vonovia SE	Goldam Sachs	(470)
(810)	Vonovia SE	HSBC	(1,987)
(951)	Zalando SE	Bank of America Merrill Lynch	(3,443)
(1,733)	Zalando SE	Barclays Bank	(4,326)
(2,064)	Zalando SE	BNP Paribas	(7,473)
(2,286)	Zalando SE	Goldam Sachs	(8,277)
			<u>(116,926)</u>
香港			
11,800	AIA Group Ltd	Barclays Bank	3,158
123,000	BOC Hong Kong Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	11,756
(6,600)	Budweiser Brewing Co APAC Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,018)
(60,700)	Budweiser Brewing Co APAC Ltd	Citibank	(9,360)
(19,500)	Budweiser Brewing Co APAC Ltd	Goldam Sachs	(3,007)
(5,200)	Chow Tai Fook Jewellery Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(530)
66,500	CK Asset Holdings Ltd	HSBC	(29,237)
(4,000)	CK Hutchison Holdings Ltd	Goldam Sachs	(535)
(1,500)	CK Infrastructure Holdings Ltd	Goldam Sachs	507
(9,600)	ESR Cayman Ltd	Goldam Sachs	(367)
(6,000)	Galaxy Entertainment Group Ltd	BNP Paribas	(1,019)
(7,000)	Galaxy Entertainment Group Ltd	Citibank	(669)
(28,000)	Galaxy Entertainment Group Ltd	Goldam Sachs	(178)
(13,000)	Hang Lung Properties Ltd	Goldam Sachs	(431)
(1,300)	Hang Seng Bank Ltd	HSBC	447
112,000	Henderson Land Development Co Ltd	Goldam Sachs	22,123
(141,000)	HKT Trust & HKT Ltd (Unit)	Bank of America Merrill Lynch	8,265



保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 / (損) (米ドル)
香港（続き）			
(258,900)	Hong Kong & China Gas Co Ltd	Barclays Bank	(8,578)
(900)	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	Goldam Sachs	(1,491)
(102,452)	MTR Corp Ltd	Barclays Bank	15,014
13,000	New World Development Co Ltd	Barclays Bank	828
28,000	New World Development Co Ltd	Goldam Sachs	3,925
15,000	New World Development Co Ltd	HSBC	2,581
2,000	New World Development Co Ltd	JP Morgan	344
(28,800)	Sands China Ltd	Goldam Sachs	2,496
(1)	Sisram Medical Ltd	JP Morgan	-
4,000	SITC International Holdings Co Ltd	Citibank	994
35,500	Sun Hung Kai Properties Ltd	Bank of America Merrill Lynch	7,238
3,500	Sun Hung Kai Properties Ltd	Goldam Sachs	714
2,000	Sun Hung Kai Properties Ltd	HSBC	1,440
77,500	Swire Pacific Ltd 'A'	HSBC	38,023
(104,200)	Swire Properties Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4,249)
(44,000)	Swire Properties Ltd	Barclays Bank	224
(1,500)	Techtronic Industries Co Ltd	Goldam Sachs	(344)
(75,000)	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	Citibank	(3,823)
(6,000)	Xinyi Glass Holdings Ltd	BNP Paribas	(1,590)
(8,000)	Xinyi Glass Holdings Ltd	Goldam Sachs	(2,121)
(8,000)	Xinyi Glass Holdings Ltd	HSBC	(2,916)
			<u>48,614</u>
アイルランド			
(1,167)	CRH Plc	BNP Paribas	(1,931)
(576)	CRH Plc	Goldam Sachs	(953)
(526)	Flutter Entertainment Plc	Barclays Bank	(2,141)
(180)	Flutter Entertainment Plc	Citibank	(733)
(177)	Flutter Entertainment Plc	Goldam Sachs	(1,792)
(165)	Flutter Entertainment Plc	HSBC	(3,647)
89	Kerry Group Plc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(728)
389	Kerry Group Plc 'A'	BNP Paribas	(3,184)
100	Kerry Group Plc 'A'	Goldam Sachs	(818)
117	Kerry Group Plc 'A'	JP Morgan	105
(393)	Kingspan Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(741)
(668)	Kingspan Group Plc	Barclays Bank	(2,934)
(594)	Kingspan Group Plc	BNP Paribas	(1,120)
(109)	Kingspan Group Plc	HSBC	(23)
(170)	Kingspan Group Plc	JP Morgan	(36)
245	Smurfit Kappa Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	178
579	Smurfit Kappa Group Plc	Barclays Bank	980
430	Smurfit Kappa Group Plc	BNP Paribas	313
1,462	Smurfit Kappa Group Plc	Citibank	2,475
306	Smurfit Kappa Group Plc	Goldam Sachs	223
309	Smurfit Kappa Group Plc	JP Morgan	(7)
			<u>(16,514)</u>

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			
6,662	Bank Hapoalim BM	Bank of America Merrill Lynch	1,438
9,527	Bank Hapoalim BM	Barclays Bank	(400)
6,041	Bank Hapoalim BM	Goldam Sachs	887
1,676	Bank Leumi Le-Israel BM	Barclays Bank	(302)
4,691	Bank Leumi Le-Israel BM	Goldam Sachs	(183)
52	Elbit Systems Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(422)
(1,298)	Fiverr International Ltd	BNP Paribas	(7,022)
50,981	Israel Discount Bank Ltd 'A'	Goldam Sachs	764
111	Nice Ltd	Barclays Bank	799
			(4,441)
イタリア			
(895)	Amplifon SpA	BNP Paribas	2,301
641	Assicurazioni Generali SpA	Barclays Bank	(343)
484	Assicurazioni Generali SpA	Goldam Sachs	(459)
456	Assicurazioni Generali SpA	HSBC	(249)
497	Assicurazioni Generali SpA	JP Morgan	(272)
(8,512)	Atlantia SpA	Barclays Bank	(547)
2,987	CNH Industrial NV	Bank of America Merrill Lynch	304
804	CNH Industrial NV	BNP Paribas	82
(5,586)	Davide Campari-Milano NV	Citibank	(610)
(96)	DiaSorin SpA	BNP Paribas	(231)
(65)	DiaSorin SpA	Goldam Sachs	(157)
27,360	Enel SpA	BNP Paribas	2,169
4,710	Enel SpA	Goldam Sachs	373
38,422	Eni SpA	BNP Paribas	20,003
1,744	EXOR NV	Barclays Bank	3,811
1,355	EXOR NV	BNP Paribas	5,226
220	Ferrari NV	BNP Paribas	271
1,138	FinecoBank Banca Fineco SpA	BNP Paribas	829
(1,237)	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	Bank of America Merrill Lynch	(311)
(5,075)	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	Barclays Bank	(1,033)
(43,427)	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	BNP Paribas	(10,933)
(2,309)	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	Citibank	(470)
44,630	Intesa Sanpaolo SpA	Goldam Sachs	3,328
(9,136)	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	BNP Paribas	3,778
988	Moncler SpA	Bank of America Merrill Lynch	243
456	Moncler SpA	Barclays Bank	1,138
1,194	Moncler SpA	BNP Paribas	871
422	Moncler SpA	Citibank	1,499
905	Moncler SpA	JP Morgan	1,920
(3,900)	Nexi SpA	Bank of America Merrill Lynch	(3,351)
(16,073)	Nexi SpA	Barclays Bank	(2,858)
(7,569)	Nexi SpA	BNP Paribas	(6,503)
(3,386)	Nexi SpA	Goldam Sachs	(2,909)
790	Poste Italiane SpA	Bank of America Merrill Lynch	466

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)			
1,291	Poste Italiane SpA	Barclays Bank	546
12,181	Poste Italiane SpA	BNP Paribas	7,190
860	Poste Italiane SpA	Citibank	364
782	Poste Italiane SpA	HSBC	1,103
598	Prysmian SpA	Citibank	673
(627)	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	Bank of America Merrill Lynch	-
(355)	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	Barclays Bank	190
(299)	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	BNP Paribas	-
(222)	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	Goldam Sachs	-
12,336	Snam SpA	BNP Paribas	344
1,613	Stellantis NV	Bank of America Merrill Lynch	249
1,042	Stellantis NV	Barclays Bank	283
9,562	Stellantis NV	BNP Paribas	1,475
544	Stellantis NV	Citibank	148
2,078	Stellantis NV	Goldam Sachs	321
1,797	Stellantis NV	HSBC	2,168
584	Stellantis NV	JP Morgan	704
(8,626)	Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	Barclays Bank	1,072
(1,651)	Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	HSBC	(71)
(2,312)	UniCredit SpA	BNP Paribas	(2,883)
			<u>31,252</u>
日本			
900	Advantest Corp	Goldam Sachs	2,237
(1,600)	Aeon Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	422
(7,300)	Aeon Co Ltd	Barclays Bank	(2,296)
(3,400)	Aeon Co Ltd	BNP Paribas	898
(3,900)	Aeon Co Ltd	Goldam Sachs	709
(600)	Aeon Co Ltd	HSBC	147
(900)	AGC Inc	Citibank	(245)
(800)	Aisin Corp	Barclays Bank	(1,367)
500	Ajinomoto Co Inc	Barclays Bank	(206)
2,100	Ajinomoto Co Inc	BNP Paribas	(261)
1,700	Ajinomoto Co Inc	Goldam Sachs	(211)
2,100	Ajinomoto Co Inc	HSBC	587
100	Ajinomoto Co Inc	JP Morgan	28
1,100	ANA Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	585
900	Asahi Group Holdings Ltd	BNP Paribas	(2,418)
(2,400)	Asahi Intecc Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,305
(2,900)	Asahi Intecc Co Ltd	Barclays Bank	1,036
(500)	Asahi Intecc Co Ltd	Goldam Sachs	272
1,900	Asahi Kasei Corp	Bank of America Merrill Lynch	221
14,400	Asahi Kasei Corp	Barclays Bank	(839)
25,300	Asahi Kasei Corp	BNP Paribas	2,947

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	日本(続き)		
15,200	Asahi Kasei Corp	Goldam Sachs	1,771
2,800	Asahi Kasei Corp	HSBC	(652)
3,100	Asahi Kasei Corp	JP Morgan	(722)
15,900	Astellas Pharma Inc	BNP Paribas	13,151
(400)	Bandai Namco Holdings Inc	Barclays Bank	(1,218)
(900)	Bandai Namco Holdings Inc	BNP Paribas	(6,158)
(400)	Bandai Namco Holdings Inc	HSBC	(3,389)
(800)	Benefit One Inc	BNP Paribas	(814)
(1,900)	Bridgestone Corp	BNP Paribas	(3,581)
(400)	Bridgestone Corp	Citibank	(326)
(300)	Bridgestone Corp	HSBC	(746)
(600)	Brother Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(666)
(2,500)	Brother Industries Ltd	BNP Paribas	(3,429)
(700)	Brother Industries Ltd	Goldam Sachs	(1,011)
(600)	Brother Industries Ltd	HSBC	(390)
(2,400)	Canon Inc	Barclays Bank	(708)
(4,500)	Canon Inc	BNP Paribas	(2,866)
(600)	Canon Inc	Citibank	(177)
(500)	Canon Inc	HSBC	(757)
700	Capcom Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,033
100	Capcom Co Ltd	Barclays Bank	66
600	Capcom Co Ltd	HSBC	1,281
(1,200)	Central Japan Railway Co	BNP Paribas	5,079
(700)	Central Japan Railway Co	Goldam Sachs	2,963
(100)	Chiba Bank Ltd	Barclays Bank	7
(19,600)	Chiba Bank Ltd	Goldam Sachs	5,175
(2,100)	Chubu Electric Power Co Inc	Barclays Bank	391
(2,500)	Chubu Electric Power Co Inc	BNP Paribas	485
(2,800)	Chubu Electric Power Co Inc	Citibank	522
(10,200)	Chubu Electric Power Co Inc	Goldam Sachs	1,940
(2,100)	Chubu Electric Power Co Inc	HSBC	538
(2,900)	Chubu Electric Power Co Inc	JP Morgan	743
1,300	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(384)
8,400	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	Barclays Bank	(5,545)
1,700	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	BNP Paribas	(502)
800	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	Citibank	(528)
1,200	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	Goldam Sachs	(354)
100	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	HSBC	(130)
2,700	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	(3,523)
(2,600)	Concordia Financial Group Ltd	Barclays Bank	40
(3,600)	Concordia Financial Group Ltd	BNP Paribas	252
(300)	Cosmos Pharmaceutical Corp	Barclays Bank	(1,864)
(300)	Cosmos Pharmaceutical Corp	BNP Paribas	(2,446)
(100)	Cosmos Pharmaceutical Corp	Goldam Sachs	(815)
(100)	Cosmos Pharmaceutical Corp	HSBC	(730)

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)	CyberAgent Inc	BNP Paribas	(51)
400	Dai Nippon Printing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	106
1,900	Dai Nippon Printing Co Ltd	Barclays Bank	44
2,300	Dai Nippon Printing Co Ltd	BNP Paribas	607
900	Dai Nippon Printing Co Ltd	Citibank	21
700	Dai Nippon Printing Co Ltd	Goldam Sachs	185
2,600	Dai Nippon Printing Co Ltd	HSBC	3,897
600	Dai Nippon Printing Co Ltd	JP Morgan	899
(1,100)	Daifuku Co Ltd	BNP Paribas	171
(1,300)	Dai-ichi Life Holdings Inc	Goldam Sachs	(1,561)
(1,000)	Daiichi Sankyo Co Ltd	BNP Paribas	(606)
(300)	Daikin Industries Ltd	Barclays Bank	(2,108)
(1,200)	Daikin Industries Ltd	BNP Paribas	233
(100)	Daito Trust Construction Co Ltd	BNP Paribas	(140)
(100)	Daito Trust Construction Co Ltd	Goldam Sachs	(140)
(200)	Daito Trust Construction Co Ltd	HSBC	109
1,700	Daiwa House Industry Co Ltd	BNP Paribas	106
9,200	Daiwa Securities Group Inc	BNP Paribas	800
1,900	Denso Corp	BNP Paribas	7,215
3,800	Dentsu Group Inc	BNP Paribas	(11,952)
700	Dentsu Group Inc	Goldam Sachs	(2,202)
300	Dentsu Group Inc	HSBC	(1,002)
300	Dentsu Group Inc	JP Morgan	(1,002)
100	Disco Corp	HSBC	3,184
(1,400)	East Japan Railway Co	BNP Paribas	54
(2,400)	East Japan Railway Co	Goldam Sachs	93
800	Eisai Co Ltd	BNP Paribas	(1,764)
200	Eisai Co Ltd	Goldam Sachs	(441)
300	Eisai Co Ltd	JP Morgan	(552)
64,300	ENEOS Holdings Inc	Barclays Bank	2,597
(100)	FANUC Corp	BNP Paribas	(858)
(100)	Fast Retailing Co Ltd	Barclays Bank	(1,165)
(200)	Fast Retailing Co Ltd	BNP Paribas	(3,293)
7,500	Fuji Electric Co Ltd	Barclays Bank	13,397
(200)	FUJIFILM Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(26)
(800)	FUJIFILM Holdings Corp	Barclays Bank	(770)
(1,300)	FUJIFILM Holdings Corp	BNP Paribas	(293)
(1,200)	FUJIFILM Holdings Corp	Citibank	(1,156)
(1,600)	FUJIFILM Holdings Corp	Goldam Sachs	(551)
200	Fujitsu Ltd	Goldam Sachs	318
(1,800)	GMO Payment Gateway Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,398)
(600)	GMO Payment Gateway Inc	Barclays Bank	(419)
(200)	GMO Payment Gateway Inc	BNP Paribas	(155)
(100)	GMO Payment Gateway Inc	Citibank	(70)
(200)	GMO Payment Gateway Inc	Goldam Sachs	(155)

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)	GMO Payment Gateway Inc	JP Morgan	(652)
10,500	Hakuhodo DY Holdings Inc	Barclays Bank	(1,549)
(300)	Hamamatsu Photonics KK	Bank of America Merrill Lynch	(722)
(600)	Hamamatsu Photonics KK	Barclays Bank	(513)
(200)	Hamamatsu Photonics KK	Goldam Sachs	(481)
2,200	Hankyu Hanshin Holdings Inc	Barclays Bank	(1,538)
400	Hankyu Hanshin Holdings Inc	BNP Paribas	18
500	Hankyu Hanshin Holdings Inc	HSBC	69
800	Hankyu Hanshin Holdings Inc	JP Morgan	(59)
(700)	Hikari Tsushin Inc	Barclays Bank	(1,142)
(400)	Hikari Tsushin Inc	Goldam Sachs	(3,106)
7,300	Hino Motors Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,891
(2,200)	Hitachi Construction Machinery Co Ltd	HSBC	940
700	Hitachi Ltd	Barclays Bank	549
100	Hitachi Ltd	BNP Paribas	230
100	Hitachi Ltd	Citibank	78
900	Hitachi Ltd	Goldam Sachs	2,069
(2,700)	Hitachi Metals Ltd	BNP Paribas	(1,573)
(3,800)	Hitachi Metals Ltd	HSBC	(826)
4,200	Honda Motor Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	391
4,600	Honda Motor Co Ltd	Barclays Bank	(643)
1,600	Honda Motor Co Ltd	BNP Paribas	149
400	Honda Motor Co Ltd	Citibank	(56)
6,100	Honda Motor Co Ltd	Goldam Sachs	568
1,500	Honda Motor Co Ltd	JP Morgan	(2,411)
300	Hoshizaki Corp	BNP Paribas	(140)
1,300	Hoya Corp	Bank of America Merrill Lynch	10,752
200	Hoya Corp	BNP Paribas	2,009
100	Hoya Corp	Goldam Sachs	827
(12,400)	Hulic Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,407)
(17,800)	Hulic Co Ltd	Barclays Bank	(553)
300	Ibiden Co Ltd	BNP Paribas	26
1,300	Ibiden Co Ltd	HSBC	375
800	Idemitsu Kosan Co Ltd	Barclays Bank	466
3,200	Idemitsu Kosan Co Ltd	BNP Paribas	2,112
2,400	Idemitsu Kosan Co Ltd	Goldam Sachs	1,584
900	Idemitsu Kosan Co Ltd	JP Morgan	(804)
(2,600)	Iida Group Holdings Co Ltd	BNP Paribas	(1,636)
(1,400)	Iida Group Holdings Co Ltd	Citibank	(511)
(1,400)	Iida Group Holdings Co Ltd	Goldam Sachs	(881)
(300)	Inpex Corp	Barclays Bank	(394)
(7,900)	Inpex Corp	BNP Paribas	(12,700)
(5,600)	Inpex Corp	Goldam Sachs	(9,002)
5,100	Isuzu Motors Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(238)
900	Isuzu Motors Ltd	Barclays Bank	(91)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	日本(続き)		
6,400	Isuzu Motors Ltd	BNP Paribas	(298)
5,500	Isuzu Motors Ltd	Goldam Sachs	(256)
2,200	Isuzu Motors Ltd	HSBC	(444)
(300)	Ito En Ltd	BNP Paribas	676
3,000	ITOCHU Corp	BNP Paribas	3,774
(1,500)	Itochu Techno-Solutions Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,747)
(700)	Itochu Techno-Solutions Corp	Barclays Bank	54
(2,500)	Itochu Techno-Solutions Corp	BNP Paribas	(2,912)
(900)	Itochu Techno-Solutions Corp	Citibank	70
(400)	Itochu Techno-Solutions Corp	Goldam Sachs	(466)
(400)	Itochu Techno-Solutions Corp	HSBC	(749)
(700)	Japan Airlines Co Ltd	Barclays Bank	(549)
(3,200)	Japan Airlines Co Ltd	Goldam Sachs	(4,622)
(3,600)	Japan Exchange Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,872)
(2,200)	Japan Exchange Group Inc	Goldam Sachs	(2,366)
(2,600)	Japan Exchange Group Inc	HSBC	(2,877)
(18,000)	Japan Post Bank Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,237
(10,000)	Japan Post Bank Co Ltd	BNP Paribas	1,243
(700)	Japan Post Bank Co Ltd	Goldam Sachs	87
(3,100)	Japan Post Bank Co Ltd	HSBC	24
(3,600)	Japan Post Holdings Co Ltd	Barclays Bank	(590)
(8,500)	Japan Post Holdings Co Ltd	BNP Paribas	(1,096)
(4,500)	Japan Post Holdings Co Ltd	Goldam Sachs	(580)
(1,100)	Japan Post Insurance Co Ltd	Goldam Sachs	145
(1,500)	JFE Holdings Inc	BNP Paribas	(967)
(6,700)	JFE Holdings Inc	Goldam Sachs	(4,319)
2,100	JSR Corp	Bank of America Merrill Lynch	6,768
1,900	JSR Corp	Barclays Bank	5,164
800	JSR Corp	BNP Paribas	2,578
800	JSR Corp	Goldam Sachs	2,578
900	JSR Corp	JP Morgan	4,019
10,200	Kajima Corp	Bank of America Merrill Lynch	951
5,700	Kajima Corp	Barclays Bank	708
5,400	Kajima Corp	Goldam Sachs	503
900	Kajima Corp	HSBC	(328)
(800)	Kakaku.com Inc	Barclays Bank	416
(600)	Kakaku.com Inc	BNP Paribas	606
(1,800)	Kakaku.com Inc	Goldam Sachs	1,817
(600)	Kansai Paint Co Ltd	Barclays Bank	(154)
1,100	Kao Corp	Barclays Bank	384
300	Kao Corp	HSBC	58
(1)	Kawasaki Kisen Kaisha Ltd	BNP Paribas	(14)
300	KDDI Corp	Bank of America Merrill Lynch	170
9,300	KDDI Corp	Barclays Bank	(4,478)
(5,900)	Keio Corp	JP Morgan	21,306

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
日本(続き)			
(1,100)	Keisei Electric Railway Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	384
(800)	Keisei Electric Railway Co Ltd	Barclays Bank	373
(800)	Keisei Electric Railway Co Ltd	Goldam Sachs	280
(400)	Keisei Electric Railway Co Ltd	JP Morgan	(280)
(200)	Keyence Corp	HSBC	(2,097)
200	Kikkoman Corp	Bank of America Merrill Lynch	(637)
800	Kikkoman Corp	Barclays Bank	373
200	Kikkoman Corp	Citibank	93
(4,500)	Kintetsu Group Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,097)
(2,000)	Kintetsu Group Holdings Co Ltd	Barclays Bank	(854)
(600)	Kintetsu Group Holdings Co Ltd	Goldam Sachs	(280)
3,500	Kirin Holdings Co Ltd	Barclays Bank	1,712
(2,300)	Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd	Goldam Sachs	5,894
(5,900)	Kobe Bussan Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(9,164)
(700)	Kobe Bussan Co Ltd	Goldam Sachs	(1,087)
(4,510)	Koei Tecmo Holdings Co Ltd	Barclays Bank	(3,678)
(2,300)	Koei Tecmo Holdings Co Ltd	Goldam Sachs	(6,073)
(1,000)	Koei Tecmo Holdings Co Ltd	HSBC	(3,844)
(300)	Koito Manufacturing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	268
(1,000)	Koito Manufacturing Co Ltd	Barclays Bank	233
(1,300)	Koito Manufacturing Co Ltd	BNP Paribas	1,161
(900)	Koito Manufacturing Co Ltd	Goldam Sachs	804
3,300	Komatsu Ltd	BNP Paribas	2,358
500	Komatsu Ltd	Goldam Sachs	357
(100)	Konami Holdings Corp	Barclays Bank	(23)
(400)	Konami Holdings Corp	BNP Paribas	(2,609)
(900)	Konami Holdings Corp	Goldam Sachs	(5,871)
(600)	Kose Corp	Barclays Bank	(513)
(1,500)	Kose Corp	BNP Paribas	(3,029)
(200)	Kose Corp	Citibank	(171)
(300)	Kose Corp	Goldam Sachs	(606)
(10,200)	Kubota Corp	Bank of America Merrill Lynch	(7,525)
(10,500)	Kubota Corp	Barclays Bank	(10,886)
(10,600)	Kubota Corp	BNP Paribas	(7,820)
(4,400)	Kubota Corp	Goldam Sachs	(3,246)
(2,500)	Kubota Corp	HSBC	(2,407)
(400)	Kurita Water Industries Ltd	BNP Paribas	(342)
2,200	Kyocera Corp	Barclays Bank	1,589
1,100	Kyocera Corp	BNP Paribas	899
200	Kyocera Corp	Goldam Sachs	92
200	Kyocera Corp	JP Morgan	699
(800)	Kyowa Kirin Co Ltd	Barclays Bank	(31)
(500)	Kyowa Kirin Co Ltd	BNP Paribas	(43)
(400)	Kyowa Kirin Co Ltd	Citibank	(16)
(1,500)	Kyowa Kirin Co Ltd	Goldam Sachs	(128)



保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(400)	Kyowa Kirin Co Ltd	JP Morgan	(466)
(1,000)	Lasertec Corp	Barclays Bank	(7,688)
(200)	Lasertec Corp	Citibank	(1,987)
(300)	Lasertec Corp	Goldam Sachs	(2,947)
(1,200)	Lion Corp	Bank of America Merrill Lynch	(662)
(600)	Lion Corp	Barclays Bank	(294)
(1,700)	Lion Corp	BNP Paribas	(937)
(4,400)	Lion Corp	Goldam Sachs	(2,426)
(800)	Lion Corp	HSBC	(547)
(600)	Lion Corp	JP Morgan	(410)
9,700	Lixil Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4,445)
(600)	M3 Inc	Barclays Bank	1,198
(3,200)	M3 Inc	BNP Paribas	2,634
(100)	M3 Inc	HSBC	117
(1,400)	Makita Corp	Goldam Sachs	2,359
7,000	Marubeni Corp	Barclays Bank	136
21,900	Marubeni Corp	BNP Paribas	6,888
30,700	Mazda Motor Corp	Barclays Bank	(5,245)
8,900	Mazda Motor Corp	BNP Paribas	1,659
400	Mazda Motor Corp	HSBC	379
200	Mazda Motor Corp	JP Morgan	190
800	McDonald's Holdings Co Japan Ltd	Barclays Bank	(746)
900	McDonald's Holdings Co Japan Ltd	BNP Paribas	(1,048)
500	McDonald's Holdings Co Japan Ltd	Citibank	(466)
1,000	McDonald's Holdings Co Japan Ltd	HSBC	(311)
4,500	MEIJI Holdings Co Ltd	Goldam Sachs	(9,436)
(1,300)	Mercari Inc	Bank of America Merrill Lynch	767
(900)	Mercari Inc	Barclays Bank	(475)
(5,800)	Mercari Inc	BNP Paribas	3,423
(1,100)	Mercari Inc	Goldam Sachs	649
(400)	Mercari Inc	HSBC	9
1,400	MINEBEA MITSUMI Inc	Barclays Bank	-
(200)	MISUMI Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(17)
(900)	MISUMI Group Inc	Barclays Bank	(42)
(700)	MISUMI Group Inc	Goldam Sachs	(60)
(4,700)	Mitsubishi Chemical Holdings Corp	Barclays Bank	504
(7,700)	Mitsubishi Corp	Barclays Bank	(2,631)
(1,800)	Mitsubishi Corp	HSBC	(1,286)
29,700	Mitsubishi Electric Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,998)
8,900	Mitsubishi Electric Corp	BNP Paribas	(899)
17,200	Mitsubishi Electric Corp	Citibank	(1,336)
2,600	Mitsubishi Electric Corp	HSBC	1,232
(2,600)	Mitsubishi Estate Co Ltd	Barclays Bank	(1,504)
1,200	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	997
4,800	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	Barclays Bank	2,498

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	日本(続き)		
6,600	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	BNP Paribas	5,484
2,800	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	HSBC	2,088
1,500	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	JP Morgan	1,118
(13,200)	Mitsubishi HC Capital Inc	HSBC	(2,665)
(500)	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(920)
(2,100)	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Barclays Bank	(832)
(500)	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Citibank	(198)
(2,700)	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Goldam Sachs	(4,970)
(900)	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	HSBC	(2,293)
(5,000)	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	Barclays Bank	163
(12,400)	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	BNP Paribas	(77)
(10,600)	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	HSBC	2,733
(12,800)	Mitsui & Co Ltd	BNP Paribas	(19,583)
1,300	Mitsui Chemicals Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,010
1,900	Mitsui Chemicals Inc	Barclays Bank	1,402
2,700	Mitsui Chemicals Inc	BNP Paribas	2,097
3,900	Mitsui Chemicals Inc	Goldam Sachs	3,029
3,600	Mitsui Chemicals Inc	HSBC	3,914
2,000	Mitsui Chemicals Inc	JP Morgan	2,175
(1,100)	Mitsui Fudosan Co Ltd	Barclays Bank	(1,200)
(500)	Mitsui Fudosan Co Ltd	BNP Paribas	(480)
(2,300)	Mitsui Fudosan Co Ltd	Goldam Sachs	(2,206)
(300)	Mitsui OSK Lines Ltd	Barclays Bank	116
(1,800)	Mitsui OSK Lines Ltd	Goldam Sachs	(2,446)
(600)	Mitsui OSK Lines Ltd	HSBC	(676)
(300)	Miura Co Ltd	BNP Paribas	(172)
(3,400)	Miura Co Ltd	HSBC	(7,816)
6,490	Mizuho Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,008
4,900	Mizuho Financial Group Inc	Barclays Bank	(552)
11,400	Mizuho Financial Group Inc	BNP Paribas	1,771
2,700	Mizuho Financial Group Inc	Goldam Sachs	419
(6,700)	MonotaRO Co Ltd	Barclays Bank	5,307
(400)	MonotaRO Co Ltd	Goldam Sachs	401
(600)	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,430)
(1,200)	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	Barclays Bank	(867)
(400)	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	Goldam Sachs	(954)
600	Murata Manufacturing Co Ltd	Barclays Bank	247
100	Murata Manufacturing Co Ltd	HSBC	71
1,700	NEC Corp	Goldam Sachs	(1,452)
1,000	NEC Corp	HSBC	(1,631)
(4,600)	Nexon Co Ltd	Barclays Bank	(3,751)
(1,400)	Nexon Co Ltd	BNP Paribas	(2,892)
(400)	Nexon Co Ltd	Citibank	(326)
(500)	Nexon Co Ltd	HSBC	(1,192)
(700)	Nexon Co Ltd	JP Morgan	(1,669)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	日本(続き)		
3,900	NGK Insulators Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3,483
5,800	NGK Insulators Ltd	Barclays Bank	3,423
3,900	NGK Insulators Ltd	BNP Paribas	3,483
25,200	NGK Insulators Ltd	Goldam Sachs	22,506
3,400	NGK Insulators Ltd	HSBC	3,749
1,400	NGK Insulators Ltd	JP Morgan	1,544
(1,300)	Nidec Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4,048)
(1,200)	Nidec Corp	Barclays Bank	(2,544)
(300)	Nidec Corp	BNP Paribas	(900)
(100)	Nidec Corp	Citibank	(212)
(500)	Nidec Corp	Goldam Sachs	(1,557)
(500)	Nidec Corp	HSBC	(1,806)
(200)	Nidec Corp	JP Morgan	(722)
(1,500)	Nihon M&A Center Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,631)
(1,300)	Nihon M&A Center Holdings Inc	Barclays Bank	(909)
(500)	Nihon M&A Center Holdings Inc	BNP Paribas	(544)
(5,400)	Nihon M&A Center Holdings Inc	HSBC	(4,823)
(100)	Nintendo Co Ltd	BNP Paribas	(839)
500	Nippon Express Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,165)
2,500	Nippon Express Holdings Inc	Barclays Bank	194
800	Nippon Express Holdings Inc	Goldam Sachs	(1,864)
100	Nippon Express Holdings Inc	HSBC	101
300	Nippon Express Holdings Inc	JP Morgan	(839)
(12,100)	Nippon Paint Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,128
(3,800)	Nippon Paint Holdings Co Ltd	Barclays Bank	1,003
(7,600)	Nippon Paint Holdings Co Ltd	Goldam Sachs	708
(1,900)	Nippon Paint Holdings Co Ltd	HSBC	354
(6,600)	Nippon Sanso Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,128)
(1,000)	Nippon Sanso Holdings Corp	Barclays Bank	(163)
(3,300)	Nippon Sanso Holdings Corp	BNP Paribas	(564)
(3,100)	Nippon Sanso Holdings Corp	Citibank	(506)
(2,300)	Nippon Sanso Holdings Corp	Goldam Sachs	(393)
(2,900)	Nippon Sanso Holdings Corp	HSBC	(2,072)
(1,100)	Nippon Shinyaku Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(7,176)
(200)	Nippon Shinyaku Co Ltd	Barclays Bank	93
(800)	Nippon Shinyaku Co Ltd	BNP Paribas	(5,219)
(600)	Nippon Steel Corp	Barclays Bank	(587)
(400)	Nippon Steel Corp	HSBC	(870)
5,900	Nippon Telegraph & Telephone Corp	Barclays Bank	-
9,300	Nippon Telegraph & Telephone Corp	Goldam Sachs	7,584
1,900	Nippon Telegraph & Telephone Corp	HSBC	1,018
600	Nippon Yusen KK	Goldam Sachs	4,613
200	Nissan Chemical Corp	Bank of America Merrill Lynch	(217)
200	Nissan Chemical Corp	Barclays Bank	(62)
300	Nissan Chemical Corp	BNP Paribas	(326)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	日本(続き)		
1,400	Nissan Chemical Corp	Goldam Sachs	(1,522)
600	Nissan Chemical Corp	JP Morgan	1,212
(34,500)	Nissan Motor Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,581)
(9,900)	Nissan Motor Co Ltd	Barclays Bank	(208)
(11,800)	Nissan Motor Co Ltd	BNP Paribas	(541)
(16,200)	Nissan Motor Co Ltd	Goldam Sachs	(742)
(6,700)	Nissan Motor Co Ltd	HSBC	978
2,300	Nisshin Seifun Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,465)
1,100	Nisshin Seifun Group Inc	Barclays Bank	(367)
2,200	Nisshin Seifun Group Inc	BNP Paribas	(1,401)
1,600	Nisshin Seifun Group Inc	Citibank	(534)
1,200	Nisshin Seifun Group Inc	Goldam Sachs	(764)
2,700	Nisshin Seifun Group Inc	HSBC	(4,424)
2,400	Nisshin Seifun Group Inc	JP Morgan	(3,933)
4,800	Nissin Foods Holdings Co Ltd	BNP Paribas	746
(100)	Nitori Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(12)
(200)	Nitori Holdings Co Ltd	Barclays Bank	(784)
(200)	Nitori Holdings Co Ltd	BNP Paribas	(23)
(100)	Nitori Holdings Co Ltd	Citibank	(392)
(500)	Nitori Holdings Co Ltd	Goldam Sachs	(58)
(100)	Nitori Holdings Co Ltd	HSBC	(633)
(100)	Nitori Holdings Co Ltd	JP Morgan	(633)
2,200	Nitto Denko Corp	Goldam Sachs	6,834
7,600	Nitto Denko Corp	JP Morgan	21,838
(4,700)	Nomura Holdings Inc	Barclays Bank	(683)
(19,400)	Nomura Holdings Inc	BNP Paribas	(5,273)
(2,400)	Nomura Holdings Inc	Goldam Sachs	(652)
100	Nomura Real Estate Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	101
3,600	Nomura Real Estate Holdings Inc	Barclays Bank	(699)
6,000	Nomura Real Estate Holdings Inc	BNP Paribas	6,058
400	Nomura Real Estate Holdings Inc	Citibank	(78)
1,000	Nomura Real Estate Holdings Inc	Goldam Sachs	1,010
600	Nomura Real Estate Holdings Inc	HSBC	326
400	Nomura Real Estate Holdings Inc	JP Morgan	217
(400)	Nomura Research Institute Ltd	Barclays Bank	(47)
(1,000)	Nomura Research Institute Ltd	BNP Paribas	(1,864)
(6,600)	NTT Data Corp	Barclays Bank	1,076
(2,500)	NTT Data Corp	BNP Paribas	(194)
(4,000)	NTT Data Corp	Goldam Sachs	(311)
(2,000)	Obayashi Corp	BNP Paribas	78
(3,100)	Obayashi Corp	HSBC	(602)
(4,000)	Obayashi Corp	JP Morgan	(777)
(100)	Obic Co Ltd	BNP Paribas	132
(17,700)	Odakyu Electric Railway Co Ltd	Barclays Bank	4,536
(5,200)	Odakyu Electric Railway Co Ltd	BNP Paribas	3,675

