

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	2023年10月13日
【計算期間】	第18期（自 2023年1月17日 至 2023年7月18日）
【ファンド名】	ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド（為替ヘッジあり） ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド（為替ヘッジなし）
【発行者名】	ブラックロック・ジャパン株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 有田 浩之
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番3号
【事務連絡者氏名】	坂井 瑛美
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番3号
【電話番号】	03-6703-7940
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

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

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

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

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

<商品分類表>

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

<属性区分表>

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

< 各分類および区分の定義 >

・ 商品分類

単位型投信・追加型投信の区分	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
投資対象地域による区分	海外	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
投資対象資産による区分	株式	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
補足分類	特殊型 (絶対収益追求型)	目論見書または投資信託約款において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

・ 属性区分

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

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

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

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

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

ファンドの特色（当ファンドおよびマザーファンドの特色）

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

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

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

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

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

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

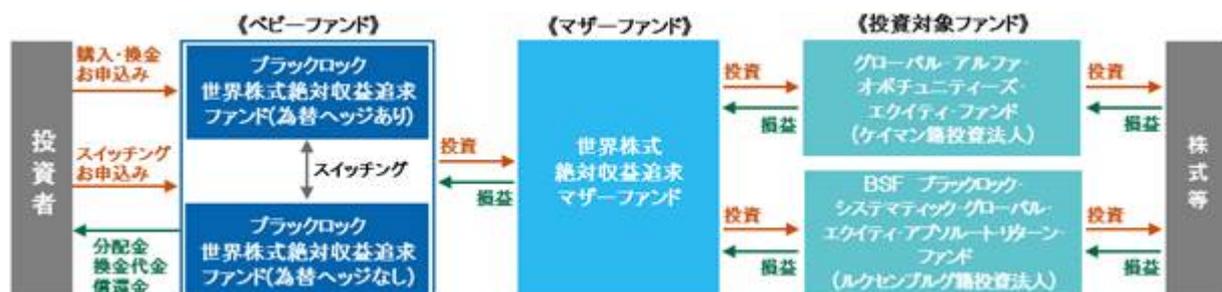
- c. ファンドは、世界株式絶対収益追求マザーファンドをマザーファンドとするファミリーファンド方式で運用します。ファンドは、マザーファンドを通じて、投資信託証券を実質的な投資対象とするファンド・オブ・ファンズです。

投資対象とする投資信託証券は、本書提出日現在、以下の通りです。

- グローバル・アルファ・オポチュニティーズ・エクイティ・ファンド・リミテッド クラスA投資証券（ケイマン籍投資法人、以下「グローバル・アルファ・オポチュニティーズ・エクイティ・ファンド」といいます。）

- ブラックロック・ストラテジック・ファンズ（BSF）ブラックロック・システムティック・グローバル・エクイティ・アブソルート・リターン・ファンド クラスJ投資証券（ルクセンブルグ籍投資法人、以下「BSF ブラックロック・システムティック・グローバル・エクイティ・アブソルート・リターン・ファンド」といいます。）

2023年8月1日付で、ファンド名称が「ブラックロック・ストラテジック・ファンズ ブラックロック・システムティック・グローバル・ロング/ショート・エクイティ・ファンド クラスJ」投資証券」から変更となりました。



<ファンドの仕組みについて>

投資対象ファンドは、委託会社の判断により適宜見直しを行うことがあります。

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

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

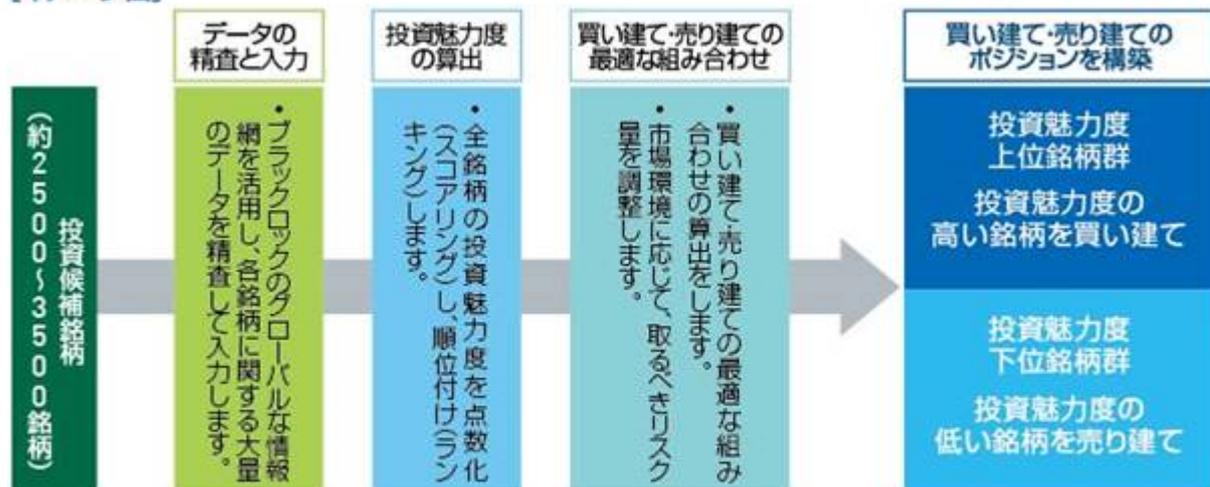
d. 各投資対象ファンドの運用戦略は、ブラックロック独自の計量モデルを活用します。

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

<運用プロセス（投資対象ファンドの運用プロセス）>

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

[イメージ図]



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

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

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

スイッチングの際には、換金時と同様の税金がかかります。

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

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

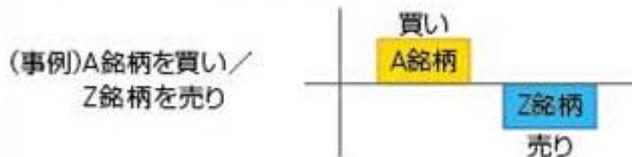
(追加的記載事項)

買い建て/売り建てポジションとその損益について

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

[イメージ図]

買い建て／売り建ての組み合わせによる損益



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

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

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

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

(参考)グロスポジションについて

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

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

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

[イメージ図]

グロスポジション：500% の例



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

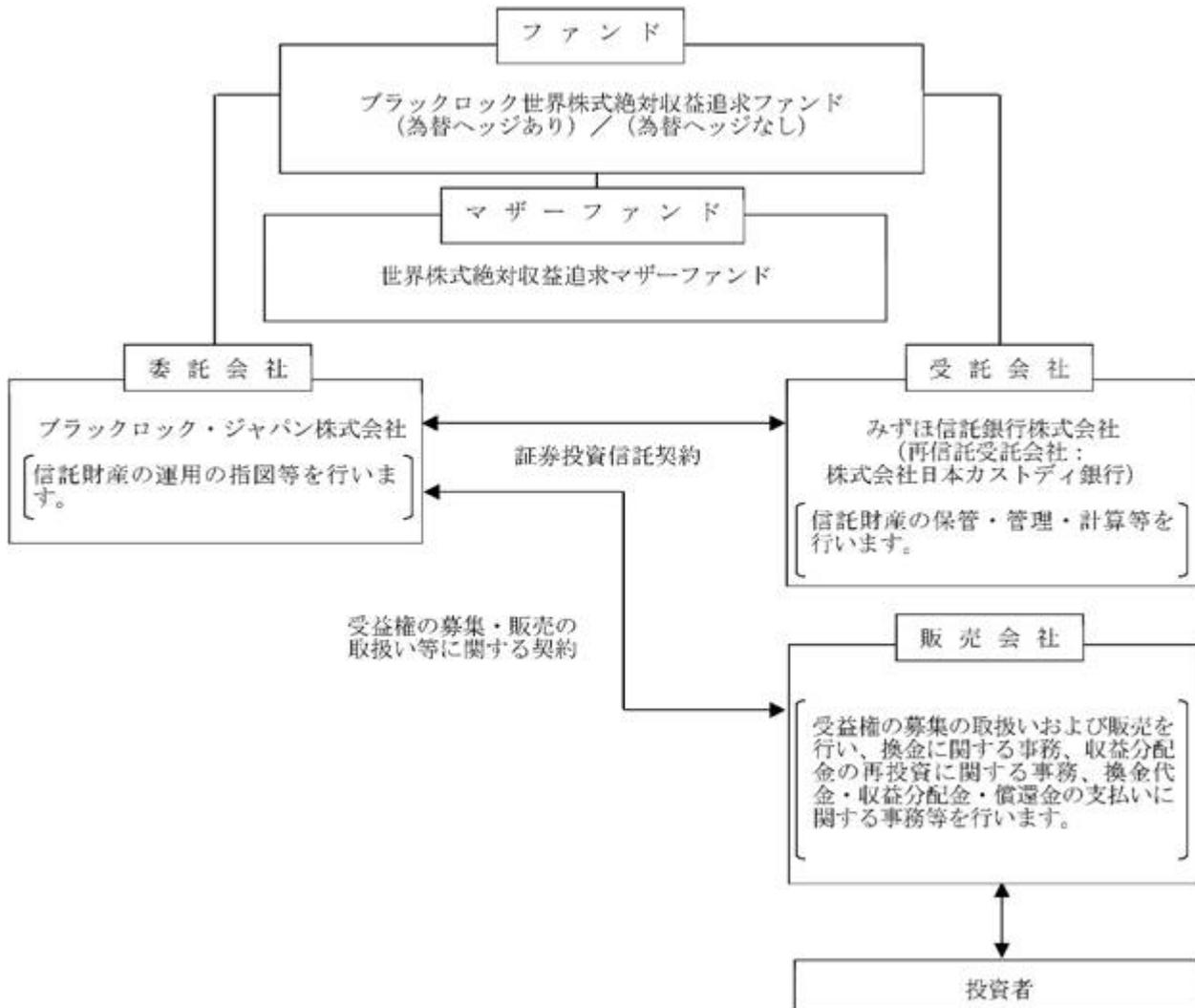
(2) 【ファンドの沿革】

2014年7月7日 信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

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

(3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



< 契約等の概要 >

a. 「証券投資信託契約」

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

b. 「受益権の募集・販売の取扱い等に関する契約」

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

< 委託会社の概況 >

2023年7月末現在の委託会社の概況は、以下のとおりです。

a . 資本金 3,120百万円

b . 沿革

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

c . 大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

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

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

（為替ヘッジあり）

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

（為替ヘッジなし）

実質外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

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

<参考> マザーファンドの運用の基本方針

世界株式絶対収益追求マザーファンド

運用の基本方針

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

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

(2) 投資態度

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

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

別に定める投資信託証券は、委託会社の判断により、変更することがあります。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

(3) 投資制限

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

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

(2)【投資対象】

投資対象とする資産の種類

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

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

投資対象とする有価証券

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

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

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

投資対象とする金融商品

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

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

マザーファンドの投資対象ファンドの概要

a. グローバル・アルファ・オポチュニティーズ・エクイティ・ファンド

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

b. B S F ブラックロック・システマティック・グローバル・エクイティ・アブソルート・リターン・ファンド

形態	ルクセンブルグ籍(オープン・エンド型)会社型外国投資証券(米ドル建て)
投資目的および投資態度	ファンドは、株式等に投資するロング・ショート(買い建ておよび売り建て)ポジションを構築することにより市場動向に係わらずプラスの絶対収益の追求を目指します。ファンドの純資産の少なくとも70%を先進国の株式もしくは株式関連の派生商品等へ投資を行います。ファンドは、先進国の株式に広く分散投資を行い、それと同時に市場動向との相関性の低いリターンを生み出すことを目指します。
存続期間	無期限
主な投資対象	先進国の株式もしくは株式関連の派生商品等に投資します。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・同一発行体の譲渡性のある証券への投資は、原則としてファンドの純資産総額の10%以下とします。 ・純資産総額の5%を超えて投資しているすべての発行体について、ファンドが保有する譲渡性のある証券の総額は原則として純資産総額の40%を超えないものとします。
管理報酬	年1.50%
その他費用	管理業務会社、保管会社および名義書換事務代行会社への報酬等および事務諸費に要する費用についてはファンドから差し引かれます。
決算日	年1回(原則として5月末日)に決算を行います。
収益分配方針	分配を行います。ただし、必ず分配を行うものではありません。
申込手数料	ありません。
管理会社	ブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エー
投資顧問会社	ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク
保管会社	ステート・ストリート・バンク・インターナショナル GmbH、ルクセンブルグ支店

(3) 【運用体制】

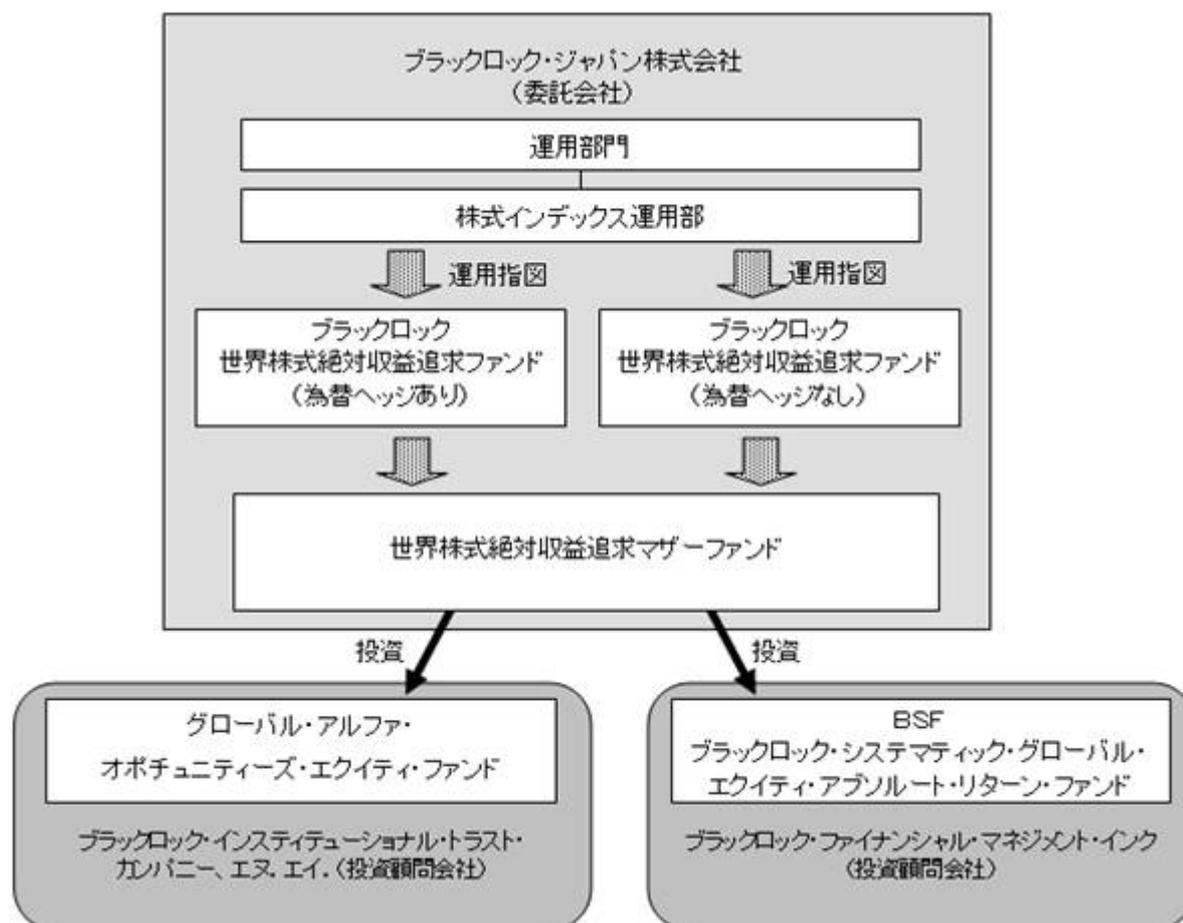
ファンドの運用・管理の各業務の役割分担を社内規程により定めております。

ファンドの運用については委託会社の運用部門が統括しています。

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

当ファンドの運用は、株式インデックス運用部（当ファンド担当：8名程度）が担当いたします。

運用体制図



運用体制等は、変更となる場合があります。

ブラックロック・グループ

ブラックロック・グループは、運用資産残高約9.42兆ドル^{*}（約1,362兆円）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。

^{*} 2023年6月末現在。（円換算レートは1ドル=144.535円を使用）

(4)【分配方針】

収益分配方針

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

a. 分配対象額の範囲

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

b. 分配対象収益についての分配方針

分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。

c. 留保益の運用方針

留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

基準価額水準、市況動向等によっては分配を行わないことがあります。将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