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(23,500)	Oji Holdings Corp	Goldam Sachs	(1,825)
200	Olympus Corp	BNP Paribas	106
2,200	Olympus Corp	Goldam Sachs	1,170
(300)	Omron Corp	Barclays Bank	56
(400)	Omron Corp	BNP Paribas	(494)
(600)	Omron Corp	Goldam Sachs	(741)
7,100	Ono Pharmaceutical Co Ltd	Barclays Bank	(8,988)
4,800	Ono Pharmaceutical Co Ltd	BNP Paribas	2,050
(4,000)	Open House Group Co Ltd	BNP Paribas	(12,115)
(500)	Oracle Corp Japan	Citibank	1,747
(1,500)	Oracle Corp Japan	Goldam Sachs	5,708
(500)	Oriental Land Co Ltd	Goldam Sachs	(4,912)
(100)	Oriental Land Co Ltd	HSBC	(1,045)
2,000	ORIX Corp	Barclays Bank	1,406
23,100	Osaka Gas Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(5,202)
3,900	Osaka Gas Co Ltd	Barclays Bank	(1,757)
5,300	Osaka Gas Co Ltd	HSBC	123
(3,800)	Otsuka Corp	Bank of America Merrill Lynch	(6,935)
(1,700)	Otsuka Corp	Barclays Bank	(1,980)
(4,000)	Otsuka Corp	BNP Paribas	(7,300)
(5,300)	Otsuka Corp	Goldam Sachs	(9,673)
(1,200)	Otsuka Corp	HSBC	(652)
(500)	Otsuka Holdings Co Ltd	Barclays Bank	571
(2,500)	Otsuka Holdings Co Ltd	BNP Paribas	2,629
(7,400)	Pan Pacific International Holdings Corp	Barclays Bank	(13,333)
(4,500)	Pan Pacific International Holdings Corp	BNP Paribas	(1,363)
(2,100)	Pan Pacific International Holdings Corp	Goldam Sachs	(636)
1,300	Panasonic Holdings Corp	BNP Paribas	535
8,400	Panasonic Holdings Corp	Goldam Sachs	3,457
800	Persol Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	261
1,400	Persol Holdings Co Ltd	Citibank	(826)
200	Persol Holdings Co Ltd	JP Morgan	120
(24,400)	Pola Orbis Holdings Inc	BNP Paribas	(15,159)
(800)	Pola Orbis Holdings Inc	Goldam Sachs	(497)
(1,000)	Pola Orbis Holdings Inc	HSBC	(947)
(1,700)	Rakuten Group Inc	Barclays Bank	502
(22,500)	Rakuten Group Inc	Goldam Sachs	13,629
1,200	Recruit Holdings Co Ltd	BNP Paribas	391
2,100	Recruit Holdings Co Ltd	Goldam Sachs	685
400	Recruit Holdings Co Ltd	HSBC	817
(6,600)	Renesas Electronics Corp	Bank of America Merrill Lynch	(6,663)
(4,600)	Renesas Electronics Corp	Barclays Bank	(1,107)
(7,300)	Renesas Electronics Corp	BNP Paribas	(7,370)
(1,100)	Renesas Electronics Corp	Citibank	(265)
(5,100)	Renesas Electronics Corp	Goldam Sachs	(5,149)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(1,400)	Renesas Electronics Corp	HSBC	(1,620)
33,700	Resona Holdings Inc	BNP Paribas	(2,643)
(1,700)	Ricoh Co Ltd	Citibank	(488)
100	Rinnai Corp	BNP Paribas	116
(300)	Rohm Co Ltd	Barclays Bank	(1,328)
(300)	Rohm Co Ltd	BNP Paribas	(2,493)
(100)	Rohm Co Ltd	Goldam Sachs	(831)
(600)	Ryohin Keikaku Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(643)
(3,100)	Ryohin Keikaku Co Ltd	Barclays Bank	(1,083)
(8,100)	Ryohin Keikaku Co Ltd	Goldam Sachs	(8,681)
16,000	Santen Pharmaceutical Co Ltd	Barclays Bank	1,118
(1,400)	SBI Holdings Inc	BNP Paribas	631
(1,900)	SBI Holdings Inc	Goldam Sachs	856
(5,700)	SBI Holdings Inc	HSBC	12,129
(6,300)	SCSK Corp	Barclays Bank	1,908
1,000	Secom Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	474
500	Secom Co Ltd	BNP Paribas	237
300	Secom Co Ltd	Citibank	70
700	Secom Co Ltd	Goldam Sachs	332
200	Secom Co Ltd	HSBC	(989)
300	Secom Co Ltd	JP Morgan	(1,484)
13,800	Seiko Epson Corp	Barclays Bank	965
34,500	Sekisui Chemical Co Ltd	BNP Paribas	47,424
600	Sekisui House Ltd	Bank of America Merrill Lynch	245
5,600	Sekisui House Ltd	BNP Paribas	2,283
700	Sekisui House Ltd	Citibank	313
700	Sekisui House Ltd	HSBC	315
1,500	Sekisui House Ltd	JP Morgan	676
1,200	SG Holdings Co Ltd	Barclays Bank	242
600	SG Holdings Co Ltd	Citibank	121
600	SG Holdings Co Ltd	HSBC	(98)
(1,300)	Sharp Corp	Bank of America Merrill Lynch	304
(1,900)	Sharp Corp	BNP Paribas	103
(10,600)	Sharp Corp	Goldam Sachs	557
(3,000)	Sharp Corp	HSBC	199
900	Shimadzu Corp	Barclays Bank	(664)
1,300	Shimadzu Corp	Goldam Sachs	959
100	Shimadzu Corp	JP Morgan	299
(100)	Shimano Inc	Bank of America Merrill Lynch	(404)
(300)	Shimano Inc	Barclays Bank	(582)
(100)	Shimano Inc	Citibank	(194)
(27,200)	Shimizu Corp	BNP Paribas	4,225
(2,300)	Shimizu Corp	Goldam Sachs	357
(5,600)	Shimizu Corp	HSBC	(348)
(200)	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	Goldam Sachs	(575)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(200)	Shionogi & Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(47)
(900)	Shionogi & Co Ltd	Barclays Bank	629
(300)	Shionogi & Co Ltd	Citibank	210
(300)	Shionogi & Co Ltd	Goldam Sachs	(70)
(200)	Shiseido Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(103)
(2,200)	Shiseido Co Ltd	Barclays Bank	(2,392)
(3,100)	Shiseido Co Ltd	BNP Paribas	(1,589)
(100)	Shiseido Co Ltd	HSBC	(92)
2,500	Shizuoka Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(815)
2,500	Shizuoka Bank Ltd	Barclays Bank	(194)
1,400	Shizuoka Bank Ltd	Citibank	(109)
5,900	Shizuoka Bank Ltd	HSBC	(4,628)
(200)	SMC Corp	Bank of America Merrill Lynch	(5,017)
(4,500)	SoftBank Corp	Barclays Bank	349
(8,200)	SoftBank Corp	BNP Paribas	(1,433)
(1,900)	SoftBank Corp	HSBC	413
(1,100)	SoftBank Group Corp	Barclays Bank	(880)
(300)	SoftBank Group Corp	BNP Paribas	(627)
(800)	SoftBank Group Corp	Goldam Sachs	(1,671)
(2,200)	SoftBank Group Corp	HSBC	(6,663)
700	Sohgo Security Services Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(516)
1,300	Sohgo Security Services Co Ltd	BNP Paribas	(959)
900	Sohgo Security Services Co Ltd	Goldam Sachs	(664)
400	Sohgo Security Services Co Ltd	HSBC	(248)
300	Sohgo Security Services Co Ltd	JP Morgan	(186)
2,000	Sompo Holdings Inc	BNP Paribas	13,063
2,700	Sompo Holdings Inc	Goldam Sachs	17,634
1,400	Sompo Holdings Inc	HSBC	5,795
100	Sony Corp	BNP Paribas	673
300	Sony Corp	Goldam Sachs	2,178
100	Sony Corp	JP Morgan	209
(1,700)	Square Enix Holdings Co Ltd	Barclays Bank	(1,848)
(300)	Square Enix Holdings Co Ltd	HSBC	(2,539)
3,700	Stanley Electric Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3,190
100	Stanley Electric Co Ltd	JP Morgan	84
2,400	Subaru Corp	Barclays Bank	2,376
2,800	Subaru Corp	Goldam Sachs	2,088
(900)	SUMCO Corp	Bank of America Merrill Lynch	(769)
(1,900)	SUMCO Corp	Barclays Bank	(1,535)
(6,600)	SUMCO Corp	BNP Paribas	(5,638)
(4,200)	SUMCO Corp	Citibank	(3,392)
(4,800)	SUMCO Corp	Goldam Sachs	(4,100)
49,300	Sumitomo Chemical Co Ltd	Barclays Bank	766
18,200	Sumitomo Chemical Co Ltd	BNP Paribas	1,555
200	Sumitomo Chemical Co Ltd	Citibank	3

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	日本(続き)		
8,700	Sumitomo Chemical Co Ltd	Goldam Sachs	743
3,300	Sumitomo Chemical Co Ltd	JP Morgan	(1,128)
(17,600)	Sumitomo Corp	Goldam Sachs	(4,032)
(9,200)	Sumitomo Electric Industries Ltd	Barclays Bank	(393)
(29,200)	Sumitomo Electric Industries Ltd	BNP Paribas	(7,143)
(5,600)	Sumitomo Electric Industries Ltd	Goldam Sachs	(1,370)
(900)	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	BNP Paribas	(3,047)
(400)	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	Goldam Sachs	(1,354)
4,300	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	BNP Paribas	668
1,200	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,389)
500	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	Barclays Bank	54
300	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	BNP Paribas	(347)
600	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	Goldam Sachs	(694)
1,100	Sumitomo Pharma Co Ltd	BNP Paribas	(77)
2,200	Sumitomo Pharma Co Ltd	Goldam Sachs	(154)
(500)	Sumitomo Realty & Development Co Ltd	Barclays Bank	(687)
1,700	Suntory Beverage & Food Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4,027)
1,000	Suzuki Motor Corp	Barclays Bank	334
900	Suzuki Motor Corp	BNP Paribas	664
400	Suzuki Motor Corp	Goldam Sachs	295
500	Suzuki Motor Corp	HSBC	(497)
300	Suzuki Motor Corp	JP Morgan	(298)
800	Systemex Corp	Bank of America Merrill Lynch	(311)
300	Systemex Corp	BNP Paribas	(116)
300	Systemex Corp	Citibank	410
300	Systemex Corp	Goldam Sachs	(116)
200	Systemex Corp	HSBC	868
200	Systemex Corp	JP Morgan	868
(900)	T&D Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	175
(4,100)	T&D Holdings Inc	BNP Paribas	302
(1,400)	T&D Holdings Inc	Citibank	359
(800)	T&D Holdings Inc	Goldam Sachs	155
(1,200)	T&D Holdings Inc	HSBC	2,097
2,300	Taisei Corp	Barclays Bank	-
700	Taisei Corp	Goldam Sachs	(299)
(2,600)	Taisho Pharmaceutical Holdings Co Ltd	BNP Paribas	(4,139)
(1,600)	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	Goldam Sachs	(522)
700	TDK Corp	Goldam Sachs	1,386
1,600	TDK Corp	HSBC	5,281
600	Terumo Corp	Bank of America Merrill Lynch	885
4,600	Terumo Corp	Barclays Bank	2,429
300	Terumo Corp	BNP Paribas	443
(4,900)	TIS Inc	HSBC	(14,955)
(7,600)	Tobu Railway Co Ltd	Barclays Bank	2,066
(4,500)	Toho Co Ltd	HSBC	(7,514)



保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
日本(続き)			
(1,600)	Tokio Marine Holdings Inc	Goldam Sachs	(7,629)
(3,200)	Tokyo Century Corp	Goldam Sachs	(3,728)
100	Tokyo Electron Ltd	BNP Paribas	1,522
100	Tokyo Electron Ltd	Goldam Sachs	1,522
900	Tokyo Gas Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(594)
16,900	Tokyo Gas Co Ltd	Barclays Bank	(10,500)
7,100	Tokyo Gas Co Ltd	BNP Paribas	(4,687)
1,400	Tokyo Gas Co Ltd	Citibank	(870)
1,000	Tokyo Gas Co Ltd	Goldam Sachs	(660)
6,200	Tokyo Gas Co Ltd	HSBC	193
1,000	Tokyo Gas Co Ltd	JP Morgan	31
(6,300)	Tokyu Corp	Bank of America Merrill Lynch	5,627
(7,300)	Tokyu Corp	Barclays Bank	4,876
(1,300)	Tokyu Corp	BNP Paribas	1,161
(600)	Tokyu Corp	Goldam Sachs	536
7,700	Toppan Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,169
2,100	Toppan Inc	Barclays Bank	555
1,300	Toppan Inc	Goldam Sachs	535
1,400	Toppan Inc	JP Morgan	2,740
800	Toray Industries Inc	BNP Paribas	197
58,900	Toray Industries Inc	Goldam Sachs	14,500
(400)	Toshiba Corp	BNP Paribas	(1,069)
2,500	Tosoh Corp	Bank of America Merrill Lynch	(330)
900	Tosoh Corp	Barclays Bank	(7)
7,400	Tosoh Corp	BNP Paribas	(977)
3,800	Tosoh Corp	Goldam Sachs	(502)
2,900	Tosoh Corp	HSBC	878
4,500	TOTO Ltd	Barclays Bank	3,145
300	TOTO Ltd	Citibank	210
6,400	Toyo Suisan Kaisha Ltd	Bank of America Merrill Lynch	14,165
(300)	Toyota Industries Corp	Barclays Bank	23
(200)	Toyota Industries Corp	BNP Paribas	(233)
(600)	Toyota Industries Corp	Goldam Sachs	(699)
(200)	Toyota Industries Corp	HSBC	(404)
(2,700)	Toyota Motor Corp	Citibank	(1,279)
(10,800)	Toyota Motor Corp	Goldam Sachs	(6,123)
400	Toyota Tsusho Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,507
300	Toyota Tsusho Corp	BNP Paribas	1,130
600	Toyota Tsusho Corp	Citibank	1,724
700	Trend Micro Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,011
600	Trend Micro Inc	Barclays Bank	513
(200)	Tsuruha Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(528)
(400)	Tsuruha Holdings Inc	Barclays Bank	(435)
(800)	Tsuruha Holdings Inc	BNP Paribas	(2,112)
(700)	Tsuruha Holdings Inc	Citibank	(970)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
日本(続き)			
(1,300)	Unicharm Corp	Barclays Bank	242
10,900	USS Co Ltd	BNP Paribas	(13,967)
(300)	Welcia Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	44
(2,000)	Welcia Holdings Co Ltd	Barclays Bank	637
(4,500)	Welcia Holdings Co Ltd	BNP Paribas	664
(500)	Welcia Holdings Co Ltd	Citibank	159
(1,300)	Welcia Holdings Co Ltd	Goldam Sachs	192
(1,400)	Welcia Holdings Co Ltd	HSBC	(468)
(1,700)	West Japan Railway Co	Bank of America Merrill Lynch	1,030
(1,000)	West Japan Railway Co	Barclays Bank	505
(1,100)	West Japan Railway Co	BNP Paribas	666
(1,400)	West Japan Railway Co	Goldam Sachs	848
1,500	Yakult Honsha Co Ltd	Barclays Bank	1,398
800	Yamaha Corp	BNP Paribas	932
1,100	Yamaha Corp	Goldam Sachs	1,281
14,400	Yamaha Motor Co Ltd	Barclays Bank	8,947
500	Yamaha Motor Co Ltd	JP Morgan	(590)
200	Yamato Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(326)
800	Yamato Holdings Co Ltd	Barclays Bank	(565)
100	Yamato Holdings Co Ltd	BNP Paribas	(163)
400	Yamato Holdings Co Ltd	Goldam Sachs	(652)
(400)	Yaskawa Electric Corp	Bank of America Merrill Lynch	(792)
(900)	Yaskawa Electric Corp	Barclays Bank	(1,118)
(500)	Yaskawa Electric Corp	BNP Paribas	(990)
(300)	Yaskawa Electric Corp	Citibank	(373)
(300)	Yaskawa Electric Corp	Goldam Sachs	(594)
7,900	Yokogawa Electric Corp	Bank of America Merrill Lynch	5,215
(1,200)	Z Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(57)
(13,400)	Z Holdings Corp	BNP Paribas	(635)
(4,600)	Z Holdings Corp	Goldam Sachs	(218)
(25,800)	Z Holdings Corp	HSBC	3,567
800	ZOZO Inc	Barclays Bank	460
			(121,231)
オランダ			
(18,544)	ABN AMRO Bank NV - CVA	BNP Paribas	15,991
(1,237)	ABN AMRO Bank NV - CVA	Goldam Sachs	1,067
9	Adyen NV	Bank of America Merrill Lynch	(558)
7	Adyen NV	Barclays Bank	(264)
(15,555)	Aegon NV	BNP Paribas	(2,121)
(699)	Akzo Nobel NV	Barclays Bank	(150)
(641)	Akzo Nobel NV	BNP Paribas	(440)
(138)	Akzo Nobel NV	Citibank	(30)
(263)	Akzo Nobel NV	Goldam Sachs	(180)
(94)	Akzo Nobel NV	HSBC	(185)
(438)	Akzo Nobel NV	JP Morgan	(863)

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)			
(1,572)	ArcelorMittal SA	Barclays Bank	(2,947)
(5,683)	ArcelorMittal SA	BNP Paribas	(19,025)
(702)	ArcelorMittal SA	Citibank	(1,316)
(786)	ArcelorMittal SA	Goldam Sachs	(2,631)
(611)	ArcelorMittal SA	HSBC	(2,831)
(120)	ASM International NV	Barclays Bank	(810)
(319)	ASM International NV	BNP Paribas	(1,230)
(35)	ASM International NV	Goldam Sachs	(135)
222	ASML Holding NV	BNP Paribas	6,540
78	ASML Holding NV	Goldam Sachs	2,298
(368)	Heineken NV	BNP Paribas	489
(249)	IMCD NV	BNP Paribas	(1,267)
(310)	ING Groep NV	BNP Paribas	(409)
(3,464)	ING Groep NV	Citibank	(2,683)
(1,881)	ING Groep NV	HSBC	(3,700)
(1,206)	InPost SA	Barclays Bank	377
(2,748)	JDE Peet's NV	Barclays Bank	1,413
(4,956)	JDE Peet's NV	BNP Paribas	8,601
(4,291)	JDE Peet's NV	Goldam Sachs	7,447
(4,459)	Just Eat Takeaway.com NV	BNP Paribas	(3,009)
(145)	Just Eat Takeaway.com NV	Citibank	(188)
(92)	Just Eat Takeaway.com NV	Goldam Sachs	(62)
11,354	Koninklijke Ahold Delhaize NV	BNP Paribas	(21,893)
(178)	Koninklijke DSM NV	Barclays Bank	(3,175)
9,399	Koninklijke KPN NV	Bank of America Merrill Lynch	725
38,855	Koninklijke KPN NV	BNP Paribas	2,997
9,507	Koninklijke Philips NV	BNP Paribas	3,514
8,341	NN Group NV	BNP Paribas	(5,719)
6,742	NN Group NV	Goldam Sachs	(4,622)
(6,343)	Prosus NV	BNP Paribas	(26,670)
(184)	Prosus NV	Goldam Sachs	(774)
2,516	Randstad NV	BNP Paribas	5,498
2,278	Wolters Kluwer NV	Barclays Bank	(2,977)
1,474	Wolters Kluwer NV	BNP Paribas	(3,095)
			<u>(59,002)</u>
ニュージーランド			
(85,037)	Auckland International Airport Ltd	HSBC	(6,641)
689	Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd	Barclays Bank	85
19,708	Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd	Goldam Sachs	(641)
(54,097)	Mercury NZ Ltd	HSBC	5,281
22,661	Meridian Energy Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,949
14,116	Meridian Energy Ltd	BNP Paribas	1,837
(52,599)	Ryman Healthcare Ltd	HSBC	(57,847)
8,424	Spark New Zealand Ltd	Bank of America Merrill Lynch	274
24,869	Spark New Zealand Ltd	Barclays Bank	2,428

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)			
54,495	Spark New Zealand Ltd	BNP Paribas	1,773
10,539	Spark New Zealand Ltd	Citibank	1,029
23,437	Spark New Zealand Ltd	Goldam Sachs	763
			(48,710)
ノルウェー			
(1,316)	Adevinta ASA	Bank of America Merrill Lynch	(1,718)
(11,487)	Adevinta ASA	BNP Paribas	(14,997)
(358)	Aker BP ASA	BNP Paribas	(1,699)
(1,062)	Aker BP ASA	Goldam Sachs	(5,039)
2,639	DNB Bank ASA	Bank of America Merrill Lynch	(347)
581	DNB Bank ASA	Barclays Bank	43
2,110	DNB Bank ASA	BNP Paribas	1,355
455	DNB Bank ASA	Citibank	34
1,121	DNB Bank ASA	Goldam Sachs	720
1,032	Equinor ASA	BNP Paribas	3,533
506	Equinor ASA	Goldam Sachs	587
(101)	Gjensidige Forsikring ASA	Bank of America Merrill Lynch	(41)
(501)	Gjensidige Forsikring ASA	Barclays Bank	(32)
(3,380)	Gjensidige Forsikring ASA	BNP Paribas	(1,363)
(821)	Gjensidige Forsikring ASA	Goldam Sachs	(331)
829	Mowi ASA	Bank of America Merrill Lynch	388
1,527	Mowi ASA	Barclays Bank	130
477	Mowi ASA	BNP Paribas	38
359	Mowi ASA	JP Morgan	(88)
7,705	Norsk Hydro ASA	Barclays Bank	114
5,998	Norsk Hydro ASA	BNP Paribas	3,578
2,680	Orkla ASA	Barclays Bank	114
22,571	Orkla ASA	BNP Paribas	(6,660)
1,908	Orkla ASA	Citibank	81
1,602	Orkla ASA	Goldam Sachs	(473)
2,147	Orkla ASA	HSBC	(460)
1,191	Orkla ASA	JP Morgan	(255)
(1,401)	Schibsted ASA 'A'	BNP Paribas	(773)
2,618	Telenor ASA	Bank of America Merrill Lynch	681
668	Telenor ASA	Barclays Bank	145
1,706	Telenor ASA	BNP Paribas	444
875	Telenor ASA	Citibank	190
1,338	Telenor ASA	HSBC	33
(62)	Yara International ASA	Bank of America Merrill Lynch	(127)
(1,406)	Yara International ASA	Barclays Bank	(955)
(854)	Yara International ASA	Goldam Sachs	(1,750)
(511)	Yara International ASA	HSBC	(1,166)
			(26,066)
ポルトガル			
(2,676)	Galp Energia SGPS SA	Citibank	(3,526)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
ポルトガル(続き)			
789	Jeronimo Martins SGPS SA	Bank of America Merrill Lynch	211
539	Jeronimo Martins SGPS SA	Barclays Bank	202
854	Jeronimo Martins SGPS SA	BNP Paribas	229
995	Jeronimo Martins SGPS SA	Goldam Sachs	266
533	Jeronimo Martins SGPS SA	HSBC	(68)
579	Jeronimo Martins SGPS SA	JP Morgan	(74)
			(2,760)
シンガポール			
190	CDL Hospitality Trusts (Unit)	Bank of America Merrill Lynch	(6)
349	CDL Hospitality Trusts (Unit)	BNP Paribas	318
(2,300)	City Developments Ltd	BNP Paribas	(168)
1,200	DBS Group Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(87)
(8,600)	Keppel Corp Ltd	Goldam Sachs	(1,694)
2,600	Singapore Airlines Ltd	Bank of America Merrill Lynch	398
500	Singapore Airlines Ltd	Barclays Bank	22
9,800	Singapore Airlines Ltd	BNP Paribas	1,501
2,500	Singapore Airlines Ltd	Citibank	109
14,200	Singapore Airlines Ltd	Goldam Sachs	2,175
3,200	Singapore Airlines Ltd	HSBC	514
(2,200)	Singapore Exchange Ltd	BNP Paribas	209
(3,600)	Singapore Exchange Ltd	Citibank	1,024
(27,500)	Singapore Exchange Ltd	Goldam Sachs	2,608
(3,000)	Singapore Exchange Ltd	HSBC	-
(2,000)	Singapore Exchange Ltd	JP Morgan	-
26,300	Singapore Technologies Engineering Ltd	Barclays Bank	1,151
25,000	Singapore Technologies Engineering Ltd	BNP Paribas	1,094
6,500	Singapore Technologies Engineering Ltd	Citibank	285
3,900	Singapore Technologies Engineering Ltd	Goldam Sachs	171
7,200	Singapore Technologies Engineering Ltd	HSBC	-
26,400	Singapore Technologies Engineering Ltd	JP Morgan	-
37,200	Singapore Telecommunications Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3,799)
21,900	Singapore Telecommunications Ltd	Barclays Bank	(1,278)
33,800	Singapore Telecommunications Ltd	BNP Paribas	(3,451)
15,000	Singapore Telecommunications Ltd	Goldam Sachs	(1,532)
10,800	Singapore Telecommunications Ltd	HSBC	(1,260)
12,500	United Overseas Bank Ltd	Barclays Bank	2,644
(17,500)	UOL Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4,085)
(2,700)	Venture Corp Ltd	Barclays Bank	(1,103)
(17,400)	Venture Corp Ltd	BNP Paribas	(6,346)
(13,000)	Venture Corp Ltd	Goldam Sachs	(4,741)
(2,800)	Venture Corp Ltd	HSBC	(858)
(3,400)	Wilmar International Ltd	Bank of America Merrill Lynch	-
(3,300)	Wilmar International Ltd	Barclays Bank	48
(7,600)	Wilmar International Ltd	Goldam Sachs	-
			(16,137)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
韓国			
1	Doosan Co Ltd	Citibank	5
1	HDC Holdings Co Ltd	Goldam Sachs	-
1	HDC Holdings Co Ltd	JP Morgan	-
(1)	Lotte Shopping Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3)
			2
スペイン			
1,131	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	HSBC	3,441
(56)	Aena SME SA	Barclays Bank	(276)
(1,513)	Aena SME SA	BNP Paribas	(11,751)
(1,388)	Amadeus IT Group SA	BNP Paribas	1,279
7,351	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Bank of America Merrill Lynch	1,701
5,544	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Barclays Bank	1,146
20,816	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	BNP Paribas	4,817
1,859	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Citibank	384
5,882	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Goldam Sachs	1,361
3,324	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	HSBC	1,727
3,313	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	JP Morgan	1,721
36,805	Banco Santander SA	Barclays Bank	6,762
51,316	Banco Santander SA	BNP Paribas	17,701
18,251	Banco Santander SA	Goldam Sachs	6,296
4,702	Banco Santander SA	JP Morgan	2,123
(1,991)	CaixaBank SA	Barclays Bank	(277)
(27,403)	CaixaBank SA	BNP Paribas	(13,709)
(21,637)	CaixaBank SA	Goldam Sachs	(10,824)
(8,063)	CaixaBank SA	JP Morgan	(3,731)
(2,801)	Cellnex Telecom SA	Barclays Bank	(6,331)
(5,713)	Cellnex Telecom SA	BNP Paribas	(17,626)
(1,235)	Cellnex Telecom SA	Goldam Sachs	(3,810)
10,756	Endesa SA	BNP Paribas	7,835
(5,651)	Ferrovial SA	BNP Paribas	(666)
(64)	Ferrovial SA	BNP Paribas	23
(16,561)	Ferrovial SA	Citibank	(8,161)
(189)	Ferrovial SA	Citibank	(59)
(1,325)	Ferrovial SA	Goldam Sachs	(156)
(21)	Ferrovial SA	Goldam Sachs	11
(1,532)	Ferrovial SA	HSBC	(1,805)
(22)	Ferrovial SA	HSBC	(567)
(31)	Ferrovial SA (Right)	Citibank	-
(2,812)	Grifols SA	Barclays Bank	783
(10,403)	Grifols SA	BNP Paribas	1,003
(543)	Grifols SA	Goldam Sachs	52
19,100	Grifols SA	HSBC	-
19,920	Iberdrola SA	BNP Paribas	4,801
5,427	Iberdrola SA	Goldam Sachs	1,308
479	Industria de Diseno Textil SA	Barclays Bank	867

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)			
6,282	Industria de Diseno Textil SA	BNP Paribas	10,969
1,424	Industria de Diseno Textil SA	Goldam Sachs	2,487
(787)	Naturgy Energy Group SA	Bank of America Merrill Lynch	(1,475)
(1,435)	Naturgy Energy Group SA	Barclays Bank	(261)
(4,400)	Naturgy Energy Group SA	BNP Paribas	(8,249)
(644)	Naturgy Energy Group SA	HSBC	(442)
10,903	Repsol SA	BNP Paribas	12,322
(3,886)	Siemens Gamesa Renewable Energy SA	Barclays Bank	(645)
(2,647)	Siemens Gamesa Renewable Energy SA	BNP Paribas	(12,888)
(1,534)	Siemens Gamesa Renewable Energy SA	Citibank	(255)
(4,298)	Telefonica SA	Bank of America Merrill Lynch	(1,386)
(5,553)	Telefonica SA	Barclays Bank	(1,547)
(15,983)	Telefonica SA	BNP Paribas	(5,154)
(394)	Telefonica SA	Citibank	(110)
(2,163)	Telefonica SA	Goldam Sachs	(697)
(6,108)	Telefonica SA	HSBC	(2,663)
			<u>(22,601)</u>
スウェーデン			
952	Alfa Laval AB	Bank of America Merrill Lynch	1,115
771	Alfa Laval AB	Barclays Bank	958
3,742	Alfa Laval AB	BNP Paribas	4,382
586	Alfa Laval AB	HSBC	1,056
1,127	Assa Abloy AB 'B'	Barclays Bank	1,010
1,995	Assa Abloy AB 'B'	BNP Paribas	1,828
2,437	Assa Abloy AB 'B'	Goldam Sachs	2,233
328	Assa Abloy AB 'B'	HSBC	494
327	Assa Abloy AB 'B'	JP Morgan	493
(21,204)	Atlas Copco AB 'A'	BNP Paribas	(17,661)
(5,301)	Atlas Copco AB 'A'	BNP Paribas	(4,302)
950	Boliden AB	Bank of America Merrill Lynch	4,314
5,190	Boliden AB	BNP Paribas	23,569
(736)	Electrolux AB 'B'	Barclays Bank	(520)
(7,515)	Electrolux AB 'B'	BNP Paribas	811
(2,514)	Electrolux AB 'B'	Citibank	(1,776)
(5,559)	Electrolux AB 'B'	Goldam Sachs	600
(1,306)	Electrolux AB 'B'	HSBC	(564)
(4,373)	Embracer Group AB	Barclays Bank	(2,743)
(20,440)	Embracer Group AB	Goldam Sachs	(33,736)
(2,161)	Embracer Group AB	JP Morgan	(4,629)
715	Epiroc AB 'A'	BNP Paribas	575
(2,362)	EQT AB	BNP Paribas	(4,497)
(843)	Essity AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	395
(207)	Essity AB 'B'	Barclays Bank	(17)
(6,182)	Essity AB 'B'	BNP Paribas	2,895
112	Evolution AB	HSBC	1,442

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)			
(4,416)	Fastighets AB Balder 'B'	Bank of America Merrill Lynch	453
(9,708)	Fastighets AB Balder 'B'	BNP Paribas	995
(4,470)	Fastighets AB Balder 'B'	Goldam Sachs	458
(1,032)	Fastighets AB Balder 'B'	JP Morgan	(348)
(897)	Getinge AB 'B'	BNP Paribas	265
(8,612)	Hennes & Mauritz AB 'B'	BNP Paribas	(3,332)
(804)	Hexagon AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(422)
(23,946)	Hexagon AB 'B'	BNP Paribas	(12,557)
(2,191)	Hexagon AB 'B'	Goldam Sachs	(1,149)
(4,656)	Hexagon AB 'B'	HSBC	(4,148)
1,114	Husqvarna AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	43
32,134	Husqvarna AB 'B'	Barclays Bank	4,908
9,505	Husqvarna AB 'B'	BNP Paribas	368
300	Industrivarden AB 'A'	Goldam Sachs	360
529	Industrivarden AB 'C'	BNP Paribas	641
(15,974)	Investment AB Latour 'B'	Goldam Sachs	(25,698)
868	Investor AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(85)
1,093	Investor AB 'B'	Goldam Sachs	1,137
8,132	Investor AB 'B'	JP Morgan	13,877
241	Kinnevik AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	599
1,264	Kinnevik AB 'B'	BNP Paribas	3,140
686	Kinnevik AB 'B'	Citibank	1,317
(886)	L E Lundbergforetagen AB 'B'	Barclays Bank	(2,084)
(2,462)	L E Lundbergforetagen AB 'B'	BNP Paribas	(6,242)
(1,464)	Lifco AB 'B'	BNP Paribas	(2,959)
(415)	Lifco AB 'B'	Goldam Sachs	(839)
(262)	Lundin Energy AB	Goldam Sachs	(1,342)
(935)	Lundin Energy AB	HSBC	(6,931)
(2)	NCC AB 'B'	BNP Paribas	1
(641)	Nibe Industrier AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	35
(2,187)	Nibe Industrier AB 'B'	Barclays Bank	13
(4,178)	Nibe Industrier AB 'B'	BNP Paribas	230
(2,047)	Nibe Industrier AB 'B'	Citibank	13
(5,527)	Nibe Industrier AB 'B'	Goldam Sachs	304
(2,472)	Nibe Industrier AB 'B'	HSBC	(1,520)
17,143	Nordea Bank Abp	BNP Paribas	2,042
(365)	Sagax AB 'B'	Barclays Bank	104
1,732	Sandvik AB	Barclays Bank	1,631
655	Sandvik AB	Citibank	617
688	Sandvik AB	Goldam Sachs	935
(8,659)	Securitas AB 'B'	BNP Paribas	1,851
(3,082)	Sinch AB	Bank of America Merrill Lynch	(411)
(3,300)	Sinch AB	Barclays Bank	(516)
(4,193)	Sinch AB	BNP Paribas	(559)
(968)	Sinch AB	Citibank	(151)