収益の分配

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

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

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

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

収益分配金の支払い

a. 支払時期と支払場所

(a) 一般コースの場合

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

(b) 累積投資コースの場合

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

b. 時効

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

(5) 【投資制限】

各ファンドの約款で定める投資制限

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

投資信託証券への投資制限

投資信託証券への実質投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資制限

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

公社債の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認められた時は、担保の提供の指図を行うものとします。
- b. a. の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- c. 換金等の事由により、b. の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- d. a. の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

外国為替予約の指図および範囲

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

資金の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、換金に伴う支払資金の手当て（換金に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- b. 換金に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、投資者への換金代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または投資者への換金代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの間もしくは投資者への換金代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却または換金代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

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

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

信用リスク集中回避のための投資制限

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

3【投資リスク】

(1) 投資リスク

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

当ファンドにかかる主なリスクは以下の通りです。

基準価額の変動要因

a．買い建て・売り建てポジションを構築する戦略リスク

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

b．株価変動リスク

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

c．デリバティブ取引のリスク

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

（レバレッジ・リスク）

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

（デリバティブ取引の取引先に関するリスク）

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

d．為替変動リスク

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

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

e．カンントリー・リスク

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

ファンド運営上のリスク

a．換金の受付の中止・取消

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、主要投資対象ファンドの取引停止、その他やむを得ない事情があるときは、受益権の換金の受付を中止する場合があります。また、この場合、既に受付けた受益権の換金の受付についても取り消す場合があります（スイッチングを含みます）。

b．ファンドの繰上償還

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

c．法令・税制・会計等の変更

法令・税制・会計方法等は今後変更される可能性があります。

d．流動性リスクに関する事項

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

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

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

e．収益分配金に関する留意点

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

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

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

(2) リスクの管理体制

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

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

リスクの管理体制は、変更となる場合があります。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

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

(2)【換金（解約）手数料】

換金手数料
ありません。

信託財産留保額
ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬の総額

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

a．ファンドの信託報酬

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

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

b．投資対象ファンドにかかる運用管理費用

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

信託報酬の支払時期と支払方法等

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

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

(4)【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

個別元本方式について

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

換金時および償還時の課税について

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

収益分配金の課税について

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

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

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

個人、法人の課税の取扱いについて

a. 個人の投資者に対する課税

(a) 収益分配金の課税について

支払いを受ける収益分配金のうち、課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として、20.315%(所得税15.315%、地方税5%)の税率による源泉徴収が行われます。原則として、申告は不要です。

また、確定申告を行うことにより総合課税(配当控除なし)と申告分離課税(20.315%(所得税15.315%、地方税5%))のいずれかを選択することができます。

(b) 換金時および償還時の差益の課税について

換金時および償還時の差益(換金価額および償還価額から購入費用(購入時手数料および当該購入時手数料にかかる消費税等相当額を含みます。)を控除した利益)は、譲渡益として課税対象(譲渡所得等)となり、20.315%(所得税15.315%、地方税5%)の税率による申告分離課税が適用されます。原則として確定申告が必要ですが、特定口座(源泉徴収口座)の利用が可能な場合があります。

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

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

少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」がご利用になれます。少額投資非課税制度「NISA(ニーサ)」は、少額上場株式等に関する非課税制度です。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など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が、2024年1月1日以降は、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。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。また、2024年1月1日以降は、税法上の要件を満たした商品を購入した場合に限り、非課税の適用を受けることができます。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

b. 法人の投資者に対する課税

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

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

上記は2023年7月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

以下の運用状況は2023年7月末現在のものです。

「ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド(為替ヘッジあり)」

(1)【投資状況】

資産の種類	金額(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	20,123,317	98.69
内 日本	20,123,317	98.69
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	266,827	1.31
純資産総額	20,390,144	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

順位	銘柄	国/地域	種類	数量(口)	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	世界株式絶対収益追求マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	13,186,971	1.5028	19,818,698	1.5260	20,123,317	98.69

(注) 投資比率は、純資産総額に対する評価金額の比率です。

種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.69

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

	純資産総額(円)		1口当たりの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期(2015年1月15日)	957,773,597	(同左)	0.9845	(同左)
第2期(2015年7月15日)	706,420,247	716,876,433	1.0134	1.0284
第3期(2016年1月15日)	431,355,676	(同左)	0.9882	(同左)
第4期(2016年7月15日)	257,693,759	(同左)	0.9387	(同左)
第5期(2017年1月16日)	205,337,547	(同左)	0.9494	(同左)
第6期(2017年7月18日)	186,476,290	(同左)	0.9820	(同左)
第7期(2018年1月15日)	159,770,771	(同左)	0.9934	(同左)
第8期(2018年7月17日)	125,789,790	(同左)	0.9650	(同左)
第9期(2019年1月15日)	115,787,456	(同左)	0.9544	(同左)
第10期(2019年7月16日)	101,429,981	(同左)	0.9724	(同左)
第11期(2020年1月15日)	89,167,045	(同左)	0.9387	(同左)
第12期(2020年7月15日)	83,645,450	(同左)	0.9403	(同左)
第13期(2021年1月15日)	68,745,586	(同左)	0.9060	(同左)
第14期(2021年7月15日)	50,959,802	(同左)	0.9222	(同左)
第15期(2022年1月17日)	42,005,589	(同左)	0.8852	(同左)
第16期(2022年7月15日)	29,622,820	(同左)	0.8760	(同左)
第17期(2023年1月16日)	20,573,711	(同左)	0.8738	(同左)
第18期(2023年7月18日)	20,427,260	(同左)	0.8713	(同左)
2022年7月末現在	21,775,913		0.8893	
2022年8月末現在	20,837,699		0.8851	
2022年9月末現在	20,654,146		0.8773	
2022年10月末現在	20,324,508		0.8633	
2022年11月末現在	20,476,802		0.8697	
2022年12月末現在	20,667,409		0.8778	
2023年1月末現在	20,659,480		0.8775	
2023年2月末現在	20,422,808		0.8674	
2023年3月末現在	20,539,923		0.8761	
2023年4月末現在	20,543,152		0.8763	
2023年5月末現在	19,920,176		0.8497	
2023年6月末現在	20,380,362		0.8693	
2023年7月末現在	20,390,144		0.8697	

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1期	
第2期	0.0150
第3期	
第4期	
第5期	
第6期	
第7期	
第8期	
第9期	
第10期	
第11期	
第12期	
第13期	
第14期	
第15期	
第16期	
第17期	
第18期	

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1期	1.6
第2期	4.5
第3期	2.5
第4期	5.0
第5期	1.1
第6期	3.4
第7期	1.2
第8期	2.9
第9期	1.1
第10期	1.9
第11期	3.5
第12期	0.2
第13期	3.6
第14期	1.8
第15期	4.0
第16期	1.0
第17期	0.3
第18期	0.3

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

(4)【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第1期	998,560,692	25,710,000	972,850,692
第2期	22,680,735	298,452,329	697,079,098
第3期	98,124,924	358,683,774	436,520,248
第4期	2,804,198	164,800,640	274,523,806
第5期	35,149,826	93,384,340	216,289,292
第6期	13,280,231	39,666,243	189,903,280
第7期		29,077,262	160,826,018
第8期		30,468,963	130,357,055
第9期	50,604	9,091,990	121,315,669
第10期		17,002,909	104,312,760
第11期		9,323,895	94,988,865
第12期		6,030,604	88,958,261
第13期		13,080,309	75,877,952
第14期		20,619,325	55,258,627
第15期		7,802,788	47,455,839
第16期		13,641,039	33,814,800
第17期		10,270,961	23,543,839
第18期		100,000	23,443,839

「ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド(為替ヘッジなし)」

(1) 投資状況

資産の種類	金額(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	762,408,061	100.03
内 日本	762,408,061	100.03
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	223,444	0.03
純資産総額	762,184,617	100.00

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

順位	銘柄	国/地域	種類	数量(口)	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
1	世界株式絶対収益追求マ ザーファンド	日本	親投資信託 受益証券	499,612,098	1.5028	750,867,022	1.5260	762,408,061	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7月末現在、同日前1年以内における各月末および各計算期間末の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額(円)		1口当たりの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期(2015年1月15日)	12,135,487,725	13,301,883,530	1.0404	1.1404
第2期(2015年7月15日)	13,312,136,629	13,921,571,606	1.0922	1.1422
第3期(2016年1月15日)	9,391,426,507	9,484,247,383	1.0118	1.0218
第4期(2016年7月15日)	5,796,915,954	(同左)	0.8628	(同左)
第5期(2017年1月16日)	4,505,061,079	(同左)	0.9534	(同左)
第6期(2017年7月18日)	3,258,112,206	(同左)	0.9780	(同左)
第7期(2018年1月15日)	2,468,653,368	(同左)	0.9856	(同左)
第8期(2018年7月17日)	2,040,093,900	(同左)	0.9822	(同左)
第9期(2019年1月15日)	1,584,286,967	(同左)	0.9544	(同左)
第10期(2019年7月16日)	1,342,789,696	(同左)	0.9825	(同左)
第11期(2020年1月15日)	1,120,990,956	(同左)	0.9781	(同左)
第12期(2020年7月15日)	899,644,956	(同左)	0.9622	(同左)
第13期(2021年1月15日)	772,254,819	(同左)	0.8996	(同左)
第14期(2021年7月15日)	725,219,342	(同左)	0.9714	(同左)
第15期(2022年1月17日)	685,558,634	(同左)	0.9712	(同左)
第16期(2022年7月15日)	804,086,393	(同左)	1.1745	(同左)
第17期(2023年1月16日)	716,091,095	(同左)	1.0990	(同左)
第18期(2023年7月18日)	750,867,023	(同左)	1.2211	(同左)
2022年7月末現在	786,652,164		1.1566	
2022年8月末現在	795,814,542		1.1875	
2022年9月末現在	823,167,074		1.2327	
2022年10月末現在	813,404,105		1.2459	
2022年11月末現在	769,901,490		1.1793	
2022年12月末現在	744,358,650		1.1424	
2023年1月末現在	731,731,221		1.1278	
2023年2月末現在	758,994,159		1.1698	
2023年3月末現在	752,920,246		1.1620	
2023年4月末現在	754,226,864		1.1723	
2023年5月末現在	756,364,745		1.1909	
2023年6月末現在	800,887,673		1.2689	
2023年7月末現在	762,184,617		1.2396	

分配の推移

	1口当たりの分配金(円)
第1期	0.1000
第2期	0.0500
第3期	0.0100
第4期	
第5期	
第6期	
第7期	
第8期	
第9期	
第10期	
第11期	
第12期	
第13期	
第14期	
第15期	
第16期	
第17期	
第18期	

収益率の推移

	収益率(%)
第1期	14.0
第2期	9.8
第3期	6.4
第4期	14.7
第5期	10.5
第6期	2.6
第7期	0.8
第8期	0.3
第9期	2.8
第10期	2.9
第11期	0.4
第12期	1.6
第13期	6.5
第14期	8.0
第15期	0.0
第16期	20.9
第17期	6.4
第18期	11.1

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

(4) 設定及び解約の実績

	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第1期	12,278,492,168	614,534,115	11,663,958,053
第2期	4,455,831,030	3,931,089,532	12,188,699,551
第3期	3,291,947,721	6,198,559,640	9,282,087,632
第4期	209,741,336	2,773,360,058	6,718,468,910
第5期	90,712,428	2,084,085,529	4,725,095,809
第6期	29,368,515	1,423,205,002	3,331,259,322
第7期	82,625,597	909,247,881	2,504,637,038
第8期	1,027,622	428,549,479	2,077,115,181
第9期	638,045	417,760,595	1,659,992,631
第10期	273,194	293,550,581	1,366,715,244
第11期	234,649	220,845,674	1,146,104,219
第12期	138,048	211,281,813	934,960,454
第13期		76,532,356	858,428,098
第14期		111,853,868	746,574,230
第15期		40,716,283	705,857,947
第16期		21,239,440	684,618,507
第17期		33,048,795	651,569,712
第18期		36,683,554	614,886,158

(参考情報)「世界株式絶対収益追求マザーファンド」

(1) 投資状況

資産の種類	金額(円)	投資比率(%)
投資証券	774,691,217	99.00
内 ルクセンブルグ	388,148,286	49.60
内 ケイマン諸島	386,542,931	49.40
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	7,838,364	1.00
純資産総額	782,529,581	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・システムティック・グローバル・ロング/ショート・エクイティ・ファンド クラスJ投資証券	ルクセンブルグ	投資証券	23,314	16,542.82	385,683,331	16,648.55	388,148,286	49.60
2	グローバル・アルファ・オポチュニティーズ・エクイティ・ファンド・リミテッド クラスA投資証券	ケイマン諸島	投資証券	264,885	1,467.22	388,647,613	1,459.28	386,542,931	49.40

(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	99.00

(注) 投資比率は、純資産総額に対する評価金額の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

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

2【換金（解約）手続等】

(1) 換金の申込と受付

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

(2) 換金単位

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

(3) 換金不可日

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

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

(4) 換金価額

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

当ファンドの換金価額等につきましては販売会社または下記に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があります。詳細は販売会社にお問い合わせください。

(6) 換金代金の支払い

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

(7) 換金の申込の受付中止および取消

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

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

当ファンドの主たる投資対象の評価方法は以下の通りです。

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

（参考）マザーファンドの主たる投資対象の評価方法

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

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

ホームページアドレス： www.blackrock.com/jp/

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

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

(4)【計算期間】

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

(5)【その他】

ファンドの償還条件等

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

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

- c . a . および b . の場合において、委託会社は、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびにファンドの償還の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約に係る知っている投資者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- d . c . の書面決議において、投資者(委託会社およびファンドの信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る投資者としての受託会社を除きます。以下 d . において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている投資者が議決権を行使しないときは、当該知っている投資者は書面決議について賛成するものとみなします。
- e . c . の書面決議は議決権を行使することができる投資者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- f . c . ~ e . までの規定は、委託会社がファンドの償還について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約に係るすべての投資者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、 c . ~ e . までの手続を行うことが困難な場合も同じとします。
- g . 委託会社は、監督官庁よりファンドの償還の命令を受けたときはその命令に従い、ファンドを償還させます。
- h . 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社はこのファンドを償還させます。
- i . h . にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、「 信託約款の変更 b . 」に規定する書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- j . 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または投資者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、信託約款の変更の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。

信託約款の変更

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

- c . b . の書面決議において、投資者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る投資者としての受託会社を除きます。以下c . に同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている投資者が議決権を行使しないときは、当該知っている投資者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d . b . の書面決議は議決権を行使することができる投資者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e . 書面決議の効力は、当ファンドのすべての投資者に対してその効力を生じます。
- f . b . ~ e . までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての投資者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- g . a . ~ f . までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
- h . 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときはa . ~ f . の規定にしたがいます。

信託事務の委託

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

運用報告書の作成

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

関係法人との契約の更改等に関する手続

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

公告

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

www.blackrock.com/jp/

但し、当該公告方法に支障がある場合には、日本経済新聞による公告を行います。

4【受益者の権利等】

ファンドの受益者（投資者）の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金受領権

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

<一般コース>

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

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

<累積投資コース>

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

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

(2) 償還金受領権

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

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

償還金の支払いは、販売会社において行います。

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

(3) 受益権の換金請求権

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

換金代金は、換金受付日から起算して、原則として8営業日目から投資者に支払います。

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

(4) 反対受益者の買取請求の不適用

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

(5) 帳簿書類の閲覧または謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第18期計算期間(2023年1月17日から2023年7月18日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による監査を受けております。

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

なお、当該参考情報は監査意見の対象外となっております。

1【財務諸表】

【ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド(為替ヘッジあり)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第17期 (2023年1月16日現在)	第18期 (2023年7月18日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	194,188	189,686
親投資信託受益証券	19,624,457	19,818,698
派生商品評価勘定	844,798	503,585
流動資産合計	20,663,443	20,511,969
資産合計	20,663,443	20,511,969
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	3,283	3,111
未払委託者報酬	74,564	70,394
その他未払費用	11,885	11,204
流動負債合計	89,732	84,709
負債合計	89,732	84,709
純資産の部		
元本等		
元本	23,543,839	23,443,839
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2,970,128	3,016,579
(分配準備積立金)	258,738	257,639
元本等合計	20,573,711	20,427,260
純資産合計	20,573,711	20,427,260
負債純資産合計	20,663,443	20,511,969

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第17期 (自 2022年7月16日 至 2023年1月16日)	第18期 (自 2023年1月17日 至 2023年7月18日)
営業収益		
有価証券売買等損益	1,142,277	2,259,385
為替差損益	1,292,699	2,234,383
営業収益合計	150,422	25,002
営業費用		
受託者報酬	3,283	3,111
委託者報酬	74,564	70,394
その他費用	17,905	11,208
営業費用合計	95,752	84,713
営業利益又は営業損失()	54,670	59,711
経常利益又は経常損失()	54,670	59,711
当期純利益又は当期純損失()	54,670	59,711
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()	106,112	646
期首剰余金又は期首欠損金()	4,191,980	2,970,128
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,273,294	12,614
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,273,294	12,614
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金()	2,970,128	3,016,579

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法

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

2 デリバティブの評価基準及び評価方法

為替予約取引

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

3 収益及び費用の計上基準

有価証券売買等損益及び為替予約取引による為替差損益の計上基準

約定日基準で計上しております。

4 その他財務諸表作成のための基礎となる事項

計算期間末日の取扱い

第18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、2023年1月17日から2023年7月18日までとなっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	第17期 (2023年1月16日現在)	第18期 (2023年7月18日現在)
1 当該計算期間の末日における受益権総数	23,543,839口	23,443,839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 2,970,128円	元本の欠損 3,016,579円
3 1口当たり純資産額	0.8738円	0.8713円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第17期 (自 2022年7月16日 至 2023年1月16日)	第18期 (自 2023年1月17日 至 2023年7月18日)
分配金の計算過程	<p>当計算期末における、費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(110,568円)、分配準備積立金(258,738円)により、分配対象収益は369,306円となりましたが、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、当期は分配を見合わせました。</p>	<p>当計算期末における、費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(110,098円)、分配準備積立金(257,639円)により、分配対象収益は367,737円となりましたが、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、当期は分配を見合わせました。</p>

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

1 金融商品に対する取組方針

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

2 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク

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

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

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

3 金融商品に係るリスク管理体制

(1) 市場リスクの管理

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

(2) 信用リスクの管理

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

(3) 取引先リスクの管理

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

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

金融商品の時価等に関する事項

第17期 (2023年1月16日現在)	第18期 (2023年7月18日現在)
<p>1 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>	<p>1 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p>
<p>2 時価の算定方法 (1) 有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引については、「(その他の注記)」の「3 デリバティブ取引関係」に記載されております。 (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>	<p>2 時価の算定方法 (1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左</p>
<p>3 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	<p>3 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 同左</p>
<p>4 金銭債権の計算期間末日後の償還予定額 金銭債権については全て1年以内に償還予定であります。</p>	<p>4 金銭債権の計算期間末日後の償還予定額 同左</p>

金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 期中元本変動額

項目	第17期 (2023年1月16日現在)	第18期 (2023年7月18日現在)
期首元本額	33,814,800円	23,543,839円
期中追加設定元本額	- 円	- 円
期中一部解約元本額	10,270,961円	100,000円

2 有価証券関係

第17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	1,236,858
合計	1,236,858

第18期(2023年7月18日現在)

売買目的有価証券

種類	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	2,005,549
合計	2,005,549

3 デリバティブ取引関係

取引の時価等に関する事項

通貨関連

区分	種類	第17期(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 (円)		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売 建 アメリカドル	20,723,331	-	19,878,533	844,798
合 計		20,723,331	-	19,878,533	844,798

区分	種類	第18期(2023年7月18日現在)			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超 (円)		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売 建 アメリカドル	20,554,750	-	20,051,165	503,585
合 計		20,554,750	-	20,051,165	503,585

(注1) 時価の算定方法

為替予約取引

- 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
計算期間末日において為替予約の受渡日（以下「当該日」という。）の対顧客先物相場が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
計算期間末日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 - 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
 - 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。
- 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。
- 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。

(注2) 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	世界株式絶対収益追求マザーファンド	13,186,971	19,818,698	
親投資信託受益証券 合計		13,186,971	19,818,698	
合計		13,186,971	19,818,698	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

当該事項はデリバティブ取引関係の注記事項として記載しております。

【ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド(為替ヘッジなし)】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第17期 (2023年1月16日現在)	第18期 (2023年7月18日現在)
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	719,396,929	754,003,278
未収入金	-	7,810,177
流動資産合計	719,396,929	761,813,455
資産合計	719,396,929	761,813,455
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	7,810,177
未払受託者報酬	122,877	116,580
未払委託者報酬	2,743,975	2,603,216
その他未払費用	438,982	416,459
流動負債合計	3,305,834	10,946,432
負債合計	3,305,834	10,946,432
純資産の部		
元本等		
元本	651,569,712	614,886,158
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	64,521,383	135,980,865
(分配準備積立金)	83,768,579	107,733,855
元本等合計	716,091,095	750,867,023
純資産合計	716,091,095	750,867,023
負債純資産合計	719,396,929	761,813,455

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第17期 (自 2022年 7月16日 至 2023年 1月16日)	第18期 (自 2023年 1月17日 至 2023年 7月18日)
営業収益		
有価証券売買等損益	45,127,996	82,351,692
営業収益合計	45,127,996	82,351,692
営業費用		
受託者報酬	122,877	116,580
委託者報酬	2,743,975	2,603,216
その他費用	438,982	416,459
営業費用合計	3,305,834	3,136,255
営業利益又は営業損失()	48,433,830	79,215,437
経常利益又は経常損失()	48,433,830	79,215,437
当期純利益又は当期純損失()	48,433,830	79,215,437
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()	745,563	4,123,396
期首剰余金又は期首欠損金()	119,467,886	64,521,383
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,767,110	3,632,559
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,767,110	3,632,559
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金()	64,521,383	135,980,865

(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18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、2023年1月17日から2023年7月18日までとなっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	第17期 (2023年1月16日現在)	第18期 (2023年7月18日現在)
1 当該計算期間の末日における受益権総数	651,569,712口	614,886,158口
2 1口当たり純資産額	1.0990円	1.2211円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第17期 (自 2022年7月16日 至 2023年1月16日)	第18期 (自 2023年1月17日 至 2023年7月18日)
分配金の計算過程	<p>当計算期末における、費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(12,667,782円)、分配準備積立金(83,768,579円)により、分配対象収益は96,436,361円となりましたが、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、当期は分配を見合わせました。</p>	<p>当計算期末における、費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(28,681,459円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(16,292,426円)、収益調整金(その他収益調整金)(11,954,584円)、分配準備積立金(79,052,396円)により、分配対象収益は135,980,865円となりましたが、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、当期は分配を見合わせました。</p>

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

1 金融商品に対する取組方針

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

2 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク

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

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

3 金融商品に係るリスク管理体制

(1) 市場リスクの管理

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

(2) 信用リスクの管理

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

(3) 取引先リスクの管理

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

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

金融商品の時価等に関する事項

第17期 (2023年1月16日現在)	第18期 (2023年7月18日現在)
<p>1 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>	<p>1 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p>
<p>2 時価の算定方法 (1) 有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。</p>	<p>2 時価の算定方法 (1) 有価証券 同左 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左</p>
<p>3 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>3 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 同左</p>
<p>4 金銭債権の計算期間末日後の償還予定額 金銭債権については全て1年以内に償還予定であります。</p>	<p>4 金銭債権の計算期間末日後の償還予定額 同左</p>

金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 期中元本変動額

項目	第17期 (2023年1月16日現在)	第18期 (2023年7月18日現在)
期首元本額	684,618,507円	651,569,712円
期中追加設定元本額	- 円	- 円
期中一部解約元本額	33,048,795円	36,683,554円

2 有価証券関係

第17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	45,923,541
合計	45,923,541

第18期(2023年7月18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	78,114,509
合計	78,114,509

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	世界株式絶対収益追求マザーファンド	501,698,901	754,003,278	
親投資信託受益証券 合計		501,698,901	754,003,278	
合計		501,698,901	754,003,278	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考情報)

当ファンドは、「世界株式絶対収益追求マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。同マザーファンドの2023年7月18日現在(以下「計算日」という)の状況は次の通りであります。

なお、以下に記載した情報は監査意見の対象外であります。

「世界株式絶対収益追求マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

項目	(2023年7月18日現在)
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	7,475,396
投資証券	762,850,831
未収入金	11,388,160
流動資産合計	781,714,387
資産合計	781,714,387
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	75,267
未払解約金	7,810,177
流動負債合計	7,885,444
負債合計	7,885,444
純資産の部	
元本等	
元本	514,885,872
剰余金	
剰余金又は欠損金()	258,943,071
元本等合計	773,828,943
純資産合計	773,828,943
負債純資産合計	781,714,387

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

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法

投資証券は移動平均法に基づき、原則として以下の通り時価評価しております。

(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券

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

(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券

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

(3) 時価が入手できなかった有価証券

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

2 デリバティブの評価基準及び評価方法

為替予約取引

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

3 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準

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

4 その他財務諸表作成のための基礎となる事項

外貨建資産等の会計処理

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2023年7月18日現在)
1 当該計算日における受益権総数	514,885,872口
2 1口当たり純資産額	1.5029円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

1 金融商品に対する取組方針

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

2 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク

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

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

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

3 金融商品に係るリスク管理体制

(1) 市場リスクの管理

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

(2) 信用リスクの管理

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

(3) 取引先リスクの管理

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

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

金融商品の時価等に関する事項

(2023年7月18日現在)

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

金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

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

(2023年7月18日現在)	
同計算期間の期首元本額	548,561,006円
同計算期間中の追加設定元本額	711,918円
同計算期間中の一部解約元本額	34,387,052円
同計算期間末日の元本額	514,885,872円
当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託の元本額は次の通りです。	
ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド（為替ヘッジなし）	501,698,901円
ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド（為替ヘッジあり）	13,186,971円
合計	514,885,872円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	(2023年7月18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	35,437,330
合計	35,437,330

(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7月18日現在)			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超 (円)		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売 建 アメリカドル	11,309,399	-	11,384,666	75,267
合 計		11,309,399	-	11,384,666	75,267

(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はありません。

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカドル	ブラックロック・ストラテジック・ファンズ ブラックロック・システムティック・グローバル・ロング/ショート・エクイティ・ファンド クラスJ投資証券	23,314.230	2,735,924.890	
		グローバル・アルファ・オポチュニティーズ・エクイティ・ファンド・リミテッド クラスA投資証券	264,885.346	2,756,952.640	
	アメリカドル	小計	288,199.576	5,492,877.530 (762,850,831)	
投資証券	合計			762,850,831 (762,850,831)	
合計				762,850,831 (762,850,831)	

(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、内数で表示してまいります。

3 外貨建有価証券の内訳

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

なお、以下に記載した情報は監査意見の対象外です。

同ファンドの状況

(1)「ブラックロック・ストラテジック・ファンズ ブラックロック・システムティック・グローバル・ロング/ショート・エクイティ・ファンド クラスJ投資証券」は、ルクセンブルグにおいて設立されたオープンエンド型投資法人が発行するファンドであり、当該ファンドの現時点で日本語に翻訳された直近の情報は、2022年11月30日に終了する中間計算期間(2022年6月1日から2022年11月30日まで)に係る中間財務書類であります。

当該中間財務書類は、当該ファンドを含む「ブラックロック・ストラテジック・ファンズ」の2022年11月30日現在の中間財務書類のうち、当該ファンドにかかる部分を、委託会社において抜粋し、その原文を翻訳したものです。なお、中間財務書類に含まれる「投資有価証券明細表」の銘柄については原文通り英語表記で行っております。なお、ルクセンブルグにおける独立監査人の監査を受けておりません。

(2)「グローバル・アルファ・オポチュニティーズ・エクイティ・ファンド・リミテッド クラスA投資証券」は、ケイマン諸島において設立されたオープンエンド型投資法人が発行するファンドであり、当該ファンドの現時点で日本語に翻訳された直近の情報は、2022年12月31日に終了する計算期間(2022年1月1日から2022年12月31日まで)に係る財務書類であります。当該財務書類は、その原文を翻訳したものです。

グローバル・アルファ・オポチュニティーズ・エクイティ・ファンド・リミテッド

要約投資有価証券明細表 2022年12月31日現在

期末現在の未決済デリバティブ金融商品

差金決済契約(以下「CFD」という。)

参照事業体	取引相手	期日	正味名目価額 (米ドル)	未実現評価 益(損) (米ドル)	参照事業体の 公正価値純額 (米ドル)	未実現評価益 (損)の対純資 産比率(%)
持分証券	Merrill Lynch	2023年1月16日	12,991	(8,033) ^(a)	4,731	(0.3)
- 買建/売建	International					
	Morgan Stanley & Co.	2023年1月23日	20,341	(3,027) ^(b)	17,107	(0.1)
	International					
			33,332	(11,060)	21,838	(0.4)

(a) 227米ドルの未払配当金および融資手数料を含む。

(b) 207米ドルの未払配当金および融資手数料を含む。

2022年12月31日現在、Merrill Lynch Internationalを取引相手とする2023年1月16日期日のCFD合計の基礎となる個々の買建および売建ポジションならびに関連する持分証券の価額は、下表のとおりである。

参照事業体 - 買建	公正価値 (米ドル)	CFD公正価値の比率 (%)
普通株式		
オーストラリア		
素材	2,828	59.8
消費財、循環型	18,407	389.1
消費財、非循環型	4,834	102.2
エネルギー	385	8.1
金融	1,805	38.1
資本財	2,220	46.9
技術	1,654	35.0
電気・ガス・水道	1,976	41.8
	34,109	
ベルギー		
消費財、非循環型	273	5.8
カナダ		
素材	954	20.2
消費財、非循環型	558	11.8
エネルギー	2,439	51.6
金融	19,295	407.8
電気・ガス・水道	6,639	140.3
	29,885	
デンマーク		
コミュニケーション	138	2.9
消費財、非循環型	12,199	257.9
	12,337	
フランス		
消費財、循環型	3,871	81.8
消費財、非循環型	2,523	53.3
エネルギー	106	2.2
金融	4,080	86.2
資本財	338	7.2
電気・ガス・水道	1,715	36.3
	12,633	

参照事業体 - 買建	公正価値 (米ドル)	CFD公正価値の比率 (%)
ドイツ		
コミュニケーション	8,864	187.4
消費財、循環型	3,824	80.8
消費財、非循環型	1,258	26.6
金融	4,071	86.0
資本財	691	14.6
	18,708	
中国香港特別行政区		
コミュニケーション	625	13.2
エネルギー	789	16.7
金融	1,666	35.2
技術	4,991	105.5
	8,071	
アイルランド		
資本財	162	3.4
イスラエル		
エネルギー	267	5.7
金融	5,014	106.0
資本財	1,203	25.4
	6,484	
イタリア		
金融	1,580	33.4
資本財	643	13.6
電気・ガス・水道	6,300	133.1
	8,523	
日本		
素材	6,214	131.3
コミュニケーション	9,039	191.1
消費財、循環型	11,070	234.0
消費財、非循環型	6,311	133.4
金融	40,629	858.8
資本財	7,480	158.1
技術	6,731	142.3
電気・ガス・水道	511	10.8
	87,985	
中国マカオ特別行政区		
消費財、循環型	4,413	93.3
オランダ		
エネルギー	355	7.5
ニュージーランド		
消費財、循環型	7,916	167.3
消費財、非循環型	5,424	114.6
資本財	1,701	36.0
	15,041	

参照事業体 - 買建	公正価値 (米ドル)	CFD公正価値の比率 (%)
ノルウェー		
金融	1,073	22.7
資本財	1,412	29.8
	2,485	
シンガポール		
コミュニケーション	2,108	44.5
エネルギー	566	12.0
金融	662	14.0
資本財	2,688	56.8
電気・ガス・水道	1,512	32.0
	7,536	
スペイン		
消費財、非循環型	881	18.6
金融	122	2.6
資本財	2,013	42.5
	3,016	
スイス		
消費財、非循環型	490	10.4
英国		
コミュニケーション	3,151	66.6
消費財、循環型	2,800	59.2
消費財、非循環型	6,624	140.0
金融	2,162	45.7
	14,737	
米国		
素材	9,755	206.2
コミュニケーション	16,282	344.2
消費財、循環型	23,126	488.8
消費財、非循環型	25,159	531.8
エネルギー	9,079	191.9
金融	29,981	633.7
資本財	23,635	499.6
技術	9,644	203.8
電気・ガス・水道	7,539	159.3
	154,200	
参照事業体 - 買建合計	421,443	