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)			
(4,365)	Sinch AB	Goldam Sachs	(582)
(7,318)	Sinch AB	HSBC	(6,456)
(550)	Sinch AB	JP Morgan	(485)
(1,928)	Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A'	Goldam Sachs	157
(757)	Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A'	HSBC	(324)
4,190	Skanska AB 'B'	Barclays Bank	1,365
4,021	Skanska AB 'B'	BNP Paribas	368
2,107	SKF AB 'B'	BNP Paribas	440
(4,768)	Svenska Cellulosa AB SCA 'B'	BNP Paribas	(437)
(2,785)	Svenska Cellulosa AB SCA 'B'	Goldam Sachs	(255)
(1,915)	Svenska Handelsbanken AB 'A'	BNP Paribas	164
(865)	Svenska Handelsbanken AB 'A'	Goldam Sachs	74
(107)	Svenska Handelsbanken AB 'A'	JP Morgan	(15)
1,062	Swedbank AB 'A'	BNP Paribas	(389)
1,047	Swedbank AB 'A'	Goldam Sachs	(384)
1,560	Tele2 AB 'B'	Barclays Bank	(1,628)
3,139	Tele2 AB 'B'	BNP Paribas	(4,586)
861	Tele2 AB 'B'	Goldam Sachs	(1,258)
1,068	Tele2 AB 'B'	HSBC	(1,044)
12,034	Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B'	BNP Paribas	1,617
4,611	Telia Co AB	Barclays Bank	(249)
40,115	Telia Co AB	BNP Paribas	(2,737)
2,936	Telia Co AB	Citibank	(158)
2,451	Telia Co AB	Goldam Sachs	(167)
10,821	Telia Co AB	HSBC	672
7,484	Telia Co AB	JP Morgan	465
610	Volvo AB 'B'	Goldam Sachs	611
			<u>(72,452)</u>
スイス			
(20,594)	ABB Ltd Reg	Barclays Bank	(12,663)
(2,161)	ABB Ltd Reg	BNP Paribas	(2,950)
(2,818)	ABB Ltd Reg	Citibank	(1,733)
(5)	ABB Ltd Reg	Goldam Sachs	(7)
(137)	ABB Ltd Reg	HSBC	(251)
1,573	Adecco Group AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	1,541
301	Adecco Group AG Reg	Barclays Bank	263
458	Adecco Group AG Reg	Goldam Sachs	449
300	Adecco Group AG Reg	JP Morgan	1,022
(954)	Alcon Inc	BNP Paribas	(1,253)
(1,151)	Alcon Inc	Goldam Sachs	(1,511)
(135)	Bachem Holding AG 'B' Reg	Barclays Bank	(563)
(2,820)	Bachem Holding AG 'B' Reg	BNP Paribas	(5,437)
374	Baloise Holding AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	429
441	Baloise Holding AG Reg	Barclays Bank	(1,103)
357	Baloise Holding AG Reg	Citibank	(893)

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)		
371	Baloise Holding AG Reg	Goldam Sachs	425
464	Baloise Holding AG Reg	HSBC	2,950
64	Baloise Holding AG Reg	JP Morgan	407
(103)	Barry Callebaut AG Reg	Barclays Bank	5,797
(7)	Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	Citibank	(948)
(12,392)	Clariant AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(12,528)
(2,165)	Credit Suisse Group AG Reg	Barclays Bank	86
(15,560)	Credit Suisse Group AG Reg	BNP Paribas	(3,551)
(465)	Credit Suisse Group AG Reg	Citibank	18
(4,294)	Credit Suisse Group AG Reg	Goldam Sachs	(1,083)
(9,240)	Credit Suisse Group AG Reg	HSBC	(4,680)
(228)	EMS-Chemie Holding AG Reg	Barclays Bank	(3,683)
(100)	EMS-Chemie Holding AG Reg	BNP Paribas	(990)
(1)	EMS-Chemie Holding AG Reg	Citibank	(16)
254	Geberit AG Reg	BNP Paribas	476
43	Givaudan SA Reg	BNP Paribas	(5,333)
1,327	Holcim AG	Barclays Bank	539
290	Holcim AG	BNP Paribas	199
1,672	Julius Baer Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3,694
176	Julius Baer Group Ltd	Barclays Bank	347
1,480	Julius Baer Group Ltd	BNP Paribas	3,270
772	Julius Baer Group Ltd	Goldam Sachs	1,706
31	Julius Baer Group Ltd	HSBC	121
376	Kuehne + Nagel International AG Reg	Barclays Bank	(2,978)
111	Kuehne + Nagel International AG Reg	Citibank	(879)
98	Kuehne + Nagel International AG Reg	Goldam Sachs	(623)
84	Kuehne + Nagel International AG Reg	HSBC	445
244	Kuehne + Nagel International AG Reg	JP Morgan	1,748
(607)	Logitech International SA Reg	Goldam Sachs	418
(28)	Lonza Group AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(910)
(54)	Lonza Group AG Reg	Barclays Bank	(1,339)
(80)	Lonza Group AG Reg	BNP Paribas	(2,601)
(30)	Lonza Group AG Reg	Citibank	(744)
(133)	Lonza Group AG Reg	Goldam Sachs	(4,325)
694	Nestle SA Reg	Bank of America Merrill Lynch	(2,796)
252	Nestle SA Reg	Barclays Bank	599
336	Nestle SA Reg	BNP Paribas	(2,234)
327	Nestle SA Reg	Citibank	777
786	Nestle SA Reg	Goldam Sachs	(5,226)
159	Nestle SA Reg	HSBC	(570)
141	Nestle SA Reg	JP Morgan	(506)
2,103	Novartis AG Reg	BNP Paribas	(1,907)
762	Novartis AG Reg	Goldam Sachs	(691)
2,412	Novartis AG Reg	JP Morgan	8,245
(15)	Partners Group Holding AG	Barclays Bank	(109)

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)		
(70)	Partners Group Holding AG	BNP Paribas	(1,605)
(11)	Partners Group Holding AG	Citibank	(80)
(19)	Partners Group Holding AG	HSBC	(907)
325	Roche Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	1,626
492	Roche Holding AG	Barclays Bank	1,384
116	Roche Holding AG	BNP Paribas	580
419	Roche Holding AG	HSBC	(8,210)
88	Roche Holding AG	JP Morgan	(1,724)
(502)	Schindler Holding AG	Barclays Bank	(3,113)
29	SGS SA Reg	BNP Paribas	(1,904)
19	SGS SA Reg	Citibank	(693)
74	SGS SA Reg	Goldam Sachs	(4,859)
3	SGS SA Reg	HSBC	25
16	SGS SA Reg	JP Morgan	133
(67)	Sika AG Reg	BNP Paribas	(496)
42	Sonova Holding AG Reg	BNP Paribas	175
34	Sonova Holding AG Reg	HSBC	588
225	Straumann Holding AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	1,008
600	Straumann Holding AG Reg	Barclays Bank	4,252
330	Straumann Holding AG Reg	BNP Paribas	1,479
137	Straumann Holding AG Reg	Goldam Sachs	614
940	Straumann Holding AG Reg	HSBC	18,663
(84)	Swatch Group AG	Bank of America Merrill Lynch	(53)
(267)	Swatch Group AG	Barclays Bank	(3,618)
225	Swiss Life Holding AG Reg	Goldam Sachs	281
(106)	Swiss Prime Site AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	61
(322)	Swiss Prime Site AG Reg	Barclays Bank	772
(642)	Swiss Prime Site AG Reg	BNP Paribas	368
(231)	Swiss Prime Site AG Reg	Citibank	554
(104)	Swiss Prime Site AG Reg	Goldam Sachs	60
(116)	Swiss Prime Site AG Reg	JP Morgan	(453)
(218)	Swiss Re AG	Bank of America Merrill Lynch	527
(325)	Swiss Re AG	Barclays Bank	135
(246)	Swiss Re AG	BNP Paribas	595
(624)	Swiss Re AG	Citibank	260
(557)	Swiss Re AG	Goldam Sachs	1,347
35	Swisscom AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(423)
(315)	Temenos AG Reg	Barclays Bank	2,213
4,191	UBS Group AG Reg	BNP Paribas	4,630
75	VAT Group AG	BNP Paribas	1,043
750	Zurich Insurance Group AG	BNP Paribas	(14,617)
1	Zurich Insurance Group AG	Goldam Sachs	(20)
			<u>(53,045)</u>

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
台湾			
(415)	Shin Kong Financial Holding Co Ltd (Pref)	Bank of America Merrill Lynch	(21)
			(21)
英国			
223	3i Group Plc	Barclays Bank	74
8,583	3i Group Plc	BNP Paribas	(4,268)
318	3i Group Plc	Citibank	106
3,122	3i Group Plc	HSBC	1,906
(1,846)	Admiral Group Plc	BNP Paribas	1,929
(622)	Admiral Group Plc	Goldam Sachs	650
(2,254)	Admiral Group Plc	HSBC	2,781
1,161	Anglo American Plc	Barclays Bank	3,384
(2,134)	Antofagasta Plc	BNP Paribas	(3,949)
926	Ashtead Group Plc	BNP Paribas	3,521
529	Associated British Foods Plc	BNP Paribas	450
2,932	Associated British Foods Plc	Goldam Sachs	2,491
461	Associated British Foods Plc	HSBC	1,021
(894)	AstraZeneca Plc	BNP Paribas	878
1,586	Auto Trader Group Plc	BNP Paribas	615
6,143	Auto Trader Group Plc	Goldam Sachs	2,382
(8,274)	AVEVA Group Plc	BNP Paribas	(15,416)
(277)	AVEVA Group Plc	Goldam Sachs	(516)
(492)	AVEVA Group Plc	HSBC	(1,282)
1,120	Aviva Plc	Bank of America Merrill Lynch	500
20,261	Aviva Plc	Barclays Bank	230
18,072	Aviva Plc	BNP Paribas	8,065
(36,105)	Barclays Plc	BNP Paribas	(8,491)
(17,615)	Barclays Plc	Citibank	(2,803)
(10,916)	Barclays Plc	Goldam Sachs	(2,567)
13,048	Barratt Developments Plc	BNP Paribas	3,400
7,092	Barratt Developments Plc	Goldam Sachs	1,848
9,422	Barratt Developments Plc	HSBC	4,899
(85,926)	Barrick Gold Corp	HSBC	133,571
200	Berkeley Group Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	509
853	Berkeley Group Holdings Plc	Barclays Bank	505
2,665	Berkeley Group Holdings Plc	BNP Paribas	6,777
202	Berkeley Group Holdings Plc	Citibank	120
491	Berkeley Group Holdings Plc	Goldam Sachs	1,249
216	Berkeley Group Holdings Plc	HSBC	957
184	Berkeley Group Holdings Plc	JP Morgan	815
(3,158)	BP Plc	Bank of America Merrill Lynch	(771)
(2,405)	BP Plc	Barclays Bank	(462)
(3,097)	BP Plc	Citibank	(384)
(1,854)	BP Plc	Goldam Sachs	(242)
(2,527)	BP Plc	HSBC	(376)
(45,000)	BT Group Plc	BNP Paribas	(4,858)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	英国(続き)		
(9,013)	BT Group Plc	Goldam Sachs	(973)
(527)	BT Group Plc	HSBC	(108)
424	Bunzl Plc	Citibank	(187)
322	Bunzl Plc	Goldam Sachs	(91)
280	Bunzl Plc	JP Morgan	119
3,135	Burberry Group Plc	BNP Paribas	4,578
949	Coca-Cola HBC AG	Barclays Bank	52
4,918	Coca-Cola HBC AG	BNP Paribas	(2,889)
434	Coca-Cola HBC AG	Goldam Sachs	(255)
455	Coca-Cola HBC AG	HSBC	1,007
463	Compass Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(251)
1,390	Compass Group Plc	BNP Paribas	(752)
486	Compass Group Plc	Citibank	260
1,445	Compass Group Plc	Goldam Sachs	(782)
912	Croda International Plc	BNP Paribas	941
542	DCC Plc	Bank of America Merrill Lynch	(4,531)
1,848	DCC Plc	Barclays Bank	(4,932)
1,149	DCC Plc	BNP Paribas	(9,605)
163	DCC Plc	Citibank	(435)
454	DCC Plc	Goldam Sachs	(3,795)
175	DCC Plc	HSBC	(974)
480	DCC Plc	JP Morgan	(2,747)
5,517	Diageo Plc	BNP Paribas	(13,891)
912	Experian Plc	Goldam Sachs	149
206	Ferguson Plc	HSBC	1,224
2,867	GlaxoSmithKline Plc	BNP Paribas	(2,570)
16	GlaxoSmithKline Plc	Goldam Sachs	(14)
(12,699)	Glencore Plc	Barclays Bank	(2,606)
(23,089)	Glencore Plc	BNP Paribas	(15,202)
(1,984)	Glencore Plc	Citibank	(407)
(4,907)	Glencore Plc	Goldam Sachs	(2,360)
(6,547)	Glencore Plc	HSBC	(1,712)
3,166	GVC Holdings Plc	Barclays Bank	1,714
3,626	GVC Holdings Plc	BNP Paribas	4,314
1,192	GVC Holdings Plc	Citibank	645
1,517	GVC Holdings Plc	Goldam Sachs	1,805
1,349	GVC Holdings Plc	HSBC	3,626
679	GVC Holdings Plc	JP Morgan	1,825
(3,653)	Halma Plc	Bank of America Merrill Lynch	(3,679)
(494)	Halma Plc	Barclays Bank	(609)
(1,573)	Halma Plc	BNP Paribas	(1,584)
(2,953)	Hargreaves Lansdown Plc	Bank of America Merrill Lynch	550
(6,272)	Hargreaves Lansdown Plc	Barclays Bank	1,153
(9,202)	Hargreaves Lansdown Plc	BNP Paribas	1,714
(796)	Hargreaves Lansdown Plc	Citibank	146

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	英国(続き)		
(6,287)	Hargreaves Lansdown Plc	Goldam Sachs	1,171
(10,804)	Hargreaves Lansdown Plc	HSBC	(571)
(439)	Hikma Pharmaceuticals Plc	Bank of America Merrill Lynch	11
(3,194)	Hikma Pharmaceuticals Plc	Barclays Bank	1,990
(896)	Hikma Pharmaceuticals Plc	BNP Paribas	23
(1,940)	Hikma Pharmaceuticals Plc	HSBC	(293)
(22,389)	HSBC Holdings Plc	BNP Paribas	(9,738)
2,788	Informa Plc	BNP Paribas	(330)
78	InterContinental Hotels Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	126
3,221	InterContinental Hotels Group Plc	Barclays Bank	7,299
1,977	InterContinental Hotels Group Plc	BNP Paribas	3,186
79	InterContinental Hotels Group Plc	Goldam Sachs	127
4	Intertek Group Plc	Barclays Bank	(1)
3,719	Intertek Group Plc	BNP Paribas	(9,832)
466	Intertek Group Plc	Citibank	(94)
1,270	Intertek Group Plc	Goldam Sachs	(3,358)
903	Intertek Group Plc	HSBC	(2,342)
344	Intertek Group Plc	JP Morgan	(892)
8,344	J Sainsbury Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1,712)
9,076	J Sainsbury Plc	Barclays Bank	(571)
21,036	J Sainsbury Plc	BNP Paribas	(4,317)
15,811	J Sainsbury Plc	Goldam Sachs	(3,244)
6,545	J Sainsbury Plc	JP Morgan	(387)
8,218	JD Sports Fashion Plc	Bank of America Merrill Lynch	(828)
27,090	JD Sports Fashion Plc	Barclays Bank	(341)
22,745	JD Sports Fashion Plc	BNP Paribas	(1,707)
16,424	JD Sports Fashion Plc	Citibank	(207)
12,920	JD Sports Fashion Plc	Goldam Sachs	(1,301)
10,486	JD Sports Fashion Plc	HSBC	673
28,610	JD Sports Fashion Plc	JP Morgan	1,837
41,321	Kingfisher Plc	BNP Paribas	4,318
14,041	Legal & General Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	1,626
10,141	Legal & General Group Plc	Barclays Bank	472
62,728	Legal & General Group Plc	BNP Paribas	7,265
6,785	Legal & General Group Plc	Citibank	316
7,699	Legal & General Group Plc	Goldam Sachs	892
2,077	Legal & General Group Plc	HSBC	688
6,971	Legal & General Group Plc	JP Morgan	2,308
(709)	London Stock Exchange Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2,624)
(5)	London Stock Exchange Group Plc	BNP Paribas	(19)
(3)	London Stock Exchange Group Plc	Citibank	(5)
6,707	M&G Plc	Citibank	68
3,806	M&G Plc	Goldam Sachs	187
(22,872)	Melrose Industries Plc	Barclays Bank	(3,945)
(31,901)	Melrose Industries Plc	Citibank	(5,502)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	英国(続き)		
(2,311)	Melrose Industries Plc	Goldam Sachs	(550)
1,191	Mondi Plc	Barclays Bank	600
1,121	Mondi Plc	BNP Paribas	85
1,071	Mondi Plc	HSBC	(276)
513	Mondi Plc	JP Morgan	(132)
(28,969)	National Grid Plc	BNP Paribas	22,064
(36,138)	Natwest Group Plc	Barclays Bank	(4,959)
(400)	Natwest Group Plc	BNP Paribas	(90)
(9,125)	Natwest Group Plc	Goldam Sachs	(2,045)
399	Next Plc	Citibank	1,617
181	Next Plc	Goldam Sachs	(178)
(3,400)	Ocado Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(4,760)
(978)	Ocado Group Plc	Barclays Bank	(1,716)
(10,778)	Ocado Group Plc	BNP Paribas	(15,088)
(1,829)	Ocado Group Plc	Goldam Sachs	(2,560)
(5,750)	Ocado Group Plc	HSBC	(10,950)
(1,076)	Pearson Plc	Bank of America Merrill Lynch	123
(1,060)	Pearson Plc	BNP Paribas	35
(1,126)	Pearson Plc	Goldam Sachs	37
81	Persimmon Plc	Barclays Bank	25
3,290	Persimmon Plc	BNP Paribas	2,717
553	Persimmon Plc	Citibank	171
774	Persimmon Plc	Goldam Sachs	639
347	Persimmon Plc	HSBC	605
227	Persimmon Plc	JP Morgan	396
(11,504)	Phoenix Group Holdings Plc	Barclays Bank	1,101
(31,371)	Phoenix Group Holdings Plc	BNP Paribas	(1,580)
(698)	Phoenix Group Holdings Plc	Citibank	67
(4,874)	Phoenix Group Holdings Plc	Goldam Sachs	(245)
(1,327)	Prudential Plc	Barclays Bank	(501)
(4,464)	Prudential Plc	Goldam Sachs	(4,574)
(1,414)	Reckitt Benckiser Group Plc	Goldam Sachs	5,945
(231)	Reckitt Benckiser Group Plc	HSBC	663
1,236	RELX Plc	Barclays Bank	(420)
802	RELX Plc	BNP Paribas	(343)
2,134	RELX Plc	Goldam Sachs	(913)
1,104	RELX Plc	HSBC	(347)
(1,738)	Rentokil Initial Plc	Barclays Bank	(243)
(7,322)	Rentokil Initial Plc	BNP Paribas	756
(2,948)	Rentokil Initial Plc	Citibank	(412)
(3,056)	Rentokil Initial Plc	Goldam Sachs	315
(2,863)	Rentokil Initial Plc	HSBC	368
(1,462)	Rentokil Initial Plc	JP Morgan	188
730	Rio Tinto Plc	BNP Paribas	4,328
210	Rio Tinto Plc	Citibank	656

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	英国(続き)		
362	Rio Tinto Plc	JP Morgan	2,525
(9,508)	Rolls-Royce Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	(390)
(56,999)	Rolls-Royce Holdings Plc	BNP Paribas	(4,298)
(54,233)	Rolls-Royce Holdings Plc	Goldam Sachs	(4,090)
(35,470)	Rolls-Royce Holdings Plc	HSBC	(3,648)
(620)	Rolls-Royce Holdings Plc	JP Morgan	(64)
1,526	Sage Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(292)
3,089	Sage Group Plc	Barclays Bank	(211)
9,780	Sage Group Plc	BNP Paribas	(1,509)
7,662	Sage Group Plc	Citibank	(752)
3,707	Sage Group Plc	Goldam Sachs	(709)
1,933	Sage Group Plc	HSBC	(151)
1,720	Sage Group Plc	JP Morgan	(134)
(327)	Schroders Plc	Goldam Sachs	(296)
(2,130)	Severn Trent Plc	BNP Paribas	5,175
(264)	Severn Trent Plc	Goldam Sachs	641
(1,610)	Smith & Nephew Plc	BNP Paribas	(91)
(527)	Smith & Nephew Plc	Citibank	(70)
(1,060)	Smith & Nephew Plc	Goldam Sachs	(60)
1,112	Smiths Group Plc	BNP Paribas	805
2,211	Smiths Group Plc	Goldam Sachs	1,600
2,306	Smiths Group Plc	HSBC	3,382
173	Spirax-Sarco Engineering Plc	BNP Paribas	410
(2,084)	SSE Plc	Barclays Bank	3,948
(11,531)	SSE Plc	BNP Paribas	14,952
(4,338)	SSE Plc	Goldam Sachs	5,625
(2,270)	St James ' s Place Plc	Barclays Bank	(914)
(869)	St James ' s Place Plc	Goldam Sachs	(498)
(395)	Standard Chartered Plc	Barclays Bank	(125)
(6,286)	Standard Chartered Plc	BNP Paribas	(3,134)
3,715	Standard Life Aberdeen Plc	Citibank	200
3,472	Standard Life Aberdeen Plc	Goldam Sachs	316
17,629	Standard Life Aberdeen Plc	HSBC	3,667
6,287	Taylor Wimpey Plc	Bank of America Merrill Lynch	290
10,699	Taylor Wimpey Plc	Barclays Bank	269
28,306	Taylor Wimpey Plc	BNP Paribas	1,586
24,622	Taylor Wimpey Plc	Citibank	620
1,126	Taylor Wimpey Plc	HSBC	133
12,437	Taylor Wimpey Plc	JP Morgan	1,464
(419)	Unilever Plc	BNP Paribas	(219)
(5,262)	Unilever Plc	HSBC	(9,654)
8,022	United Utilities Group Plc	BNP Paribas	(7,221)
4,278	United Utilities Group Plc	Goldam Sachs	(3,851)
(5,994)	Vodafone Group Plc	Citibank	(395)
(33,998)	Vodafone Group Plc	Goldam Sachs	(4,828)



保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
英国(続き)			
898	Whitbread Plc	Bank of America Merrill Lynch	(441)
1,453	Whitbread Plc	BNP Paribas	689
475	Whitbread Plc	Citibank	281
2,373	Whitbread Plc	Goldam Sachs	2,091
1,882	Whitbread Plc	HSBC	3,696
12,883	WPP Plc	BNP Paribas	(10,769)
			<u>53,721</u>
米国			
(175)	10X Genomics Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(945)
(122)	10X Genomics Inc 'A'	Barclays Bank	(237)
(67)	10X Genomics Inc 'A'	BNP Paribas	(362)
(407)	10X Genomics Inc 'A'	Goldam Sachs	(2,198)
(205)	10X Genomics Inc 'A'	HSBC	(882)
613	3M Co	Barclays Bank	1,410
256	3M Co	BNP Paribas	(978)
242	3M Co	Goldam Sachs	(924)
44	3M Co	HSBC	(251)
237	A O Smith Corp	Bank of America Merrill Lynch	199
542	A O Smith Corp	Barclays Bank	786
1,102	A O Smith Corp	BNP Paribas	926
184	A O Smith Corp	Citibank	267
363	A O Smith Corp	Goldam Sachs	305
1,157	A O Smith Corp	HSBC	35
192	Abbott Laboratories	HSBC	1,513
(123)	AbbVie Inc	Bank of America Merrill Lynch	970
(66)	AbbVie Inc	Barclays Bank	100
(83)	AbbVie Inc	BNP Paribas	137
(148)	AbbVie Inc	Citibank	182
(84)	AbbVie Inc	HSBC	284
538	ABIOMED Inc	Barclays Bank	5,751
37	ABIOMED Inc	BNP Paribas	226
90	ABIOMED Inc	Citibank	962
277	ABIOMED Inc	Goldam Sachs	1,695
347	Accenture Plc 'A'	Barclays Bank	5,823
129	Accenture Plc 'A'	BNP Paribas	1,806
116	Accenture Plc 'A'	Citibank	2,148
129	Accenture Plc 'A'	HSBC	2,355
307	Accenture Plc 'A'	JP Morgan	4,485
284	Adobe Inc	Bank of America Merrill Lynch	5,033
877	Adobe Inc	Barclays Bank	9,033
26	Adobe Inc	BNP Paribas	221
25	Adobe Inc	Goldam Sachs	375
42	Adobe Inc	HSBC	519
126	Advance Auto Parts Inc	Barclays Bank	937
101	Advance Auto Parts Inc	BNP Paribas	(2,324)

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	Advanced Micro Devices Inc	Barclays Bank	1,467
1,326	Advanced Micro Devices Inc	BNP Paribas	9,521
160	Advanced Micro Devices Inc	Goldam Sachs	1,149
62	Advanced Micro Devices Inc	HSBC	934
292	Advanced Micro Devices Inc	JP Morgan	4,398
(262)	AerCap Holdings NV	Bank of America Merrill Lynch	(747)
(199)	AerCap Holdings NV	Barclays Bank	(109)
(2,047)	AerCap Holdings NV	BNP Paribas	(5,834)
(512)	AerCap Holdings NV	Citibank	(282)
(203)	AerCap Holdings NV	Goldam Sachs	(579)
(413)	AerCap Holdings NV	HSBC	(2,664)
(2,482)	Affirm Holdings Inc	Barclays Bank	(12,733)
(1,303)	Affirm Holdings Inc	BNP Paribas	(8,730)
(366)	Aflac Inc	Barclays Bank	(1,171)
(595)	Aflac Inc	BNP Paribas	(2,106)
(431)	Aflac Inc	Citibank	(1,379)
(1,434)	Aflac Inc	Goldam Sachs	(5,076)
387	Agilent Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,421
1,169	Agilent Technologies Inc	Barclays Bank	3,694
122	Agilent Technologies Inc	BNP Paribas	1,078
1,073	Agilent Technologies Inc	Goldam Sachs	9,485
1,264	Agilent Technologies Inc	HSBC	20,262
(338)	Air Products & Chemicals Inc	BNP Paribas	(4,820)
(922)	Air Products & Chemicals Inc	Goldam Sachs	(13,148)
132	Airbnb Inc 'A'	Barclays Bank	657
568	Airbnb Inc 'A'	BNP Paribas	2,170
374	Airbnb Inc 'A'	Citibank	1,863
529	Airbnb Inc 'A'	Goldam Sachs	2,021
183	Airbnb Inc 'A'	HSBC	(203)
374	Airbnb Inc 'A'	JP Morgan	(432)
162	Akamai Technologies Inc	Barclays Bank	267
85	Akamai Technologies Inc	BNP Paribas	137
117	Akamai Technologies Inc	Citibank	193
84	Akamai Technologies Inc	HSBC	423
(225)	Albemarle Corp	Barclays Bank	(3,787)
(153)	Albemarle Corp	BNP Paribas	(5,118)
(54)	Albemarle Corp	Goldam Sachs	(1,806)
17	Align Technology Inc	BNP Paribas	60
173	Align Technology Inc	Goldam Sachs	606
(584)	Allegion Plc	BNP Paribas	228
(111)	Allegion Plc	Goldam Sachs	43
(1,004)	Allstate Corp	BNP Paribas	(7,731)
(389)	Allstate Corp	Citibank	(3,614)
(423)	Allstate Corp	Goldam Sachs	(3,257)
3,855	Ally Financial Inc	Barclays Bank	11,064

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
2,166	Ally Financial Inc	BNP Paribas	9,812
469	Ally Financial Inc	HSBC	1,248
(38)	Alnylam Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	211
(134)	Alnylam Pharmaceuticals Inc	BNP Paribas	113
67	Alphabet Inc 'A'	Barclays Bank	1,365
41	Alphabet Inc 'A'	HSBC	(4)
(7)	Amazon.com Inc	BNP Paribas	(1,263)
(30)	Amazon.com Inc	Goldam Sachs	(3,598)
(15)	Amazon.com Inc	HSBC	(2,376)
(3,020)	AMC Entertainment Holdings Inc 'A'	Barclays Bank	(8,547)
195	AMERCO	Barclays Bank	(4,368)
47	AMERCO	BNP Paribas	(1,377)
38	AMERCO	Goldam Sachs	(1,113)
19	AMERCO	HSBC	(695)
23	AMERCO	JP Morgan	(841)
93	American Express Co	Bank of America Merrill Lynch	1,574
53	American Express Co	Barclays Bank	542
66	American Express Co	BNP Paribas	45
66	American Express Co	Goldam Sachs	847
107	American Financial Group Inc	Barclays Bank	540
89	American Financial Group Inc	Citibank	449
86	American Financial Group Inc	Goldam Sachs	(570)
410	American Financial Group Inc	HSBC	(2,382)
171	American International Group Inc	Barclays Bank	280
352	American International Group Inc	BNP Paribas	(25)
991	American International Group Inc	Goldam Sachs	(69)
796	American Water Works Co Inc	BNP Paribas	2,484
105	Ameriprise Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,608
219	Ameriprise Financial Inc	BNP Paribas	3,353
148	Ameriprise Financial Inc	Goldam Sachs	2,266
357	Ameriprise Financial Inc	JP Morgan	5,794
143	AmerisourceBergen Corp	Goldam Sachs	832
(240)	AMETEK Inc	Bank of America Merrill Lynch	46
(135)	AMETEK Inc	Barclays Bank	(127)
(50)	AMETEK Inc	BNP Paribas	10
(122)	AMETEK Inc	Goldam Sachs	23
(105)	Amgen Inc	Bank of America Merrill Lynch	(557)
(119)	Amgen Inc	BNP Paribas	(888)
(291)	Amgen Inc	HSBC	(3,094)
(1,492)	Amphenol Corp 'A'	Barclays Bank	(1,582)
(3,146)	Amphenol Corp 'A'	BNP Paribas	(2,894)
(522)	Amphenol Corp 'A'	Citibank	(553)
(746)	Amphenol Corp 'A'	Goldam Sachs	(686)
(973)	Analog Devices Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,599)
(446)	Analog Devices Inc	Barclays Bank	(1,650)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(626)	Analog Devices Inc	BNP Paribas	(4,889)
(366)	Analog Devices Inc	Goldam Sachs	(2,858)
(28)	Analog Devices Inc	HSBC	(364)
226	ANSYS Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,007
156	ANSYS Inc	Barclays Bank	359
120	ANSYS Inc	BNP Paribas	1,066
93	ANSYS Inc	Citibank	214
117	ANSYS Inc	Goldam Sachs	1,039
41	ANSYS Inc	JP Morgan	310
(195)	Anthem Inc	Goldam Sachs	(4,618)
(91)	Anthem Inc	HSBC	(2,401)
(313)	Aon Plc 'A'	Barclays Bank	(2,883)
(73)	Aon Plc 'A'	BNP Paribas	155
(28)	Aon Plc 'A'	Citibank	(258)
(307)	Aon Plc 'A'	Goldam Sachs	654
1	Apartment Income Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	1
1	Apartment Investment and Management Co 'A' (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	-
(1,802)	Apollo Global Management Inc	Barclays Bank	(6,649)
(1,673)	Apollo Global Management Inc	BNP Paribas	(9,034)
(199)	Apollo Global Management Inc	Citibank	(734)
(249)	Apollo Global Management Inc	Goldam Sachs	(1,345)
503	Apple Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,747
20	Apple Inc	Barclays Bank	96
715	Apple Inc	BNP Paribas	1,695
99	Apple Inc	Citibank	475
1,002	Apple Inc	Goldam Sachs	2,375
354	Apple Inc	HSBC	(1,469)
35	Apple Inc	JP Morgan	(145)
173	Applied Materials Inc	Barclays Bank	1,227
464	Applied Materials Inc	BNP Paribas	3,787
3,067	Applied Materials Inc	Goldam Sachs	20,074
87	Applied Materials Inc	HSBC	981
153	Applied Materials Inc	JP Morgan	1,479
(506)	Aptiv Plc	BNP Paribas	(4,169)
(79)	Aptiv Plc	Goldam Sachs	(651)
(572)	Aramark	Bank of America Merrill Lynch	(378)
(2,134)	Aramark	Barclays Bank	(3,500)
(965)	Aramark	BNP Paribas	(637)
(269)	Aramark	Citibank	(441)
(333)	Aramark	HSBC	(7)
1,006	Arch Capital Group Ltd	BNP Paribas	946
3,692	Archer-Daniels- Midland Co	Barclays Bank	12,331
1,643	Arista Networks Inc	Barclays Bank	986
823	Arista Networks Inc	BNP Paribas	(1,728)
322	Arista Networks Inc	Goldam Sachs	(676)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
214	Arista Networks Inc	HSBC	(89)
(271)	Arrow Electronics Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,222
(88)	Arrow Electronics Inc	Goldam Sachs	397
(409)	Arthur J Gallagher & Co	Bank of America Merrill Lynch	(755)
(1,237)	Arthur J Gallagher & Co	Barclays Bank	(5,511)
(284)	Arthur J Gallagher & Co	BNP Paribas	(524)
(133)	Arthur J Gallagher & Co	Goldam Sachs	(245)
720	Asana Inc 'A'	BNP Paribas	(238)
150	Assurant Inc	Barclays Bank	80
315	Assurant Inc	Citibank	167
117	Assurant Inc	Goldam Sachs	(171)
(3,366)	AT&T Inc	BNP Paribas	(3,147)
(1,830)	AT&T Inc	Goldam Sachs	(1,711)
(773)	Atmos Energy Corp	Barclays Bank	(1,739)
(90)	Atmos Energy Corp	BNP Paribas	(248)
1,160	Autodesk Inc	Barclays Bank	26,309
313	Autodesk Inc	BNP Paribas	4,260
52	Autodesk Inc	HSBC	1,033
305	Autodesk Inc	JP Morgan	6,060
176	Automatic Data Processing Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,520
54	Automatic Data Processing Inc	Barclays Bank	538
150	Automatic Data Processing Inc	BNP Paribas	2,148
336	Automatic Data Processing Inc	Goldam Sachs	4,812
47	Automatic Data Processing Inc	JP Morgan	455
6	AutoZone Inc	BNP Paribas	277
16	AutoZone Inc	Goldam Sachs	738
(996)	Avalara Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,337)
(1,602)	Avalara Inc	Barclays Bank	(6,120)
(507)	Avalara Inc	Goldam Sachs	(4,244)
(991)	Avantor Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,566)
(903)	Avantor Inc	Barclays Bank	(623)
(2,614)	Avantor Inc	BNP Paribas	(4,130)
(302)	Avantor Inc	Goldam Sachs	(477)
1,537	Avery Dennison Corp	Barclays Bank	5,994
704	Avery Dennison Corp	Goldam Sachs	(2,020)
1,527	Baker Hughes Co	Goldam Sachs	3,543
3,275	Baker Hughes Co	HSBC	23,580
(536)	Ball Corp	BNP Paribas	182
(626)	Ball Corp	Goldam Sachs	213
789	Bank of America Corp	Goldam Sachs	1,878
230	Bank of New York Mellon Corp	Bank of America Merrill Lynch	662
259	Bank of New York Mellon Corp	Barclays Bank	373
700	Bank of New York Mellon Corp	BNP Paribas	2,016
687	Bank of New York Mellon Corp	Citibank	989
821	Bank of New York Mellon Corp	JP Morgan	2,389