参照事業体 - 売建	公正価値 (米ドル)	CFD公正価値の比率 (%)
普通株式		
オーストラリア		
素材	(5,655)	(119.5)
金融	(2,274)	(48.1)
資本財	(5,377)	(113.7)
	(13,306)	
ベルギー		
電気・ガス・水道	(283)	(6.0)
カナダ		
素材	(2,675)	(56.5)
コミュニケーション	(5,765)	(121.9)
消費財、循環型	(4,641)	(98.1)
消費財、非循環型	(8,886)	(187.8)
エネルギー	(2,623)	(55.5)
金融	(3,497)	(73.9)
資本財	(6,189)	(130.8)
	(34,276)	
チリ		
素材	(781)	(16.5)
デンマーク		
エネルギー	(2,611)	(55.2)
資本財	(2,675)	(56.5)
電気・ガス・水道	(2,899)	(61.3)
	(8,185)	
フランス		
素材	(537)	(11.3)
コミュニケーション	(133)	(2.8)
消費財、循環型	(2,326)	(49.2)
資本財	(7,487)	(158.3)
	(10,483)	
ドイツ		
コミュニケーション	(621)	(13.1)
消費財、循環型	(4,441)	(93.9)
消費財、非循環型	(4,403)	(93.1)
資本財	(1,511)	(31.9)
	(10,976)	
中国香港特別行政区		
コミュニケーション	(20,055)	(423.9)
消費財、非循環型	(11,324)	(239.3)
金融	(35,609)	(752.7)
資本財	(15,134)	(319.9)
	(82,122)	
アイルランド		
消費財、循環型	(10,093)	(213.4)
金融	(12,993)	(274.6)
	(23,086)	

参照事業体 - 売建	公正価値 (米ドル)	CFD公正価値の比率 (%)
イスラエル		
コミュニケーション	(4,818)	(101.8)
消費財、循環型	(15,566)	(329.0)
消費財、非循環型	(9,862)	(208.5)
	(30,246)	
イタリア		
消費財、循環型	(565)	(11.9)
消費財、非循環型	(2,672)	(56.5)
資本財	(666)	(14.1)
	(3,903)	
日本		
素材	(2,440)	(51.6)
コミュニケーション	(3,423)	(72.4)
消費財、循環型	(32,367)	(684.1)
消費財、非循環型	(4,176)	(88.3)
エネルギー	(6,441)	(136.1)
金融	(17,787)	(376.0)
資本財	(5,906)	(124.8)
技術	(10,391)	(219.6)
	(82,931)	
ルクセンブルグ		
消費財、非循環型	(780)	(16.5)
資本財	(852)	(18.0)
	(1,632)	
オランダ		
コミュニケーション	(1,454)	(30.7)
消費財、非循環型	(122)	(2.6)
	(1,576)	
ニュージーランド		
技術	(3,765)	(79.6)
ノルウェー		
素材	(2,329)	(49.2)
コミュニケーション	(593)	(12.5)
消費財、非循環型	(3,685)	(77.9)
エネルギー	(2,349)	(49.7)
金融	(1,459)	(30.8)
	(10,415)	
ポルトガル		
エネルギー	(283)	(6.0)
シンガポール		
金融	(7,893)	(166.8)
南アフリカ		
金融	(295)	(6.2)
スペイン		
エネルギー	(386)	(8.2)

参照事業体 - 売建	公正価値 (米ドル)	CFD公正価値の比率 (%)
スウェーデン		
消費財、循環型	(3,233)	(68.3)
金融	(946)	(20.0)
資本財	(1,630)	(34.5)
技術	(3,097)	(65.5)
	(8,906)	
スイス		
コミュニケーション	(548)	(11.6)
消費財、循環型	(675)	(14.3)
消費財、非循環型	(11,745)	(248.3)
エネルギー	(5,164)	(109.1)
金融	(3,522)	(74.4)
技術	(1,603)	(33.9)
電気・ガス・水道	(957)	(20.2)
	(24,214)	
英国		
消費財、循環型	(2,566)	(54.2)
消費財、非循環型	(5,558)	(117.5)
金融	(2,455)	(51.9)
資本財	(525)	(11.1)
	(11,104)	
米国		
素材	(329)	(7.0)
消費財、循環型	(14,474)	(305.9)
金融	(30,862)	(652.3)
	(45,665)	
参照事業体 - 売建合計	(416,712)	
参照事業体 - Merrill Lynch International純額	4,731	

2022年12月31日現在、Morgan Stanley & Co. Internationalを取引相手とする2023年1月23日日期日のCFD合計の基礎となる個々の買建および売建ポジションならびに関連する持分証券の価額は、下表のとおりである。

参照事業体 - 買建	公正価値 (米ドル)	CFD公正価値の比率 (%)
普通株式		
オーストラリア		
素材	34,138	199.6
コミュニケーション	4,174	24.4
消費財、循環型	7,049	41.2
消費財、非循環型	26,232	153.3
金融	35,828	209.4
資本財	22,906	133.9
技術	8,049	47.0
電気・ガス・水道	14,396	84.2
	152,772	
オーストリア		
技術	1,598	9.3
ベルギー		
コミュニケーション	4,099	24.0
消費財、非循環型	1,296	7.6
金融	878	5.1
資本財	8,537	49.9
	14,810	
カナダ		
素材	12,373	72.3
消費財、循環型	6,524	38.1
消費財、非循環型	8,728	51.0
エネルギー	47,720	279.0
金融	9,621	56.3
電気・ガス・水道	20,072	117.3
	105,038	
デンマーク		
コミュニケーション	1,353	7.9
消費財、非循環型	37,466	219.0
	38,819	
フィンランド		
資本財	10,997	64.3
フランス		
消費財、循環型	45,060	263.4
消費財、非循環型	5,756	33.6
エネルギー	4,047	23.7
金融	30,481	178.2
資本財	45,269	264.6
電気・ガス・水道	31,663	185.1
	162,276	

参照事業体 - 買建	公正価値 (米ドル)	CFD公正価値の比率 (%)
ドイツ		
素材	2,029	11.9
コミュニケーション	29,518	172.6
消費財、循環型	16,542	96.7
消費財、非循環型	503	2.9
金融	19,177	112.1
資本財	7,391	43.2
技術	2,434	14.2
電気・ガス・水道	19,797	115.7
	97,391	
中国香港特別行政区		
消費財、循環型	13,699	80.1
消費財、非循環型	4,393	25.7
エネルギー	197	1.1
金融	27,141	158.7
資本財	10,468	61.2
技術	4,278	25.0
	60,176	
アイルランド		
消費財、非循環型	49,931	291.9
資本財	6,046	35.3
	55,977	
イスラエル		
コミュニケーション	1,690	9.9
エネルギー	1,479	8.6
金融	23,967	140.1
技術	4,668	27.3
	31,804	
イタリア		
金融	2,218	12.9
資本財	5,094	29.8
電気・ガス・水道	29,527	172.6
	36,839	
日本		
素材	7,130	41.7
コミュニケーション	119,677	699.6
消費財、循環型	97,683	571.0
消費財、非循環型	158,587	927.0
エネルギー	5,290	30.9
金融	373,547	2,183.6
資本財	184,987	1,081.4
技術	88,487	517.3
電気・ガス・水道	11,384	66.5
	1,046,772	
中国マカオ特別行政区		
消費財、循環型	6,232	36.4

参照事業体 - 買建	公正価値 (米ドル)	CFD公正価値の比率 (%)
オランダ		
素材	4,546	26.6
消費財、非循環型	7,063	41.3
エネルギー	444	2.6
金融	4,073	23.8
	16,126	
ニュージーランド		
資本財	2,382	13.9
ノルウェー		
エネルギー	119	0.7
金融	1,659	9.7
資本財	1,933	11.3
	3,711	
シンガポール		
コミュニケーション	16,096	94.1
消費財、非循環型	1,244	7.2
資本財	21,006	122.8
電気・ガス・水道	8,568	50.1
	46,914	
スペイン		
消費財、非循環型	6,736	39.4
エネルギー	676	3.9
金融	3,437	20.1
資本財	14,763	86.3
	25,612	
スウェーデン		
消費財、循環型	11,870	69.4
金融	558	3.3
	12,428	
スイス		
消費財、循環型	2,851	16.7
消費財、非循環型	1,959	11.4
金融	4,976	29.1
資本財	39,562	231.3
	49,348	
英国		
コミュニケーション	59,971	350.6
消費財、循環型	23,377	136.7
消費財、非循環型	29,480	172.3
金融	55,742	325.8
資本財	614	3.6
	169,184	

参照事業体 - 買建	公正価値 (米ドル)	CFD公正価値の比率 (%)
米国		
素材	71,777	419.6
コミュニケーション	151,209	883.9
消費財、循環型	157,033	917.9
消費財、非循環型	282,524	1,651.5
エネルギー	8,551	50.0
金融	413,897	2,419.5
資本財	343,334	2,007.0
技術	335,592	1,961.7
電気・ガス・水道	32,560	190.3
	<u>1,796,477</u>	
参照事業体 - 買建合計	<u>3,943,683</u>	

参照事業体 - 売建	公正価値 (米ドル)	CFD公正価値の比率 (%)
普通株式		
オーストラリア		
素材	(26,967)	(157.7)
消費財、循環型	(26,550)	(155.2)
消費財、非循環型	(11,106)	(64.9)
エネルギー	(1,658)	(9.7)
金融	(49,905)	(291.7)
資本財	(16,487)	(96.4)
技術	(964)	(5.6)
	(133,637)	
オーストリア		
エネルギー	(565)	(3.3)
バミューダ		
消費財、非循環型	(11,005)	(64.3)
金融	(14,561)	(85.1)
	(25,566)	
カナダ		
コミュニケーション	(24,224)	(141.6)
消費財、循環型	(3,657)	(21.4)
消費財、非循環型	(10,416)	(60.9)
エネルギー	(2,880)	(16.8)
金融	(4,095)	(23.9)
資本財	(17,199)	(100.6)
	(62,471)	
チリ		
素材	(2,528)	(14.8)
デンマーク		
エネルギー	(9,166)	(53.6)
金融	(4,867)	(28.4)
資本財	(19,692)	(115.1)
電気・ガス・水道	(4,802)	(28.1)
	(38,527)	
フィンランド		
資本財	(2,031)	(11.9)
フランス		
コミュニケーション	(7,796)	(45.6)
消費財、循環型	(20,495)	(119.8)
消費財、非循環型	(1,567)	(9.2)
金融	(15,062)	(88.0)
資本財	(84,247)	(492.5)
	(129,167)	

参照事業体 - 売建	公正価値 (米ドル)	CFD公正価値の比率 (%)
ドイツ		
素材	(1,092)	(6.4)
コミュニケーション	(15,342)	(89.7)
消費財、循環型	(30,342)	(177.4)
消費財、非循環型	(9,671)	(56.5)
エネルギー	(338)	(2.0)
資本財	(10,574)	(61.8)
技術	(4,202)	(24.5)
	(71,561)	
中国香港特別行政区		
消費財、非循環型	(1,901)	(11.1)
アイルランド		
エネルギー	(393)	(2.3)
イスラエル		
消費財、循環型	(351)	(2.1)
技術	(2,928)	(17.1)
	(3,279)	
イタリア		
消費財、循環型	(269)	(1.6)
消費財、非循環型	(3,711)	(21.7)
金融	(3,529)	(20.6)
資本財	(10,358)	(60.5)
	(17,867)	
日本		
素材	(104,812)	(612.7)
コミュニケーション	(34,957)	(204.3)
消費財、循環型	(127,150)	(743.3)
消費財、非循環型	(161,692)	(945.2)
金融	(320,698)	(1,874.7)
資本財	(160,610)	(938.8)
技術	(89,808)	(525.0)
電気・ガス・水道	(20,208)	(118.1)
	(1,019,935)	
ジャージー		
消費財、非循環型	(733)	(4.3)
ルクセンブルグ		
消費財、非循環型	(10,163)	(59.4)
金融	(2,402)	(14.0)
	(12,565)	
オランダ		
コミュニケーション	(3,183)	(18.6)
消費財、非循環型	(3,503)	(20.5)
	(6,686)	

参照事業体 - 売建	公正価値 (米ドル)	CFD公正価値の比率 (%)
ニュージーランド		
消費財、非循環型	(24,399)	(142.6)
資本財	(4,055)	(23.7)
技術	(8,530)	(49.9)
電気・ガス・水道	(18,292)	(106.9)
	(55,276)	
ノルウェー		
素材	(700)	(4.1)
消費財、非循環型	(10,937)	(63.9)
エネルギー	(3,250)	(19.0)
金融	(14,034)	(82.0)
技術	(80)	(0.5)
	(29,001)	
ポルトガル		
エネルギー	(7,038)	(41.1)
電気・ガス・水道	(373)	(2.2)
	(7,411)	
シンガポール		
コミュニケーション	(13,956)	(81.6)
消費財、非循環型	(349)	(2.1)
金融	(21,919)	(128.1)
	(36,224)	
スペイン		
コミュニケーション	(1,958)	(11.4)
エネルギー	(9,025)	(52.8)
電気・ガス・水道	(10,067)	(58.8)
	(21,050)	
スウェーデン		
素材	(3,218)	(18.8)
コミュニケーション	(10,879)	(63.6)
消費財、非循環型	(5,376)	(31.4)
金融	(17,032)	(99.6)
資本財	(10,337)	(60.4)
	(46,842)	
スイス		
コミュニケーション	(21,355)	(124.8)
消費財、循環型	(2,291)	(13.4)
消費財、非循環型	(52,335)	(305.9)
金融	(33,046)	(193.2)
技術	(20,229)	(118.3)
電気・ガス・水道	(16,134)	(94.3)
	(145,390)	

参照事業体 - 売建	公正価値 (米ドル)	CFD公正価値の比率 (%)
英国		
素材	(19,631)	(114.8)
コミュニケーション	(28,603)	(167.2)
消費財、循環型	(96,634)	(564.9)
消費財、非循環型	(81,105)	(474.1)
金融	(69,936)	(408.8)
資本財	(18,552)	(108.4)
技術	(901)	(5.3)
電気・ガス・水道	(1,614)	(9.4)
	<hr/>	
	(316,976)	
米国		
素材	(43,446)	(254.0)
コミュニケーション	(175,797)	(1,027.6)
消費財、循環型	(109,827)	(642.0)
消費財、非循環型	(256,827)	(1,501.3)
エネルギー	(44,537)	(260.4)
金融	(492,945)	(2,881.6)
資本財	(178,413)	(1,042.9)
技術	(265,797)	(1,553.7)
電気・ガス・水道	(169,892)	(993.1)
	<hr/>	
	(1,737,481)	
ウルグアイ		
技術	(1,513)	(8.8)
	<hr/>	
参照事業体 - 売建合計	(3,926,576)	
参照事業体 - Morgan Stanley & Co. International純額	<hr/>	
	17,107	

リスク・エクスポージャー別のデリバティブ金融商品

下表は、リスク・エクスポージャー別の、2022年12月31日現在のファンドのデリバティブ金融商品の公正価値および資産負債計算書上の科目の要約である。

	商品 契約 (米ドル)	信用 契約 (米ドル)	株式 契約 (米ドル)	為替 契約 (米ドル)	金利 契約 (米ドル)	その他の 契約 (米ドル)	合計 (米ドル)
負債 - デリバティブ金融商品							
差金決済契約							
差金決済契約に係る未実現評価損	-	-	11,060	-	-	-	11,060

下表は、2022年12月31日に終了した会計年度における損益計算書上のデリバティブ金融商品による影響の要約である。

	商品 契約 (米ドル)	信用 契約 (米ドル)	株式 契約 (米ドル)	為替 契約 (米ドル)	金利 契約 (米ドル)	その他の 契約 (米ドル)	合計 (米ドル)
以下に係る実現純利益(損失)							
差金決済契約	-	-	133,694	-	-	-	133,694
以下に係る未実現評価益(損)の純変動額							
差金決済契約	-	-	15,920	-	-	-	15,920

未決済デリバティブ金融商品の平均残高^(a)

2022年12月31日に終了した会計年度の各月末における未決済デリバティブ金融商品の平均残高^(a)は、下表のとおりである。

	(米ドル)
差金決済契約	
契約の平均名目価額 - 買建	4,804,952
契約の平均名目価額 - 売建	4,805,417

^(a) 未決済の平均名目価額は、2022年12月31日に終了した会計年度における平均取引高を表す。

期末現在のデリバティブ金融商品 - 相殺

2022年12月31日現在、ファンドのデリバティブ資産および負債(種類別)は下表のとおりである。

	資産 (米ドル)	負債 (米ドル)
デリバティブ金融商品		
差金決済契約	-	11,060
資産負債計算書上のデリバティブ資産および負債の合計	-	11,060
マスター・ネットティング契約または同様の契約(以下「MNA」という。)の対象ではないデリバティブ	-	-
MNAの対象となるデリバティブ資産および負債の合計	-	11,060

下表は、MNAに基づき相殺可能な金額およびファンドの関連する受取および/または差入担保を控除後の、2022年12月31日現在のファンドのデリバティブ資産および負債の要約である。

取引相手	MNAの対象となる 負債(総額) (米ドル)	相殺可能な デリバティブ (米ドル)	非現金担保 ^(a) (米ドル)	現金担保 ^(a) (米ドル)	負債(純額) ^(b) (米ドル)
Merrill Lynch International	8,033	-	-	-	8,033
Morgan Stanley & Co. International	3,027	-	-	(3,027)	-
	11,060	-	-	(3,027)	8,033

(a) 財務報告の目的上、受取または差入担保の超過額は表示されていない。

(b) 債務不履行時に取引相手に支払われる純額を表す。

期末の公正価値ヒエラルキー

投資およびデリバティブ金融商品の評価に関するファンドの方針の情報については財務書類に対する注記を参照のこと。

2022年12月31日現在、ファンドの投資およびデリバティブ金融商品の公正価値ヒエラルキーに基づく分類は下表のとおりである。

	レベル1 (米ドル)	レベル2 (米ドル)	レベル3 (米ドル)	実務上の簡便法に よる純資産価額	合計 (米ドル)
デリバティブ金融商品 ^(a)					
負債					
株式契約	-	11,060	-	-	11,060

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

グローバル・アルファ・オポチュニティーズ・エクイティ・ファンド・リミテッド
資産負債計算書 2022年12月31日現在

	米ドル
資産	
現金および現金同等物	2,013,057
外国通貨、公正価値(取得原価274,000米ドル)	265,682
ブローカーに対する債権	6,632
差入担保金:	
担保 - OTCデリバティブ	650,000
未収金:	
未収利息	226
前払費用	8,529
資産合計	2,944,126
負債	
ブローカーに対する債務	25,532
未払金:	
未払監査報酬	41,000
未払管理事務代行報酬	23,382
未払投資運用報酬	7,788
その他の未払費用および負債	448
以下に係る未実現評価損:	
差金決済契約	11,060
負債合計	109,210
純資産	2,834,916

財務書類に対する注記を参照のこと。

グローバル・アルファ・オポチュニティーズ・エクイティ・ファンド・リミテッド

損益計算書 2022年12月31日に終了した会計年度

	米ドル
投資収益	
受取利息	16,315
費用	
管理事務代行報酬	56,149
投資運用報酬	49,900
専門家報酬	41,000
取締役報酬	16,000
登録関連費用	10,495
支払利息	1,428
貸株料	367
その他の費用	3,333
費用合計	178,672
投資純利益（損失）	(162,357)
実現および未実現利益（損失）	
以下に係る実現純利益（損失）：	
差金決済契約	133,694
外国通貨取引	(9,241)
実現純利益（損失）	124,453
以下に係る未実現評価益（損）の純変動額：	
差金決済契約	15,920
外貨換算	(11,849)
未実現評価益（損）の純変動	4,071
実現純利益（損失）および未実現利益（損失）の純変動	128,524
運用による純資産の純増加（減少）額	(33,833)

財務書類に対する注記を参照のこと。

グローバル・アルファ・オポチュニティーズ・エクイティ・ファンド・リミテッド
純資産変動計算書 2022年12月31日に終了した会計年度

	米ドル
純資産の増加（減少）	
運用	
投資純利益（損失）	(162,357)
実現純利益（損失）	124,453
未実現評価益（損）の純変動	4,071
運用による純資産の純増加（減少）額	(33,833)
資本取引	
投資証券買戻し	(378,341)
純資産	
純資産の純増加（減少）額	(412,174)
期首純資産	3,247,090
期末純資産	2,834,916

財務書類に対する注記を参照のこと。

グローバル・アルファ・オポチュニティーズ・エクイティ・ファンド・リミテッド
キャッシュ・フロー計算書 2022年12月31日に終了した会計年度

米ドル

営業活動により生じた（に使用した）キャッシュ・フロー	
運用による純資産の純増加（減少）額	(33,833)
運用による純資産の純増加（減少）額から営業活動により生じた（に使用した）現金純額への調整：	
外国通貨取引の決済による純収入（支払額）	(9,241)
実現純（利益）損失	(124,453)
未実現評価（益）損の純変動	(4,071)
デリバティブに関して取引相手から受領した（に支払った）純支払額	133,694
営業資産の（増加）減少：	
ブローカーに対する債権	(1,558)
未収金：	
未収利息	(226)
前払費用	(148)
営業負債の増加（減少）：	
ブローカーに対する債務	25,532
未払金：	
未払専門家報酬	(8,757)
未払管理事務代行報酬	4,531
未払投資運用報酬	(1,233)
その他の未払費用および負債	(67)
営業活動により生じた（に使用した）現金純額	(19,830)
財務活動により生じた（に使用した）キャッシュ・フロー	
投資証券買戻し	(378,341)
外国通貨に対する為替レートの影響額	(11,849)
拘束性および非拘束性の現金および現金同等物ならびに外国通貨の純増加（減少）額	(410,020)
拘束性および非拘束性の現金および現金同等物ならびに外国通貨	
期首	3,338,759
期末	2,928,739

財務書類に対する注記を参照のこと。

グローバル・アルファ・オポチュニティーズ・エクイティ・ファンド・リミテッド
キャッシュ・フロー計算書 2022年12月31日に終了した会計年度（続き）

	米ドル
キャッシュ・フロー情報の補足的開示	
利息に係る当期の現金支払額	1,428
資産負債計算書から期末現在の拘束性および非拘束性の現金および現金同等物ならびに外国通貨への調整	
現金および現金同等物	2,013,057
外国通貨、公正価値	265,682
差入担保金：	
担保 - OTCデリバティブ	650,000
期末	2,928,739

財務書類に対する注記を参照のこと。

グローバル・アルファ・オポチュニティーズ・エクイティ・ファンド・リミテッド

財務ハイライト 2022年12月31日に終了した会計年度

投資証券1口当たり運用成績

	クラス A
	米ドル
期首純資産価額	10.25
投資純利益(損失) ^(a)	(0.55)
実現純利益(損失)および未実現利益(損失)の純変動	0.43
運用による純資産の純増加(減少)額	(0.12)
期末純資産価額	10.13
トータル・リターン ^(b)	
トータル・リターン	(1.12)%
平均純資産に占める割合 ^(c)	
投資純利益(損失)	(5.37)%
費用合計 ^(d)	5.91%

(a) 当期における発行済の平均投資証券口数に基づく。

(b) 該当がある場合、投資運用報酬による影響を含む。

(c) 割合はクラス投資証券を全体として捉えて計算したものである。この割合の計算上、平均純資産は2022年12月31日の投資証券買戻し(該当がある場合)考慮前で計算されている。

(d) 支払利息および貸株料を含む。

投資証券1口当たり運用成績は、期中の平均発行済投資証券口数を用いて計算したものである。投資トータル・リターンは、会計年度初日の純資産価額で投資証券を購入し、会計年度最終日の純資産価額で売却したものと仮定して計算されている。投資トータル・リターンおよび割合は、各クラス投資証券を全体として捉えて計算したものである。個々の投資主の投資トータル・リターンおよび割合は、資本取引の時期および報酬の取り決めに基づき異なる場合がある。一部の財務ハイライトデータは、四捨五入により、資本勘定に関する計算書とは異なる場合がある。

財務書類に対する注記を参照のこと。

純資産計算書 2022年11月30日現在(未監査)

	注記	ブラックロック・システムティック・ グローバル・ロング/ショート・ エクイティ・ファンド 米ドル
資産		
投資有価証券 - 取得原価		32,228,784
未実現評価損		(117,737)
投資有価証券 - 時価	2 (a)	32,111,047
銀行預金	2 (a)	3,236,545
ブローカーに対する債権	14	251,944
未収利息および未収配当金	2 (a)、2 (d)	27,417
売却投資有価証券未収金	2 (a)、2 (d)	13,953,122
販売投資証券未収金	2 (a)	1,183
以下に係る未実現評価益：		
未決済先渡為替予約	2 (d)	957,155
差金決済契約	2 (d)	2,796,906
買建オプション/スワップオプションの時価	2 (d)	6,030
資産合計		53,341,349
負債		
ブローカーに対する債務	14	66,613
未払利息および未払配当金	2 (a)、2 (d)	125,293
購入投資有価証券未払金	2 (a)、2 (d)	14,156,929
買戻し投資証券未払金	2 (a)	205
以下に係る未実現評価損：		
先物取引	2 (d)	38,205
未決済先渡為替予約	2 (d)	12,068
差金決済契約	2 (d)	2,932,491
売建オプション/スワップオプションの時価	2 (d)	350
未払費用およびその他の負債	2 (a)、4、5、 6、7、8	602,962
負債合計		17,935,116
純資産合計		35,406,233

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11月30日現在(未監査)

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

	通貨	2022年	2022年	2021年	2020年
		11月30日現在	5月31日現在	5月31日現在	5月31日現在
純資産合計	米ドル	35,406,233	52,481,344	47,865,656	72,200,396
以下の1口当たり純資産価額:					
クラスA無分配投資証券	米ドル	106.02	106.08	112.00	108.48
クラスAユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	89.63	90.78	96.86	94.73
クラスAスウェーデン・コロナ・ヘッジ無分配投資証券	スウェーデン・ コロナ	910.04	917.73	977.04	952.17
クラスAユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	90.48	91.64	97.77	95.56
クラスC無分配投資証券	米ドル	93.91	94.44	100.72	98.53
クラスD無分配投資証券	米ドル	106.63	106.37	111.63	107.46
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	97.80	98.73	104.72	101.81
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	102.72	102.84	108.11	104.55
クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	89.02	90.39	96.96	95.30
クラスIユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	91.86	92.62	99.27	96.22
クラスJ分配型投資証券	米ドル	111.49	111.23	116.76	112.41
クラスX無分配投資証券	米ドル	126.51	125.26	129.52	122.84

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11月30日に終了した会計期間（未監査）

	注記	米ドル
期首純資産		52,481,344
収益		
預金利息	2 (c)	8,264
債券利息	2 (c)	402,478
差金決済契約に係る受取利息	2 (c)、2 (d)	29,258
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)	950,723
収益合計		1,390,723
費用		
銀行利息	2 (c)	48
差金決済契約に係る支払利息	2 (c)、2 (d)	256,215
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)	1,155,973
年間サービス費用	5	62,610
預託報酬	2 (i)、6	448,717
税金	8	8,133
販売報酬	4	17,562
ローン・コミットメント・フィー	13	80
投資運用報酬および投資運用再委託報酬	4	306,651
払戻考慮前費用合計		2,255,989
費用の払戻し	4	420,243
払戻考慮後費用合計		1,835,746
投資純損失		(445,023)
以下に係る実現純利益 / (損失) :		
投資有価証券	2 (a)、2 (b)	(10,936)
差金決済契約	2 (d)	8,167
先物取引	2 (d)	289,995
外国通貨および先渡為替予約	2 (d)、2 (e)、2 (j)	(3,023,901)
オプション / スワップション契約	2 (d)	(10)
当期実現純損失		(2,736,685)
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)	(44,678)
差金決済契約	2 (d)	29,961
先物取引	2 (d)	(62,043)
外国通貨および先渡為替予約	2 (d)、2 (e)、2 (j)	537,750
オプション / スワップション契約	2 (d)	(12,495)
当期末実現評価益 / (損) の純変動		448,495
運用成績による純資産の減少		(2,733,213)
資本の変動		
投資証券発行による正味受取額		18,817,564
投資証券買戻しによる正味支払額		(33,159,462)
資本の変動による純資産の減少		(14,341,898)
期末純資産		35,406,233

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11月30日に終了した会計期間（未監査）

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

	期首発行済 投資証券口数	当期発行 投資証券口数	当期買戻し 投資証券口数	期末発行済 投資証券口数
クラスA無分配投資証券	15,649	1,549	346	16,852
クラスAユーロ・ヘッジ無分配投資証券	40,814	-	-	40,814
クラスAスウェーデン・クローナ・ヘッジ無分配投資証券	755	195	31	919
クラスA Iユーロ・ヘッジ無分配投資証券	45	275	-	320
クラスC無分配投資証券	529	-	-	529
クラスD無分配投資証券	38,548	55,940	59,013	35,475
クラスDユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	291,701	120,978	254,031	158,648
クラスD英債券・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	2,980	94	433	2,641
クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券	79,183	6,687	15,837	70,033
クラスIユーロ・ヘッジ無分配投資証券	44	-	-	44
クラスJ分配型投資証券	27,504	-	1,917	25,587
クラスX無分配投資証券	5,259	134	4,485	908

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

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

投資有価証券明細表 2022年11月30日現在(未監査)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品			
普通株式およびワラント			
ケイマン諸島			
18,000	Hedosophia European Growth	183,147	0.52
6,000	Hedosophia European Growth (Wts 13/5/2027)	125	0.00
		183,272	0.52
オランダ			
10,022	Azerion Group NV	60,975	0.17
3,340	Azerion Group NV (Wts 26/3/2026)	1,283	0.00
4,017	Climate Transition Capital Acquisition I BV	40,560	0.11
1,339	Climate Transition Capital Acquisition I BV (Wts 29/6/2026)	125	0.00
9,928	Pegasus Acquisition Co Europe BV (Unit)	100,810	0.29
		203,753	0.57
普通株式およびワラント合計		387,025	1.09
債券			
米国			
USD 1,000,000	United States Treasury Bill 1/12/2022 (Zero Coupon)	1,000,000	2.82
USD 5,700,000	United States Treasury Bill 6/12/2022 (Zero Coupon)	5,697,377	16.09
USD 2,000,000	United States Treasury Bill 13/12/2022 (Zero Coupon)	1,998,000	5.64
USD 2,000,000	United States Treasury Bill 20/12/2022 (Zero Coupon)	1,996,253	5.64
USD 500,000	United States Treasury Bill 22/12/2022 (Zero Coupon)	499,078	1.41
USD 1,400,000	United States Treasury Bill 3/1/2023 (Zero Coupon)	1,395,115	3.94
USD 3,000,000	United States Treasury Bill 10/1/2023 (Zero Coupon)	2,987,088	8.44
USD 5,000,000	United States Treasury Bill 17/1/2023 (Zero Coupon)	4,974,646	14.05
USD 1,000,000	United States Treasury Bill 19/1/2023 (Zero Coupon)	994,848	2.81
USD 5,000,000	United States Treasury Bill 24/1/2023 (Zero Coupon)	4,970,856	14.04
USD 1,250,000	United States Treasury Bill 26/1/2023 (Zero Coupon)	1,242,553	3.51
USD 2,000,000	United States Treasury Bill 2/2/2023 (Zero Coupon)	1,985,912	5.61
USD 2,000,000	United States Treasury Bill 16/2/2023 (Zero Coupon)	1,982,296	5.60
		31,724,022	89.60
債券合計		31,724,022	89.60
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		32,111,047	90.69
投資有価証券(時価)合計		32,111,047	90.69
その他の純資産		3,295,186	9.31
純資産合計(米ドル)		35,406,233	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			
4,841	a2 Milk Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,072
4,331	a2 Milk Co Ltd	Goldman Sachs	959
8,511	a2 Milk Co Ltd	Morgan Stanley	114
4,012	Abacus Property Group (REIT)	Goldman Sachs	161
428	Accent Group Ltd	Goldman Sachs	30
(1,032)	Adbri Ltd	Bank of America Merrill Lynch	38
(13,862)	Adbri Ltd	Goldman Sachs	511
(7,606)	Adbri Ltd	Morgan Stanley	230
8,512	AGL Energy Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,805
5,377	AGL Energy Ltd	Goldman Sachs	818
14,718	AGL Energy Ltd	Morgan Stanley	963
4,035	Allkem Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,309)
2,843	Allkem Ltd	Goldman Sachs	(1,344)
1,109	Allkem Ltd	Morgan Stanley	(573)
(308)	ALS Ltd	Bank of America Merrill Lynch	29
(7,791)	ALS Ltd	Goldman Sachs	52
(8,750)	APA Group (Unit)	Goldman Sachs	(1,643)
(477)	Appen Ltd	Goldman Sachs	54
1,168	Arena (REIT)	Goldman Sachs	(16)
2,468	Aristocrat Leisure Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,237)
1,024	Aristocrat Leisure Ltd	Goldman Sachs	(924)
5,144	Aristocrat Leisure Ltd	Morgan Stanley	(2,623)
45	ASX Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(20)
224	ASX Ltd	Goldman Sachs	(98)
167	ASX Ltd	Morgan Stanley	(92)
(32,518)	Atlas Arteria Ltd (Unit)	Goldman Sachs	(8,262)
(840)	Aussie Broadband Ltd	Goldman Sachs	(73)
467	Australian Agricultural Co Ltd	Goldman Sachs	8
(3,674)	Australian Clinical Labs Ltd	Bank of America Merrill Lynch	174
(720)	Australian Clinical Labs Ltd	Goldman Sachs	63
3,679	Australian Ethical Investment Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(592)
3,693	Australian Ethical Investment Ltd	Goldman Sachs	(595)
931	Bank of Queensland Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(56)
835	Bank of Queensland Ltd	Goldman Sachs	(50)
3,986	Bank of Queensland Ltd	Morgan Stanley	(481)
(310)	Bapcor Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2)
(1,150)	Bapcor Ltd	Goldman Sachs	(26)
(18,846)	Beach Energy Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(569)
(55,302)	Beach Energy Ltd	Goldman Sachs	(1,669)
(58,386)	Beach Energy Ltd	Morgan Stanley	(2,742)
(5,171)	Bega Cheese Ltd	Goldman Sachs	(624)
(15,012)	Bellevue Gold Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,109)
(12,708)	Bellevue Gold Ltd	Goldman Sachs	(1,790)