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(17,184)	Bank OZK	JP Morgan	(24,917)
(352)	Baxter International Inc	BNP Paribas	(641)
(1,538)	Baxter International Inc	Citibank	(3,291)
(663)	Baxter International Inc	Goldam Sachs	(1,207)
(203)	Becton Dickinson and Co	Bank of America Merrill Lynch	(4)
(809)	Becton Dickinson and Co	BNP Paribas	(16)
(583)	Becton Dickinson and Co	Citibank	2,384
(297)	Becton Dickinson and Co	Goldam Sachs	(6)
(813)	Bentley Systems Inc 'B'	Barclays Bank	(1,415)
(2,774)	Bentley Systems Inc 'B'	BNP Paribas	(7,240)
(352)	Bentley Systems Inc 'B'	Goldam Sachs	(919)
(252)	Berkshire Hathaway Inc 'B'	BNP Paribas	(1,686)
(42)	Berkshire Hathaway Inc 'B'	Goldam Sachs	(281)
(22)	Berkshire Hathaway Inc 'B'	JP Morgan	(66)
127	Best Buy Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(279)
228	Best Buy Co Inc	Barclays Bank	2,275
316	Best Buy Co Inc	BNP Paribas	(695)
144	Best Buy Co Inc	Citibank	1,437
204	Best Buy Co Inc	Goldam Sachs	2,399
(423)	Bill.com Holdings Inc	BNP Paribas	(4,890)
70	Biogen Inc	Bank of America Merrill Lynch	270
37	Biogen Inc	Barclays Bank	105
69	Biogen Inc	BNP Paribas	266
100	Biogen Inc	Citibank	284
216	Biogen Inc	Goldam Sachs	834
43	Biogen Inc	JP Morgan	632
(134)	BioMarin Pharmaceutical Inc	Barclays Bank	470
(347)	BioMarin Pharmaceutical Inc	BNP Paribas	463
(206)	BioMarin Pharmaceutical Inc	Citibank	723
(1,593)	BioMarin Pharmaceutical Inc	Goldam Sachs	749
(260)	Bio-Rad Laboratories Inc 'A'	Barclays Bank	(2,636)
(82)	Bio-Rad Laboratories Inc 'A'	BNP Paribas	(2,608)
(57)	Bio-Rad Laboratories Inc 'A'	Goldam Sachs	(1,813)
(34)	Bio-Techne Corp	Bank of America Merrill Lynch	(483)
(85)	Bio-Techne Corp	Barclays Bank	(1,005)
(121)	Bio-Techne Corp	BNP Paribas	(1,718)
(40)	Bio-Techne Corp	Goldam Sachs	(568)
(85)	Blackstone Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,116)
(178)	Blackstone Group Inc 'A'	BNP Paribas	(2,337)
(254)	Blackstone Group Inc 'A'	Goldam Sachs	(3,335)
(258)	Block Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,077)
(553)	Block Inc	Barclays Bank	(2,406)
(814)	Block Inc	BNP Paribas	(6,553)
(48)	Block Inc	Citibank	(209)
(391)	Block Inc	Goldam Sachs	(3,148)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(412)	Block Inc	HSBC	(1,603)
9	Booking Holdings Inc	BNP Paribas	(276)
8	Booking Holdings Inc	Goldam Sachs	1,204
14	Booking Holdings Inc	JP Morgan	2,792
138	Booz Allen Hamilton Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	426
277	Booz Allen Hamilton Holding Corp	BNP Paribas	856
186	Booz Allen Hamilton Holding Corp	Goldam Sachs	575
420	Booz Allen Hamilton Holding Corp	JP Morgan	1,638
256	BorgWarner Inc	Bank of America Merrill Lynch	563
824	BorgWarner Inc	HSBC	2,332
(4,192)	Boston Scientific Corp	Barclays Bank	(4,695)
(1,364)	Boston Scientific Corp	BNP Paribas	(1,623)
(213)	Boston Scientific Corp	HSBC	(579)
(165)	Bristol-Myers Squibb Co	Barclays Bank	411
(824)	Bristol-Myers Squibb Co	BNP Paribas	2,225
(777)	Bristol-Myers Squibb Co	Goldam Sachs	2,098
(367)	Broadcom Inc	Barclays Bank	(19,425)
(256)	Broadcom Inc	BNP Paribas	(743)
(226)	Broadcom Inc	Goldam Sachs	764
161	Broadridge Financial Solutions Inc	BNP Paribas	1,055
90	Broadridge Financial Solutions Inc	Goldam Sachs	590
(413)	Brown & Brown Inc	Bank of America Merrill Lynch	(578)
(1,366)	Brown & Brown Inc	Barclays Bank	(3,948)
(2,168)	Brown & Brown Inc	BNP Paribas	(3,035)
(314)	Brown & Brown Inc	Citibank	(907)
(101)	Brown & Brown Inc	Goldam Sachs	(141)
(202)	Brown & Brown Inc	HSBC	(461)
(730)	Brown-Forman Corp ' B '	BNP Paribas	942
912	Bunge Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4,241
504	Bunge Ltd	BNP Paribas	2,344
1,146	Bunge Ltd	Goldam Sachs	5,329
(480)	Burlington Stores Inc	Barclays Bank	(4,522)
(93)	Burlington Stores Inc	BNP Paribas	706
(235)	Burlington Stores Inc	Goldam Sachs	1,784
(24)	Cable One Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,872)
(35)	Cable One Inc	Barclays Bank	(2,410)
(24)	Cable One Inc	BNP Paribas	(3,872)
(13)	Cable One Inc	Goldam Sachs	(2,097)
(10)	Cable One Inc	HSBC	(1,745)
171	Cadence Design Systems Inc	Barclays Bank	941
5,620	Cadence Design Systems Inc	Citibank	30,910
391	Cadence Design Systems Inc	HSBC	6,467
3	Cadence Design Systems Inc	JP Morgan	48
(916)	Caesars Entertainment Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,292
(260)	Caesars Entertainment Inc	Barclays Bank	(606)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(2,699)	Caesars Entertainment Inc	BNP Paribas	3,806
(986)	Caesars Entertainment Inc	Goldam Sachs	1,390
(369)	Caesars Entertainment Inc	HSBC	875
(4,550)	Campbell Soup Co	BNP Paribas	15,743
(138)	Campbell Soup Co	Citibank	(144)
(3,989)	Campbell Soup Co	Goldam Sachs	13,802
871	Capital One Financial Corp	Barclays Bank	7,282
112	Capital One Financial Corp	BNP Paribas	1,477
1,591	Cardinal Health Inc	BNP Paribas	175
247	Carlyle Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	264
886	Carlyle Group Inc	Barclays Bank	1,728
1,014	Carlyle Group Inc	BNP Paribas	1,085
170	Carlyle Group Inc	JP Morgan	529
(19)	CarMax Inc	Bank of America Merrill Lynch	(100)
(1,607)	CarMax Inc	Barclays Bank	(11,265)
(582)	CarMax Inc	BNP Paribas	(3,050)
(303)	CarMax Inc	Citibank	(2,124)
(785)	CarMax Inc	Goldam Sachs	(4,113)
(271)	CarMax Inc	HSBC	(1,379)
(2,113)	Carnival Corp	Barclays Bank	(1,944)
(13,499)	Carnival Corp	BNP Paribas	810
(10,496)	Carnival Corp	Goldam Sachs	(3,986)
1,069	Carrier Global Corp	BNP Paribas	(941)
(2,176)	Carvana Co	Barclays Bank	(2,773)
(2,035)	Carvana Co	BNP Paribas	13,940
(626)	Carvana Co	Goldam Sachs	2,010
(287)	Carvana Co	HSBC	2,072
(1,723)	Catalent Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,839)
(178)	Catalent Inc	Goldam Sachs	(913)
(269)	Caterpillar Inc	Goldam Sachs	(2,617)
161	Cboe Global Markets Inc	Bank of America Merrill Lynch	340
88	Cboe Global Markets Inc	Barclays Bank	330
79	Cboe Global Markets Inc	HSBC	332
230	Cboe Global Markets Inc	JP Morgan	966
441	CBRE Group Inc 'A'	Barclays Bank	1,261
476	CBRE Group Inc 'A'	BNP Paribas	1,571
2	CBRE Group Inc 'A'	Citibank	6
506	CBRE Group Inc 'A'	Goldam Sachs	1,670
756	CBRE Group Inc 'A'	HSBC	2,737
231	CBRE Group Inc 'A'	JP Morgan	836
75	CDW Corp	Barclays Bank	563
238	CDW Corp	BNP Paribas	(99)
505	CDW Corp	Goldam Sachs	(210)
(1,090)	Centene Corp	BNP Paribas	1,177
(76)	Centene Corp	Goldam Sachs	82



保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(2,282)	Ceridian HCM Holding Inc	Barclays Bank	(1,940)
(4,373)	Ceridian HCM Holding Inc	HSBC	(19,722)
(405)	CF Industries Holdings Inc	Goldam Sachs	2,770
(71)	CF Industries Holdings Inc	HSBC	(660)
(114)	CH Robinson Worldwide Inc	Bank of America Merrill Lynch	119
(103)	CH Robinson Worldwide Inc	BNP Paribas	107
(324)	CH Robinson Worldwide Inc	HSBC	690
(126)	Charles River Laboratories International Inc	Barclays Bank	(879)
(168)	Charles River Laboratories International Inc	BNP Paribas	(1,179)
(50)	Charles River Laboratories International Inc	HSBC	(469)
(1,675)	Charles Schwab Corp	Goldam Sachs	(10,435)
(69)	Charter Communications Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(2,989)
(136)	Charter Communications Inc 'A'	Barclays Bank	(4,487)
(105)	Charter Communications Inc 'A'	BNP Paribas	(4,549)
(116)	Charter Communications Inc 'A'	Citibank	(3,827)
(138)	Charter Communications Inc 'A'	Goldam Sachs	(5,978)
(17)	Charter Communications Inc 'A'	HSBC	(731)
(174)	Check Point Software Technologies Ltd	BNP Paribas	(482)
(117)	Check Point Software Technologies Ltd	Goldam Sachs	(324)
(995)	Cheniere Energy Inc	Goldam Sachs	(2,935)
(290)	Chevron Corp	BNP Paribas	(2,126)
(138)	Chevron Corp	Citibank	(1,190)
(250)	Chevron Corp	Goldam Sachs	(1,833)
(509)	Chevron Corp	HSBC	(10,735)
(1,206)	Chewy Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	302
(1,366)	Chewy Inc 'A'	Barclays Bank	(1,940)
(1,130)	Chewy Inc 'A'	BNP Paribas	283
(1,661)	Chewy Inc 'A'	Citibank	(2,359)
20	Chipotle Mexican Grill Inc	Barclays Bank	2,023
26	Chipotle Mexican Grill Inc	BNP Paribas	2,389
11	Chipotle Mexican Grill Inc	Citibank	1,113
19	Chipotle Mexican Grill Inc	Goldam Sachs	1,746
(1,885)	Church & Dwight Co Inc	Barclays Bank	1,093
(1,347)	Church & Dwight Co Inc	Goldam Sachs	13,160
194	Cigna Corp	Bank of America Merrill Lynch	735
121	Cigna Corp	Goldam Sachs	459
(845)	Cincinnati Financial Corp	HSBC	(1,251)
(85)	Cintas Corp	Goldam Sachs	(1,360)
(1,513)	Cisco Systems Inc	HSBC	(2,295)
882	Citigroup Inc	BNP Paribas	5,389
570	Citigroup Inc	Goldam Sachs	3,483
(1,559)	Citizens Financial Group Inc	BNP Paribas	(4,163)
(544)	Clarivate Plc	Barclays Bank	-
(1,879)	Clarivate Plc	BNP Paribas	(714)
(7,587)	Clarivate Plc	Goldam Sachs	(2,883)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(424)	Clarivate Plc	HSBC	(72)
(20)	Clorox Co	BNP Paribas	235
(1,663)	Clorox Co	Goldam Sachs	19,507
(36)	Cloudflare Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	35
(652)	Cloudflare Inc 'A'	Barclays Bank	241
(247)	Cloudflare Inc 'A'	BNP Paribas	242
(559)	Cloudflare Inc 'A'	Goldam Sachs	548
(1)	Cloudflare Inc 'A'	HSBC	-
(35)	CME Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(77)
(606)	CME Group Inc	Citibank	(4,109)
268	Coca-Cola Co	BNP Paribas	(748)
262	Coca-Cola Co	Goldam Sachs	(731)
497	Coca-Cola Co	HSBC	(716)
355	Coca-Cola Europacific Partners Plc	Barclays Bank	(202)
779	Coca-Cola Europacific Partners Plc	Citibank	(444)
161	Coca-Cola Europacific Partners Plc	JP Morgan	705
425	Cognex Corp	Bank of America Merrill Lynch	(26)
1,119	Cognex Corp	BNP Paribas	(67)
129	Cognex Corp	Goldam Sachs	(8)
1,640	Cognizant Technology Solutions Corp 'A'	BNP Paribas	2,444
(56)	Coinbase Global Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(946)
(214)	Coinbase Global Inc 'A'	Barclays Bank	(2,673)
(671)	Coinbase Global Inc 'A'	BNP Paribas	(11,333)
(461)	Coinbase Global Inc 'A'	Citibank	(5,758)
(694)	Coinbase Global Inc 'A'	Goldam Sachs	(11,722)
(232)	Colgate-Palmolive Co	Bank of America Merrill Lynch	(760)
757	Comcast Corp 'A'	Barclays Bank	689
211	Comcast Corp 'A'	Citibank	192
250	Comcast Corp 'A'	HSBC	1,008
(1,075)	Conagra Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,462
(4,734)	Conagra Brands Inc	BNP Paribas	15,243
(287)	Conagra Brands Inc	Citibank	(23)
(1,169)	Conagra Brands Inc	Goldam Sachs	3,764
(731)	Conagra Brands Inc	HSBC	2,829
1,061	ConocoPhillips	BNP Paribas	12,117
2,002	ConocoPhillips	Goldam Sachs	22,863
(14,613)	ConocoPhillips	JP Morgan	(288,168)
231	Consolidated Edison Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,042
232	Consolidated Edison Inc	Barclays Bank	434
858	Consolidated Edison Inc	BNP Paribas	3,870
222	Consolidated Edison Inc	Citibank	415
1,274	Consolidated Edison Inc	Goldam Sachs	5,746
194	Consolidated Edison Inc	HSBC	1,003
171	Consolidated Edison Inc	JP Morgan	884
(607)	Constellation Brands Inc 'A'	BNP Paribas	3,721

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(317)	Constellation Brands Inc 'A'	Goldam Sachs	1,943
(604)	Constellation Energy Corp	Goldam Sachs	(3,890)
(40)	Cooper Cos Inc	Barclays Bank	(417)
(375)	Cooper Cos Inc	BNP Paribas	(7,965)
(27)	Cooper Cos Inc	Citibank	(282)
(32)	Cooper Cos Inc	Goldam Sachs	(680)
290	Copart Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,076
1,187	Copart Inc	Barclays Bank	4,071
859	Copart Inc	BNP Paribas	3,187
1,032	Copart Inc	Goldam Sachs	3,829
575	Copart Inc	HSBC	3,007
71	Copart Inc	JP Morgan	371
(979)	Corning Inc	Barclays Bank	(1,576)
(799)	Corning Inc	BNP Paribas	(136)
(1,463)	Corning Inc	Citibank	(2,355)
573	Corteva Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,902
4,089	Corteva Inc	Barclays Bank	9,977
644	Corteva Inc	BNP Paribas	4,386
348	Corteva Inc	JP Morgan	3,574
(777)	CoStar Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,155)
(282)	CoStar Group Inc	Barclays Bank	(905)
(2,215)	CoStar Group Inc	BNP Paribas	(8,993)
(20)	CoStar Group Inc	Citibank	(64)
(1,235)	CoStar Group Inc	Goldam Sachs	(5,014)
(1,933)	Coterra Energy Inc	BNP Paribas	(9,646)
(1,269)	Coupa Software Inc	Barclays Bank	723
(127)	Coupa Software Inc	BNP Paribas	(163)
(347)	Coupa Software Inc	Goldam Sachs	(444)
(91)	Crown Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11)
(193)	Crown Holdings Inc	Barclays Bank	(647)
(527)	Crown Holdings Inc	BNP Paribas	(63)
(657)	Crown Holdings Inc	Goldam Sachs	(79)
(80)	Crown Holdings Inc	HSBC	(302)
3,513	CSX Corp	BNP Paribas	(4,988)
36	Cummins Inc	Bank of America Merrill Lynch	162
251	Cummins Inc	Barclays Bank	2,118
1,296	Cummins Inc	BNP Paribas	5,819
331	Cummins Inc	Goldam Sachs	1,486
460	CVS Health Corp	Barclays Bank	768
486	CVS Health Corp	BNP Paribas	(637)
936	CVS Health Corp	Goldam Sachs	(1,226)
(631)	CyberArk Software Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(6,367)
(83)	Danaher Corp	BNP Paribas	(1,296)
(868)	Danaher Corp	Goldam Sachs	(13,558)
766	Darden Restaurants Inc	Barclays Bank	6,166

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
420	Darden Restaurants Inc	BNP Paribas	(806)
(224)	DaVita Inc	Bank of America Merrill Lynch	661
(122)	DaVita Inc	Barclays Bank	(329)
(677)	DaVita Inc	BNP Paribas	1,997
(98)	DaVita Inc	Goldam Sachs	289
(210)	DaVita Inc	HSBC	1,537
27	Deere & Co	HSBC	(378)
(171)	Dell Technologies Inc 'C'	Barclays Bank	(1,289)
(719)	Dell Technologies Inc 'C'	BNP Paribas	(2,682)
(99)	Dell Technologies Inc 'C'	Citibank	(746)
(180)	Dell Technologies Inc 'C'	Goldam Sachs	(671)
(799)	DENTSPLY SIRONA Inc	Barclays Bank	(767)
(803)	DENTSPLY SIRONA Inc	BNP Paribas	(964)
(301)	DENTSPLY SIRONA Inc	Goldam Sachs	(361)
1,058	Devon Energy Corp	BNP Paribas	7,194
304	Devon Energy Corp	Goldam Sachs	2,067
32	Dexcom Inc	Bank of America Merrill Lynch	(238)
116	Dexcom Inc	Barclays Bank	(783)
120	Dexcom Inc	BNP Paribas	(892)
20	Dexcom Inc	Citibank	(135)
205	Dexcom Inc	Goldam Sachs	(1,523)
137	Dexcom Inc	HSBC	(1,145)
8	Dexcom Inc	JP Morgan	(103)
168	Diamondback Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,465
81	Diamondback Energy Inc	Barclays Bank	1,763
319	Diamondback Energy Inc	BNP Paribas	8,191
138	Diamondback Energy Inc	Goldam Sachs	3,668
87	Diamondback Energy Inc	HSBC	2,428
(166)	Discover Financial Services	Barclays Bank	(676)
(52)	Discover Financial Services	Goldam Sachs	(477)
(11)	Discover Financial Services	HSBC	(54)
(605)	Discovery Inc	Barclays Bank	42
(4,024)	Discovery Inc	BNP Paribas	(4,064)
(844)	Discovery Inc	Citibank	59
(915)	Discovery Inc	Goldam Sachs	(924)
(914)	DISH Network Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,910)
(4,329)	DISH Network Corp 'A'	Barclays Bank	(8,312)
(1,779)	DISH Network Corp 'A'	BNP Paribas	(3,718)
(277)	DISH Network Corp 'A'	Citibank	(532)
(696)	DISH Network Corp 'A'	HSBC	(891)
242	DocuSign Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,301
318	DocuSign Inc	Barclays Bank	1,822
597	DocuSign Inc	BNP Paribas	5,677
119	DocuSign Inc	Citibank	682
117	DocuSign Inc	JP Morgan	1,798

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(25)	Dollar General Corp	Barclays Bank	(683)
(166)	Dollar General Corp	BNP Paribas	2,063
(350)	Dollar General Corp	Goldam Sachs	4,351
(124)	Dollar General Corp	HSBC	1,194
(169)	Dollar Tree Inc	Barclays Bank	(5,594)
(629)	Dollar Tree Inc	Goldam Sachs	(1,032)
(13)	Dollar Tree Inc	HSBC	(20)
305	Domino's Pizza Inc	Barclays Bank	5,941
21	Domino's Pizza Inc	BNP Paribas	547
6	Domino's Pizza Inc	Goldam Sachs	156
(402)	DoorDash Inc 'A'	BNP Paribas	(4,892)
(50)	DoorDash Inc 'A'	Citibank	(508)
2,081	Dover Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,415)
717	Dow Inc	BNP Paribas	380
260	Dow Inc	Citibank	265
407	Dow Inc	JP Morgan	(283)
330	DR Horton Inc	Barclays Bank	2,026
306	DR Horton Inc	BNP Paribas	1,594
175	DR Horton Inc	Citibank	1,075
132	DR Horton Inc	JP Morgan	482
(3,689)	DraftKings Inc 'A'	BNP Paribas	2,786
(1,174)	DraftKings Inc 'A'	BNP Paribas	2,430
(393)	DraftKings Inc 'A'	Citibank	12
(3,063)	DraftKings Inc 'A'	Goldam Sachs	(4,380)
2,905	Dropbox Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1,685
6,723	Dropbox Inc 'A'	Barclays Bank	2,756
9,450	Dropbox Inc 'A'	BNP Paribas	5,481
10,687	Dropbox Inc 'A'	Goldam Sachs	6,198
2,923	Dropbox Inc 'A'	HSBC	1,082
802	Dropbox Inc 'A'	JP Morgan	297
112	DuPont de Nemours Inc	Bank of America Merrill Lynch	503
1,143	DuPont de Nemours Inc	BNP Paribas	3,342
487	DuPont de Nemours Inc	Citibank	1,193
86	DuPont de Nemours Inc	JP Morgan	309
347	Eaton Corp Plc	JP Morgan	(3,678)
2,491	eBay Inc	BNP Paribas	6,850
1,340	eBay Inc	Goldam Sachs	3,685
2,304	eBay Inc	HSBC	(3,272)
186	eBay Inc	JP Morgan	(264)
95	Ecolab Inc	Goldam Sachs	297
939	Edison International	Barclays Bank	2,601
362	Edwards Lifesciences Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,430
2,653	Edwards Lifesciences Corp	Barclays Bank	9,977
1,107	Edwards Lifesciences Corp	BNP Paribas	4,154
2,950	Edwards Lifesciences Corp	Goldam Sachs	11,653

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
29	Edwards Lifesciences Corp	HSBC	199
382	Edwards Lifesciences Corp	JP Morgan	2,170
(3,264)	Elanco Animal Health Inc	Barclays Bank	(947)
(813)	Elanco Animal Health Inc	Goldam Sachs	(545)
969	Electronic Arts Inc	BNP Paribas	5,402
218	Electronic Arts Inc	Goldam Sachs	2,235
241	Electronic Arts Inc	HSBC	6,170
411	Eli Lilly & Co	BNP Paribas	5,421
186	Eli Lilly & Co	Goldam Sachs	2,453
1,484	Emerson Electric Co	BNP Paribas	4,630
(240)	Enphase Energy Inc	Goldam Sachs	(8,671)
(4)	Entegris Inc	Barclays Bank	(18)
(1,714)	Entegris Inc	BNP Paribas	(7,147)
(79)	Entegris Inc	Goldam Sachs	(329)
295	Entergy Corp	BNP Paribas	519
126	Entergy Corp	Goldam Sachs	222
129	Entergy Corp	HSBC	37
499	EOG Resources Inc	Barclays Bank	5,943
36	EOG Resources Inc	BNP Paribas	490
4	EOG Resources Inc	Goldam Sachs	54
190	EOG Resources Inc	JP Morgan	4,188
(35)	EPAM Systems Inc	Goldam Sachs	(446)
162	Equifax Inc	BNP Paribas	804
76	Equifax Inc	Goldam Sachs	377
1,063	Equitable Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,955
416	Equitable Holdings Inc	Barclays Bank	666
4,849	Equitable Holdings Inc	BNP Paribas	13,480
509	Equitable Holdings Inc	Citibank	814
1,822	Equitable Holdings Inc	Goldam Sachs	5,065
2,469	Equitable Holdings Inc	HSBC	5,111
(744)	Erie Indemnity Co 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(2,306)
(900)	Erie Indemnity Co 'A'	Barclays Bank	(3,240)
(365)	Erie Indemnity Co 'A'	Goldam Sachs	(1,132)
(4,097)	Essential Utilities Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,639)
(474)	Essential Utilities Inc	Barclays Bank	90
38	Estee Lauder Cos Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	754
122	Estee Lauder Cos Inc 'A'	Barclays Bank	2,272
317	Estee Lauder Cos Inc 'A'	BNP Paribas	6,289
160	Estee Lauder Cos Inc 'A'	Citibank	2,979
366	Estee Lauder Cos Inc 'A'	Goldam Sachs	7,261
59	Estee Lauder Cos Inc 'A'	JP Morgan	1,277
(47)	Etsy Inc	Barclays Bank	(280)
(111)	Etsy Inc	BNP Paribas	511
(258)	Etsy Inc	Goldam Sachs	1,187
(219)	Etsy Inc	HSBC	906

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
85	Everest Re Group Ltd	Barclays Bank	643
20	Everest Re Group Ltd	BNP Paribas	(8)
413	Eversource Energy	Bank of America Merrill Lynch	1,222
864	Eversource Energy	Barclays Bank	812
1,818	Eversource Energy	BNP Paribas	5,381
694	Eversource Energy	Citibank	652
463	Eversource Energy	Goldam Sachs	1,370
450	Eversource Energy	HSBC	761
164	Eversource Energy	JP Morgan	277
(2,822)	Exact Sciences Corp	Barclays Bank	1,637
(306)	Exact Sciences Corp	BNP Paribas	(266)
(1,651)	Exact Sciences Corp	Goldam Sachs	(1,436)
1,254	Exelon Corp	BNP Paribas	2,859
146	Expedia Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	656
447	Expedia Group Inc	Barclays Bank	2,999
78	Expedia Group Inc	BNP Paribas	350
548	Expedia Group Inc	Goldam Sachs	2,461
241	Expedia Group Inc	HSBC	133
5,509	Expeditors International of Washington Inc	JP Morgan	(10,577)
(126)	Exxon Mobil Corp	Bank of America Merrill Lynch	(933)
(271)	Exxon Mobil Corp	Barclays Bank	(1,401)
(78)	Exxon Mobil Corp	BNP Paribas	(633)
(238)	Exxon Mobil Corp	Goldam Sachs	(1,930)
(237)	Exxon Mobil Corp	HSBC	(3,460)
(289)	F5 Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,130
(219)	F5 Inc	Barclays Bank	(1,053)
(351)	F5 Inc	BNP Paribas	1,372
(61)	F5 Inc	Goldam Sachs	239
(104)	F5 Inc	HSBC	337
43	FactSet Research Systems Inc	Barclays Bank	444
251	FactSet Research Systems Inc	BNP Paribas	2,535
120	FactSet Research Systems Inc	Goldam Sachs	1,212
9	FactSet Research Systems Inc	HSBC	168
62	FactSet Research Systems Inc	JP Morgan	1,160
28	Fair Isaac Corp	Barclays Bank	52
4	Fair Isaac Corp	BNP Paribas	145
278	Fair Isaac Corp	Goldam Sachs	10,055
1,000	Fastenal Co	BNP Paribas	370
484	Fastenal Co	Citibank	557
346	FedEx Corp	Barclays Bank	5,238
276	FedEx Corp	BNP Paribas	2,790
100	FedEx Corp	Goldam Sachs	1,011
(462)	Fidelity National Information Services Inc	BNP Paribas	(3,710)
(1)	Fidelity National Information Services Inc	Goldam Sachs	(8)
(182)	Fidelity National Information Services Inc	HSBC	(1,782)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(751)	Fifth Third Bancorp	BNP Paribas	(2,478)
(215)	Fifth Third Bancorp	Citibank	(469)
(364)	First Citizens BancShares Inc 'A'	BNP Paribas	(15,117)
(11)	First Citizens BancShares Inc 'A'	Goldam Sachs	(457)
(11)	First Citizens BancShares Inc 'A'	HSBC	(505)
99	First Republic Bank	Bank of America Merrill Lynch	1,670
465	First Republic Bank	Barclays Bank	3,171
391	First Republic Bank	BNP Paribas	6,596
74	First Republic Bank	Goldam Sachs	1,248
59	First Republic Bank	HSBC	680
(3,346)	Fiserv Inc	Barclays Bank	(5,153)
(333)	Fiserv Inc	BNP Paribas	(1,372)
(265)	FleetCor Technologies Inc	Barclays Bank	(2,337)
(370)	FleetCor Technologies Inc	BNP Paribas	(7,629)
(65)	FleetCor Technologies Inc	Citibank	(573)
(216)	FleetCor Technologies Inc	Goldam Sachs	(4,454)
(80)	FleetCor Technologies Inc	HSBC	(2,478)
(79)	FleetCor Technologies Inc	JP Morgan	(2,447)
9	FMC Corp	Bank of America Merrill Lynch	60
680	FMC Corp	Barclays Bank	88
196	FMC Corp	BNP Paribas	1,298
316	FMC Corp	Goldam Sachs	2,092
(4,481)	Ford Motor Co	BNP Paribas	(1,837)
(4,663)	Ford Motor Co	Goldam Sachs	(1,912)
(541)	Ford Motor Co	HSBC	(49)
674	Fortinet Inc	Bank of America Merrill Lynch	11,283
263	Fortinet Inc	BNP Paribas	4,403
8	Fortinet Inc	Goldam Sachs	134
2,466	Fortive Corp	BNP Paribas	7,102
304	Fortive Corp	Goldam Sachs	876
124	Fortive Corp	HSBC	219
1,357	Fortune Brands Home & Security Inc	Barclays Bank	2,130
360	Fortune Brands Home & Security Inc	BNP Paribas	144
(1,663)	Fox Corp 'A'	BNP Paribas	(2,844)
(89)	Fox Corp 'A'	Goldam Sachs	(152)
389	Franklin Resources Inc	Barclays Bank	521
613	Franklin Resources Inc	BNP Paribas	1,477
654	Franklin Resources Inc	Goldam Sachs	1,576
(1,154)	Futu Holdings Ltd ADR	Barclays Bank	(2,493)
(1,114)	Futu Holdings Ltd ADR	BNP Paribas	(5,793)
(112)	Futu Holdings Ltd ADR	HSBC	(913)
711	Garmin Ltd	Barclays Bank	2,019
724	Garmin Ltd	BNP Paribas	2,129
1,660	Garmin Ltd	Goldam Sachs	4,880
(34)	Gartner Inc	Goldam Sachs	(295)



保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(184)	Gartner Inc	HSBC	(4,195)
(100)	Generac Holdings Inc	Barclays Bank	(1,685)
(32)	Generac Holdings Inc	BNP Paribas	(886)
(202)	Generac Holdings Inc	Goldam Sachs	(5,591)
(1,288)	General Electric Co	BNP Paribas	(5,397)
37	General Mills Inc	Bank of America Merrill Lynch	(165)
760	General Mills Inc	HSBC	(3,420)
268	General Motors Co	Barclays Bank	611
518	General Motors Co	Goldam Sachs	611
513	General Motors Co	HSBC	(54)
360	Genuine Parts Co	Bank of America Merrill Lynch	238
68	Genuine Parts Co	Barclays Bank	496
119	Genuine Parts Co	Citibank	868
1,877	Genuine Parts Co	Goldam Sachs	1,239
409	Genuine Parts Co	HSBC	2,041
201	Genuine Parts Co	JP Morgan	1,003
2,170	Gilead Sciences Inc	BNP Paribas	3,167
165	Gilead Sciences Inc	Citibank	40
282	Gilead Sciences Inc	Goldam Sachs	(211)
998	Gilead Sciences Inc	HSBC	1,850
(772)	Global Payments Inc	Barclays Bank	(4,238)
(316)	Global Payments Inc	Goldam Sachs	(3,340)
822	GoDaddy Inc 'A'	Barclays Bank	2,302
(7,646)	Grab Holdings Ltd 'A'	Barclays Bank	1,682
(536)	Guidewire Software Inc	Barclays Bank	(1,415)
452	Halliburton Co	BNP Paribas	2,500
759	Halliburton Co	Goldam Sachs	2,998
264	Halliburton Co	HSBC	1,398
73	Hartford Financial Services Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	194
13	Hartford Financial Services Group Inc	Barclays Bank	43
1,522	Hartford Financial Services Group Inc	BNP Paribas	4,049
200	Hartford Financial Services Group Inc	Goldam Sachs	532
524	Hartford Financial Services Group Inc	HSBC	587
(942)	Hasbro Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,815
(364)	HCA Healthcare Inc	BNP Paribas	(692)
(320)	HCA Healthcare Inc	Citibank	(2,720)
(107)	HCA Healthcare Inc	Goldam Sachs	(835)
(551)	HCA Healthcare Inc	HSBC	5,819
(590)	HEICO Corp	BNP Paribas	(3,752)
(1,066)	HEICO Corp	Goldam Sachs	(6,780)
(170)	Henry Schein Inc	Bank of America Merrill Lynch	(117)
21	Hershey Co	Bank of America Merrill Lynch	(407)
1,449	Hershey Co	Barclays Bank	1,000
461	Hershey Co	BNP Paribas	(8,934)
628	Hershey Co	Goldam Sachs	(12,171)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
180	Hershey Co	HSBC	(2,387)
6	Hershey Co	JP Morgan	(80)
(260)	Hess Corp	Barclays Bank	(2,694)
(551)	Hess Corp	BNP Paribas	(5,365)
(186)	Hess Corp	Goldam Sachs	(1,927)
6,313	Hewlett Packard Enterprise Co	Barclays Bank	6,881
1,914	Hewlett Packard Enterprise Co	BNP Paribas	(708)
2,396	Hewlett Packard Enterprise Co	HSBC	(575)
816	Hewlett Packard Enterprise Co	JP Morgan	(196)
(358)	Hilton Worldwide Holdings Inc	Barclays Bank	(2,903)
(333)	Hilton Worldwide Holdings Inc	BNP Paribas	(2,534)
(595)	Hilton Worldwide Holdings Inc	Goldam Sachs	(4,528)
(330)	Hilton Worldwide Holdings Inc	HSBC	(2,359)
452	Hologic Inc	Bank of America Merrill Lynch	(773)
1,258	Hologic Inc	Barclays Bank	(4,151)
196	Hologic Inc	BNP Paribas	(335)
727	Hologic Inc	Goldam Sachs	(1,243)
289	Hologic Inc	HSBC	795
108	Home Depot Inc	Bank of America Merrill Lynch	696
77	Home Depot Inc	Barclays Bank	1,263
71	Home Depot Inc	BNP Paribas	457
35	Home Depot Inc	Citibank	574
46	Home Depot Inc	Goldam Sachs	296
127	Home Depot Inc	HSBC	686
82	Home Depot Inc	JP Morgan	443
108	Horizon Therapeutics Plc	Goldam Sachs	326
(972)	Hormel Foods Corp	Barclays Bank	350
(920)	Hormel Foods Corp	BNP Paribas	4,839
(3,254)	Howmet Aerospace Inc	Barclays Bank	(3,872)
(262)	Howmet Aerospace Inc	BNP Paribas	(375)
(2,319)	Howmet Aerospace Inc	Goldam Sachs	(3,316)
519	HP Inc	Barclays Bank	1,842
25	HubSpot Inc	Goldam Sachs	103
42	HubSpot Inc	HSBC	331
(183)	Humana Inc	Barclays Bank	(2,963)
(70)	Humana Inc	Goldam Sachs	(1,162)
(11)	Humana Inc	HSBC	(364)
(5,058)	Huntington Bancshares Inc	Barclays Bank	(1,416)
(2,192)	IAC Holdings Inc	Barclays Bank	(4,296)
(374)	IAC Holdings Inc	BNP Paribas	(1,743)
(1,663)	IAC Holdings Inc	Citibank	(3,259)
(1,584)	IAC Holdings Inc	Goldam Sachs	(7,381)
(304)	IAC Holdings Inc	HSBC	(3,666)
52	IDEX Corp	Barclays Bank	160
348	IDEX Corp	BNP Paribas	1,082