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)		
1,544	BHP Group Ltd	Morgan Stanley	2,113
(47)	Blackmores Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(86)
(12)	Blackmores Ltd	Goldman Sachs	(25)
(64)	BlueScope Steel Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(25)
(8,624)	BlueScope Steel Ltd	Goldman Sachs	(3,413)
7,750	Boral Ltd	Bank of America Merrill Lynch	624
3,778	Boral Ltd	Goldman Sachs	304
7,328	Boral Ltd	Morgan Stanley	197
(3,792)	Brambles Ltd	Goldman Sachs	(2,086)
(930)	BWP Trust (REIT)	Goldman Sachs	(62)
(158)	Capricorn Metals Ltd	Bank of America Merrill Lynch	10
(457)	Capricorn Metals Ltd	Goldman Sachs	10
(145)	carsales.com Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(142)
(629)	carsales.com Ltd	Goldman Sachs	(616)
(236)	carsales.com Ltd	Morgan Stanley	(228)
(3,169)	Centuria Capital Group	Goldman Sachs	(106)
(1,421)	Centuria Industrial (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(143)
(227)	Centuria Industrial (REIT)	Goldman Sachs	(23)
3,897	Challenger Ltd	Goldman Sachs	393
2,531	Challenger Ltd	Morgan Stanley	200
(5,549)	Champion Iron Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(999)
(9,196)	Champion Iron Ltd	Goldman Sachs	(1,833)
731	Charter Hall Group (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	284
32	Charter Hall Group (REIT)	Goldman Sachs	12
237	Charter Hall Group (REIT)	Morgan Stanley	64
(870)	Charter Hall Long Wale (REIT)	Goldman Sachs	(105)
120	Charter Hall Retail (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	3
7,676	Charter Hall Retail (REIT)	Goldman Sachs	206
4,596	Charter Hall Social Infrastructure (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	93
6,555	Charter Hall Social Infrastructure (REIT)	Goldman Sachs	132
(47,404)	Cleanaway Waste Management Ltd	Goldman Sachs	(3,498)
57	Clinuvel Pharmaceuticals Ltd	Bank of America Merrill Lynch	11
218	Clinuvel Pharmaceuticals Ltd	Goldman Sachs	46
99	Collins Foods Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(167)
318	Collins Foods Ltd	Goldman Sachs	(535)
(557)	Computershare Ltd	Goldman Sachs	(613)
(5,262)	Core Lithium Ltd	Goldman Sachs	(243)
1,535	Coronado Global Resources Inc - CDI	Bank of America Merrill Lynch	72
453	Coronado Global Resources Inc - CDI	Goldman Sachs	21
(129)	Corporate Travel Management Ltd	Bank of America Merrill Lynch	51
(129)	Corporate Travel Management Ltd	Goldman Sachs	78
557	Credit Corp Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	52
1,011	Credit Corp Group Ltd	Goldman Sachs	94
(25,485)	Cromwell Property Group (REIT)	Goldman Sachs	256
98	Data#3 Ltd	Goldman Sachs	7

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)		
5,091	Deterra Royalties Ltd	Morgan Stanley	546
4,162	Dexus Industria (REIT)	Goldman Sachs	112
(310)	Dicker Data Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(92)
(369)	Dicker Data Ltd	Goldman Sachs	(122)
6,929	Domain Holdings Australia Ltd	Bank of America Merrill Lynch	46
5,156	Domain Holdings Australia Ltd	Goldman Sachs	35
5,148	Domain Holdings Australia Ltd	Morgan Stanley	104
175	Domino's Pizza Enterprises Ltd	Bank of America Merrill Lynch	263
386	Domino's Pizza Enterprises Ltd	Goldman Sachs	580
245	Domino's Pizza Enterprises Ltd	Morgan Stanley	289
13,799	Downer EDI Ltd	Bank of America Merrill Lynch	593
12,077	Downer EDI Ltd	Goldman Sachs	910
2,834	Downer EDI Ltd	Morgan Stanley	25
298	Eagers Automotive Ltd	Goldman Sachs	(2)
(14,693)	Endeavour Group Ltd	Goldman Sachs	887
(4,867)	Endeavour Group Ltd	Morgan Stanley	392
(1,624)	Evolution Mining Ltd	Goldman Sachs	(22)
1,907	Flight Centre Travel Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	308
6,298	Flight Centre Travel Group Ltd	Goldman Sachs	285
10,759	Flight Centre Travel Group Ltd	Morgan Stanley	1,986
(849)	G8 Education Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(14)
(10,167)	G8 Education Ltd	Goldman Sachs	(171)
(171)	Goodman Group (REIT)	Goldman Sachs	(142)
(4,638)	Grange Resources Ltd	Goldman Sachs	38
3,462	Growthpoint Properties Australia Ltd (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(100)
2,689	Growthpoint Properties Australia Ltd (REIT)	Goldman Sachs	(77)
(1,946)	GUD Holdings Ltd	Goldman Sachs	(131)
2,067	GWA Group Ltd	Goldman Sachs	55
2,788	Harvey Norman Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	206
672	Harvey Norman Holdings Ltd	Goldman Sachs	50
2,613	Harvey Norman Holdings Ltd	Morgan Stanley	175
(3,463)	Healius Ltd	Goldman Sachs	1,095
(106)	HMC Capital Ltd (REIT)	Goldman Sachs	(16)
(5,760)	HomeCo Daily Needs (REIT)	Goldman Sachs	(182)
106	IDP Education Ltd	Goldman Sachs	(28)
124	IDP Education Ltd	Morgan Stanley	18
(1,007)	IGO Ltd	Goldman Sachs	189
6,505	Iluka Resources Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(44)
3,703	Iluka Resources Ltd	Goldman Sachs	(25)
2,265	Iluka Resources Ltd	Morgan Stanley	304
4,252	Imdex Ltd	Bank of America Merrill Lynch	171
10,773	Imdex Ltd	Goldman Sachs	434
(81,116)	Imugene Ltd	Goldman Sachs	1,360
(11,188)	Incitec Pivot Ltd	Goldman Sachs	(370)

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)		
(154)	Ingenia Communities Group (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(12)
(941)	Ingenia Communities Group (REIT)	Goldman Sachs	(58)
(339)	Inghams Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(9)
(26,501)	Inghams Group Ltd	Goldman Sachs	(1,935)
7,942	Insignia Financial Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(799)
458	Insignia Financial Ltd	Goldman Sachs	(46)
18,006	Insignia Financial Ltd	Morgan Stanley	(604)
(945)	Integral Diagnostics Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(38)
(1,091)	Integral Diagnostics Ltd	Goldman Sachs	(44)
(137)	InvoCare Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2
(3,973)	InvoCare Ltd	Goldman Sachs	74
(2,618)	IRESS Ltd	Goldman Sachs	439
580	James Hardie Industries Plc - CDI	Bank of America Merrill Lynch	(307)
446	James Hardie Industries Plc - CDI	Goldman Sachs	(236)
1,476	James Hardie Industries Plc - CDI	Morgan Stanley	287
(3,026)	JB Hi-Fi Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,817)
(626)	JB Hi-Fi Ltd	Goldman Sachs	(241)
(2,456)	JB Hi-Fi Ltd	Morgan Stanley	(2,665)
(857)	Jervois Global Ltd	Bank of America Merrill Lynch	20
(1,082)	Jervois Global Ltd	Goldman Sachs	(6)
1,488	Johns Lyng Group Ltd	Goldman Sachs	359
735	Jumbo Interactive Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(57)
1,946	Jumbo Interactive Ltd	Goldman Sachs	(144)
(4,801)	Karoon Energy Ltd	Goldman Sachs	(225)
(2,974)	Kelsian Group Ltd	Goldman Sachs	(599)
713	Kogan.com Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(81)
1,114	Kogan.com Ltd	Goldman Sachs	(127)
(887)	Leo Lithium Ltd	Goldman Sachs	19
(1,307)	Link Administration Holdings Ltd	Goldman Sachs	(79)
(6,935)	Lottery Corp Ltd	Goldman Sachs	(512)
202	Lovisa Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(150)
1,012	Lovisa Holdings Ltd	Goldman Sachs	(754)
343	Macquarie Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	6
615	Macquarie Group Ltd	Goldman Sachs	(109)
1,287	Macquarie Group Ltd	Morgan Stanley	1,803
933	Magellan Financial Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(369)
143	Magellan Financial Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4)
937	Magellan Financial Group Ltd	Goldman Sachs	(371)
144	Magellan Financial Group Ltd	Goldman Sachs	(4)
734	Magellan Financial Group Ltd	Morgan Stanley	(123)
91	Magellan Financial Group Ltd	Morgan Stanley	(2)
(19,406)	Mayne Pharma Group Ltd	Goldman Sachs	781
9,814	Medibank Pvt Ltd	Bank of America Merrill Lynch	790
4,859	Medibank Pvt Ltd	Goldman Sachs	364
8,855	Medibank Pvt Ltd	Morgan Stanley	594

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)		
3,469	Metcash Ltd	Bank of America Merrill Lynch	559
3,137	Metcash Ltd	Goldman Sachs	505
15,276	Metcash Ltd	Morgan Stanley	512
38	Mineral Resources Ltd	Bank of America Merrill Lynch	61
1,902	Mineral Resources Ltd	Goldman Sachs	8,999
39	Mineral Resources Ltd	Morgan Stanley	24
(3,939)	Mirvac Group (REIT)	Goldman Sachs	(317)
1,690	Monadelphous Group Ltd	Goldman Sachs	(499)
(1,095)	Mount Gibson Iron Ltd	Goldman Sachs	4
2,859	Nanosonics Ltd	Bank of America Merrill Lynch	503
4,131	Nanosonics Ltd	Goldman Sachs	721
1,805	National Australia Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,271
1,022	National Australia Bank Ltd	Goldman Sachs	566
2,838	National Australia Bank Ltd	Morgan Stanley	1,085
(3,070)	Nearmap Ltd	Goldman Sachs	(227)
750	Netwealth Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	12
719	Netwealth Group Ltd	Goldman Sachs	10
(4,661)	NEXTDC Ltd	Goldman Sachs	(1,876)
496	Nick Scali Ltd	Bank of America Merrill Lynch	522
364	Nick Scali Ltd	Goldman Sachs	383
(2,219)	Northern Star Resources Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(670)
(25,180)	Northern Star Resources Ltd	Goldman Sachs	(7,601)
(3,650)	Nufarm Ltd	Goldman Sachs	(1,469)
615	Objective Corp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(578)
849	Objective Corp Ltd	Goldman Sachs	(797)
(214)	Omni Bridgeway Ltd	Bank of America Merrill Lynch	7
(6,728)	Omni Bridgeway Ltd	Goldman Sachs	223
1,757	oOh!media Ltd	Goldman Sachs	127
(12,322)	Paladin Energy Ltd	Goldman Sachs	579
4,649	Perenti Ltd	Bank of America Merrill Lynch	78
11,337	Perenti Ltd	Goldman Sachs	168
1,348	Perpetual Ltd	Morgan Stanley	(1,121)
2,085	Pilbara Minerals Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(238)
10,536	Pilbara Minerals Ltd	Morgan Stanley	(1,908)
3,643	Pinnacle Investment Management Group Ltd	Goldman Sachs	(2,053)
7,016	Platinum Asset Management Ltd	Morgan Stanley	(212)
(662)	Pointsbet Holdings Ltd	Goldman Sachs	-
(9,133)	PointsBet Holdings Ltd	Goldman Sachs	123
3,924	PolyNovo Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(290)
768	Pro Medicus Ltd	Bank of America Merrill Lynch	201
259	Pro Medicus Ltd	Goldman Sachs	68
384	Pro Medicus Ltd	Morgan Stanley	244
863	PWR Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	318
248	PWR Holdings Ltd	Goldman Sachs	92
1,464	QBE Insurance Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	616

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)		
1,580	QBE Insurance Group Ltd	Goldman Sachs	690
1,255	QBE Insurance Group Ltd	Morgan Stanley	177
(27,202)	Qube Holdings Ltd	Goldman Sachs	(2,372)
136	REA Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	81
160	REA Group Ltd	Morgan Stanley	384
(5,926)	Reece Ltd	Goldman Sachs	(80)
12,891	Region RE Ltd (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	1,211
5,603	Region RE Ltd (REIT)	Goldman Sachs	526
7,484	Region RE Ltd (REIT)	Morgan Stanley	351
(1,006)	Regis Resources Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(37)
(7,040)	Regis Resources Ltd	Goldman Sachs	(260)
(1,452)	Reliance Worldwide Corp Ltd	Goldman Sachs	(39)
(969)	Sandfire Resources Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(241)
(148)	Sandfire Resources Ltd (Right)	Bank of America Merrill Lynch	(69)
(54,080)	Santos Ltd	Goldman Sachs	(573)
(75,695)	Sayona Mining Ltd	Goldman Sachs	147
(5,132)	Scentre Group (REIT)	Goldman Sachs	(478)
2,191	SEEK Ltd	Bank of America Merrill Lynch	470
2,235	SEEK Ltd	Morgan Stanley	1,709
(1,381)	Select Harvests Ltd	Bank of America Merrill Lynch	908
(949)	Select Harvests Ltd	Goldman Sachs	624
(3,187)	Seven Group Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3,036)
(7,254)	Seven Group Holdings Ltd	Goldman Sachs	(6,806)
(1,417)	Seven Group Holdings Ltd	Morgan Stanley	(627)
(381)	Sigma Healthcare Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(9)
(29,251)	Sigma Healthcare Ltd	Goldman Sachs	(687)
(662)	Silver Lake Resources Ltd	Goldman Sachs	8
(173)	SiteMinder Ltd	Goldman Sachs	(17)
(68,319)	South32 Ltd	Goldman Sachs	5,694
6,699	Steadfast Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,168
7,757	Steadfast Group Ltd	Goldman Sachs	1,353
3,056	Steadfast Group Ltd	Morgan Stanley	(123)
(5,985)	Suncorp Group Ltd	Goldman Sachs	(161)
(1,595)	Super Retail Group Ltd	Goldman Sachs	(481)
(577)	Syrah Resources Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(27)
(75,470)	Tabcorp Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,287)
(126,338)	Tabcorp Holdings Ltd	Goldman Sachs	(3,984)
1,342	Technology One Ltd	Goldman Sachs	1,080
(1,480)	Telix Pharmaceuticals Ltd	Goldman Sachs	(417)
6,948	Telstra Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	466
4,274	Telstra Group Ltd	Goldman Sachs	287
16,053	Telstra Group Ltd	Morgan Stanley	538
(13,366)	TPG Telecom Ltd	Morgan Stanley	90
(4,677)	Transurban Group (Unit)	Goldman Sachs	(688)
522	Treasury Wine Estates Ltd	Bank of America Merrill Lynch	147