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
57	IDEX Corp	Goldam Sachs	177
68	IDEX Corp	HSBC	(29)
402	IDEXX Laboratories Inc	Goldam Sachs	13,262
2,873	Illinois Tool Works Inc	BNP Paribas	(9,165)
39	Illinois Tool Works Inc	HSBC	(217)
91	Illinois Tool Works Inc	JP Morgan	(506)
140	Illumina Inc	BNP Paribas	1,357
134	Illumina Inc	Citibank	(220)
117	Incyte Corp	Barclays Bank	(158)
1,309	Incyte Corp	BNP Paribas	1,374
2,317	Incyte Corp	Goldam Sachs	2,433
(3,245)	Ingersoll Rand Inc	Bank of America Merrill Lynch	(12,396)
(194)	Ingersoll Rand Inc	Barclays Bank	(371)
288	Inmode Ltd	Barclays Bank	878
461	Inmode Ltd	JP Morgan	1,443
426	Intel Corp	Barclays Bank	807
5,929	Intel Corp	BNP Paribas	4,832
391	Intel Corp	Citibank	741
446	Intel Corp	HSBC	368
(102)	Intercontinental Exchange Inc	Bank of America Merrill Lynch	-
(107)	Intercontinental Exchange Inc	Barclays Bank	(429)
(265)	Intercontinental Exchange Inc	HSBC	(1,359)
(157)	International Business Machines Corp	Barclays Bank	(1,080)
(908)	International Business Machines Corp	BNP Paribas	(2,742)
(1,080)	International Business Machines Corp	Goldam Sachs	(3,262)
(103)	International Business Machines Corp	HSBC	(372)
(67)	International Flavors & Fragrances Inc	BNP Paribas	(179)
(198)	International Flavors & Fragrances Inc	Goldam Sachs	(529)
(49)	International Flavors & Fragrances Inc	HSBC	(546)
(560)	International Paper Co	BNP Paribas	(437)
(1,280)	International Paper Co	Goldam Sachs	(998)
(1,355)	International Paper Co	HSBC	(1,165)
6,365	Interpublic Group of Cos Inc	Barclays Bank	4,965
1,847	Interpublic Group of Cos Inc	BNP Paribas	185
465	Interpublic Group of Cos Inc	Goldam Sachs	47
363	Interpublic Group of Cos Inc	HSBC	(174)
270	Interpublic Group of Cos Inc	JP Morgan	(130)
64	Intuit Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,930
1,181	Intuit Inc	Barclays Bank	58,613
202	Intuit Inc	Citibank	10,025
103	Intuit Inc	Goldam Sachs	6,325
92	Intuit Inc	HSBC	5,132
(27)	Intuitive Surgical Inc	Citibank	(147)
(66)	Intuitive Surgical Inc	HSBC	(1,211)
415	Invesco Ltd	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)
	米国(続き)		
377	Invesco Ltd	Barclays Bank	215
2,006	Invesco Ltd	BNP Paribas	3,169
1,421	Invesco Ltd	Goldam Sachs	2,245
1,208	Invesco Ltd	HSBC	1,884
(214)	IPG Photonics Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,367)
(772)	IPG Photonics Corp	Barclays Bank	(3,103)
(461)	IPG Photonics Corp	BNP Paribas	(2,946)
(516)	IPG Photonics Corp	Goldam Sachs	(3,297)
(427)	IQVIA Holdings Inc	Barclays Bank	(5,145)
(174)	IQVIA Holdings Inc	BNP Paribas	(1,540)
(42)	IQVIA Holdings Inc	Goldam Sachs	(378)
(783)	J M Smucker Co	Barclays Bank	(1,292)
(507)	J M Smucker Co	BNP Paribas	10,094
(886)	J M Smucker Co	Goldam Sachs	17,640
(88)	Jack Henry & Associates Inc	Barclays Bank	(356)
(639)	Jack Henry & Associates Inc	BNP Paribas	(5,955)
(594)	Jack Henry & Associates Inc	Goldam Sachs	(5,536)
(46)	Jack Henry & Associates Inc	HSBC	(417)
(236)	Jazz Pharmaceuticals Plc	Barclays Bank	(637)
683	JB Hunt Transport Services Inc	Barclays Bank	3,982
804	JB Hunt Transport Services Inc	BNP Paribas	(1,391)
346	Johnson & Johnson	BNP Paribas	(702)
68	Johnson & Johnson	HSBC	(87)
1,638	Johnson Controls International Plc	Bank of America Merrill Lynch	3,898
128	JPMorgan Chase & Co	Bank of America Merrill Lynch	1,688
103	JPMorgan Chase & Co	Barclays Bank	706
554	JPMorgan Chase & Co	BNP Paribas	5,849
99	JPMorgan Chase & Co	Citibank	496
191	JPMorgan Chase & Co	HSBC	1,832
4,559	Juniper Networks Inc	Barclays Bank	4,696
2,000	Juniper Networks Inc	BNP Paribas	740
4,082	Juniper Networks Inc	Goldam Sachs	1,510
(609)	Kellogg Co	BNP Paribas	2,887
(2,564)	Keurig Dr Pepper Inc	BNP Paribas	6,077
(723)	Keurig Dr Pepper Inc	HSBC	1,829
4,974	KeyCorp	Barclays Bank	3,731
154	Keysight Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,542
1,447	Keysight Technologies Inc	Barclays Bank	7,278
1,636	Keysight Technologies Inc	BNP Paribas	16,376
1,990	Keysight Technologies Inc	Goldam Sachs	19,920
134	Keysight Technologies Inc	HSBC	1,741
(471)	Kimberly-Clark Corp	Barclays Bank	(890)
(1,104)	Kimberly-Clark Corp	BNP Paribas	8,424
(296)	Kimberly-Clark Corp	Citibank	(559)
(289)	Kimberly-Clark Corp	Goldam Sachs	2,205

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(3,713)	Kinder Morgan Inc	BNP Paribas	(2,154)
(2,968)	Kinder Morgan Inc	Citibank	(2,404)
(1,472)	Kinder Morgan Inc	Goldam Sachs	(854)
170	KKR & Co Inc	Barclays Bank	462
6	KLA Corp	Bank of America Merrill Lynch	182
42	KLA Corp	Barclays Bank	827
753	KLA Corp	BNP Paribas	22,831
236	KLA Corp	Goldam Sachs	7,156
15	KLA Corp	HSBC	630
5,497	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	Barclays Bank	2,584
341	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	BNP Paribas	341
(328)	Kornit Digital Ltd	Goldam Sachs	(1,364)
(320)	Kraft Heinz Co	BNP Paribas	2,163
1,101	Kroger Co	BNP Paribas	(694)
472	L Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,431)
289	L Brands Inc	Barclays Bank	754
348	L Brands Inc	Goldam Sachs	(2,530)
431	Laboratory Corp of America Holdings	Goldam Sachs	3,069
230	Lam Research Corp	BNP Paribas	7,475
281	Lam Research Corp	Goldam Sachs	9,133
(1,551)	Las Vegas Sands Corp	Barclays Bank	(4,265)
(782)	Las Vegas Sands Corp	BNP Paribas	(1,853)
(5,359)	Las Vegas Sands Corp	Goldam Sachs	(12,701)
(152)	Lear Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,637)
(563)	Lear Corp	BNP Paribas	(6,064)
(239)	Lear Corp	Citibank	(1,479)
(226)	Lear Corp	Goldam Sachs	(2,434)
321	Lennar Corp 'A'	HSBC	876
38	Lennox International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(361)
199	Lennox International Inc	Barclays Bank	147
398	Lennox International Inc	BNP Paribas	(3,785)
26	Lennox International Inc	Goldam Sachs	(247)
(1,446)	Liberty Broadband Corp 'C'	Barclays Bank	(9,009)
(899)	Liberty Broadband Corp 'C'	Goldam Sachs	(7,821)
(3,087)	Liberty Global Plc 'A'	Barclays Bank	(5,248)
(1,581)	Liberty Global Plc 'C'	Barclays Bank	(2,909)
(945)	Liberty Global Plc 'C'	BNP Paribas	(1,814)
(346)	Liberty Global Plc 'C'	Citibank	(637)
(1,083)	Liberty Global Plc 'C'	Goldam Sachs	(2,079)
(4,660)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	Bank of America Merrill Lynch	(10,625)
(1,674)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	Barclays Bank	(2,176)
(352)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	BNP Paribas	(803)
(13)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	Citibank	(17)
(817)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	Goldam Sachs	(1,863)
(1,025)	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C'	Barclays Bank	(892)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(220)	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C'	Goldam Sachs	(486)
(645)	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C'	HSBC	(1,742)
573	Lincoln National Corp	Goldam Sachs	2,515
783	Lincoln National Corp	JP Morgan	1,597
(50)	Linde Plc	Bank of America Merrill Lynch	(570)
(50)	Linde Plc	Barclays Bank	(184)
(95)	Linde Plc	BNP Paribas	(1,392)
(477)	Linde Plc	Goldam Sachs	(6,988)
(17)	Live Nation Entertainment Inc	Bank of America Merrill Lynch	(124)
(119)	Live Nation Entertainment Inc	BNP Paribas	(865)
(395)	Live Nation Entertainment Inc	Goldam Sachs	(2,872)
504	LKQ Corp	Barclays Bank	1,109
656	LKQ Corp	BNP Paribas	367
2,326	LKQ Corp	Goldam Sachs	1,303
2,604	Loews Corp	Barclays Bank	3,437
235	Lowe's Cos Inc	BNP Paribas	200
(1,291)	Lucid Group Inc	BNP Paribas	(3,034)
69	Lululemon Athletica Inc	Barclays Bank	1,440
67	Lululemon Athletica Inc	Citibank	1,398
103	Lululemon Athletica Inc	Goldam Sachs	(1,075)
32	Lululemon Athletica Inc	JP Morgan	(335)
(7,050)	Lumen Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,076)
2,155	Lyft Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(3,340)
842	Lyft Inc 'A'	Barclays Bank	(2,206)
2,029	Lyft Inc 'A'	BNP Paribas	(3,145)
407	Lyft Inc 'A'	JP Morgan	(415)
366	LyondellBasell Industries NV 'A'	Citibank	3,481
(1,067)	M&T Bank Corp	BNP Paribas	(14,725)
(1)	M&T Bank Corp	Citibank	(9)
(50)	M&T Bank Corp	Goldam Sachs	(690)
8	Marathon Petroleum Corp	Bank of America Merrill Lynch	63
228	Marathon Petroleum Corp	Barclays Bank	1,699
140	Marathon Petroleum Corp	BNP Paribas	1,147
490	Marathon Petroleum Corp	Goldam Sachs	3,866
385	Marathon Petroleum Corp	HSBC	5,198
315	Marathon Petroleum Corp	JP Morgan	4,253
(12)	Markel Corp	Barclays Bank	(311)
(174)	MarketAxess Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,216)
(207)	MarketAxess Holdings Inc	Barclays Bank	1,339
(135)	MarketAxess Holdings Inc	Goldam Sachs	(2,495)
(42)	MarketAxess Holdings Inc	HSBC	(814)
(233)	Marriott International Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(3,234)
(1,572)	Marriott International Inc 'A'	Barclays Bank	(19,414)
(221)	Marriott International Inc 'A'	BNP Paribas	(1,757)
(580)	Marriott International Inc 'A'	Goldam Sachs	(4,611)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(171)	Marsh & McLennan Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	12
(83)	Marsh & McLennan Cos Inc	Barclays Bank	(551)
(477)	Marsh & McLennan Cos Inc	BNP Paribas	33
(241)	Marsh & McLennan Cos Inc	Goldam Sachs	17
(62)	Marsh & McLennan Cos Inc	HSBC	(118)
(284)	Martin Marietta Materials Inc	Barclays Bank	(1,329)
(170)	Martin Marietta Materials Inc	BNP Paribas	(2,496)
(293)	Martin Marietta Materials Inc	Citibank	(1,371)
(277)	Martin Marietta Materials Inc	Goldam Sachs	(4,066)
210	Marvell Technology Inc	Goldam Sachs	839
145	Masco Corp	Bank of America Merrill Lynch	162
464	Masco Corp	BNP Paribas	520
311	Masimo Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,650
258	Masimo Corp	Barclays Bank	294
102	Masimo Corp	BNP Paribas	869
29	Masimo Corp	Citibank	33
302	Masimo Corp	Goldam Sachs	2,573
693	Masimo Corp	HSBC	15,897
66	Masimo Corp	JP Morgan	1,514
(669)	Match Group Inc	Barclays Bank	(2,576)
(494)	Match Group Inc	BNP Paribas	(1,591)
(261)	Match Group Inc	Goldam Sachs	(840)
(121)	McCormick & Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,193
(667)	McCormick & Co Inc	BNP Paribas	6,577
(835)	McCormick & Co Inc	HSBC	6,212
20	McDonald's Corp	BNP Paribas	122
61	McDonald's Corp	HSBC	161
(145)	McKesson Corp	Bank of America Merrill Lynch	183
(98)	McKesson Corp	Barclays Bank	(70)
(126)	McKesson Corp	BNP Paribas	298
(91)	McKesson Corp	Goldam Sachs	(46)
(1,944)	Medtronic Plc	BNP Paribas	7,776
(8,787)	Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR	Bank of America Merrill Lynch	(2,285)
(9,488)	Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR	Barclays Bank	(1,518)
(1,857)	Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR	BNP Paribas	(483)
(848)	Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR	Citibank	(136)
(3,244)	Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR	HSBC	(3,049)
13	MercadoLibre Inc	BNP Paribas	(329)
1,207	Merck & Co Inc	BNP Paribas	(1,545)
244	Merck & Co Inc	JP Morgan	830
(280)	Meta Platforms Inc 'A'	Citibank	678
4,164	MetLife Inc	Barclays Bank	13,450
2,858	MetLife Inc	Goldam Sachs	10,174
715	MetLife Inc	HSBC	1,101
150	Mettler-Toledo International Inc	Bank of America Merrill Lynch	11,004

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
140	Mettler-Toledo International Inc	Barclays Bank	8,315
94	Mettler-Toledo International Inc	Goldam Sachs	6,896
(2,544)	MGM Resorts International	Barclays Bank	(4,705)
(2,711)	MGM Resorts International	BNP Paribas	(244)
(368)	MGM Resorts International	Goldam Sachs	(489)
(109)	MGM Resorts International	JP Morgan	(2)
(1,829)	Microchip Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10,078)
(770)	Microchip Technology Inc	Barclays Bank	(3,419)
(19)	Microchip Technology Inc	Goldam Sachs	(105)
439	Micron Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	931
129	Micron Technology Inc	Barclays Bank	387
35	Micron Technology Inc	BNP Paribas	74
153	Micron Technology Inc	Citibank	459
707	Micron Technology Inc	Goldam Sachs	2,365
355	Microsoft Corp	Bank of America Merrill Lynch	6,769
657	Microsoft Corp	Barclays Bank	6,701
49	Microsoft Corp	BNP Paribas	561
537	Microsoft Corp	Goldam Sachs	5,021
123	Microsoft Corp	HSBC	310
1,909	Microsoft Corp	JP Morgan	11,969
(84)	Moderna Inc	BNP Paribas	(890)
(90)	Moderna Inc	Citibank	(832)
(67)	Mohawk Industries Inc	Barclays Bank	(239)
(93)	Mohawk Industries Inc	BNP Paribas	(291)
(102)	Mohawk Industries Inc	HSBC	864
250	Molina Healthcare Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,083)
41	Molina Healthcare Inc	Barclays Bank	(515)
116	Molina Healthcare Inc	BNP Paribas	(502)
350	Molina Healthcare Inc	Citibank	(4,396)
132	Molina Healthcare Inc	Goldam Sachs	(572)
737	Molson Coors Beverage Co 'B'	BNP Paribas	(1,548)
160	Molson Coors Beverage Co 'B'	Goldam Sachs	(336)
(1,357)	Mondelez International Inc 'A'	Barclays Bank	(1,113)
(2,014)	Mondelez International Inc 'A'	BNP Paribas	6,586
(315)	Mondelez International Inc 'A'	Citibank	(258)
(1,054)	Mondelez International Inc 'A'	Goldam Sachs	3,447
(233)	Mondelez International Inc 'A'	HSBC	797
(176)	Mondelez International Inc 'A'	JP Morgan	602
(32)	MongoDB Inc	Goldam Sachs	263
157	Monolithic Power Systems Inc	Barclays Bank	4,363
38	Monolithic Power Systems Inc	BNP Paribas	1,123
489	Monster Beverage Corp	Barclays Bank	655
526	Monster Beverage Corp	BNP Paribas	(379)
161	Monster Beverage Corp	Goldam Sachs	(116)
753	Monster Beverage Corp	HSBC	3,629



保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
85	Moody's Corp	Barclays Bank	577
1	Moody's Corp	BNP Paribas	14
(236)	Morgan Stanley	Barclays Bank	(911)
(545)	Morgan Stanley	BNP Paribas	(3,417)
(187)	Morgan Stanley	Citibank	(722)
(715)	Morgan Stanley	HSBC	(3,589)
(140)	Mosaic Co	BNP Paribas	113
(353)	Mosaic Co	Citibank	(448)
(132)	Mosaic Co	Goldam Sachs	107
(96)	Motorola Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	(896)
(173)	Motorola Solutions Inc	Barclays Bank	(1,045)
(281)	Motorola Solutions Inc	BNP Paribas	(2,622)
(53)	Motorola Solutions Inc	Citibank	(320)
(601)	Motorola Solutions Inc	Goldam Sachs	(5,607)
(59)	Motorola Solutions Inc	HSBC	(988)
(117)	Motorola Solutions Inc	JP Morgan	(1,960)
54	MSCI Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,320
94	MSCI Inc	Barclays Bank	2,376
90	MSCI Inc	BNP Paribas	3,866
21	MSCI Inc	HSBC	1,341
(292)	Nasdaq Inc	BNP Paribas	(2,610)
(53)	Nasdaq Inc	Goldam Sachs	(474)
166	NetApp Inc	Bank of America Merrill Lynch	71
1,394	NetApp Inc	Barclays Bank	4,767
2,664	NetApp Inc	BNP Paribas	1,146
1,557	NetApp Inc	Goldam Sachs	670
659	NetApp Inc	HSBC	1,168
(44)	Netflix Inc	Bank of America Merrill Lynch	(293)
(126)	Netflix Inc	Barclays Bank	(723)
(152)	Netflix Inc	HSBC	(3,052)
131	Neurocrine Biosciences Inc	Barclays Bank	791
135	Neurocrine Biosciences Inc	Goldam Sachs	1,033
647	Neurocrine Biosciences Inc	JP Morgan	10,831
(1,220)	Newell Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,415
(4,040)	Newell Brands Inc	BNP Paribas	4,686
(381)	Newell Brands Inc	Citibank	(701)
(4,800)	Newell Brands Inc	Goldam Sachs	5,568
(432)	Newell Brands Inc	HSBC	1,223
(205)	Newmont Corp	Barclays Bank	(50)
(144)	Newmont Corp	BNP Paribas	1
(146)	Newmont Corp	Goldam Sachs	(101)
(364)	Newmont Corp	HSBC	(36)
870	News Corp 'A'	Barclays Bank	(70)
1,705	News Corp 'A'	BNP Paribas	(494)
2,117	News Corp 'A'	Goldam Sachs	(614)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
1,150	News Corp 'A'	HSBC	(184)
(100)	NextEra Energy Inc	BNP Paribas	(622)
(384)	NextEra Energy Inc	Goldam Sachs	(2,387)
101	NIKE Inc 'B'	Barclays Bank	764
90	NIKE Inc 'B'	BNP Paribas	323
78	NIKE Inc 'B'	Citibank	590
74	NIKE Inc 'B'	Goldam Sachs	266
100	NIKE Inc 'B'	HSBC	498
92	NIKE Inc 'B'	JP Morgan	458
524	Nordson Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,672
298	Nordson Corp	Barclays Bank	2,944
83	Nordson Corp	BNP Paribas	423
48	Nordson Corp	Citibank	474
1,153	Nordson Corp	Goldam Sachs	5,880
64	Nordson Corp	HSBC	451
(42)	Norfolk Southern Corp	BNP Paribas	(3)
294	Northern Trust Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,390
739	Northern Trust Corp	Barclays Bank	3,939
583	Northern Trust Corp	BNP Paribas	4,740
175	Northern Trust Corp	Citibank	933
660	Northern Trust Corp	Goldam Sachs	5,366
(437)	NortonLifeLock Inc	Bank of America Merrill Lynch	(359)
(1,184)	NortonLifeLock Inc	Barclays Bank	(36)
(579)	NortonLifeLock Inc	BNP Paribas	(434)
(63)	Novavax Inc	Bank of America Merrill Lynch	(571)
(64)	Novavax Inc	Barclays Bank	(362)
(27)	Novavax Inc	BNP Paribas	(245)
(116)	Novavax Inc	Goldam Sachs	(1,051)
(78)	Novocure Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,143)
(67)	Novocure Ltd	Barclays Bank	(287)
(441)	Novocure Ltd	BNP Paribas	(6,465)
323	Nucor Corp	Bank of America Merrill Lynch	4,963
235	Nucor Corp	BNP Paribas	2,487
101	Nucor Corp	HSBC	975
271	NVIDIA Corp	Bank of America Merrill Lynch	3,515
153	NVIDIA Corp	Barclays Bank	2,544
704	NVIDIA Corp	BNP Paribas	9,131
304	NVIDIA Corp	Goldam Sachs	5,902
442	NVIDIA Corp	HSBC	7,093
2	NVR Inc	Bank of America Merrill Lynch	302
10	NVR Inc	Barclays Bank	1,712
3	NVR Inc	BNP Paribas	452
5	NVR Inc	Goldam Sachs	754
3	NVR Inc	JP Morgan	37
(56)	NXP Semiconductors NV	Bank of America Merrill Lynch	(786)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(246)	NXP Semiconductors NV	Barclays Bank	(2,544)
(197)	NXP Semiconductors NV	BNP Paribas	(2,766)
(298)	NXP Semiconductors NV	Citibank	(3,081)
(143)	NXP Semiconductors NV	Goldam Sachs	(2,008)
(1,463)	Occidental Petroleum Corp	Goldam Sachs	(7,139)
(11)	Okta Inc	BNP Paribas	50
(711)	Okta Inc	Goldam Sachs	3,214
(118)	Okta Inc	HSBC	470
421	Old Dominion Freight Line Inc	Goldam Sachs	(2,884)
583	Old Dominion Freight Line Inc	HSBC	(9,077)
(142)	Omnicom Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	376
(1,151)	Omnicom Group Inc	Barclays Bank	1,738
(396)	Omnicom Group Inc	BNP Paribas	1,049
(1,588)	Omnicom Group Inc	Goldam Sachs	4,208
(129)	Omnicom Group Inc	HSBC	192
386	ON Semiconductor Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,872
237	ON Semiconductor Corp	Citibank	974
261	ON Semiconductor Corp	Goldam Sachs	855
641	ONEOK Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,051
7,414	ONEOK Inc	BNP Paribas	12,159
492	ONEOK Inc	Citibank	1,609
387	ONEOK Inc	Goldam Sachs	635
265	ONEOK Inc	HSBC	1,357
(800)	Oracle Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,098)
(851)	Oracle Corp	BNP Paribas	(2,059)
(857)	Oracle Corp	Goldam Sachs	(2,074)
(1,235)	Oracle Corp	HSBC	(1,035)
(25)	O'Reilly Automotive Inc	Citibank	(1,597)
1,514	Otis Worldwide Corp	BNP Paribas	(257)
1,526	Otis Worldwide Corp	Goldam Sachs	(259)
575	Owens Corning	Barclays Bank	1,369
213	Owens Corning	Goldam Sachs	337
363	Owens Corning	HSBC	1,263
(403)	PACCAR Inc	Bank of America Merrill Lynch	(830)
(593)	PACCAR Inc	Goldam Sachs	(1,222)
(366)	PACCAR Inc	HSBC	4
(339)	Packaging Corp of America	Goldam Sachs	(485)
(3,931)	Palantir Technologies Inc 'A'	Barclays Bank	(2,929)
(3,167)	Palantir Technologies Inc 'A'	Citibank	(2,359)
29	Palo Alto Networks Inc	Barclays Bank	88
125	Palo Alto Networks Inc	BNP Paribas	4,393
112	Palo Alto Networks Inc	Goldam Sachs	2,974
72	Palo Alto Networks Inc	HSBC	1,767
85	Palo Alto Networks Inc	JP Morgan	3,724
339	Parker-Hannifin Corp	BNP Paribas	1,692

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
130	Parker-Hannifin Corp	HSBC	(104)
199	Paychex Inc	Bank of America Merrill Lynch	686
373	Paychex Inc	BNP Paribas	951
99	Paychex Inc	Citibank	436
181	Paychex Inc	Goldam Sachs	791
80	Paychex Inc	HSBC	187
35	Paycom Software Inc	Goldam Sachs	234
48	Paycom Software Inc	HSBC	303
(143)	PayPal Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(909)
(243)	PayPal Holdings Inc	Barclays Bank	(688)
(1,273)	PayPal Holdings Inc	Goldam Sachs	(8,096)
(397)	PayPal Holdings Inc	HSBC	(1,779)
1	Pebblebrook Hotel Trust (REIT)	BNP Paribas	-
(3,877)	Peloton Interactive Inc 'A'	BNP Paribas	4,963
(3,542)	Peloton Interactive Inc 'A'	Goldam Sachs	2,075
(412)	Peloton Interactive Inc 'A'	HSBC	(29)
1,440	Pentair Plc	Barclays Bank	619
1,332	Pentair Plc	BNP Paribas	(107)
2,445	PepsiCo Inc	Bank of America Merrill Lynch	(24,132)
723	PepsiCo Inc	Barclays Bank	-
755	PepsiCo Inc	Goldam Sachs	(7,452)
188	PepsiCo Inc	HSBC	(941)
(1,211)	PerkinElmer Inc	Barclays Bank	(5,680)
(542)	PerkinElmer Inc	BNP Paribas	(2,374)
(204)	PerkinElmer Inc	Goldam Sachs	(894)
(2,046)	Pfizer Inc	BNP Paribas	(2,864)
(211)	Pfizer Inc	Goldam Sachs	(295)
187	Phillips 66	BNP Paribas	1,161
166	Phillips 66	Citibank	1,363
55	Phillips 66	Goldam Sachs	342
620	Phillips 66	HSBC	8,562
517	Phillips 66	JP Morgan	7,140
1,073	Pinterest Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,717)
1,319	Pinterest Inc 'A'	Barclays Bank	(3,561)
1,952	Pinterest Inc 'A'	BNP Paribas	(3,123)
168	Pinterest Inc 'A'	Citibank	(454)
1,775	Pinterest Inc 'A'	Goldam Sachs	(2,840)
122	Pinterest Inc 'A'	HSBC	(145)
136	Pioneer Natural Resources Co	Barclays Bank	1,738
307	Pioneer Natural Resources Co	BNP Paribas	4,912
19	Pioneer Natural Resources Co	Goldam Sachs	304
(3,710)	Plug Power Inc	Barclays Bank	(6,771)
(1,556)	Plug Power Inc	BNP Paribas	(6,170)
(145)	Plug Power Inc	Citibank	(265)
(588)	Plug Power Inc	Goldam Sachs	(2,331)

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)	PNC Financial Services Group Inc	Barclays Bank	(24)
(801)	PNC Financial Services Group Inc	BNP Paribas	(15,195)
(254)	PNC Financial Services Group Inc	Goldam Sachs	(4,818)
(75)	PNC Financial Services Group Inc	HSBC	(793)
(103)	PNC Financial Services Group Inc	JP Morgan	(1,089)
414	Pool Corp	Barclays Bank	(2,256)
110	Pool Corp	BNP Paribas	(206)
(121)	PPG Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(640)
(586)	PPG Industries Inc	Barclays Bank	(1,729)
(92)	PPG Industries Inc	BNP Paribas	(487)
(80)	PPG Industries Inc	Citibank	(236)
(129)	PPG Industries Inc	Goldam Sachs	(682)
(65)	PPG Industries Inc	HSBC	90
(927)	Principal Financial Group Inc	BNP Paribas	(2,197)
260	Procter & Gamble Co	Bank of America Merrill Lynch	(2,254)
972	Procter & Gamble Co	BNP Paribas	(8,427)
395	Procter & Gamble Co	Citibank	553
1,187	Procter & Gamble Co	Goldam Sachs	(10,291)
134	Procter & Gamble Co	JP Morgan	(1,227)
(632)	Progressive Corp	Bank of America Merrill Lynch	(5,663)
(645)	Progressive Corp	Barclays Bank	(3,722)
(1,539)	Progressive Corp	BNP Paribas	(13,789)
(624)	Progressive Corp	Goldam Sachs	(5,591)
(629)	Prudential Financial Inc	Citibank	(2,579)
(440)	PTC Inc	Barclays Bank	(1,681)
(86)	PTC Inc	BNP Paribas	(671)
(114)	PTC Inc	Goldam Sachs	(889)
(104)	PTC Inc	HSBC	(1,064)
1,483	Public Service Enterprise Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	311
1,139	Public Service Enterprise Group Inc	Barclays Bank	(11)
1,165	Public Service Enterprise Group Inc	BNP Paribas	245
600	Public Service Enterprise Group Inc	Citibank	(6)
176	Public Service Enterprise Group Inc	Goldam Sachs	37
298	Public Service Enterprise Group Inc	HSBC	(235)
543	Public Service Enterprise Group Inc	JP Morgan	(429)
695	PulteGroup Inc	BNP Paribas	1,453
(584)	Qorvo Inc	Barclays Bank	(2,071)
(323)	Qorvo Inc	BNP Paribas	(1,381)
(111)	Qorvo Inc	Goldam Sachs	(886)
57	QUALCOMM Inc	Bank of America Merrill Lynch	255
1,299	QUALCOMM Inc	BNP Paribas	6,532
1,254	QUALCOMM Inc	Goldam Sachs	5,605
240	QUALCOMM Inc	JP Morgan	830
(485)	Quest Diagnostics Inc	BNP Paribas	(2,343)
(193)	Quest Diagnostics Inc	HSBC	(774)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 / (損) (米ドル)
	米国 ( 続き )		
(609)	Raymond James Financial Inc	BNP Paribas	(3,118)
74	Regeneron Pharmaceuticals Inc	BNP Paribas	1,805
31	Regeneron Pharmaceuticals Inc	Citibank	(78)
4	Regeneron Pharmaceuticals Inc	Goldam Sachs	98
1,006	Regions Financial Corp	Barclays Bank	1,076
1,475	Regions Financial Corp	Goldam Sachs	3,053
5,025	Regions Financial Corp	HSBC	6,131
1,126	Regions Financial Corp	JP Morgan	1,374
(2,442)	Republic Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9,499)
(3,871)	Republic Services Inc	Goldam Sachs	(15,058)
(92)	ResMed Inc	Bank of America Merrill Lynch	(628)
(47)	ResMed Inc	Barclays Bank	(248)
(85)	ResMed Inc	BNP Paribas	(581)
81	RingCentral Inc ' A '	Bank of America Merrill Lynch	148
117	RingCentral Inc ' A '	Barclays Bank	267
187	RingCentral Inc ' A '	BNP Paribas	342
184	RingCentral Inc ' A '	Citibank	420
83	RingCentral Inc ' A '	Goldam Sachs	152
87	RingCentral Inc ' A '	JP Morgan	(370)
(271)	Rivian Automotive Inc ' A '	Citibank	(797)
(552)	Rivian Automotive Inc ' A '	Goldam Sachs	(3,351)
2,747	Robert Half International Inc	Barclays Bank	(769)
342	Robert Half International Inc	BNP Paribas	(1,327)
487	Robert Half International Inc	Goldam Sachs	(1,890)
(2,037)	Robinhood Markets Inc ' A '	Barclays Bank	(509)
(876)	Robinhood Markets Inc ' A '	BNP Paribas	(175)
(3,155)	Robinhood Markets Inc ' A '	Goldam Sachs	(631)
(262)	Rockwell Automation Inc	Barclays Bank	(1,522)
(77)	Rockwell Automation Inc	BNP Paribas	(468)
(155)	Rockwell Automation Inc	Goldam Sachs	(1,240)
(128)	Rockwell Automation Inc	HSBC	(562)
157	Roku Inc	Barclays Bank	491
(1,783)	Rollins Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,765)
(400)	Rollins Inc	Barclays Bank	(236)
(714)	Rollins Inc	BNP Paribas	(707)
(203)	Rollins Inc	Goldam Sachs	(201)
(2,475)	Rollins Inc	HSBC	(5,420)
(532)	Rollins Inc	JP Morgan	(1,165)
(37)	Roper Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(374)
(44)	Roper Technologies Inc	Barclays Bank	(707)
(528)	Roper Technologies Inc	BNP Paribas	(5,479)
(216)	Roper Technologies Inc	Citibank	(3,469)
(101)	Roper Technologies Inc	Goldam Sachs	(1,021)
(79)	Roper Technologies Inc	HSBC	(557)
(216)	Roper Technologies Inc	JP Morgan	(1,523)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(106)	Ross Stores Inc	Barclays Bank	(666)
(560)	Ross Stores Inc	BNP Paribas	(1,514)
(856)	Ross Stores Inc	Citibank	(5,376)
(123)	Ross Stores Inc	HSBC	1,031
(98)	Ross Stores Inc	JP Morgan	821
(615)	Royal Caribbean Cruises Ltd	Barclays Bank	(2,698)
(1,610)	Royal Caribbean Cruises Ltd	BNP Paribas	3,839
(386)	Royal Caribbean Cruises Ltd	Citibank	(1,127)
(2,417)	Royal Caribbean Cruises Ltd	Goldam Sachs	6,362
(942)	Royalty Pharma Plc 'A'	BNP Paribas	(377)
(3,516)	Royalty Pharma Plc 'A'	Goldam Sachs	(1,406)
(791)	RPM International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,232)
(2,690)	RPM International Inc	Barclays Bank	(9,818)
(1,687)	RPM International Inc	BNP Paribas	(9,025)
(269)	RPM International Inc	Citibank	(982)
(1,047)	RPM International Inc	Goldam Sachs	(5,601)
(579)	RPM International Inc	HSBC	(2,565)
(32)	S&P Global Inc	Bank of America Merrill Lynch	(601)
(344)	S&P Global Inc	Barclays Bank	(1,249)
(170)	S&P Global Inc	BNP Paribas	(3,194)
(417)	salesforce.com Inc	Barclays Bank	(100)
(135)	salesforce.com Inc	BNP Paribas	481
(622)	salesforce.com Inc	Citibank	(149)
(204)	salesforce.com Inc	Goldam Sachs	726
(124)	salesforce.com Inc	HSBC	377
(351)	salesforce.com Inc	JP Morgan	1,067
6,419	Schlumberger NV	BNP Paribas	36,396
1,955	Schlumberger NV	Goldam Sachs	11,085
1,219	Schlumberger NV	HSBC	11,946
65	Seagate Technology Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	(34)
133	Seagate Technology Holdings Plc	Barclays Bank	49
799	Seagate Technology Holdings Plc	BNP Paribas	(423)
126	Seagate Technology Holdings Plc	Citibank	47
127	Seagate Technology Holdings Plc	Goldam Sachs	(67)
289	Seagate Technology Holdings Plc	HSBC	561
123	Seagate Technology Holdings Plc	JP Morgan	239
(225)	Seagen Inc	Barclays Bank	95
(95)	Seagen Inc	BNP Paribas	344
(260)	Seagen Inc	Goldam Sachs	941
39	Sealed Air Corp	Barclays Bank	60
3,042	Sealed Air Corp	Goldam Sachs	213
(927)	SEI Investments Co	Bank of America Merrill Lynch	(3,059)
(1,021)	SEI Investments Co	Barclays Bank	(2,532)
(719)	SEI Investments Co	BNP Paribas	(2,373)
(1,112)	SEI Investments Co	Goldam Sachs	(3,670)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(452)	SEI Investments Co	JP Morgan	(1,383)
66	Sempra Energy	Barclays Bank	(114)
1,544	Sempra Energy	BNP Paribas	4,633
608	Sempra Energy	Goldam Sachs	2,278
178	Sempra Energy	HSBC	301
(1,264)	Sensata Technologies Holding Plc	Bank of America Merrill Lynch	(3,451)
(1,265)	Sensata Technologies Holding Plc	Barclays Bank	(1,708)
(425)	Sensata Technologies Holding Plc	BNP Paribas	(1,160)
(559)	Sensata Technologies Holding Plc	Goldam Sachs	(1,526)
(181)	Sensata Technologies Holding Plc	HSBC	(445)
122	ServiceNow Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,911
751	ServiceNow Inc	Barclays Bank	30,303
64	ServiceNow Inc	BNP Paribas	2,403
446	ServiceNow Inc	Goldam Sachs	16,495
76	ServiceNow Inc	HSBC	3,294
(17)	Sherwin-Williams Co	Barclays Bank	(125)
(1,379)	Sherwin-Williams Co	BNP Paribas	6,550
(163)	Signature Bank	BNP Paribas	(3,720)
(3,350)	Sirius XM Holdings Inc	Barclays Bank	(436)
(8,911)	Sirius XM Holdings Inc	BNP Paribas	(2,050)
111	Skyworks Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	609
78	Skyworks Solutions Inc	Barclays Bank	406
481	Skyworks Solutions Inc	BNP Paribas	2,641
13	Skyworks Solutions Inc	JP Morgan	69
(552)	Snap Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	4,990
(1,808)	Snap Inc 'A'	BNP Paribas	16,344
(297)	Snap-on Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,108)
(45)	Snap-on Inc	Barclays Bank	(371)
(136)	Snap-on Inc	Goldam Sachs	(507)
140	Snowflake Inc 'A'	HSBC	(2,156)
(1,065)	SoFi Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(671)
(4,368)	SoFi Technologies Inc	Barclays Bank	(1,179)
(13,065)	SoFi Technologies Inc	BNP Paribas	(8,231)
(864)	SoFi Technologies Inc	Goldam Sachs	(544)
(228)	SolarEdge Technologies Inc	Barclays Bank	(5,100)
(321)	SolarEdge Technologies Inc	BNP Paribas	(17,722)
826	Southwest Airlines Co	Barclays Bank	1,611
(38,622)	Spectrum Brands Holdings Inc	JP Morgan	(54,843)
714	Splunk Inc	BNP Paribas	6,105
77	Splunk Inc	Goldam Sachs	658
(1,292)	SS&C Technologies Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,866)
(2,055)	SS&C Technologies Holdings Inc	Barclays Bank	(4,172)
(1,463)	SS&C Technologies Holdings Inc	BNP Paribas	(6,642)
(267)	SS&C Technologies Holdings Inc	Citibank	(542)
(764)	SS&C Technologies Holdings Inc	Goldam Sachs	(3,469)



保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(523)	SS&C Technologies Holdings Inc	HSBC	(1,919)
(137)	Stanley Black & Decker Inc	Bank of America Merrill Lynch	137
(659)	Stanley Black & Decker Inc	Barclays Bank	185
(1,213)	Stanley Black & Decker Inc	BNP Paribas	1,213
(143)	Stanley Black & Decker Inc	Citibank	40
(353)	Stanley Black & Decker Inc	Goldam Sachs	263
(122)	Stanley Black & Decker Inc	JP Morgan	1,003
143	Starbucks Corp	Barclays Bank	521
1,803	Starbucks Corp	Citibank	6,563
128	Starbucks Corp	HSBC	457
495	State Street Corp	Barclays Bank	1,143
233	State Street Corp	HSBC	650
241	Steel Dynamics Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,449
167	Steel Dynamics Inc	Barclays Bank	1,192
2,352	Steel Dynamics Inc	BNP Paribas	23,896
407	Steel Dynamics Inc	Goldam Sachs	4,097
144	Steel Dynamics Inc	HSBC	1,491
(587)	STERIS Plc	Barclays Bank	(1,057)
(431)	STERIS Plc	BNP Paribas	(4,913)
(49)	STERIS Plc	Goldam Sachs	(559)
(36)	STERIS Plc	HSBC	(582)
(276)	Stryker Corp	Barclays Bank	36
(133)	Stryker Corp	BNP Paribas	124
(44)	Stryker Corp	Goldam Sachs	41
(2,378)	Sunrun Inc	Barclays Bank	(7,086)
(2,575)	Sunrun Inc	BNP Paribas	(14,600)
(781)	Sunrun Inc	Citibank	(2,327)
(414)	Sunrun Inc	Goldam Sachs	(2,347)
(763)	Sunrun Inc	HSBC	(3,968)
53	SVB Financial Group	Barclays Bank	1,961
98	SVB Financial Group	BNP Paribas	5,179
20	SVB Financial Group	Citibank	740
119	SVB Financial Group	Goldam Sachs	6,289
33	SVB Financial Group	HSBC	501
307	Synchrony Financial	Bank of America Merrill Lynch	1,273
273	Synchrony Financial	Barclays Bank	614
213	Synchrony Financial	BNP Paribas	679
563	Synchrony Financial	Citibank	1,267
232	Synchrony Financial	Goldam Sachs	740
84	Synopsys Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,722
1,877	Synopsys Inc	Citibank	20,760
113	Synopsys Inc	JP Morgan	6,286
(699)	Sysco Corp	BNP Paribas	671
(797)	Sysco Corp	Goldam Sachs	765
(127)	Sysco Corp	HSBC	(318)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(225)	T Rowe Price Group Inc	BNP Paribas	(1,292)
(199)	T Rowe Price Group Inc	Goldam Sachs	(1,142)
(415)	T Rowe Price Group Inc	HSBC	(1,822)
(114)	Take-Two Interactive Software Inc	Bank of America Merrill Lynch	(870)
(1,150)	Take-Two Interactive Software Inc	Barclays Bank	(2,576)
(630)	Take-Two Interactive Software Inc	BNP Paribas	(8,567)
(122)	Take-Two Interactive Software Inc	Citibank	(273)
(276)	Take-Two Interactive Software Inc	Goldam Sachs	(4,347)
(86)	Take-Two Interactive Software Inc	HSBC	(369)
196	Target Corp	Barclays Bank	1,903
(67)	TE Connectivity Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(336)
(2,165)	TE Connectivity Ltd	Barclays Bank	(11,063)
(65)	TE Connectivity Ltd	BNP Paribas	(326)
(228)	TE Connectivity Ltd	Goldam Sachs	(1,142)
(1,554)	Teladoc Health Inc	Barclays Bank	(1,756)
(906)	Teladoc Health Inc	BNP Paribas	(2,165)
(408)	Teladoc Health Inc	Citibank	(461)
(1,219)	Teladoc Health Inc	Goldam Sachs	(2,913)
(628)	Teladoc Health Inc	HSBC	(2,559)
(320)	Teledyne Technologies Inc	Barclays Bank	(262)
(401)	Teleflex Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,841)
(137)	Teleflex Inc	Barclays Bank	470
(40)	Teleflex Inc	Goldam Sachs	(184)
(108)	Teleflex Inc	HSBC	(2,833)
(8,823)	Tenaris SA	BNP Paribas	(4,679)
(10,371)	Tenaris SA	Goldam Sachs	(5,499)
(483)	Teradyne Inc	Barclays Bank	(2,345)
(37)	Tesla Inc	BNP Paribas	(990)
(53)	Tesla Inc	Goldam Sachs	(1,418)
(13,531)	Teva Pharmaceutical Industries Ltd ADR	Bank of America Merrill Lynch	(13,666)
(8,322)	Teva Pharmaceutical Industries Ltd ADR	Barclays Bank	(3,911)
(4,122)	Teva Pharmaceutical Industries Ltd ADR	BNP Paribas	(4,163)
(1,050)	Teva Pharmaceutical Industries Ltd ADR	Goldam Sachs	(1,061)
268	Texas Instruments Inc	BNP Paribas	1,576
60	Texas Instruments Inc	Citibank	308
549	Texas Instruments Inc	Goldam Sachs	3,228
160	Texas Instruments Inc	HSBC	1,510
(366)	Thermo Fisher Scientific Inc	Barclays Bank	(5,940)
(186)	Thermo Fisher Scientific Inc	BNP Paribas	(5,963)
(83)	Thermo Fisher Scientific Inc	Citibank	(1,347)
(33)	Thermo Fisher Scientific Inc	Goldam Sachs	(1,058)
(503)	TJX Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,755)
(943)	TJX Cos Inc	BNP Paribas	(6,535)
(1,037)	TJX Cos Inc	Citibank	(2,841)
(1,239)	TJX Cos Inc	Goldam Sachs	(8,586)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(166)	TJX Cos Inc	HSBC	(649)
(261)	TJX Cos Inc	JP Morgan	(1,021)
(1,377)	T-Mobile US Inc	Barclays Bank	(4,461)
(1,013)	T-Mobile US Inc	Goldam Sachs	(6,666)
(4)	Torchmark Corp	Bank of America Merrill Lynch	(5)
(587)	Torchmark Corp	Barclays Bank	(1,039)
(2,483)	Torchmark Corp	BNP Paribas	(2,880)
(697)	Torchmark Corp	Goldam Sachs	(809)
(241)	Torchmark Corp	HSBC	268
501	Tractor Supply Co	Barclays Bank	6,172
(86)	Trade Desk Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(30)
(1,505)	Trade Desk Inc 'A'	Barclays Bank	1,776
(163)	Trade Desk Inc 'A'	Goldam Sachs	(57)
(1,195)	Tradeweb Markets Inc 'A'	Goldam Sachs	(3,716)
738	Trane Technologies Plc	Barclays Bank	4,303
15	Trane Technologies Plc	HSBC	42
(273)	TransUnion	Barclays Bank	(1,136)
(857)	TransUnion	BNP Paribas	(4,088)
(94)	TransUnion	Citibank	(391)
(308)	TransUnion	Goldam Sachs	(1,469)
315	Travelers Cos Inc	Barclays Bank	1,408
45	Trimble Inc	Bank of America Merrill Lynch	124
972	Trimble Inc	Barclays Bank	1,030
2,478	Trimble Inc	BNP Paribas	6,839
645	Trimble Inc	Goldam Sachs	1,780
633	Trimble Inc	HSBC	3,861
499	Trimble Inc	JP Morgan	3,044
(733)	Truist Financial Corp	BNP Paribas	(2,045)
(159)	Twilio Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(987)
(141)	Twilio Inc 'A'	Barclays Bank	(808)
(683)	Twilio Inc 'A'	BNP Paribas	(4,241)
(599)	Twilio Inc 'A'	Goldam Sachs	(3,720)
(167)	Twilio Inc 'A'	HSBC	(858)
(44)	Tyler Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(431)
(578)	Tyler Technologies Inc	Barclays Bank	(6,844)
(178)	Tyler Technologies Inc	BNP Paribas	(1,743)
(185)	Tyler Technologies Inc	Goldam Sachs	(1,811)
153	Tyson Foods Inc 'A'	BNP Paribas	(225)
614	Tyson Foods Inc 'A'	Goldam Sachs	(903)
349	Uber Technologies Inc	BNP Paribas	(24)
1,696	Uber Technologies Inc	Goldam Sachs	(119)
4,990	UGI Corp	BNP Paribas	12,974
2,185	UGI Corp	Goldam Sachs	5,681
70	Ulta Beauty Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,651
415	Ulta Beauty Inc	Barclays Bank	29,092

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
261	Ulta Beauty Inc	Goldam Sachs	6,157
31	Ulta Beauty Inc	HSBC	1,105
(60)	Union Pacific Corp	Bank of America Merrill Lynch	414
(99)	Union Pacific Corp	Barclays Bank	(406)
(67)	Union Pacific Corp	BNP Paribas	(326)
(178)	Union Pacific Corp	Goldam Sachs	1,228
161	United Parcel Service Inc 'B'	Barclays Bank	836
298	United Parcel Service Inc 'B'	BNP Paribas	(57)
42	United Parcel Service Inc 'B'	Goldam Sachs	(8)
339	United Parcel Service Inc 'B'	HSBC	(627)
68	United Rentals Inc	Bank of America Merrill Lynch	735
113	United Rentals Inc	Barclays Bank	2,214
383	United Rentals Inc	BNP Paribas	4,140
125	United Rentals Inc	Citibank	2,449
225	United Rentals Inc	Goldam Sachs	2,432
112	United Rentals Inc	HSBC	1,644
42	United Rentals Inc	JP Morgan	291
(201)	UnitedHealth Group Inc	Citibank	(2,050)
(231)	UnitedHealth Group Inc	Goldam Sachs	(3,017)
(452)	Unity Software Inc	Barclays Bank	344
(220)	Universal Health Services Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	81
(774)	Universal Health Services Inc 'B'	BNP Paribas	286
(222)	Universal Health Services Inc 'B'	HSBC	322
(170)	Upstart Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,076)
(345)	Upstart Holdings Inc	Barclays Bank	(2,777)
(142)	Upstart Holdings Inc	BNP Paribas	(1,734)
(11)	Upstart Holdings Inc	Citibank	(89)
(467)	US Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	(1,896)
(2,079)	US Bancorp	Barclays Bank	(3,285)
(4,000)	US Bancorp	BNP Paribas	(16,240)
(180)	US Bancorp	Citibank	(284)
224	Vail Resorts Inc	Barclays Bank	2,253
298	Vail Resorts Inc	BNP Paribas	5,552
64	Vail Resorts Inc	Citibank	644
152	Vail Resorts Inc	Goldam Sachs	2,832
373	Vail Resorts Inc	HSBC	5,319
110	Vail Resorts Inc	JP Morgan	1,569
734	Veeva Systems Inc 'A'	Barclays Bank	3,890
316	Veeva Systems Inc 'A'	BNP Paribas	1,912
183	Veeva Systems Inc 'A'	Goldam Sachs	1,107
102	Veeva Systems Inc 'A'	JP Morgan	224
84	VeriSign Inc	Bank of America Merrill Lynch	752
903	VeriSign Inc	Barclays Bank	6,131
693	VeriSign Inc	BNP Paribas	5,437
52	VeriSign Inc	Citibank	353

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
314	VeriSign Inc	Goldam Sachs	2,810
(223)	Verisk Analytics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(876)
(105)	Verisk Analytics Inc	BNP Paribas	(413)
(132)	Verisk Analytics Inc	Citibank	(660)
(264)	Verisk Analytics Inc	Goldam Sachs	(1,038)
(105)	Verisk Analytics Inc	HSBC	216
1,377	Verizon Communications Inc	BNP Paribas	2,802
1,747	Verizon Communications Inc	Goldam Sachs	3,555
361	Verizon Communications Inc	JP Morgan	886
124	Vertex Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,748
9	Vertex Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	(1)
278	Vertex Pharmaceuticals Inc	BNP Paribas	3,920
240	Vertex Pharmaceuticals Inc	Citibank	(19)
214	Vertex Pharmaceuticals Inc	HSBC	7,116
(412)	VF Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,384)
(379)	VF Corp	Barclays Bank	(1,463)
(1,532)	VF Corp	BNP Paribas	(5,148)
(91)	VF Corp	Citibank	(351)
(1,738)	VF Corp	Goldam Sachs	(5,840)
(1,456)	ViacomCBS Inc 'B'	BNP Paribas	(8,620)
(269)	ViacomCBS Inc 'B'	Citibank	(229)
(1,156)	ViacomCBS Inc 'B'	HSBC	(7,514)
(2,937)	Viatris Inc	Barclays Bank	(1,292)
(32)	Viatris Inc	Citibank	(14)
(5,097)	Viatris Inc	Goldam Sachs	(4,740)
(74)	Visa Inc 'A'	Citibank	(343)
(426)	Visa Inc 'A'	Goldam Sachs	(6,126)
(34)	Vulcan Materials Co	Barclays Bank	(19)
(193)	Vulcan Materials Co	BNP Paribas	(838)
(170)	Vulcan Materials Co	Citibank	(95)
(559)	W R Berkley Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,560)
(504)	W R Berkley Corp	Barclays Bank	(1,300)
(237)	W R Berkley Corp	BNP Paribas	(661)
(225)	W R Berkley Corp	Citibank	(581)
(402)	W R Berkley Corp	HSBC	(1,282)
(423)	Walgreens Boots Alliance Inc	BNP Paribas	292
(203)	Walmart Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,893)
(618)	Walmart Inc	Barclays Bank	(3,393)
(687)	Walmart Inc	BNP Paribas	3,008
(247)	Walmart Inc	Citibank	(1,356)
(439)	Walmart Inc	Goldam Sachs	8,833
(532)	Walmart Inc	HSBC	10,558
(808)	Walt Disney Co	BNP Paribas	(2,876)
(2,255)	Waste Connections Inc	Barclays Bank	(4,194)
(725)	Waste Connections Inc	BNP Paribas	(624)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(660)	Waste Connections Inc	Goldam Sachs	(568)
(2,759)	Waste Management Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,256)
(496)	Waste Management Inc	BNP Paribas	(585)
(181)	Waste Management Inc	Citibank	(458)
(516)	Waste Management Inc	Goldam Sachs	(609)
(842)	Waste Management Inc	HSBC	530
582	Waters Corp	Barclays Bank	4,150
36	Waters Corp	BNP Paribas	265
27	Waters Corp	HSBC	324
(362)	Wayfair Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(2,016)
(995)	Wayfair Inc 'A'	BNP Paribas	(5,542)
(195)	Wayfair Inc 'A'	Goldam Sachs	(1,086)
(331)	Webster Financial Corp	Goldam Sachs	(685)
(215)	Wells Fargo & Co	BNP Paribas	(778)
(2,276)	Wells Fargo & Co	Goldam Sachs	(8,239)
(787)	Wells Fargo & Co	HSBC	(1,472)
(176)	Wells Fargo & Co	JP Morgan	(329)
496	West Pharmaceutical Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	5,674
22	West Pharmaceutical Services Inc	BNP Paribas	252
176	West Pharmaceutical Services Inc	Goldam Sachs	2,013
(1,199)	Western Digital Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,458)
(430)	Western Digital Corp	Barclays Bank	(1,118)
(421)	Western Digital Corp	BNP Paribas	(863)
(230)	Western Digital Corp	Citibank	(598)
(1,060)	Western Union Co	Bank of America Merrill Lynch	(848)
(570)	Western Union Co	BNP Paribas	(456)
(2,908)	Western Union Co	Citibank	(1,367)
(847)	Western Union Co	Goldam Sachs	(678)
(3,451)	Western Union Co	HSBC	(2,381)
132	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	Barclays Bank	944
242	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	BNP Paribas	2,059
134	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	JP Morgan	1,104
355	Westrock Co	Bank of America Merrill Lynch	1,534
199	Westrock Co	Barclays Bank	557
447	Westrock Co	BNP Paribas	961
596	Westrock Co	Citibank	1,862
741	Westrock Co	Goldam Sachs	1,593
214	Westrock Co	HSBC	(610)
(130)	Whirlpool Corp	Barclays Bank	(920)
(52)	Whirlpool Corp	BNP Paribas	(2)
(250)	Whirlpool Corp	Goldam Sachs	(8)
(1,582)	Williams Cos Inc	Barclays Bank	(2,531)
(3,931)	Williams Cos Inc	BNP Paribas	(8,570)
(3,319)	Williams Cos Inc	Goldam Sachs	(7,235)
(1,366)	Williams Cos Inc	HSBC	(3,934)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(836)	Willis Towers Watson Plc	Barclays Bank	(6,880)
(137)	Willis Towers Watson Plc	BNP Paribas	(1,097)
(49)	Willis Towers Watson Plc	Goldam Sachs	(392)
(392)	Wix.com Ltd	Barclays Bank	1,047
(203)	Wix.com Ltd	BNP Paribas	491
(120)	Wix.com Ltd	Goldam Sachs	290
(3)	Wix.com Ltd	HSBC	1
(77)	Wix.com Ltd	JP Morgan	28
479	Workday Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(9,978)
470	Workday Inc 'A'	Barclays Bank	(4,963)
662	Workday Inc 'A'	BNP Paribas	(13,178)
261	Workday Inc 'A'	Citibank	(2,756)
449	Workday Inc 'A'	Goldam Sachs	(9,353)
317	Workday Inc 'A'	HSBC	(6,651)
126	Workday Inc 'A'	JP Morgan	(2,369)
29	WW Grainger Inc	BNP Paribas	176
45	WW Grainger Inc	Citibank	738
38	WW Grainger Inc	Goldam Sachs	655
541	WW Grainger Inc	HSBC	3,608
102	WW Grainger Inc	JP Morgan	955
(1,295)	Wynn Resorts Ltd	Barclays Bank	(4,753)
(546)	Wynn Resorts Ltd	BNP Paribas	(912)
(272)	Wynn Resorts Ltd	Citibank	(998)
(1,174)	Wynn Resorts Ltd	Goldam Sachs	(3,167)
(696)	Xylem Inc	Barclays Bank	(2,046)
(159)	Xylem Inc	BNP Paribas	(378)
(430)	Xylem Inc	Citibank	(1,264)
(140)	Xylem Inc	Goldam Sachs	(333)
(578)	Xylem Inc	HSBC	462
(186)	Xylem Inc	JP Morgan	149
2,209	Yum! Brands Inc	Barclays Bank	12,945
126	Yum! Brands Inc	BNP Paribas	945
1,002	Yum! Brands Inc	Goldam Sachs	7,515
220	Yum! Brands Inc	JP Morgan	2,108
201	Zebra Technologies Corp 'A'	BNP Paribas	1,282
207	Zebra Technologies Corp 'A'	Goldam Sachs	1,321
(262)	Zendesk Inc	BNP Paribas	1,048
(91)	Zendesk Inc	Citibank	227
(95)	Zendesk Inc	Goldam Sachs	380
(970)	Zillow Group Inc 'C'	Bank of America Merrill Lynch	(660)
(535)	Zillow Group Inc 'C'	Barclays Bank	642
(722)	Zillow Group Inc 'C'	BNP Paribas	(491)
(234)	Zillow Group Inc 'C'	Goldam Sachs	(159)
(74)	Zimmer Biomet Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(318)
(148)	Zimmer Biomet Holdings Inc	Barclays Bank	209

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(807)	Zimmer Biomet Holdings Inc	BNP Paribas	(3,470)
(529)	Zimmer Biomet Holdings Inc	Goldam Sachs	(2,275)
(503)	Zoetis Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,253)
(214)	Zoetis Inc	Barclays Bank	(1,494)
(200)	Zoetis Inc	BNP Paribas	(896)
(250)	Zoetis Inc	Citibank	(1,745)
(564)	Zoom Video Communications Inc 'A'	Barclays Bank	(10,507)
(632)	Zoom Video Communications Inc 'A'	BNP Paribas	(12,033)
(266)	Zoom Video Communications Inc 'A'	Citibank	(4,956)
(6)	Zoom Video Communications Inc 'A'	Goldam Sachs	(114)
(190)	Zoom Video Communications Inc 'A'	HSBC	(2,968)
(2,788)	ZoomInfo Technologies Inc	BNP Paribas	5,604
41	Zscaler Inc	Barclays Bank	771
62	Zscaler Inc	BNP Paribas	1,048
71	Zscaler Inc	Goldam Sachs	1,200
			<u>(211,204)</u>
合計(基礎となるエクスポージャー総額 - 241,405,829米ドル)			<u>(853,303)</u>

0.5ユーロ未満の金額は端数切捨てにより0と表示されている。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。



種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現純評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
金融デリバティブ商品						
スワップ						
CCCDS	USD 2,462,000	ファンドはMarkit CDX.NA.HY.38 Version 1に係るデフォルト・プロ テクションを受け取り、5.000%の 固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2027	9,667	(33,367)
CCCDS	USD 9,602,000	ファンドはMarkit CDX.NA.IG.38 Version 1に係るデフォルト・プロ テクションを受け取り、1.000%の 固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2027	(6,625)	(87,700)
CCCDS	EUR 9,107,000	ファンドは1.000%の固定金利を受 け取り、Markit iTraxx Europe Series 37 Version 1に係るデフォ ルト・プロテクションを提供する	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2027	(10,596)	(57,123)
CCCDS	EUR 2,335,000	ファンドは5.000%の固定金利を受 け取り、Markit iTraxx Europe Crossover Series 37 Version 1に 係るデフォルト・プロテクション を提供する	Bank of America Merrill Lynch	20/6/2027	8,774	(61,812)
CCIRS	USD 1,250,000	ファンドは0.537%の固定金利を受 け取り、USD12ヶ月SOFRの変動金 利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/10/2030	(196,162)	(196,162)
CCIRS	EUR 7,806,000	ファンドは0.825%の固定金利を受 け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動 金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2032	(848,380)	(857,545)
CCIRS	SEK 150,574,000	ファンドは1.213%の固定金利を受 け取り、SEK 3ヶ月STIBORの変動金 利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	(953,120)	(958,073)
CCIRS	USD 317,000	ファンドは1.548%の固定金利を受 け取り、USD12ヶ月SOFRの変動金 利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	(16,370)	(16,505)
CCIRS	GBP 14,202,000	ファンドは1.570%の固定金利を受 け取り、GBP12ヶ月SONIAの変動金 利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	(614,772)	(614,851)
CCIRS	EUR 2,829,000	ファンドは1.770%の固定金利を受 け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動 金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2032	(46,755)	(46,414)
CCIRS	HKD 3,853,948	ファンドは2.056%の固定金利を受 け取り、HKD 3ヶ月HIBORの変動金 利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	(19,869)	(19,863)
CCIRS	HKD 16,756,740	ファンドは2.069%の固定金利を受 け取り、HKD 3ヶ月HIBORの変動金 利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	(85,144)	(85,120)
CCIRS	GBP 4,373,000	ファンドは2.100%の固定金利を受 け取り、GBP12ヶ月SONIAの変動金 利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	(54,612)	(53,829)
CCIRS	CAD 11,675,000	ファンドは2.265%の固定金利を受 け取り、CAD 3ヶ月CDORの変動金 利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2032	(900,141)	(899,418)
CCIRS	SEK 6,067,000	ファンドは2.380%の固定金利を受 け取り、SEK 3ヶ月STIBORの変動金 利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	(4,418)	(4,830)
CCIRS	SEK 66,300,000	ファンドは2.430%の固定金利を受 け取り、SEK 3ヶ月STIBORの変動金 利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	(32,403)	(36,970)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現純評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CCIRS	CAD 1,019,000	ファンドは2.452%の固定金利を受け取り、CAD 3ヶ月CDORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2032	(65,586)	(65,572)
CCIRS	SEK 9,586,000	ファンドは2.480%の固定金利を受け取り、SEK 3ヶ月STIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	(5,385)	(3,059)
CCIRS	USD 517,000	ファンドは2.712%の固定金利を受け取り、USD12ヶ月SOFRの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	1,101	1,107
CCIRS	CAD 144,000	ファンドは2.984%の固定金利を受け取り、CAD 3ヶ月CDORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2032	(4,089)	(4,087)
CCIRS	HKD 5,246,000	ファンドは3.076%の固定金利を受け取り、HKD 3ヶ月HIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	4,723	4,731
CCIRS	HKD 16,003,000	ファンドは3.080%の固定金利を受け取り、HKD 3ヶ月HIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	14,789	14,812
CCIRS	HKD 3,599,000	ファンドは3.150%の固定金利を受け取り、HKD 3ヶ月HIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	4,822	4,828
CCIRS	HKD 3,503,000	ファンドは3.185%の固定金利を受け取り、HKD 3ヶ月HIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	5,422	5,427
CCIRS	HKD 3,580,000	ファンドは3.220%の固定金利を受け取り、HKD 3ヶ月HIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	6,286	6,291
CCIRS	CAD 5,477,000	ファンドは3.380%の固定金利を受け取り、CAD 3ヶ月CDORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2032	(6,697)	(8,665)
CCIRS	AUD 403,000	ファンドは3.620%の固定金利を受け取り、AUD 6ヶ月BBSWの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2032	(5,002)	(4,222)
CCIRS	ZAR 14,679,000	ファンドは7.475%の固定金利を受け取り、ZAR 3ヶ月JIBARの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	(7,697)	(7,686)
CCIRS	ZAR 6,815,000	ファンドは7.485%の固定金利を受け取り、ZAR 3ヶ月JIBARの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	(3,395)	(3,389)
CCIRS	ZAR 80,240,000	ファンドは7.534%の固定金利を受け取り、ZAR 3ヶ月JIBARの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	(29,645)	(29,587)
CCIRS	ZAR 49,428,000	ファンドは7.630%の固定金利を受け取り、ZAR 3ヶ月JIBARの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	(5,806)	(5,771)
CCIRS	ZAR 10,941,000	ファンドは7.785%の固定金利を受け取り、ZAR 3ヶ月JIBARの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	3,166	3,174
CCIRS	MXN 20,251,000	ファンドは8.120%の固定金利を受け取り、MXN 1ヶ月TIEの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2027	(18,579)	(18,568)
CCIRS	MXN 10,652,000	ファンドは8.328%の固定金利を受け取り、MXN 1ヶ月TIEの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2027	(5,288)	(5,282)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現純評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CCIRS	MXN 10,410,000	ファンドは8.412%の固定金利を受け取り、MXN 1ヶ月T1IEの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2027	(3,373)	(3,367)
CCIRS	MXN 17,003,000	ファンドは8.605%の固定金利を受け取り、MXN 1ヶ月T1IEの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2027	1,133	1,142
CCIRS	MXN 15,481,000	ファンドは8.610%の固定金利を受け取り、MXN 1ヶ月T1IEの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2027	1,189	1,197
CCIRS	MXN 23,773,000	ファンドは8.640%の固定金利を受け取り、MXN 1ヶ月T1IEの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2027	3,272	3,285
CCIRS	MXN 20,924,000	ファンドは8.645%の固定金利を受け取り、MXN 1ヶ月T1IEの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2027	3,092	3,104
CCIRS	MXN 11,354,000	ファンドは8.670%の固定金利を受け取り、MXN 1ヶ月T1IEの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2027	2,254	2,260
CCIRS	MXN 71,396,000	ファンドは8.725%の固定金利を受け取り、MXN 1ヶ月T1IEの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2027	22,140	22,180
CCIRS	MXN 27,462,000	ファンドは8.825%の固定金利を受け取り、MXN 1ヶ月T1IEの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2027	14,088	14,103
CCIRS	MXN 9,509,000	ファンドは9.228%の固定金利を受け取り、MXN 1ヶ月T1IEの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/9/2027	12,644	12,649
CCIRS	AUD 661,000	ファンドはAUD 6ヶ月BBSWの変動金利を受け取り、3.470%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	4,137	3,806
CCIRS	CAD 22,061,000	ファンドはCAD 3ヶ月CDORの変動金利を受け取り、2.070%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	916,246	915,179
CCIRS	CAD 69,000	ファンドはCAD 3ヶ月CDORの変動金利を受け取り、2.251%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	2,407	2,408
CCIRS	CAD 1,599,000	ファンドはCAD 3ヶ月CDORの変動金利を受け取り、2.851%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	20,845	20,859
CCIRS	CAD 10,160,000	ファンドはCAD 3ヶ月CDORの変動金利を受け取り、3.250%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	(15,636)	(15,080)
CCIRS	EUR 14,817,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、0.540%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	842,587	852,750
CCIRS	EUR 5,406,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、1.520%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	37,778	37,760
CCIRS	GBP 7,509,500	ファンドはGBP12ヶ月SONIAの変動金利を受け取り、1.340%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2032	685,739	686,204
CCIRS	GBP 2,342,000	ファンドはGBP12ヶ月SONIAの変動金利を受け取り、1.900%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2032	68,387	68,062

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現純評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CCIRS	PLN 66,955,196	ファンドはPLN 6ヶ月WIBORの変動金利を受け取り、4.350%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	1,458,414	1,458,577
CCIRS	PLN 27,708,000	ファンドはPLN 6ヶ月WIBORの変動金利を受け取り、6.195%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	118,207	118,277
CCIRS	PLN 156,000	ファンドはPLN 6ヶ月WIBORの変動金利を受け取り、6.320%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	480	481
CCIRS	SEK 80,019,000	ファンドはSEK 3ヶ月STIBORの変動金利を受け取り、1.420%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2032	851,089	855,248
CCIRS	SEK 3,112,000	ファンドはSEK 3ヶ月STIBORの変動金利を受け取り、2.485%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2032	3,912	3,478
CCIRS	SEK 4,816,000	ファンドはSEK 3ヶ月STIBORの変動金利を受け取り、2.520%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2032	5,810	3,868
CCIRS	SEK 35,224,000	ファンドはSEK 3ヶ月STIBORの変動金利を受け取り、2.530%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2032	36,468	25,129
CCIRS	SGD 514,000	ファンドはSGD 6ヶ月SORAの変動金利を受け取り、1.978%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	9,119	9,123
CCIRS	SGD 1,066,000	ファンドはSGD 6ヶ月SORAの変動金利を受け取り、2.205%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	10,657	10,665
CCIRS	SGD 364,500	ファンドはSGD 6ヶ月SORAの変動金利を受け取り、2.276%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	2,763	2,766
CCIRS	SGD 850,500	ファンドはSGD 6ヶ月SORAの変動金利を受け取り、2.285%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	6,186	6,193
CCIRS	SGD 833,000	ファンドはSGD 6ヶ月SORAの変動金利を受け取り、2.330%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	4,783	4,790
CCIRS	SGD 297,559	ファンドはSGD 6ヶ月SORAの変動金利を受け取り、2.359%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	1,415	1,417
CCIRS	SGD 323,789	ファンドはSGD 6ヶ月SORAの変動金利を受け取り、2.374%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	1,374	1,377
CCIRS	SGD 198,372	ファンドはSGD 6ヶ月SORAの変動金利を受け取り、2.376%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	825	827
CCIRS	SGD 368,280	ファンドはSGD 6ヶ月SORAの変動金利を受け取り、2.378%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	1,513	1,516
CCIRS	SGD 1,470,000	ファンドはSGD 6ヶ月SORAの変動金利を受け取り、2.44%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	2,936	2,948
CCIRS	SGD 2,122,000	ファンドはSGD 6ヶ月SORAの変動金利を受け取り、2.455%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	3,155	3,173

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現純評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CCIRS	SGD 5,383,260	ファンドはSGD 6ヶ月SORAの変動金利を受け取り、2.482%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	2,966	3,009
CCIRS	SGD 1,262,740	ファンドはSGD 6ヶ月SORAの変動金利を受け取り、2.485%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	588	598
CCIRS	SGD 1,161,000	ファンドはSGD 6ヶ月SORAの変動金利を受け取り、2.490%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	343	353
CCIRS	SGD 874,000	ファンドはSGD 6ヶ月SORAの変動金利を受け取り、2.505%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	(188)	(181)
CCIRS	SGD 2,060,000	ファンドはSGD 6ヶ月SORAの変動金利を受け取り、2.510%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	(793)	(777)
CCIRS	SGD 743,270	ファンドはSGD 6ヶ月SORAの変動金利を受け取り、2.547%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	(1,222)	(1,216)
CCIRS	SGD 532,730	ファンドはSGD 6ヶ月SORAの変動金利を受け取り、2.549%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	(912)	(908)
CCIRS	SGD 1,967,000	ファンドはSGD 6ヶ月SORAの変動金利を受け取り、2.555%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	(3,771)	(3,755)
CCIRS	SGD 1,123,000	ファンドはSGD 6ヶ月SORAの変動金利を受け取り、2.575%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	(2,917)	(2,908)
CCIRS	SGD 717,000	ファンドはSGD 6ヶ月SORAの変動金利を受け取り、2.580%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	(1,985)	(1,979)
CCIRS	SGD 1,102,000	ファンドはSGD 6ヶ月SORAの変動金利を受け取り、2.732%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	(8,752)	(8,743)
CCIRS	USD 323,000	ファンドはUSD12ヶ月FEDLの変動金利を受け取り、0.554%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/10/2030	24,591	50,322
CCIRS	USD 1,357,000	ファンドはUSD12ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、1.612%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2032	127,637	128,398
IRS	INR 738,557,000	ファンドは6.173%の固定金利を受け取り、INR 6ヶ月MIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	(397,333)	(397,333)
IRS	INR 340,920,000	ファンドは7.229%の固定金利を受け取り、INR 6ヶ月MIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	15,646	15,646
IRS	CNY 6,574,000	ファンドはCNY 3ヶ月CNRRの変動金利を受け取り、2.425%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	1,317	1,317
IRS	CNY 3,580,000	ファンドはCNY 3ヶ月CNRRの変動金利を受け取り、2.458%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	(69)	(69)
IRS	KRW 1,444,066,000	ファンドはKRW 3ヶ月KWDCDの変動金利を受け取り、3.177%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/9/2027	1,950	1,950