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)			
1,343	Treasury Wine Estates Ltd	Goldman Sachs	316
1,410	Treasury Wine Estates Ltd	Morgan Stanley	274
(2,831)	United Malt Grp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(152)
(5,734)	United Malt Grp Ltd	Goldman Sachs	(385)
(6,509)	Vicinity Ltd (REIT)	Goldman Sachs	(502)
4,522	Viva Energy Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	303
5,139	Viva Energy Group Ltd	Goldman Sachs	345
23	Webjet Ltd	Bank of America Merrill Lynch	14
2,188	Webjet Ltd	Goldman Sachs	1,314
(12,462)	Wesfarmers Ltd	Goldman Sachs	(4,876)
(9,020)	Wesfarmers Ltd	Morgan Stanley	(2,360)
(1,459)	West African Resources Ltd	Bank of America Merrill Lynch	44
(14,034)	West African Resources Ltd	Goldman Sachs	424
(1,817)	Westgold Resources Ltd	Bank of America Merrill Lynch	177
(6,002)	Westgold Resources Ltd	Goldman Sachs	491
4,729	Westpac Banking Corp	Bank of America Merrill Lynch	(647)
3,707	Westpac Banking Corp	Goldman Sachs	(473)
8,378	Westpac Banking Corp	Morgan Stanley	(776)
145	WiseTech Global Ltd	Goldman Sachs	133
880	WiseTech Global Ltd	Morgan Stanley	(407)
(2,919)	Woodside Energy Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,987
(2,043)	Woodside Energy Group Ltd	Goldman Sachs	1,568
(10,633)	Woodside Energy Group Ltd	Morgan Stanley	6,673
(1,237)	Woolworths Group Ltd	Goldman Sachs	(573)
(1,940)	Worley Ltd	Goldman Sachs	299
616	Zip Co Ltd	Goldman Sachs	17
			(33,561)
オーストリア			
132	ANDRITZ AG	Bank of America Merrill Lynch	27
165	ANDRITZ AG	Goldman Sachs	34
622	ANDRITZ AG	Morgan Stanley	(613)
386	AT&S Austria Technologie & Systemtechnik AG	Bank of America Merrill Lynch	(902)
159	AT&S Austria Technologie & Systemtechnik AG	Goldman Sachs	(371)
(151)	CA Immobilien Anlagen AG	Bank of America Merrill Lynch	235
335	EVN AG	Bank of America Merrill Lynch	21
335	EVN AG	Goldman Sachs	21
(1,843)	FACC AG	Goldman Sachs	612
(2,351)	Immofinanz Ag	Goldman Sachs	-
(39)	OMV AG	Goldman Sachs	26
(1,770)	OMV AG	Morgan Stanley	(1,782)
140	Palfinger AG	Bank of America Merrill Lynch	(65)
214	Palfinger AG	Goldman Sachs	(100)
412	Porr AG	Goldman Sachs	616
239	Raiffeisen Bank International AG	Bank of America Merrill Lynch	(12)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	オーストリア(続き)		
1,027	Raiffeisen Bank International AG	Goldman Sachs	(160)
1,284	Raiffeisen Bank International AG	Morgan Stanley	(104)
2	Schoeller-Bleckmann Oilfield Equipment AG	Bank of America Merrill Lynch	3
60	Schoeller-Bleckmann Oilfield Equipment AG	Goldman Sachs	87
(280)	Semperit AG Holding	Bank of America Merrill Lynch	779
(1,034)	Semperit AG Holding	Goldman Sachs	2,877
40	UNIQA Insurance Group AG	Goldman Sachs	(2)
203	Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe	Bank of America Merrill Lynch	(74)
74	Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe	Goldman Sachs	(18)
(293)	voestalpine AG	Bank of America Merrill Lynch	(49)
(1,176)	voestalpine AG	Goldman Sachs	(195)
(2,033)	voestalpine AG	Morgan Stanley	(338)
			553
	ベルギー		
73	Ackermans & van Haaren NV	Goldman Sachs	379
236	Ackermans & van Haaren NV	Morgan Stanley	637
204	AGFA-Gevaert NV	Bank of America Merrill Lynch	(32)
920	AGFA-Gevaert NV	Goldman Sachs	(143)
2,158	Anheuser-Busch InBev SA	Bank of America Merrill Lynch	6,611
129	Anheuser-Busch InBev SA	Goldman Sachs	422
814	Anheuser-Busch InBev SA	Morgan Stanley	1,682
52	Barco NV	Bank of America Merrill Lynch	9
139	Barco NV	Goldman Sachs	23
(3)	Biocartis Group NV	Goldman Sachs	1
(2,621)	bpost SA	Goldman Sachs	395
(30)	Cofinimmo SA (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	122
(162)	Cofinimmo SA (REIT)	Goldman Sachs	869
(470)	D'iereeren Group	Bank of America Merrill Lynch	(3,278)
(561)	D'iereeren Group	Goldman Sachs	(4,511)
(584)	D'iereeren Group	Morgan Stanley	(1,925)
260	Econocom Group SA	Bank of America Merrill Lynch	(9)
157	Econocom Group SA	Goldman Sachs	(6)
19	Euronav NV	Goldman Sachs	(14)
(885)	Gimv NV	Goldman Sachs	2,098
61	Ion Beam Applications	Bank of America Merrill Lynch	(15)
18	Ion Beam Applications	Goldman Sachs	(5)
(119)	KBC Ancora	Bank of America Merrill Lynch	(225)
(188)	KBC Ancora	Goldman Sachs	(355)
1,257	KBC Group NV	Bank of America Merrill Lynch	842
478	KBC Group NV	Morgan Stanley	79
(185)	Kinopolis Group NV	Bank of America Merrill Lynch	863
(245)	Kinopolis Group NV	Goldman Sachs	1,336
271	Melexis NV	Bank of America Merrill Lynch	(310)
295	Melexis NV	Goldman Sachs	(431)

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)		
22	Montea NV (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(72)
22	Montea NV (REIT)	Goldman Sachs	(71)
(88)	Orange Belgium SA	Bank of America Merrill Lynch	(18)
(45)	Orange Belgium SA	Goldman Sachs	(9)
115	Shurgard Self Storage SA	Goldman Sachs	(310)
(187)	Telenet Group Holding NV	Bank of America Merrill Lynch	380
(84)	Telenet Group Holding NV	Goldman Sachs	114
(346)	UCB SA	Bank of America Merrill Lynch	(525)
(194)	UCB SA	Goldman Sachs	(140)
(939)	UCB SA	Morgan Stanley	(808)
1,147	Umicore SA	Bank of America Merrill Lynch	(810)
67	Umicore SA	Goldman Sachs	7
(41)	VGP NV	Bank of America Merrill Lynch	45
(110)	VGP NV	Goldman Sachs	77
(8)	Xior Student Housing NV (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	26
(10)	Xior Student Housing NV (REIT)	Goldman Sachs	28
			3,023
	カナダ		
(633)	Absolute Software Corp	Goldman Sachs	(130)
(31)	Advantage Energy Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3
(298)	Advantage Energy Ltd	Goldman Sachs	24
1,005	Aecon Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(30)
1,112	Aecon Group Inc	Goldman Sachs	(45)
(522)	Ag Growth International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,400)
(2,418)	Agnico Eagle Mines Ltd	Goldman Sachs	(6,190)
(544)	Agnico Eagle Mines Ltd	Morgan Stanley	(475)
2,204	Air Canada	Goldman Sachs	163
1,589	Air Canada	Morgan Stanley	377
(995)	Algoma Steel Group Inc	Goldman Sachs	15
2,078	Algonquin Power & Utilities Corp	Morgan Stanley	(15)
(232)	Alimentation Couche-Tard Inc	Morgan Stanley	129
473	Altius Minerals Corp	Bank of America Merrill Lynch	(319)
1,740	Altius Minerals Corp	Goldman Sachs	(1,173)
(55)	Altus Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(25)
(121)	Altus Group Ltd	Goldman Sachs	(50)
(10)	Andlauer Healthcare Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2)
710	ARC Resources Ltd	Bank of America Merrill Lynch	337
3,119	ARC Resources Ltd	Morgan Stanley	1,409
(4,108)	Argonaut Gold Inc	Bank of America Merrill Lynch	(107)
(1,626)	Aritzia Inc	Morgan Stanley	1,247
(5,025)	Atco Ltd 'I'	Morgan Stanley	(893)
(3,833)	ATS Corp	Morgan Stanley	(8,220)
(6,040)	B2Gold Corp	Goldman Sachs	(582)
(605)	B2Gold Corp	Morgan Stanley	(22)
4,909	Ballard Power Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(540)

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)		
7,339	Ballard Power Systems Inc	Goldman Sachs	(814)
7,280	Ballard Power Systems Inc	Morgan Stanley	598
3,568	Baytex Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,136)
558	Baytex Energy Corp	Goldman Sachs	(178)
2,742	Baytex Energy Corp	Morgan Stanley	(41)
(1,696)	BCE Inc	Morgan Stanley	(867)
(105)	BELLUS Health Inc	Goldman Sachs	(24)
(706)	BlackBerry Ltd	Goldman Sachs	(42)
288	Boardwalk (REIT)	Goldman Sachs	(279)
617	Bombardier Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	1,402
554	Bombardier Inc 'B'	Goldman Sachs	1,055
368	Bombardier Inc 'B'	Morgan Stanley	968
165	Boralex Inc 'A'	Goldman Sachs	(126)
337	Boralex Inc 'A'	Morgan Stanley	127
(385)	Boyd Group Services Inc	Morgan Stanley	320
549	Brookfield Asset Management Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(199)
(169)	Brookfield Asset Management Reinsurance Partners Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	73
(87)	Brookfield Asset Management Reinsurance Partners Ltd 'A'	Goldman Sachs	28
(16)	Calian Group Ltd	Goldman Sachs	(113)
47	Canaccord Genuity Group Inc	Goldman Sachs	(6)
988	Canada Goose Holdings Inc	Goldman Sachs	(739)
(1,382)	Canadian Apartment Properties (REIT)	Goldman Sachs	31
(1,883)	Canadian Apartment Properties (REIT)	Morgan Stanley	723
(1,685)	Canadian National Railway Co	Goldman Sachs	(10,288)
(395)	Canadian National Railway Co	Morgan Stanley	(810)
(1,403)	Canadian Pacific Railway Ltd	Goldman Sachs	(8,761)
(1,123)	Canadian Pacific Railway Ltd	Morgan Stanley	(907)
(1,457)	Canadian Tire Corp Ltd 'A'	Morgan Stanley	(2,408)
556	Canadian Western Bank	Goldman Sachs	329
120	Cargojet Inc	Bank of America Merrill Lynch	79
288	Cargojet Inc	Goldman Sachs	190
179	Cargojet Inc	Morgan Stanley	(400)
286	Cascades Inc	Goldman Sachs	(11)
(573)	CCL Industries Inc 'B'	Morgan Stanley	(160)
556	Cenovus Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(236)
97	Cenovus Energy Inc	Goldman Sachs	35
857	Centerra Gold Inc	Bank of America Merrill Lynch	66
552	Centerra Gold Inc	Goldman Sachs	46
(987)	Choice Properties (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(285)
(3,130)	Choice Properties (REIT)	Goldman Sachs	(904)
(352)	Chorus Aviation Inc	Bank of America Merrill Lynch	(34)
(415)	Cogeco Inc	Bank of America Merrill Lynch	(227)
(172)	Cogeco Inc	Goldman Sachs	(94)
75	Colliers International Group Inc	Goldman Sachs	(189)

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)		
213	Colliers International Group Inc	Morgan Stanley	(297)
(2,474)	Converge Technology Solutions Corp	Bank of America Merrill Lynch	(990)
(1,864)	Converge Technology Solutions Corp	Goldman Sachs	(746)
27	Corby Spirit and Wine Ltd	Goldman Sachs	1
4,004	Crescent Point Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,065)
10,736	Crescent Point Energy Corp	Goldman Sachs	(5,954)
1,393	Crescent Point Energy Corp	Morgan Stanley	(279)
(114)	Definity Financial Corp	Goldman Sachs	(94)
(2,758)	Denison Mines Corp	Bank of America Merrill Lynch	143
97	Descartes Systems Group Inc	Goldman Sachs	(442)
746	Descartes Systems Group Inc	Morgan Stanley	(431)
13	Docebo Inc	Goldman Sachs	11
(8,140)	Dollarama Inc	Morgan Stanley	(8,863)
(5,197)	Dream Industrial (REIT)	Morgan Stanley	(193)
24	Dream Office (REIT)	Goldman Sachs	(1)
128	DREAM Unlimited Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(229)
44	DREAM Unlimited Corp 'A'	Goldman Sachs	(79)
(308)	Dye & Durham Ltd	Bank of America Merrill Lynch	46
(1,356)	Dye & Durham Ltd	Goldman Sachs	201
1,829	Eldorado Gold Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,145
2,998	Eldorado Gold Corp	Goldman Sachs	1,876
369	Element Fleet Management Corp	Bank of America Merrill Lynch	82
1,085	Element Fleet Management Corp	Goldman Sachs	592
2,837	Element Fleet Management Corp	Morgan Stanley	820
604	Emera Inc	Bank of America Merrill Lynch	850
1,789	Emera Inc	Goldman Sachs	2,082
2,206	Emera Inc	Morgan Stanley	1,716
1,362	Endeavour Mining Plc	Morgan Stanley	787
(456)	Enerflex Ltd	Goldman Sachs	20
(140)	Energy Fuels Inc	Goldman Sachs	(18)
1,231	Enerplus Corp	Bank of America Merrill Lynch	29
1,895	Enerplus Corp	Goldman Sachs	651
4,966	Enerplus Corp	Morgan Stanley	164
22	EQB Inc	Bank of America Merrill Lynch	52
580	EQB Inc	Goldman Sachs	1,366
(2,985)	Equinox Gold Corp	Goldman Sachs	509
(594)	ERO Copper Corp	Goldman Sachs	(361)
427	Evertz Technologies Ltd	Bank of America Merrill Lynch	85
670	Evertz Technologies Ltd	Goldman Sachs	134
(251)	Exchange Income Corp	Bank of America Merrill Lynch	(95)
(7,920)	Extencicare Inc	Bank of America Merrill Lynch	(117)
(1,310)	Filo Mining Corp	Bank of America Merrill Lynch	(165)
(175)	Filo Mining Corp	Goldman Sachs	(74)
(9,610)	Finning International Inc	Morgan Stanley	(13,008)
5,273	First Majestic Silver Corp	Goldman Sachs	1,015

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	カナダ(続き)		
4,291	First Majestic Silver Corp	Morgan Stanley	(572)
124	First Quantum Minerals Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(109)
2,299	First Quantum Minerals Ltd	Goldman Sachs	(2,026)
181	First Quantum Minerals Ltd	Morgan Stanley	67
99	FirstService Corp	Goldman Sachs	221
179	FirstService Corp	Morgan Stanley	260
2,067	Fortuna Silver Mines Inc	Bank of America Merrill Lynch	364
2,098	Fortuna Silver Mines Inc	Goldman Sachs	381
(188)	Frontera Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	28
(355)	Frontera Energy Corp	Goldman Sachs	53
(201)	GDI Integrated Facility Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	435
(106)	George Weston Ltd	Morgan Stanley	(119)
338	GFL Environmental Inc	Bank of America Merrill Lynch	576
275	GFL Environmental Inc	Goldman Sachs	468
876	GFL Environmental Inc	Morgan Stanley	136
1,720	Gildan Activewear Inc	Bank of America Merrill Lynch	(235)
1,297	Gildan Activewear Inc	Goldman Sachs	(129)
3,206	Gildan Activewear Inc	Morgan Stanley	(884)
(8,319)	H&R (REIT)	Morgan Stanley	801
(169)	Hardwoods Distribution Inc	Bank of America Merrill Lynch	145
(401)	Hardwoods Distribution Inc	Goldman Sachs	345
(229)	Headwater Exploration Inc	Bank of America Merrill Lynch	13
(364)	Headwater Exploration Inc	Goldman Sachs	68
(991)	HLS Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(683)
473	Home Capital Group Inc	Goldman Sachs	5,287
2,285	Hudbay Minerals Inc	Bank of America Merrill Lynch	480
5,267	Hudbay Minerals Inc	Goldman Sachs	1,309
339	Hydro One Ltd	Morgan Stanley	183
(1,318)	iA Financial Corp Inc	Morgan Stanley	(1,308)
265	IAMGOLD Corp	Goldman Sachs	45
334	Imperial Oil Ltd	Goldman Sachs	512
235	Imperial Oil Ltd	Morgan Stanley	193
3,416	Innergex Renewable Energy Inc	Goldman Sachs	875
(503)	Intact Financial Corp	Morgan Stanley	(1,785)
2,910	Ivanhoe Mines Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1,595
1,336	Ivanhoe Mines Ltd 'A'	Goldman Sachs	732
2,316	Ivanhoe Mines Ltd 'A'	Morgan Stanley	1,321
(29)	Jamieson Wellness Inc	Bank of America Merrill Lynch	13
149	Kelt Exploration Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(15)
3,295	Kelt Exploration Ltd	Goldman Sachs	(342)
916	Keyera Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,079
1,557	Keyera Corp	Goldman Sachs	1,834
1,470	Keyera Corp	Morgan Stanley	1,154
77	Kinaxis Inc	Bank of America Merrill Lynch	(746)
175	Kinaxis Inc	Goldman Sachs	(1,695)