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現純評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
IRS	CNY 10,924,000	ファンドはCNY 3ヶ月CNRRの変動金利を受け取り、2.494%の固定金利を支払う	JP Morgan	21/9/2027	(2,907)	(2,907)
IRS	THB 65,233,000	ファンドはTHB 6ヶ月THBXFの変動金利を受け取り、1.840%の固定金利を支払う	Morgan Stanley	21/9/2027	66,746	66,746
TRS	BRL 7,875,658	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、Ibovespa Index Futuresを支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/6/2022	101,786	101,786
TRS	BRL 799,392	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、Ibovespa Index Futuresを支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/6/2022	3,161	3,161
TRS	BRL 887,605	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、Ibovespa Index Futuresを支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/6/2022	(1,913)	(1,913)
TRS	BRL 993,958	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、Ibovespa Index Futuresを支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/6/2022	(3,129)	(3,129)
TRS	BRL 3,183,183	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、Ibovespa Index Futuresを支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/6/2022	(38,074)	(38,074)
TRS	BRL 1,982,625	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、Ibovespa Index Futuresを支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/6/2022	(7,383)	(7,383)
TRS	BRL 2,315,448	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、Ibovespa Index Futuresを支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/6/2022	(8,107)	(8,107)
TRS	KRW 4,008,697,875	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、KOSPI 200 Index Futuresを支払う	Bank of America Merrill Lynch	9/6/2022	19,811	19,811
TRS	KRW 3,515,593,000	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、KOSPI 200 Index Futuresを支払う	Bank of America Merrill Lynch	9/6/2022	(20,940)	(20,940)
TRS	KRW 265,392,600	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、KOSPI 200 Index Futuresを支払う	Bank of America Merrill Lynch	9/6/2022	(178)	(178)
TRS	KRW 725,438,200	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、KOSPI 200 Index Futuresを支払う	Bank of America Merrill Lynch	9/6/2022	13,852	13,852
TRS	KRW 272,986,650	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、KOSPI 200 Index Futuresを支払う	Bank of America Merrill Lynch	9/6/2022	5,960	5,960
TRS	KRW 1,548,128,375	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、KOSPI 200 Index Futuresを支払う	Bank of America Merrill Lynch	9/6/2022	34,749	34,749
TRS	KRW 894,116,500	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、KOSPI 200 Index Futuresを支払う	Bank of America Merrill Lynch	9/6/2022	7,066	7,066
TRS	KRW 445,464,750	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、KOSPI 200 Index Futuresを支払う	Bank of America Merrill Lynch	9/6/2022	2,245	2,245
TRS	KRW 442,814,125	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、KOSPI 200 Index Futuresを支払う	Bank of America Merrill Lynch	9/6/2022	102	102

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現純評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
TRS	KRW 171,867,150	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、KOSPI 200 Index Futuresを支払う	Bank of America Merrill Lynch	9/6/2022	(4,209)	(4,209)
TRS	KRW 864,827,000	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、KOSPI 200 Index Futuresを支払う	Bank of America Merrill Lynch	9/6/2022	(16,608)	(16,608)
TRS	KRW 1,355,947,600	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、KOSPI 200 Index Futuresを支払う	Bank of America Merrill Lynch	9/6/2022	(49,024)	(49,024)
TRS	KRW 1,495,473,000	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、KOSPI 200 Index Futuresを支払う	Bank of America Merrill Lynch	9/6/2022	(7,812)	(7,812)
TRS	THB 1,369,868	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、SET50 Index Futuresを支払う	Bank of America Merrill Lynch	29/6/2022	(799)	(799)
TRS	THB 7,454,846	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、SET50 Index Futuresを支払う	Bank of America Merrill Lynch	29/6/2022	(9,630)	(9,630)
TRS	THB 17,264,369	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、SET50 Index Futuresを支払う	Bank of America Merrill Lynch	29/6/2022	(26,278)	(26,278)
TRS	THB 4,461,552	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、SET50 Index Futuresを支払う	Bank of America Merrill Lynch	29/6/2022	(3,777)	(3,777)
TRS	THB 18,998,478	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、SET50 Index Futuresを支払う	Bank of America Merrill Lynch	29/6/2022	(10,600)	(10,600)
TRS	TWD 22,965,880	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、TAIEX Index Futuresを支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/6/2022	13,351	13,351
TRS	TWD 69,945,809	ファンドはTAIEX Index Futuresを受け取り、0.000%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	15/6/2022	118,884	118,884
TRS	PLN 1,170,442	ファンドはWIG20 Index Futuresを受け取り、0.000%の固定金利を支払う	HSBC	17/6/2022	(31,112)	(31,112)
TRS	PLN 1,139,725	ファンドはWIG20 Index Futuresを受け取り、0.000%の固定金利を支払う	HSBC	17/6/2022	(32,599)	(32,599)
TRS	PLN 2,582,333	ファンドはWIG20 Index Futuresを受け取り、0.000%の固定金利を支払う	HSBC	17/6/2022	(66,698)	(66,698)
合計(基礎となるエクスポージャー総額 - 32,599,518米ドル)					1,053,281	822,914

CCCDs：中央決済機関で決済されるクレジット・デフォルト・スワップ

CCIRS：中央決済機関で決済される金利スワップ

IRS：金利スワップ

TRS：トータル・リターン・スワップ

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

契約数	契約通貨	契約 / 摘要	満期日	基礎となる エクスポ ージャー総額 (米ドル)	未実現純評価益 / (損) (米ドル)
金融デリバティブ商品					
先物取引					
76	EUR	Amsterdam Index Futures June 2022	2022年6月	11,608,964	257,897
438	AUD	Australian 10 Year Bond Futures June 2022	2022年6月	38,427,542	(1,934,930)
163	EUR	CAC 40 Index Futures June 2022	2022年6月	11,274,809	129,578
(511)	CAD	Canadian 10 Year Bond Futures September 2022	2022年9月	51,324,309	387,329
(15)	EUR	DAX Index Futures June 2022	2022年6月	5,774,305	(108,919)
(20)	USD	E- Mini S&P 500 Index Futures June 2022	2022年6月	4,115,000	257,595
178	EUR	Euro Bund Futures June 2022	2022年6月	28,886,489	(255,738)
(135)	GBP	FTSE 100 Index Futures June 2022	2022年6月	12,931,614	(166,674)
326	USD	FTSE China A50 Index Futures June 2022	2022年6月	4,419,256	169,115
85	EUR	FTSE MIB Index Futures June 2022	2022年6月	11,154,390	184,871
(141)	ZAR	FTSE/JSE Top 40 Index Futures June 2022	2022年6月	5,918,591	(262,701)
32	EUR	IBEX 35 Index Futures June 2022	2022年6月	3,032,751	110,531
(2)	JPY	Japan 10 Year Bond Futures June 2022	2022年6月	2,324,389	5,359
77	USD	MSCI Hong Kong Index Futures June 2022	2022年6月	5,153,225	98,851
(303)	SGD	MSCI Singapore Index Futures June 2022	2022年6月	6,636,827	(38,134)
(403)	SEK	OMX Stockholm 30 Index Futures June 2022	2022年6月	8,462,128	(158,996)
(17)	CAD	S&P/TSX 60 Index Futures June 2022	2022年6月	3,378,890	91,399
156	USD	SGX NIFTY 50 Index Futures June 2022	2022年6月	5,166,720	79,998
(54)	AUD	SPI 200 Index Futures June 2022	2022年6月	6,989,129	113,824
43	CHF	Swiss Market Index Futures June 2022	2022年6月	5,204,367	(125,128)
71	JPY	Topix Index Futures June 2022	2022年6月	10,526,075	(69,560)
(112)	GBP	UK Long Gilt Bond Futures September 2022	2022年9月	16,386,654	288,344
16	USD	US Treasury 10 Year Note Futures September 2022	2022年9月	1,910,000	(14,026)
合計					(960,115)

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。



通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
金融デリバティブ商品						
未決済先渡為替予約						
AUD	870,000	USD	654,884	Deutsche Bank	15/6/2022	(30,236)
AUD	3,119,000	USD	2,246,388	Goldman Sachs	15/6/2022	(6,991)
AUD	1,126,000	USD	842,784	JP Morgan	15/6/2022	(34,331)
AUD	5,291,000	USD	3,862,600	Morgan Stanley	15/6/2022	(63,738)
AUD	473,000	USD	350,033	Standard Chartered Bank	15/6/2022	(10,426)
AUD	2,451,000	USD	1,769,434	Morgan Stanley	20/7/2022	(8,715)
AUD	472,000	USD	349,550	UBS	20/7/2022	(10,480)
AUD	358,000	USD	246,722	Morgan Stanley	17/8/2022	10,542
BRL	17,674,000	USD	3,424,126	Bank of America Merrill Lynch	15/6/2022	320,044
BRL	5,493,000	USD	1,114,691	BNP Paribas	15/6/2022	48,979
BRL	453,000	USD	87,198	Goldman Sachs	15/6/2022	8,769
BRL	522,000	USD	100,206	Barclays Bank	20/7/2022	9,301
BRL	1,363,000	USD	266,887	HSBC	20/7/2022	19,047
BRL	17,640,000	USD	3,634,266	Morgan Stanley	20/7/2022	66,306
BRL	13,685,000	USD	2,622,994	HSBC	17/8/2022	223,913
BRL	527,000	USD	100,332	UBS	17/8/2022	9,301
CAD	9,626,000	USD	7,577,777	Bank of America Merrill Lynch	15/6/2022	34,844
CAD	310,000	USD	245,749	JP Morgan	15/6/2022	(589)
CAD	1,228,000	USD	976,766	Morgan Stanley	15/6/2022	(5,615)
CAD	205,000	USD	159,990	UBS	15/6/2022	2,132
CAD	142,000	USD	112,536	Bank of America Merrill Lynch	20/7/2022	(254)
CAD	7,570,000	USD	6,030,575	JP Morgan	20/7/2022	(44,848)
CAD	586,000	USD	457,503	Standard Chartered Bank	20/7/2022	5,857
CAD	5,494,000	USD	4,259,360	Deutsche Bank	17/8/2022	84,396
CAD	586,000	USD	457,464	Standard Chartered Bank	17/8/2022	5,849
CHF	1,623,000	EUR	1,595,187	Morgan Stanley	15/6/2022	(17,265)
CHF	600,000	USD	633,759	Deutsche Bank	15/6/2022	(8,024)
CLP	19,842,382	USD	24,154	Bank of America Merrill Lynch	15/6/2022	(208)
CLP	630,591,000	USD	755,746	BNP Paribas	15/6/2022	5,268
CLP	209,752,000	USD	250,268	Deutsche Bank	15/6/2022	2,866
CLP	516,159,618	USD	624,937	Goldman Sachs	15/6/2022	(2,023)
CLP	55,141,000	USD	63,687	Bank of America Merrill Lynch	20/7/2022	2,398
CLP	50,661,000	USD	59,383	Barclays Bank	20/7/2022	1,334
CLP	357,529,000	USD	430,862	BNP Paribas	20/7/2022	(2,369)
CLP	44,984,000	USD	53,616	Goldman Sachs	20/7/2022	297
CLP	83,090,000	USD	95,092	HSBC	20/7/2022	4,490
CLP	148,806,000	USD	176,104	Morgan Stanley	20/7/2022	2,238
CLP	50,948,000	USD	59,401	Barclays Bank	17/8/2022	1,326
CLP	45,220,000	USD	53,610	Morgan Stanley	17/8/2022	290
CNH	4,152,000	USD	638,868	Bank of America Merrill Lynch	15/6/2022	(17,062)
CNH	2,321,000	USD	362,836	Barclays Bank	15/6/2022	(15,241)

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)
CNH	3,177,000	USD	497,188	BNP Paribas	15/6/2022	(21,398)
CNH	2,256,000	USD	351,150	Morgan Stanley	15/6/2022	(13,289)
CNH	8,265,000	USD	1,291,670	Standard Chartered Bank	15/6/2022	(53,899)
CNH	3,428,000	USD	523,652	Morgan Stanley	20/7/2022	(10,787)
EUR	605,544	CHF	615,000	Morgan Stanley	15/6/2022	7,703
EUR	329,312	CHF	338,000	Societe Generale	15/6/2022	491
EUR	35,000	USD	36,491	Citibank	15/6/2022	1,026
EUR	106,000	USD	115,243	Deutsche Bank	15/6/2022	(1,622)
EUR	1,154,000	USD	1,257,491	HSBC	15/6/2022	(20,522)
EUR	2,617,000	USD	2,920,543	JP Morgan	15/6/2022	(115,388)
EUR	175,000	USD	191,164	Morgan Stanley	15/6/2022	(3,582)
EUR	985,000	USD	1,040,428	Standard Chartered Bank	15/6/2022	15,390
EUR	178,000	USD	193,997	UBS	15/6/2022	(3,199)
EUR	106,000	USD	115,471	Deutsche Bank	20/7/2022	(1,632)
EUR	210,000	USD	222,257	Morgan Stanley	20/7/2022	3,272
EUR	808,000	USD	854,870	Standard Chartered Bank	20/7/2022	12,883
EUR	592,000	USD	628,296	JP Morgan	17/8/2022	8,523
EUR	34,000	USD	35,583	Standard Chartered Bank	17/8/2022	991
GBP	2,337,000	USD	3,021,348	Bank of America Merrill Lynch	15/6/2022	(79,295)
GBP	257,000	USD	322,911	Deutsche Bank	15/6/2022	627
GBP	226,000	USD	296,038	HSBC	15/6/2022	(11,526)
GBP	436,000	USD	572,196	JP Morgan	15/6/2022	(23,316)
GBP	1,083,000	USD	1,421,827	Morgan Stanley	15/6/2022	(58,438)
GBP	1,323,000	USD	1,740,679	UBS	15/6/2022	(75,152)
GBP	360,000	USD	455,124	Bank of America Merrill Lynch	20/7/2022	(1,797)
GBP	84,000	USD	109,470	Deutsche Bank	20/7/2022	(3,694)
GBP	2,090,000	USD	2,745,620	Morgan Stanley	20/7/2022	(113,801)
GBP	173,000	USD	213,561	Standard Chartered Bank	20/7/2022	4,289
GBP	2,125,000	USD	2,626,224	HSBC	17/8/2022	50,324
HUF	797,029,000	USD	2,277,399	Goldman Sachs	15/6/2022	(121,313)
HUF	89,787,000	USD	260,720	HSBC	15/6/2022	(17,833)
HUF	74,247,000	USD	215,198	JP Morgan	15/6/2022	(14,348)
HUF	46,202,000	USD	131,675	Morgan Stanley	15/6/2022	(6,691)
HUF	51,820,000	USD	154,507	UBS	15/6/2022	(14,326)
HUF	314,054,000	USD	900,022	Bank of America Merrill Lynch	20/7/2022	(54,551)
HUF	211,017,000	USD	591,068	Goldman Sachs	20/7/2022	(22,984)
HUF	19,968,000	USD	54,415	HSBC	20/7/2022	(658)
HUF	374,960,000	USD	1,022,194	HSBC	17/8/2022	(16,653)
INR	4,339,000	USD	55,916	Bank of America Merrill Lynch	15/6/2022	(134)
INR	6,062,000	USD	78,036	Barclays Bank	15/6/2022	(104)
INR	1,036,609,000	USD	13,275,898	BNP Paribas	15/6/2022	50,615
INR	22,954,000	USD	300,090	Deutsche Bank	15/6/2022	(4,996)
INR	20,566,000	USD	268,298	JP Morgan	15/6/2022	(3,904)
INR	9,785,000	USD	127,196	Standard Chartered Bank	15/6/2022	(1,401)
INR	3,772,000	USD	49,088	UBS	15/6/2022	(596)

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)
INR	3,465,000	USD	44,503	Citibank	20/7/2022	(119)
INR	878,568,570	USD	11,419,447	HSBC	20/7/2022	(165,492)
INR	4,803,000	USD	62,283	Morgan Stanley	20/7/2022	(759)
INR	10,435,000	USD	133,907	Standard Chartered Bank	20/7/2022	(241)
INR	6,101,000	USD	78,036	Deutsche Bank	17/8/2022	(111)
INR	848,528,740	USD	10,900,794	Goldman Sachs	17/8/2022	(62,861)
INR	4,366,000	USD	55,902	Standard Chartered Bank	17/8/2022	(137)
INR	3,478,000	USD	44,532	UBS	17/8/2022	(108)
JPY	135,464,000	USD	1,106,687	Bank of America Merrill Lynch	15/6/2022	(54,189)
JPY	100,000,000	USD	783,816	HSBC	15/6/2022	(6,859)
JPY	311,708,000	USD	2,551,697	JP Morgan	15/6/2022	(129,858)
JPY	843,420,000	USD	7,299,695	Morgan Stanley	15/6/2022	(746,683)
JPY	21,257,000	USD	165,791	Bank of America Merrill Lynch	20/7/2022	(377)
JPY	20,337,000	USD	161,159	HSBC	20/7/2022	(2,904)
JPY	25,884,000	USD	206,283	JP Morgan	20/7/2022	(4,864)
JPY	935,997,000	USD	7,489,968	Morgan Stanley	20/7/2022	(206,412)
JPY	530,399,000	USD	4,082,495	Bank of America Merrill Lynch	17/8/2022	51,093
JPY	20,305,000	USD	161,163	HSBC	17/8/2022	(2,919)
KRW	490,346,363	USD	396,350	Bank of America Merrill Lynch	15/6/2022	(1,659)
KRW	691,868,637	USD	557,604	Barclays Bank	15/6/2022	(705)
KRW	1,021,066,000	USD	828,001	BNP Paribas	15/6/2022	(6,123)
KRW	690,750,000	USD	559,475	HSBC	15/6/2022	(3,476)
KRW	471,176,000	USD	373,558	JP Morgan	15/6/2022	5,702
KRW	620,478,000	USD	503,584	Morgan Stanley	15/6/2022	(4,149)
KRW	790,787,000	USD	624,338	Standard Chartered Bank	15/6/2022	12,183
KRW	66,837,000	USD	53,830	UBS	15/6/2022	(32)
KRW	470,979,000	USD	373,425	Barclays Bank	20/7/2022	5,807
KRW	1,259,927,000	USD	1,001,938	BNP Paribas	20/7/2022	12,556
KRW	466,391,000	USD	366,508	HSBC	20/7/2022	9,030
KRW	66,782,000	USD	53,813	UBS	20/7/2022	(40)
KRW	790,203,000	USD	624,000	Bank of America Merrill Lynch	17/8/2022	12,374
KRW	813,424,000	USD	642,035	HSBC	17/8/2022	13,041
MXN	353,066,000	USD	16,457,038	Goldman Sachs	15/6/2022	1,504,482
MXN	9,737,000	USD	489,687	HSBC	15/6/2022	5,663
MXN	2,761,000	USD	129,499	JP Morgan	15/6/2022	10,962
MXN	5,428,000	USD	251,103	UBS	15/6/2022	25,036
MXN	2,000,000	USD	98,661	Citibank	20/7/2022	2,397
MXN	4,270,000	USD	215,579	Goldman Sachs	20/7/2022	179
MXN	6,754,000	USD	337,343	HSBC	20/7/2022	3,930
MXN	3,222,000	USD	157,129	JP Morgan	20/7/2022	5,675
MXN	2,332,000	USD	111,546	Morgan Stanley	20/7/2022	6,288
MXN	4,270,000	USD	214,404	Goldman Sachs	17/8/2022	174
MXN	6,758,000	USD	335,742	HSBC	17/8/2022	3,864
NOK	792,000	USD	81,452	Citibank	15/6/2022	2,620

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
NOK	8,238,000	USD	919,893	Goldman Sachs	15/6/2022	(45,416)
NOK	24,774,000	USD	2,767,305	JP Morgan	15/6/2022	(137,504)
NOK	4,016,000	USD	437,962	Morgan Stanley	15/6/2022	(11,656)
NOK	5,136,000	USD	590,398	Societe Generale	15/6/2022	(45,203)
NOK	791,000	USD	81,382	Citibank	20/7/2022	2,615
NOK	22,719,000	USD	2,585,001	JP Morgan	20/7/2022	(172,462)
NOK	2,416,000	USD	257,037	Morgan Stanley	20/7/2022	(481)
NOK	18,672,000	USD	1,973,892	Bank of America Merrill Lynch	17/8/2022	9,816
NOK	791,000	USD	81,403	JP Morgan	17/8/2022	2,633
NZD	89,000	USD	61,108	Bank of America Merrill Lynch	15/6/2022	(3,205)
NZD	779,000	USD	541,818	Barclays Bank	15/6/2022	(35,005)
NZD	233,000	USD	150,194	Deutsche Bank	15/6/2022	1,395
NZD	953,000	USD	610,529	JP Morgan	15/6/2022	9,488
NZD	4,356,000	USD	2,936,021	Morgan Stanley	15/6/2022	(102,034)
NZD	233,000	USD	150,139	Deutsche Bank	20/7/2022	1,374
NZD	720,000	USD	450,190	JP Morgan	20/7/2022	18,004
NZD	2,060,000	USD	1,356,792	Morgan Stanley	20/7/2022	(17,237)
NZD	720,000	USD	450,046	JP Morgan	17/8/2022	17,918
NZD	910,000	USD	585,990	Morgan Stanley	17/8/2022	5,466
PLN	2,840,000	USD	650,619	JP Morgan	15/6/2022	13,785
PLN	1,907,000	USD	432,873	Morgan Stanley	15/6/2022	13,261
PLN	866,000	USD	193,048	UBS	15/6/2022	9,548
PLN	682,000	USD	157,908	Citibank	20/7/2022	867
PLN	684,000	USD	151,250	JP Morgan	20/7/2022	7,990
PLN	3,690,000	USD	847,693	Morgan Stanley	20/7/2022	11,368
PLN	687,000	USD	151,320	Goldman Sachs	17/8/2022	7,984
SEK	5,654,000	USD	593,885	Citibank	15/6/2022	(17,983)
SEK	1,250,000	USD	133,179	Deutsche Bank	15/6/2022	(5,857)
SEK	1,092,000	USD	109,410	Goldman Sachs	15/6/2022	1,819
SEK	3,451,000	USD	350,755	HSBC	15/6/2022	755
SEK	15,796,000	USD	1,638,446	JP Morgan	15/6/2022	(29,505)
SEK	7,235,000	USD	757,145	Morgan Stanley	15/6/2022	(20,205)
SEK	11,443,000	USD	1,146,684	Societe Generale	15/6/2022	18,870
SEK	5,340,000	USD	575,619	UBS	15/6/2022	(31,701)
SEK	4,093,000	USD	428,201	Citibank	20/7/2022	(10,821)
SEK	3,446,000	USD	350,777	HSBC	20/7/2022	626
SEK	10,653,000	USD	1,095,420	JP Morgan	20/7/2022	(9,091)
SEK	4,269,000	USD	436,354	JP Morgan	17/8/2022	(607)
SGD	753,000	USD	551,473	Bank of America Merrill Lynch	15/6/2022	(2,256)
SGD	8,963,000	USD	6,572,512	Barclays Bank	15/6/2022	(35,148)
SGD	669,000	USD	487,759	BNP Paribas	15/6/2022	191
SGD	216,000	USD	156,348	Goldman Sachs	15/6/2022	1,197
SGD	242,000	USD	174,940	Morgan Stanley	15/6/2022	1,568
SGD	1,864,000	USD	1,343,506	Societe Generale	15/6/2022	16,044
SGD	375,000	USD	274,007	Bank of America Merrill Lynch	20/7/2022	(505)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
SGD	2,919,000	USD	2,118,377	BNP Paribas	20/7/2022	10,561
SGD	458,000	USD	331,324	Goldman Sachs	20/7/2022	2,713
SGD	378,000	USD	277,513	HSBC	20/7/2022	(1,823)
SGD	9,000	USD	6,646	Societe Generale	20/7/2022	(82)
SGD	375,000	USD	274,046	Bank of America Merrill Lynch	17/8/2022	(521)
SGD	2,919,000	USD	2,118,727	BNP Paribas	17/8/2022	10,390
THB	108,931,000	USD	3,230,277	Barclays Bank	15/6/2022	(46,056)
THB	42,395,000	USD	1,277,979	Goldman Sachs	15/6/2022	(38,708)
THB	2,362,000	USD	70,242	HSBC	15/6/2022	(1,197)
THB	42,758,000	USD	1,239,641	Standard Chartered Bank	15/6/2022	10,242
THB	11,121,000	USD	331,948	UBS	15/6/2022	(6,864)
THB	52,036,000	USD	1,523,458	Barclays Bank	20/7/2022	(716)
THB	6,110,000	USD	177,849	HSBC	20/7/2022	949
THB	7,494,000	USD	220,023	Morgan Stanley	20/7/2022	(724)
THB	82,535,000	USD	2,450,740	Societe Generale	20/7/2022	(35,500)
THB	36,612,000	USD	1,061,525	Standard Chartered Bank	20/7/2022	9,859
THB	131,422,000	USD	3,830,741	Bank of America Merrill Lynch	17/8/2022	19,379
THB	2,094,000	USD	61,585	Barclays Bank	17/8/2022	(239)
THB	13,595,000	USD	397,901	Societe Generale	17/8/2022	375
THB	28,600,000	USD	825,695	Standard Chartered Bank	17/8/2022	12,167
TWD	8,743,000	USD	294,933	BNP Paribas	15/6/2022	6,660
TWD	28,838,000	USD	1,002,706	Deutsche Bank	15/6/2022	(7,928)
TWD	12,709,000	USD	426,505	JP Morgan	15/6/2022	11,897
TWD	8,615,000	USD	291,582	Standard Chartered Bank	15/6/2022	5,596
TWD	8,588,000	USD	291,524	Goldman Sachs	20/7/2022	5,676
TWD	18,676,000	USD	632,316	HSBC	20/7/2022	13,993
TWD	12,674,000	USD	426,381	Morgan Stanley	20/7/2022	12,221
TWD	12,642,000	USD	426,311	Deutsche Bank	17/8/2022	12,230
TWD	17,267,000	USD	586,277	HSBC	17/8/2022	12,702
USD	9,337,799	AUD	12,604,000	Bank of America Merrill Lynch	15/6/2022	288,308
USD	935,409	AUD	1,251,000	Deutsche Bank	15/6/2022	37,209
USD	403,736	AUD	550,000	Goldman Sachs	15/6/2022	8,844
USD	1,624,627	AUD	2,248,000	Morgan Stanley	15/6/2022	10,595
USD	417,560	AUD	565,000	UBS	15/6/2022	11,899
USD	6,003,971	AUD	8,047,000	Citibank	20/7/2022	223,269
USD	543,240	AUD	761,000	Morgan Stanley	20/7/2022	(3,437)
USD	139,556	AUD	195,000	Standard Chartered Bank	20/7/2022	(526)
USD	4,678,344	AUD	6,587,000	Goldman Sachs	17/8/2022	(55,160)
USD	359,326	BRL	1,841,000	Bank of America Merrill Lynch	15/6/2022	(30,683)
USD	302,230	BRL	1,446,000	Barclays Bank	15/6/2022	(4,100)
USD	1,399,182	BRL	7,027,000	BNP Paribas	15/6/2022	(89,463)
USD	300,696	BRL	1,571,000	Citibank	15/6/2022	(32,115)
USD	262,338	BRL	1,318,000	Goldman Sachs	15/6/2022	(16,875)
USD	111,259	BRL	579,000	HSBC	15/6/2022	(11,400)
USD	163,158	BRL	779,000	Morgan Stanley	15/6/2022	(1,870)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
USD	782,230	BRL	3,894,000	Barclays Bank	20/7/2022	(34,665)
USD	885,838	BRL	4,531,000	BNP Paribas	20/7/2022	(64,688)
USD	207,125	BRL	1,000,000	Goldman Sachs	20/7/2022	(2,658)
USD	155,809	BRL	787,000	HSBC	20/7/2022	(9,290)
USD	657,884	BRL	3,316,000	Barclays Bank	17/8/2022	(31,947)
USD	207,255	BRL	1,009,000	HSBC	17/8/2022	(2,649)
USD	124,725	BRL	612,000	UBS	17/8/2022	(2,590)
USD	512,286	CAD	641,000	Barclays Bank	15/6/2022	5,358
USD	1,598,462	CAD	2,049,000	BNP Paribas	15/6/2022	(21,968)
USD	861,875	CAD	1,101,000	Goldman Sachs	15/6/2022	(8,839)
USD	2,824,496	CAD	3,628,000	Morgan Stanley	15/6/2022	(44,670)
USD	97,349	CAD	125,000	Standard Chartered Bank	15/6/2022	(1,506)
USD	512,235	CAD	641,000	Barclays Bank	20/7/2022	5,385
USD	910,496	CAD	1,165,000	BNP Paribas	20/7/2022	(10,689)
USD	342,204	CAD	440,000	HSBC	20/7/2022	(5,712)
USD	1,666,452	CAD	2,149,000	Morgan Stanley	20/7/2022	(32,798)
USD	910,419	CAD	1,165,000	BNP Paribas	17/8/2022	(10,672)
USD	705,331	CAD	918,000	Morgan Stanley	17/8/2022	(20,474)
USD	1,699,630	CHF	1,566,000	JP Morgan	15/6/2022	66,463
USD	281,507	CLP	230,273,000	Bank of America Merrill Lynch	15/6/2022	3,608
USD	549,991	CLP	445,417,532	BNP Paribas	15/6/2022	12,449
USD	453,923	CLP	395,821,000	Credit Suisse	15/6/2022	(23,763)
USD	220,928	CLP	186,092,000	Deutsche Bank	15/6/2022	(3,652)
USD	3,857,804	CLP	3,167,836,000	Goldman Sachs	15/6/2022	34,782
USD	118,987	CLP	94,138,468	Morgan Stanley	15/6/2022	5,378
USD	4,125,292	CLP	3,403,180,000	Barclays Bank	20/7/2022	46,639
USD	453,914	CLP	398,605,000	Credit Suisse	20/7/2022	(23,807)
USD	96,465	CLP	84,216,000	Morgan Stanley	20/7/2022	(4,466)
USD	124,437	CLP	103,627,000	Barclays Bank	17/8/2022	918
USD	454,293	CLP	400,982,000	Credit Suisse	17/8/2022	(23,656)
USD	3,158,642	CLP	2,755,594,000	Goldman Sachs	17/8/2022	(125,883)
USD	477,108	CNH	3,036,000	Bank of America Merrill Lynch	15/6/2022	22,434
USD	232,324	CNH	1,481,505	Barclays Bank	15/6/2022	10,453
USD	2,738,156	CNH	18,483,000	BNP Paribas	15/6/2022	(29,872)
USD	2,213,059	CNH	14,305,000	Deutsche Bank	15/6/2022	70,731
USD	2,687,838	CNH	17,539,000	Morgan Stanley	15/6/2022	61,185
USD	747,334	CNH	4,765,495	Standard Chartered Bank	15/6/2022	33,650
USD	2,737,921	CNH	18,507,000	BNP Paribas	20/7/2022	(30,922)
USD	581,633	CNH	3,923,000	Deutsche Bank	20/7/2022	(5,289)
USD	2,815,911	CNH	18,311,000	Morgan Stanley	20/7/2022	76,393
USD	300,081	CNH	2,018,000	Standard Chartered Bank	20/7/2022	(1,833)
USD	1,789,211	CNH	12,162,000	BNP Paribas	17/8/2022	(29,312)
USD	581,855	CNH	3,927,000	Deutsche Bank	17/8/2022	(5,329)
USD	3,457,476	CNH	23,306,000	Morgan Stanley	17/8/2022	(27,353)
USD	1,820,499	EUR	1,635,000	Bank of America Merrill Lynch	15/6/2022	67,948

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
USD	503,859	EUR	453,000	Barclays Bank	15/6/2022	18,290
USD	3,103,908	EUR	2,820,000	Deutsche Bank	15/6/2022	81,158
USD	1,136,781	EUR	1,059,000	HSBC	15/6/2022	1,642
USD	1,214,152	EUR	1,091,000	JP Morgan	15/6/2022	44,712
USD	1,940,071	EUR	1,830,000	Morgan Stanley	15/6/2022	(21,500)
USD	449,602	EUR	411,000	UBS	15/6/2022	9,052
USD	3,442,819	EUR	3,146,786	Deutsche Bank	20/7/2022	63,326
USD	414,720	EUR	392,000	HSBC	20/7/2022	(6,268)
USD	1,196,754	EUR	1,126,000	Morgan Stanley	20/7/2022	(12,515)
USD	970,050	EUR	909,000	Standard Chartered Bank	20/7/2022	(6,171)
USD	348,288	EUR	323,000	Deutsche Bank	17/8/2022	834
USD	208,250	EUR	193,000	Morgan Stanley	17/8/2022	639
USD	4,730,606	EUR	4,453,000	Standard Chartered Bank	17/8/2022	(59,517)
USD	2,829,936	GBP	2,135,000	Bank of America Merrill Lynch	15/6/2022	142,181
USD	220,273	GBP	168,000	Deutsche Bank	15/6/2022	8,778
USD	184,107	GBP	141,000	HSBC	15/6/2022	6,602
USD	354,428	GBP	283,000	JP Morgan	15/6/2022	(1,841)
USD	1,939,435	GBP	1,543,000	Morgan Stanley	15/6/2022	(3,050)
USD	173,814	GBP	132,000	Standard Chartered Bank	15/6/2022	7,639
USD	706,504	GBP	541,000	Bank of America Merrill Lynch	20/7/2022	25,253
USD	179,018	GBP	143,000	JP Morgan	20/7/2022	(1,054)
USD	676,206	GBP	546,000	Morgan Stanley	20/7/2022	(11,341)
USD	174,249	GBP	134,000	Societe Generale	20/7/2022	5,511
USD	179,085	GBP	143,000	JP Morgan	17/8/2022	(1,031)
USD	676,444	GBP	546,000	Morgan Stanley	17/8/2022	(11,271)
USD	510,835	HKD	3,991,000	JP Morgan	15/6/2022	2,080
USD	998,959	HUF	369,412,000	Bank of America Merrill Lynch	15/6/2022	(357)
USD	276,767	HUF	95,244,000	Barclays Bank	15/6/2022	19,117
USD	444,345	HUF	155,010,000	HSBC	15/6/2022	25,019
USD	576,937	HUF	210,961,000	Morgan Stanley	15/6/2022	6,255
USD	265,852	HUF	94,745,000	UBS	15/6/2022	9,552
USD	446,950	HUF	156,934,000	Goldman Sachs	20/7/2022	24,465
USD	163,382	HUF	58,858,000	HSBC	20/7/2022	4,929
USD	389,897	HUF	144,608,000	Morgan Stanley	20/7/2022	594
USD	140,814	HUF	51,212,000	UBS	20/7/2022	2,945
USD	170,181	HUF	61,458,000	BNP Paribas	17/8/2022	5,367
USD	93,170	HUF	34,447,000	HSBC	17/8/2022	793
USD	390,132	HUF	145,253,000	Morgan Stanley	17/8/2022	603
USD	50,457	INR	3,906,000	Bank of America Merrill Lynch	15/6/2022	242
USD	484,581	INR	37,819,000	Citibank	15/6/2022	(1,616)
USD	1,303,582	INR	100,055,000	Deutsche Bank	15/6/2022	17,288
USD	1,081,944	INR	83,375,000	JP Morgan	15/6/2022	10,084
USD	266,445	INR	20,535,000	Standard Chartered Bank	15/6/2022	2,450
USD	55,995	INR	4,308,000	Deutsche Bank	20/7/2022	812
USD	223,251	INR	17,228,000	HSBC	20/7/2022	2,570

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
USD	210,375	INR	16,299,000	JP Morgan	20/7/2022	1,594
USD	1,186,578	JPY	153,415,000	Bank of America Merrill Lynch	15/6/2022	(5,392)
USD	43,818	JPY	5,556,000	BNP Paribas	15/6/2022	650
USD	103,135	JPY	13,218,000	Citibank	15/6/2022	436
USD	200,881	JPY	23,790,000	HSBC	15/6/2022	16,043
USD	1,504,949	JPY	191,907,000	JP Morgan	15/6/2022	13,913
USD	4,358,559	JPY	543,201,000	Morgan Stanley	15/6/2022	138,117
USD	1,186,381	JPY	153,124,000	Bank of America Merrill Lynch	20/7/2022	(5,169)
USD	43,803	JPY	5,545,000	BNP Paribas	20/7/2022	654
USD	103,120	JPY	13,193,000	Citibank	20/7/2022	457
USD	1,504,737	JPY	191,558,000	JP Morgan	20/7/2022	14,108
USD	1,742,721	JPY	225,627,000	Morgan Stanley	20/7/2022	(13,019)
USD	406,903	JPY	52,900,000	Standard Chartered Bank	20/7/2022	(4,744)
USD	43,801	JPY	5,536,000	BNP Paribas	17/8/2022	657
USD	103,101	JPY	13,169,000	Citibank	17/8/2022	470
USD	1,317,122	JPY	166,985,000	JP Morgan	17/8/2022	15,748
USD	656,476	KRW	821,236,000	Barclays Bank	15/6/2022	(4,554)
USD	87,867	KRW	107,343,000	BNP Paribas	15/6/2022	1,464
USD	171,884	KRW	213,249,000	JP Morgan	15/6/2022	236
USD	10,981,059	KRW	13,539,316,000	Standard Chartered Bank	15/6/2022	82,979
USD	288,215	KRW	362,935,000	BNP Paribas	20/7/2022	(4,020)
USD	9,222,459	KRW	11,307,841,000	Deutsche Bank	20/7/2022	117,380
USD	340,528	KRW	428,139,000	HSBC	20/7/2022	(4,210)
USD	9,061,536	KRW	11,484,500,000	HSBC	17/8/2022	(187,285)
USD	2,249,521	MXN	46,296,889	Bank of America Merrill Lynch	15/6/2022	(105,742)
USD	845,596	MXN	17,657,000	Goldman Sachs	15/6/2022	(52,668)
USD	352,381	MXN	7,264,111	JP Morgan	15/6/2022	(17,166)
USD	2,156,057	MXN	44,540,000	Morgan Stanley	15/6/2022	(109,825)
USD	234,221	MXN	4,811,000	Bank of America Merrill Lynch	20/7/2022	(8,874)
USD	3,709,563	MXN	74,674,000	Citibank	20/7/2022	(63,638)
USD	234,372	MXN	4,840,000	Bank of America Merrill Lynch	17/8/2022	(8,850)
USD	3,306,158	MXN	67,716,000	HSBC	17/8/2022	(96,734)
USD	734,737	NOK	6,741,000	Citibank	15/6/2022	19,169
USD	841,454	NOK	7,462,000	Goldman Sachs	15/6/2022	49,351
USD	1,243,521	NOK	11,572,000	JP Morgan	15/6/2022	15,134
USD	686,242	NOK	6,035,000	Morgan Stanley	15/6/2022	45,617
USD	250,999	NOK	2,411,000	Citibank	20/7/2022	(5,026)
USD	1,327,349	NOK	12,393,000	JP Morgan	20/7/2022	11,332
USD	251,033	NOK	2,410,000	HSBC	17/8/2022	(5,005)
USD	676,280	NOK	6,423,000	JP Morgan	17/8/2022	(6,097)
USD	2,968,951	NZD	4,327,000	Bank of America Merrill Lynch	15/6/2022	153,828
USD	544,430	NZD	799,000	HSBC	15/6/2022	24,605
USD	88,207	NZD	137,000	JP Morgan	15/6/2022	(924)
USD	223,537	NZD	348,000	Morgan Stanley	15/6/2022	(2,869)



通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
USD	276,352	NZD	416,000	Bank of America Merrill Lynch	20/7/2022	5,840
USD	958,605	NZD	1,408,000	Deutsche Bank	20/7/2022	43,026
USD	223,568	NZD	348,000	Morgan Stanley	20/7/2022	(2,726)
USD	547,883	NZD	854,000	Morgan Stanley	17/8/2022	(7,175)
USD	811,850	PLN	3,618,000	BNP Paribas	15/6/2022	(34,562)
USD	1,334,874	PLN	5,838,000	JP Morgan	15/6/2022	(30,897)
USD	658,071	PLN	2,923,000	Morgan Stanley	15/6/2022	(25,750)
USD	1,766,165	PLN	7,593,000	HSBC	20/7/2022	(1,546)
USD	662,088	PLN	2,926,000	JP Morgan	20/7/2022	(19,108)
USD	368,018	PLN	1,653,000	UBS	20/7/2022	(16,814)
USD	1,454,171	PLN	6,577,000	HSBC	17/8/2022	(70,927)
USD	201,012	PLN	869,000	JP Morgan	17/8/2022	(495)
USD	409,348	SEK	3,874,000	Deutsche Bank	15/6/2022	14,753
USD	502,730	SEK	4,988,000	Goldman Sachs	15/6/2022	(5,335)
USD	4,538,566	SEK	45,132,000	JP Morgan	15/6/2022	(58,465)
USD	1,124,600	SEK	10,870,000	Morgan Stanley	15/6/2022	17,409
USD	541,003	SEK	5,444,000	Societe Generale	15/6/2022	(13,509)
USD	409,355	SEK	3,869,000	Deutsche Bank	20/7/2022	14,818
USD	502,537	SEK	4,980,000	Goldman Sachs	20/7/2022	(5,293)
USD	143,971	SEK	1,424,000	JP Morgan	20/7/2022	(1,240)
USD	156,804	SEK	1,536,000	Morgan Stanley	20/7/2022	172
USD	2,734,508	SEK	25,733,000	Standard Chartered Bank	20/7/2022	110,412
USD	100,936	SEK	1,000,000	Deutsche Bank	17/8/2022	(1,137)
USD	186,070	SEK	1,874,000	Goldman Sachs	17/8/2022	(5,214)
USD	2,201,158	SEK	21,756,000	HSBC	17/8/2022	(19,533)
USD	1,540,096	SGD	2,089,993	Barclays Bank	15/6/2022	15,713
USD	2,136,077	SGD	2,929,575	BNP Paribas	15/6/2022	(674)
USD	614,849	SGD	837,000	HSBC	15/6/2022	4,364
USD	90,171	SGD	122,432	JP Morgan	15/6/2022	873
USD	2,362,951	SGD	3,229,000	Morgan Stanley	15/6/2022	7,809
USD	2,995,010	SGD	4,065,000	Standard Chartered Bank	15/6/2022	30,111
USD	1,877,441	SGD	2,578,000	BNP Paribas	20/7/2022	(2,793)
USD	168,956	SGD	234,000	JP Morgan	20/7/2022	(1,709)
USD	1,115,948	SGD	1,524,000	Morgan Stanley	20/7/2022	4,437
USD	2,375,802	SGD	3,288,000	HSBC	17/8/2022	(22,465)
USD	173,533	SGD	242,000	Morgan Stanley	17/8/2022	(2,981)
USD	317,917	THB	10,538,000	Barclays Bank	15/6/2022	9,875
USD	234,964	THB	7,868,000	Goldman Sachs	15/6/2022	4,970
USD	71,900	THB	2,471,000	Societe Generale	15/6/2022	(331)
USD	156,670	THB	5,209,000	Standard Chartered Bank	15/6/2022	4,403
USD	230,733	THB	7,928,000	UBS	15/6/2022	(1,014)
USD	302,504	THB	10,391,000	UBS	20/7/2022	(1,570)
USD	444,620	TWD	13,107,000	Bank of America Merrill Lynch	15/6/2022	(7,512)
USD	1,857,963	TWD	53,695,000	BNP Paribas	15/6/2022	5,730
USD	2,375,553	TWD	68,408,000	Deutsche Bank	15/6/2022	15,789

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
USD	702,866	TWD	20,114,000	Morgan Stanley	15/6/2022	9,025
USD	1,359,070	TWD	38,223,000	Standard Chartered Bank	15/6/2022	40,550
USD	235,502	TWD	6,632,000	UBS	15/6/2022	6,729
USD	813,749	TWD	23,733,000	Barclays Bank	20/7/2022	(7,564)
USD	4,739,852	TWD	136,814,000	HSBC	20/7/2022	5,212
USD	686,487	TWD	19,997,000	UBS	20/7/2022	(5,537)
USD	195,553	TWD	5,680,000	HSBC	17/8/2022	(1,481)
USD	5,520,520	TWD	162,714,000	Standard Chartered Bank	17/8/2022	(123,898)
USD	181,992	ZAR	2,886,000	Barclays Bank	15/6/2022	(2,542)
USD	423,849	ZAR	6,735,000	Citibank	15/6/2022	(6,794)
USD	2,109,920	ZAR	32,952,000	Morgan Stanley	15/6/2022	2,933
USD	181,943	ZAR	2,896,000	Barclays Bank	20/7/2022	(2,464)
USD	378,808	ZAR	6,012,000	Citibank	20/7/2022	(4,015)
USD	970,498	ZAR	14,358,000	UBS	20/7/2022	56,231
USD	917,980	ZAR	14,825,000	JP Morgan	17/8/2022	(23,190)
USD	143,615	ZAR	2,268,000	Morgan Stanley	17/8/2022	(370)
ZAR	1,478,000	USD	99,061	Citibank	15/6/2022	(4,556)
ZAR	13,539,000	USD	921,098	HSBC	15/6/2022	(55,400)
ZAR	3,621,000	USD	246,561	JP Morgan	15/6/2022	(15,030)
ZAR	8,645,000	USD	561,817	Morgan Stanley	15/6/2022	(9,047)
ZAR	8,853,000	USD	563,742	Morgan Stanley	20/7/2022	(14)
ZAR	2,892,000	USD	182,912	Morgan Stanley	17/8/2022	687
						56,500
ヘッジを使用した豪ドル建投資証券クラス						
AUD	52,065,133	USD	36,969,694	State Street Bank & Trust Company	15/6/2022	412,325
USD	3,585,021	AUD	5,172,422	State Street Bank & Trust Company	15/6/2022	(128,705)
						283,620
ヘッジを使用したブラジル・レアル建投資証券クラス						
BRL	16,679	USD	3,293	State Street Bank & Trust Company	2/6/2022	253
BRL	16,033	USD	3,336	State Street Bank & Trust Company	5/7/2022	43
USD	3,491	BRL	16,678	State Street Bank & Trust Company	2/6/2022	(55)
USD	75	BRL	359	State Street Bank & Trust Company	5/7/2022	(1)
						240
ヘッジを使用したスイス・フラン建投資証券クラス						
CHF	418,896	USD	426,531	State Street Bank & Trust Company	15/6/2022	10,332
USD	29,088	CHF	28,674	State Street Bank & Trust Company	15/6/2022	(815)
						9,517

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)
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	2,540,156	USD	2,692,364	State Street Bank & Trust Company	15/6/2022	30,421
USD	144,005	EUR	135,894	State Street Bank & Trust Company	15/6/2022	(1,658)
						28,763
ヘッジを使用した英ポンド建投資証券クラス						
GBP	665,059	USD	822,865	State Street Bank & Trust Company	15/6/2022	14,378
USD	204,759	GBP	164,045	State Street Bank & Trust Company	15/6/2022	(1,756)
						12,622
ヘッジを使用した日本円建投資証券クラス						
JPY	10,800,720,782	USD	83,030,055	State Street Bank & Trust Company	15/6/2022	886,930
USD	1,688,327	JPY	216,696,798	State Street Bank & Trust Company	15/6/2022	4,685
						891,615
ヘッジを使用したニュージーランド・ドル建投資証券クラス						
NZD	206	USD	133	State Street Bank & Trust Company	15/6/2022	1
USD	4	NZD	5	State Street Bank & Trust Company	15/6/2022	-
						1
ヘッジを使用したスウェーデン・クローナ建投資証券クラス						
SEK	33,906	USD	3,428	State Street Bank & Trust Company	15/6/2022	25
USD	215	SEK	2,142	State Street Bank & Trust Company	15/6/2022	(2)
						23
合計(基礎となるエクスポージャー総額 - 611,016,228米ドル)						1,282,901

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

## 業種別内訳 2022年5月31日現在

	純資産比率 (%)
政府	67.74
金融	7.41
投資有価証券 - 時価	75.15
その他の純資産	24.85
	100.00

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

## ブラックロック・ICS・USTレジャリー・ファンド

## 要約損益計算書（未監査）

2022年3月31日に終了した会計期間

	注記	2022年3月31日に 終了した会計期間	2021年3月31日に 終了した会計期間
		千米ドル	千米ドル
営業収益		10,338	17,247
金融商品に係る純利益		60	136
投資収益合計		10,398	17,383
営業費用		(7,431)	(8,829)
金融資産のネガティブ・イールド		-	(6,369)
純営業利益		2,967	2,185
財務費用：			
償還可能投資証券保有者への分配金	5	(2,866)	(2,149)
財務費用合計		(2,866)	(2,149)
純利益		101	36
償還可能投資証券保有者に帰属する純資産の増加		101	36

本要約損益計算書に計上された損益以外で当会計期間に認識された損益はない。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

## ブラックロック・ICS・USTレジャリー・ファンド

## 償還可能投資証券保有者に帰属する要約純資産変動計算書（未監査）

2022年3月31日に終了した会計期間

	2022年3月31日に 終了した会計期間	2021年3月31日に 終了した会計期間
	千米ドル	千米ドル
期首純資産	17,759,497	21,281,310
償還可能投資証券保有者に帰属する純資産の増加	101	36
投資証券取引：		
償還可能投資証券の発行	80,956,417	79,180,133
償還可能投資証券の買戻	(78,939,310)	(81,314,431)
分配金再投資額	336	1,839
投資証券取引による純資産の増加 / (減少)	2,017,443	(2,132,459)
期末純資産	19,777,041	19,148,887

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ブラックロック・ICS・USTレジャー・ファンド  
要約貸借対照表（未監査）  
2022年3月31日現在

	注記	2022年3月31日現在	2021年9月30日現在
		千円	千円
流動資産			
現金		833,301	1,055,979
未収金		43,763	1,045
損益を通じて公正価値で測定する金融資産	4	19,080,243	17,908,428
流動資産合計		19,957,307	18,965,452
流動負債			
未払金		180,266	1,205,955
流動負債合計		180,266	1,205,955
償還可能投資証券保有者に帰属する純資産	8	19,777,041	17,759,497

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

## ブラックロック・ICS・USTレジャー・ファンド

投資有価証券明細表 2022年3月31日現在(未監査)

保有高	通貨	銘柄	公正価値 (千米ドル)	純資産比率 (%)
債券				
国債(2021年9月30日:34.78%)				
米国(2021年9月30日:34.78%)				
237,670,000	USD	US Cash Management Bill, 0.00%, 07/06/2022	237,520	1.20
359,110,000	USD	US Cash Management Bill, 0.00%, 14/06/2022	358,807	1.81
786,540,000	USD	US Cash Management Bill, 0.00%, 28/06/2022	785,464	3.97
29,310,000	USD	US Cash Management Bill, 0.00%, 05/07/2022	29,271	0.15
116,340,000	USD	US Cash Management Bill, 0.00%, 02/08/2022	116,033	0.59
4,485,000	USD	US Treasury, 0.13%, 30/04/2022	4,485	0.02
140,000,000	USD	US Treasury, 1.75%, 30/04/2022	140,167	0.71
200,000,000	USD	US Treasury, 1.88%, 30/04/2022	200,258	1.01
18,565,000	USD	US Treasury, 2.13%, 16/05/2022	18,612	0.09
100,000,000	USD	US Treasury, 1.88%, 31/05/2022	100,296	0.51
14,735,000	USD	US Treasury, 0.13%, 30/06/2022	14,737	0.07
12,000,000	USD	US Treasury, 0.13%, 01/08/2022	12,001	0.06
127,635,000	USD	US Treasury, 2.00%, 30/11/2022	128,562	0.65
59,000,000	USD	US Treasury, 1.63%, 15/12/2022	59,113	0.30
31,465,000	USD	US Treasury, 2.13%, 31/12/2022	31,729	0.16
15,470,000	USD	US Treasury, 1.50%, 28/02/2023	15,514	0.08
18,880,000	USD	US Treasury, 1.50%, 31/03/2023	18,950	0.10
40,550,000	USD	US Treasury, 2.50%, 31/03/2023	41,091	0.21
175,000,000	USD	US Treasury, FRN, 0.72%, 30/04/2022	175,015	0.88
100,000,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 12/04/2022	99,994	0.51
185,000,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 14/04/2022	184,985	0.93
87,000,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 19/04/2022	86,990	0.44
10,332,900	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 10/05/2022	10,330	0.05
55,125,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 17/05/2022	55,105	0.28
169,930,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 31/05/2022	169,844	0.86
1,177,455,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 16/06/2022	1,176,642	5.95
88,425,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 23/06/2022	88,393	0.45
87,200,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 30/06/2022	87,069	0.44
107,990,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 07/07/2022	107,892	0.55
42,945,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 28/07/2022	42,892	0.22
48,425,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 18/08/2022	48,281	0.24
135,090,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 01/09/2022	134,705	0.68
654,925,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 08/09/2022	652,974	3.30
112,370,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 15/09/2022	111,943	0.57
132,690,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 22/09/2022	132,132	0.67
282,720,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 29/09/2022	281,228	1.42
300,550,200	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 03/11/2022	300,262	1.52
20,625,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 29/12/2022	20,564	0.10
80,895,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 26/01/2023	80,470	0.41
309,250,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 23/02/2023	306,068	1.55

保有高	通貨	銘柄	公正価値 (千米ドル)	純資産比率 (%)
		米国(2021年9月30日: 34.78%)(続き)		
200,000,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 23/03/2023	196,855	0.99
		米国合計	6,863,243	34.70
		国債に対する投資合計	6,863,243	34.70
		債券に対する投資合計	6,863,243	34.70

保有高	通貨	取引相手	金利	期日	公正価値 (千米ドル)	純資産比率 (%)
		リバースレポ取引 <sup>1</sup> (2021年9月30日: 66.06%)				
		米国(2021年9月30日: 66.06%)				
1,600,000,000	USD	Barclays Capital, Inc.	0.30%	01/04/2022	1,600,000	8.09
2,250,000,000	USD	BNP Paribas SA	0.29%	01/04/2022	2,250,000	11.38
100,000,000	USD	BNP Paribas SA	0.29%	01/04/2022	100,000	0.51
1,060,000,000	USD	BofA Securities, Inc.	0.27%	01/04/2022	1,060,000	5.36
150,000,000	USD	BofA Securities, Inc.	0.27%	01/04/2022	150,000	0.76
1,125,000,000	USD	Citigroup Global Markets, Inc.	0.30%	01/04/2022	1,125,000	5.69
77,000,000	USD	Citigroup Global Markets, Inc.	0.30%	01/04/2022	77,000	0.39
190,000,000	USD	Credit Agricole Corporate and Investment Bank	0.30%	01/04/2022	190,000	0.96
150,000,000	USD	Credit Agricole Corporate and Investment Bank	0.30%	01/04/2022	150,000	0.76
990,000,000	USD	Credit Suisse AG	0.30%	01/04/2022	990,000	5.01
733,455,882	USD	Fixed Income Clearing Corp. JPM	0.30%	01/04/2022	733,456	3.71
526,409,314	USD	Fixed Income Clearing Corp. JPM	0.30%	01/04/2022	526,409	2.66
524,802,196	USD	Fixed Income Clearing Corp. JPM	0.30%	01/04/2022	524,802	2.65
489,583,333	USD	Fixed Income Clearing Corp. JPM	0.30%	01/04/2022	489,583	2.47
175,749,485	USD	Fixed Income Clearing Corp. JPM	0.30%	01/04/2022	175,750	0.89
1,445,000,000	USD	Societe Generale SA	0.30%	01/04/2022	1,445,000	7.31
630,000,000	USD	TD Securities (USA) LLC	0.28%	01/04/2022	630,000	3.18
		米国合計			12,217,000	61.78
		リバースレポ取引に対する投資合計			12,217,000	61.78
		損益を通じて公正価値で測定する金融資産合計			19,080,243	96.48
		現金			833,301	4.21
		その他の資産および負債			(136,503)	(0.69)
		償還可能投資証券保有者に帰属する純資産			19,777,041	100.00

資産合計額の内訳	資産合計に 対する割合 (%)
公認の証券取引所に上場されている譲渡可能な有価証券合計	3.94
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	91.67
その他の資産	4.39
資産合計	100.00

<sup>1</sup> 担保として保有する有価証券は12,415,564,000米ドルであった。



## 2 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】(2023年1月末現在)

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

資産総額	7,673,898,953円
負債総額	9,418,790円
純資産総額( - )	7,664,480,163円
発行済数量	10,222,067,232口
1 単位当たり純資産額( / )	0.7498円

(参考情報)

「スタイル・アドバンテージ・マザー・ポートフォリオ(円)」

資産総額	7,674,193,141円
負債総額	6,889,854円
純資産総額( - )	7,667,303,287円
発行済数量	9,784,340,352口
1 単位当たり純資産額( / )	0.7836円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

- 1 受益証券の名義書換え等  
該当事項はありません。
- 2 受益者名簿の閉鎖の時期  
受益者名簿は作成していません。
- 3 投資者に対する特典  
該当事項はありません。
- 4 内国投資信託受益証券の譲渡制限の内容  
ファンド受益証券の譲渡制限は設けておりません。
- 5 受益証券の再発行  
投資者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。
- 6 受益権の譲渡  
投資者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該投資者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。  
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。

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額等

資本金 3,120百万円

発行する株式の総数 36,000株

発行済株式の総数 15,000株

直近5カ年における主な資本金の額の増減 該当事項はありません。

##### (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2023年1月末現在、以下の通りです(親投資信託を除きます。 )。

種類	本数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	185	10,171,042
単位型株式投資信託	72	446,478
合計	257	10,617,519

### 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36期事業年度(自2022年1月1日 至2022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35期 (2021年12月31日現在)	第36期 (2022年12月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	17,813	18,002
立替金	16	50
前払費用	223	260
未収入金	2 527	2
未収委託者報酬	2,017	1,751
未収運用受託報酬	2,244	2,880
未収収益	2 981	570
その他流動資産	2	-
流動資産計	23,827	23,520
固定資産		
有形固定資産		
建物附属設備	1 789	744
器具備品	1 575	553
有形固定資産計	1,364	1,297
無形固定資産		
ソフトウェア	10	12
無形固定資産計	10	12
投資その他の資産		
投資有価証券	50	39
長期差入保証金	1,118	1,125
前払年金費用	1,001	1,084
長期前払費用	12	9
繰延税金資産	889	898
投資その他の資産計	3,072	3,156
固定資産計	4,448	4,465
資産合計	28,275	27,986

	第35期 (2021年12月31日現在)	第36期 (2022年12月31日現在)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	143	143
未払金	2	
未払収益分配金	4	4
未払償還金	70	70
未払手数料	459	421
その他未払金	2,991	1,995
未払費用	2	
未払消費税等	272	172
未払法人税等	402	384
為替予約	-	4
前受金	166	276
賞与引当金	2,156	1,778
役員賞与引当金	203	149
早期退職慰労引当金	-	326
流動負債計	7,630	6,355
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	82	92
資産除去債務	784	961
固定負債計	866	1,053
負債合計	8,497	7,409
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	3,120	3,120
資本剰余金		
資本準備金	3,001	3,001
その他資本剰余金	3,846	3,846
資本剰余金合計	6,847	6,847
利益剰余金		
利益準備金	336	336
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	9,470	10,276
利益剰余金合計	9,807	10,612
株主資本合計	19,775	20,580
<b>評価・換算差額等</b>		
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	19,778	20,576
負債・純資産合計	28,275	27,986



## (2)【損益計算書】

(単位：百万円)

		第35期 (自 2021年 1月 1日 至 2021年12月31日)	第36期 (自 2022年 1月 1日 至 2022年12月31日)
営業収益			
委託者報酬		6,653	6,484
運用受託報酬	1	8,355	8,687
その他営業収益	1	14,536	16,110
営業収益計		29,546	31,281
営業費用			
支払手数料		1,534	1,551
広告宣伝費		170	188
調査費			
調査費		298	360
委託調査費	1	4,326	4,677
調査費計		4,625	5,037
委託計算費		94	106
営業雑経費			
通信費		51	86
印刷費		95	87
諸会費		39	47
営業雑経費計		187	222
営業費用計		6,611	7,106
一般管理費			
給料			
役員報酬		579	915
給料・手当		5,106	5,934
賞与		2,616	2,360
給料計		8,302	9,209
退職給付費用		352	463
福利厚生費		1,073	1,109
事務委託費	1	3,360	3,699
交際費		11	34
寄付金		-	1
旅費交通費		24	123
租税公課		260	285
不動産賃借料		902	901
水道光熱費		53	76
固定資産減価償却費		426	441
資産除去債務利息費用		0	0
事務過誤取引損		519	3
諸経費		348	431
一般管理費計		15,638	16,782
営業利益		7,296	7,392

	第35期 (自 2021年 1月 1日 至 2021年12月31日)	第36期 (自 2022年 1月 1日 至 2022年12月31日)
営業外収益		
為替差益	102	53
その他	1	3
営業外収益計	103	57
営業外費用		
有価証券売却損	-	2
固定資産除却損	0	-
その他	-	0
営業外費用計	0	2
経常利益	7,398	7,448
特別利益		
特別利益計	-	-
特別損失		
特別退職金	0	362
特別損失計	0	362
税引前当期純利益	7,398	7,085
法人税、住民税及び事業税	2,415	2,485
法人税等調整額	0	5
当期純利益	4,984	4,605

## (3)【株主資本等変動計算書】

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

第36期（自 2022年1月1日 至 2022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				
2022年1月1日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	9,470	9,807	19,775	3	3	19,778
当期変動額											
剰余金の配当						3,800	3,800	3,800			3,800
当期純利益						4,605	4,605	4,605			4,605
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）									7	7	7
当期変動額合計	-	-	-	-	-	805	805	805	7	7	798
2022年12月31日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	10,276	10,612	20,580	3	3	20,576

## 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) 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. 収益及び費用の計上基準

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。

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。

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。

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。

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。

## 7. その他計算書類作成のための基本となる重要な事項

## (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。

## (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。

**(会計方針の変更)****(収益認識に関する会計基準等の適用)**

「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。

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。

これによる財務諸表に与える影響はありません。

なお、収益認識会計基準第89-3項に定める経過的な取扱いに従って、前会計期間に係る「注記事項(収益認識関係)」については記載していません。

**(時価の算定に関する会計基準等の適用)**

「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。これによる財務諸表に与える影響はありません。

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。ただし、「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 2019年7月4日)第7-4項に定める経過的な取扱いに従って、当該注記のうち前会計期間に係るものについては記載していません。

**(未適用の会計基準等)**

「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」(実務対応報告第42号 2021年8月12日 企業会計基準委員会)

**(1) 概要**

2020年3月27日に成立した「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、連結納税制度を見直しグループ通算制度へ移行することとされたことを受け、グループ通算制度を適用する場合における法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示の取扱を明らかにすることを目的として企業会計基準委員会から公表されたものです。

**(2) 適用予定日**

2023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 (2021年12月31日)	当事業年度 (2022年12月31日)
建物附属設備	2,246 百万円	2,488 百万円
器具備品	1,470 百万円	1,662 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 (2021年12月31日)	当事業年度 (2022年12月31日)
未収入金	524 百万円	- 百万円
未収収益	377 百万円	186 百万円
その他未払金	1,940 百万円	1,982 百万円
未払費用	112 百万円	55 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 (2021年12月31日)	当事業年度 (2022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 関係会社との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 2021年 1月 1日 至 2021年12月31日)	当事業年度 (自 2022年 1月 1日 至 2022年12月31日)
運用受託報酬	249 百万円	224 百万円
その他営業収益	6,036 百万円	6,692 百万円
委託調査費	1,178 百万円	1,869 百万円
事務委託費	1,204 百万円	1,351 百万円

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(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

	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
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

当事業年度(自 2022年1月1日 至 2022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
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



**（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。

	前事業年度	当事業年度
	(自 2021年 1月 1日 至 2021年12月31日)	(自 2022年 1月 1日 至 2022年12月31日)
1年以内	835 百万円	726 百万円
1年超	-	1,938 百万円
合計	835 百万円	2,665 百万円

(注) 前事業年度における未経過リース料には、解約損害金が含まれております。

**（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（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おります。

## (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(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	-	-	-

当事業年度(2022年12月31日)

(単位:百万円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
長期差入保証金	1,125	1,077	47

(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、未収入金、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。

## (注3) 金銭債権の決算日後の償還予定額

当事業年度（2022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	18,002	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	1,751	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	2,880	-	-	-
(4) 未収収益	570	-	-	-
(5) 未収入金	2	-	-	-
合計	23,209	-	-	-

## 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。

当事業年度（2022年12月31日）

(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	-	1,077	-	1,077

## (注) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

長期差入保証金の時価について、そのうち事務所敷金については、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しているため、レベル2の時価に分類しております。また従業員社宅敷金については、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しているため、レベル2の時価に分類しております。

**(退職給付関係)**

前事業年度 (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)

	前事業年度 (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)

	前事業年度 (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)

	前事業年度 (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
未積立退職給付債務	82
未認識数理計算上の差異	1,018
未認識過去勤務費用	65
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	33
退職給付引当金	919
前払年金費用	82
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,001
	919

## (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 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。

	前事業年度 (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

	前事業年度 (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。

当事業年度（自 2022年1月1日 至 2022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 2022年 1月 1日 至 2022年12月31日)
退職給付債務の期首残高	2,588
勤務費用	392
利息費用	17
数理計算上の差異の発生額	78
退職給付の支払額	116
過去勤務費用の発生額	0
退職給付債務の期末残高	2,803

## (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 2022年 1月 1日 至 2022年12月31日)
年金資産の期首残高	3,606
期待運用収益	3
数理計算上の差異の発生額	573
事業主からの拠出額	448
退職給付の支払額	116
年金資産の期末残高	3,368

## (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 (2022年12月31日)
積立型制度の退職給付債務	2,710
年金資産	3,368
	657
非積立型制度の退職給付債務	92
未積立退職給付債務	565
未認識数理計算上の差異	455
未認識過去勤務費用	29
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	991
退職給付引当金	92
前払年金費用	1,084
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	991

## (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 2022年 1月 1日 至 2022年12月31日)
勤務費用	392
利息費用	17
期待運用収益	3
数理計算上の差異の費用処理額	27
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	375
特別退職金	362
合計	738

(注) 特別退職金は、特別損失の「特別退職金」に含めて計上しております。

## (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 (2022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88%、株式11%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 2022年 1月 1日 至 2022年12月31日)
割引率	1.3%
長期期待運用収益率	0.1%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、87百万円 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 (2021年12月31日)	当事業年度 (2022年12月31日)
繰延税金資産		
未払費用	161	140
賞与引当金	660	544
資産除去債務	240	294
未払事業税	89	83
早期退職慰労引当金	-	99
退職給付引当金	25	28
有形固定資産	1	0
その他	78	121
繰延税金資産合計	1,257	1,312
繰延税金負債		
退職給付引当金	306	331
資産除去債務に対応する除去費用	59	82
その他	1	-
繰延税金負債合計	367	414
繰延税金資産の純額	889	898

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

	（単位：百万円）	
	前事業年度 (2021年12月31日)	当事業年度 (2022年12月31日)
固定資産 - 繰延税金資産	889	898

## 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 (2021年12月31日)	当事業年度 (2022年12月31日)
	法定実効税率	30.6 %
（調整）		
交際費等永久に損金に算入されない項目	2.0	3.9
その他	0.0	0.4
税効果会計適用後の法人税等の負担率	32.6 %	35.0 %

**（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%～0.72%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

当事業年度において、資産の除去時点において必要とされる除去費用の見積額が前回見積算出時における見積額を大幅に超過することが明らかになったことから、見積りの変更による増加額を0.72%で割り引き、変更前の資産除去債務に176百万円加算しております。

（単位：百万円）

	前事業年度 (自 2021年 1月 1日 至 2021年12月31日)	当事業年度 (自 2022年 1月 1日 至 2022年12月31日)
期首残高	783	784
見積りの変更による増加額	-	176
時の経過による調整額	0	0
期末残高	784	961

**（収益認識関係）**

当事業年度（自 2022年1月1日 至 2022年12月31日）

## 1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

	当事業年度 (自 2022年 1月 1日 至 2022年12月31日)
委託者報酬	6,484 百万円
運用受託報酬	7,644 百万円
成功報酬（注）	1,042 百万円
その他営業収益	16,110 百万円
合計	31,281 百万円

（注）成功報酬は、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会計期間末において存在する顧客との契約から当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）**

前事業年度（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。

当事業年度（自 2022年1月1日 至 2022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	6,484	8,687	16,110	31,281

(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
14,721	13,745	2,813	31,281

（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	6,917	投資運用業
ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	4,287	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 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		
							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

当事業年度（自 2022年1月1日 至 2022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	224	未収収益	186
							受入手数料	6,692		
							委託調査費	1,869	未払費用	55
							事務委託費	1,351		
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	1,982	その他未払金	1,982

- (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 2021年1月1日 至 2021年12月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2022年1月1日 至 2022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 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		

当事業年度（自 2022年1月1日 至 2022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	4,287	未収収益	180
							委託調査費	35		
							事務委託費	12		

## (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 2021年 1月 1日 至 2021年12月31日)	当事業年度 (自 2022年 1月 1日 至 2022年12月31日)
1株当たり純資産額	1,318,566 円 41 銭	1,371,780 円 88 銭
1株当たり当期純利益金額	332,267 円 26 銭	307,029 円 07 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 2021年 1月 1日 至 2021年12月31日)	当事業年度 (自 2022年 1月 1日 至 2022年12月31日)
当期純利益 (百万円)	4,984	4,605
普通株主に帰属しない金額 (百万円)	-	-
普通株式に係る当期純利益 (百万円)	4,984	4,605
普通株式の期中平均株式数 (株)	15,000	15,000

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

## 5【その他】

定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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



## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

- ・名称 三井住友信託銀行株式会社
- ・資本金の額 342,037百万円（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
野村證券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500	

### 2【関係業務の概要】

#### (1) 受託会社

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

#### (2) 販売会社

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

### 3【資本関係】

#### (1) 受託会社

該当事項はありません。

#### (2) 販売会社

該当事項はありません。

### 第3【その他】

1 交付目論見書の表紙等に、以下の事項を記載します。

(1) 委託会社等の情報

委託会社名

金融商品取引業者登録番号

設立年月日

資本金

当該委託会社が運用する投資信託財産の合計純資産総額

「ファンドの運用の指図を行う者である。」旨

(2) 受託会社に関する情報

受託会社名および「ファンドの財産の保管および管理を行う者である。」旨

(3) 詳細情報の入手方法

詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載します。

委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間等

請求目論見書の入手方法および投資信託約款が請求目論見書に添付されている旨

(4) 交付目論見書の使用開始日

(5) 届出の効力に関する事項

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

届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法

届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日

(6) その他の記載事項

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

投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨

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

「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載

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

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

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

独立監査人の監査報告書

2023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 水野 龍也

## 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2022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。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類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。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

## 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

2023年3月31日

ブラックロック・ジャパン株式会社  
取締役会御中

## PwCあらた有限責任監査法人

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・スタイル・アドバンテージ・ポートフォリオ（円/年1回決算コース）の2022年1月18日から2023年1月16日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ブラックロック・スタイル・アドバンテージ・ポートフォリオ（円/年1回決算コース）の2023年1月16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、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む）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。