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)		
333	Kinaxis Inc	Morgan Stanley	(678)
326	Laurentian Bank of Canada	Goldman Sachs	34
(4,467)	Lightspeed Commerce Inc	Goldman Sachs	6,914
(2,504)	Lightspeed Commerce Inc	Morgan Stanley	(1,595)
(434)	Linamar Corp	Morgan Stanley	(223)
438	Lithium Americas Corp	Bank of America Merrill Lynch	(925)
489	Lithium Americas Corp	Goldman Sachs	(1,032)
(771)	Loblaw Cos Ltd	Morgan Stanley	(3,855)
(2,376)	Lundin Mining Corp	Morgan Stanley	(766)
(79)	MAG Silver Corp	Goldman Sachs	(20)
43	Major Drilling Group International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9)
(681)	Maple Leaf Foods Inc	Bank of America Merrill Lynch	(444)
(1,464)	Maple Leaf Foods Inc	Goldman Sachs	(911)
58	Martinrea International Inc	Bank of America Merrill Lynch	19
49	Martinrea International Inc	Goldman Sachs	16
(574)	MDA Ltd	Bank of America Merrill Lynch	119
(160)	MDA Ltd	Goldman Sachs	33
420	MEG Energy Corp	Goldman Sachs	172
797	MEG Energy Corp	Morgan Stanley	299
1,304	Methanex Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,066)
1,815	Methanex Corp	Goldman Sachs	(2,341)
1,321	Methanex Corp	Morgan Stanley	(2,597)
(441)	Metro Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,859)
(1,247)	Metro Inc	Goldman Sachs	(5,256)
(802)	Metro Inc	Morgan Stanley	(273)
(77)	Neighbourly Pharmacy Inc	Bank of America Merrill Lynch	51
(8,329)	New Gold Inc	Goldman Sachs	(31)
(1,002)	Newcrest Mining Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(379)
(222)	Newcrest Mining Ltd	Morgan Stanley	(140)
(991)	North West Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,875)
(96)	NorthWest Healthcare Properties (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	2
3,279	Novagold Resources Inc	Goldman Sachs	1,093
(63)	Nuvei Corp	Bank of America Merrill Lynch	142
(95)	Nuvei Corp	Goldman Sachs	303
(1,029)	Nuvei Corp	Morgan Stanley	381
(95)	Obsidian Energy Ltd	Goldman Sachs	28
(530)	OceanaGold Corp	Bank of America Merrill Lynch	53
(6,565)	OceanaGold Corp	Goldman Sachs	656
(643)	Onex Corp	Morgan Stanley	562
(727)	Orla Mining Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(97)
(151)	Orla Mining Ltd	Goldman Sachs	(20)
(2,586)	Osisko Gold Royalties Ltd	Goldman Sachs	(289)
(2,298)	Osisko Gold Royalties Ltd	Morgan Stanley	(39)
155	Ovintiv Inc	Bank of America Merrill Lynch	(381)
181	Ovintiv Inc	Goldman Sachs	(445)

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)		
220	Ovintiv Inc	Morgan Stanley	(52)
(2,176)	Pan American Silver Corp	Morgan Stanley	(193)
1,360	Parex Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	114
1,363	Parex Resources Inc	Goldman Sachs	121
1,097	Parex Resources Inc	Morgan Stanley	32
(263)	Parkland Corp	Bank of America Merrill Lynch	(432)
(211)	Parkland Corp	Goldman Sachs	(347)
(3,869)	Parkland Corp	Morgan Stanley	(3,968)
310	Pason Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	11
337	Pason Systems Inc	Goldman Sachs	11
(93)	Pet Valu Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(183)
(370)	Peyto Exploration & Development Corp	Morgan Stanley	(5)
(3,184)	Pipestone Energy Corp	Goldman Sachs	(71)
(332)	Pollard Banknote Ltd	Goldman Sachs	271
21	PrairieSky Royalty Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1
1,937	PrairieSky Royalty Ltd	Goldman Sachs	624
28	Precision Drilling Corp	Goldman Sachs	(87)
(253)	Premium Brands Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(532)
(199)	Premium Brands Holdings Corp	Goldman Sachs	(419)
(99)	Quebecor Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(108)
(273)	Quebecor Inc 'B'	Goldman Sachs	(335)
(1,003)	Quebecor Inc 'B'	Morgan Stanley	(731)
(1,118)	Restaurant Brands International Inc	Goldman Sachs	(7,511)
(253)	Restaurant Brands International Inc	Morgan Stanley	401
41	Richelieu Hardware Ltd	Bank of America Merrill Lynch	18
436	Richelieu Hardware Ltd	Goldman Sachs	187
(1,921)	Rogers Communications Inc 'B'	Goldman Sachs	(5,243)
(140)	Rogers Communications Inc 'B'	Morgan Stanley	(149)
127	Russel Metals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(24)
114	Russel Metals Inc	Goldman Sachs	(20)
2,100	Sandstorm Gold Ltd	Bank of America Merrill Lynch	16
2,496	Sandstorm Gold Ltd	Goldman Sachs	18
(3,954)	Saputo Inc	Morgan Stanley	7,293
100	Secure Energy Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6)
446	Secure Energy Services Inc	Goldman Sachs	(25)
(5,301)	Shaw Communications Inc 'B'	Goldman Sachs	(1,755)
(8,021)	Shaw Communications Inc 'B'	Morgan Stanley	(462)
(771)	Sienna Senior Living Inc	Bank of America Merrill Lynch	86
(10)	Sierra Wireless Inc	Goldman Sachs	(8)
2,783	Silvercorp Metals Inc	Bank of America Merrill Lynch	62
4,851	Silvercorp Metals Inc	Goldman Sachs	108
(60)	SilverCrest Metals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(15)
(770)	SilverCrest Metals Inc	Goldman Sachs	(188)
(1,511)	Skeena Resources Ltd	Goldman Sachs	155
668	Slate Grocery 'U' (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	228

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)		
929	Slate Grocery 'U' (REIT)	Goldman Sachs	317
578	Sleep Country Canada Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	379
233	Sleep Country Canada Holdings Inc	Goldman Sachs	153
(115)	SNC-Lavalin Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9)
(261)	SNC-Lavalin Group Inc	Goldman Sachs	(2)
(256)	Spartan Delta Corp	Bank of America Merrill Lynch	(154)
(554)	Spartan Delta Corp	Goldman Sachs	(347)
1,292	Stantec Inc	Bank of America Merrill Lynch	(36)
1,767	Stantec Inc	Goldman Sachs	(101)
2,127	Stantec Inc	Morgan Stanley	(1,885)
(327)	Stelco Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(341)
(326)	Stelco Holdings Inc	Goldman Sachs	(429)
(1,232)	Stelco Holdings Inc	Morgan Stanley	3,303
(720)	Stella-Jones Inc	Bank of America Merrill Lynch	85
(592)	Stella-Jones Inc	Goldman Sachs	68
(1,441)	StorageVault Canada Inc	Bank of America Merrill Lynch	149
(3,728)	StorageVault Canada Inc	Goldman Sachs	500
(227)	Sun Life Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(257)
(518)	Sun Life Financial Inc	Morgan Stanley	(349)
341	Suncor Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,109)
379	Suncor Energy Inc	Morgan Stanley	(980)
(2,820)	Superior Plus Corp	Bank of America Merrill Lynch	(376)
(1,703)	Superior Plus Corp	Goldman Sachs	(227)
(22,580)	Tamarack Valley Energy Ltd	Morgan Stanley	(2,239)
196	Taseko Mines Ltd	Bank of America Merrill Lynch	5
539	Taseko Mines Ltd	Goldman Sachs	32
2,595	TC Energy Corp	Morgan Stanley	(7,593)
(64)	TFI International Inc	Goldman Sachs	(84)
(293)	TFI International Inc	Morgan Stanley	(7)
(63)	Thomson Reuters Corp	Goldman Sachs	(389)
(246)	Thomson Reuters Corp	Morgan Stanley	(242)
(1,447)	Timbercreek Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(11)
(347)	TMX Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,175)
(88)	TMX Group Ltd	Goldman Sachs	(298)
(276)	TMX Group Ltd	Morgan Stanley	(507)
201	Topaz Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	20
711	Topaz Energy Corp	Goldman Sachs	68
449	Torex Gold Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	341
572	Torex Gold Resources Inc	Goldman Sachs	344
(1,788)	Toromont Industries Ltd	Morgan Stanley	(993)
823	TransAlta Corp	Bank of America Merrill Lynch	(6)
(3,276)	Tricon Residential Inc	Goldman Sachs	2,014
(316)	Uni-Select Inc	Bank of America Merrill Lynch	(690)
(312)	Uni-Select Inc	Goldman Sachs	(682)
812	Vermilion Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(297)

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)			
225	Vermilion Energy Inc	Goldman Sachs	80
1,766	Vermilion Energy Inc	Morgan Stanley	170
(462)	Wesdome Gold Mines Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(161)
(303)	Wesdome Gold Mines Ltd	Goldman Sachs	(105)
(905)	Whitecap Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	308
(1,926)	Whitecap Resources Inc	Morgan Stanley	165
(233)	Winpak Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(45)
(279)	Winpak Ltd	Goldman Sachs	(55)
(16)	WSP Global Inc	Morgan Stanley	66
			(93,916)
デンマーク			
(2,588)	Ambu A/S 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(2,110)
(292)	Ambu A/S 'B'	Goldman Sachs	(238)
3	AP Moller - Maersk A/S 'A'	Bank of America Merrill Lynch	71
2	AP Moller - Maersk A/S 'A'	Goldman Sachs	48
3	AP Moller - Maersk A/S 'B'	Morgan Stanley	241
(363)	Bavarian Nordic A/S	Goldman Sachs	1,368
(673)	Carlsberg AS 'B'	Morgan Stanley	958
(6,723)	Danske Bank A/S	Bank of America Merrill Lynch	(6,474)
(7,791)	Danske Bank A/S	Morgan Stanley	(1,321)
317	Demant A/S	Morgan Stanley	117
160	Dfds A/S	Bank of America Merrill Lynch	98
159	Dfds A/S	Goldman Sachs	98
393	FLSmidth & Co A/S	Goldman Sachs	(55)
9	Genmab A/S	Goldman Sachs	103
1,344	H Lundbeck A/S	Bank of America Merrill Lynch	(173)
4,521	H Lundbeck A/S	Goldman Sachs	(581)
107	H Lundbeck A/S	Goldman Sachs	(17)
7,449	H Lundbeck A/S	Morgan Stanley	(733)
388	Jyske Bank A/S Reg	Bank of America Merrill Lynch	23
311	Jyske Bank A/S Reg	Goldman Sachs	86
69	Jyske Bank A/S Reg	Morgan Stanley	(18)
(455)	Matas A/S	Bank of America Merrill Lynch	200
(465)	Netcompany Group A/S	Bank of America Merrill Lynch	1,286
(221)	Nilfisk Holding A/S	Bank of America Merrill Lynch	179
477	Novozymes A/S 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(140)
363	Novozymes A/S 'B'	Morgan Stanley	669
(173)	NTG Nordic Transport Group A/S	Goldman Sachs	12
(6)	Orsted AS	Bank of America Merrill Lynch	32
(389)	Orsted AS	Morgan Stanley	364
(551)	Pandora A/S	Bank of America Merrill Lynch	(800)
(722)	Pandora A/S	Morgan Stanley	(4,435)
(264)	Ringkjoebing Landbobank A/S	Bank of America Merrill Lynch	(1,295)
72	ROCKWOOL A/S 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(522)
104	ROCKWOOL A/S 'B'	Goldman Sachs	(1,646)

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)		
133	ROCKWOOL A/S 'B'	Morgan Stanley	(1,261)
34	Royal Unibrew A/S	Bank of America Merrill Lynch	38
7	Schouw & Co A/S	Bank of America Merrill Lynch	30
45	Schouw & Co A/S	Goldman Sachs	192
272	SimCorp A/S	Bank of America Merrill Lynch	(835)
153	SimCorp A/S	Goldman Sachs	(470)
81	SimCorp A/S	Morgan Stanley	(235)
222	Sydbank AS	Bank of America Merrill Lynch	528
109	Sydbank AS	Goldman Sachs	259
(179)	Topdanmark AS	Bank of America Merrill Lynch	(200)
(17)	Trifork Holding AG	Goldman Sachs	12
999	Tryg A/S	Bank of America Merrill Lynch	174
19	Tryg A/S	Morgan Stanley	2
(227)	Zealand Pharma A/S	Bank of America Merrill Lynch	(143)
			<u>(16,514)</u>
	フィンランド		
(855)	Aktia Bank Oyj	Bank of America Merrill Lynch	(89)
(1,029)	Aktia Bank Oyj	Goldman Sachs	(107)
28	Cargotec Oyj	Bank of America Merrill Lynch	3
33	Cargotec Oyj	Goldman Sachs	8
1,981	Citycon Oyj	Bank of America Merrill Lynch	21
1,803	Citycon Oyj	Goldman Sachs	19
(3,470)	Fortum Oyj	Goldman Sachs	(198)
(2,191)	Fortum Oyj	Morgan Stanley	(1,103)
(604)	Huhtamaki Oyj	Morgan Stanley	589
(434)	Kamux Corp	Goldman Sachs	153
(387)	Kemira Oyj	Goldman Sachs	56
(658)	Kesko Oyj 'B'	Bank of America Merrill Lynch	760
(568)	Kesko Oyj 'B'	Goldman Sachs	377
(2,629)	Kesko Oyj 'B'	Morgan Stanley	1,600
(429)	Kojamo Oyj	Goldman Sachs	282
(1,537)	Kojamo Oyj	Morgan Stanley	670
110	Konecranes Oyj	Goldman Sachs	(65)
(1,011)	Metsa Board Oyj 'B'	Goldman Sachs	(787)
5,720	Nokia Oyj	Bank of America Merrill Lynch	(246)
10,177	Nokia Oyj	Goldman Sachs	(439)
15,300	Nokia Oyj	Morgan Stanley	(389)
5,150	Nokian Renkaat Oyj	Bank of America Merrill Lynch	(4,438)
2,296	Nokian Renkaat Oyj	Goldman Sachs	(1,979)
1,674	Nokian Renkaat Oyj	Morgan Stanley	(834)
(205)	Orion Oyj 'B'	Goldman Sachs	(664)
(859)	Orion Oyj 'B'	Morgan Stanley	(1,124)
(969)	Puuiilo Oyj	Goldman Sachs	(131)
20	Revenio Group Oyj	Bank of America Merrill Lynch	1
45	Revenio Group Oyj	Goldman Sachs	2

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)			
454	Rovio Entertainment Oyj	Goldman Sachs	(134)
(2,118)	Sanoma Oyj	Bank of America Merrill Lynch	440
(303)	Sanoma Oyj	Goldman Sachs	63
(36)	TietoEVRY Oyj	Bank of America Merrill Lynch	(16)
(196)	TietoEVRY Oyj	Goldman Sachs	(90)
(1,070)	Tokmanni Group Corp	Bank of America Merrill Lynch	127
(1,079)	Tokmanni Group Corp	Goldman Sachs	121
(463)	UPM-Kymmene Oyj	Goldman Sachs	(385)
(2,188)	UPM-Kymmene Oyj	Morgan Stanley	(704)
(75)	Uponor Oyj	Goldman Sachs	66
881	Valmet Oyj	Bank of America Merrill Lynch	(1,107)
1,201	Valmet Oyj	Goldman Sachs	(1,509)
1,355	Valmet Oyj	Morgan Stanley	(394)
9,771	Wartsila Oyj Abp	Bank of America Merrill Lynch	1,585
13,154	Wartsila Oyj Abp	Goldman Sachs	2,023
6,917	Wartsila Oyj Abp	Morgan Stanley	710
2,101	YIT Oyj	Goldman Sachs	(349)
			<u>(7,605)</u>
フランス			
(126)	ABC arbitrage	Bank of America Merrill Lynch	(10)
(155)	ABC arbitrage	Goldman Sachs	(13)
81	Accor SA	Bank of America Merrill Lynch	(5)
3,794	Accor SA	Goldman Sachs	(236)
2,750	Accor SA	Morgan Stanley	2,998
6,806	Air France-KLM	Morgan Stanley	230
696	Air Liquide SA	Goldman Sachs	1,037
725	Air Liquide SA	Morgan Stanley	1,536
(22)	AKWEL	Bank of America Merrill Lynch	(1)
1,089	ALD SA	Bank of America Merrill Lynch	(2,148)
4,136	ALD SA	Goldman Sachs	(8,159)
2,033	ALD SA	Morgan Stanley	(3,419)
1,089	ALD SA (Right)	Bank of America Merrill Lynch	961
4,136	ALD SA (Right)	Goldman Sachs	3,650
2,033	ALD SA (Right)	Morgan Stanley	1,794
683	Alstom SA	Goldman Sachs	745
(16)	Altarea SCA (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(30)
(157)	Altarea SCA (REIT)	Goldman Sachs	(293)
(16)	Alten SA	Bank of America Merrill Lynch	88
(55)	Alten SA	Goldman Sachs	290
(468)	Amundi SA	Bank of America Merrill Lynch	850
(544)	Amundi SA	Morgan Stanley	(226)
(357)	Antin Infrastructure Partners SA	Bank of America Merrill Lynch	352
(754)	Antin Infrastructure Partners SA	Goldman Sachs	561
(1,121)	Aramis Group SAS	Bank of America Merrill Lynch	400
(1,720)	Aramis Group SAS	Goldman Sachs	614

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)		
41	Arkema SA	Bank of America Merrill Lynch	(74)
664	Atos SE	Bank of America Merrill Lynch	(697)
1,510	Atos SE	Goldman Sachs	(1,936)
61	Believe SA	Bank of America Merrill Lynch	(14)
56	Believe SA	Goldman Sachs	(44)
(136)	BioMerieux	Bank of America Merrill Lynch	104
(275)	BioMerieux	Goldman Sachs	659
(299)	BioMerieux	Morgan Stanley	(52)
(819)	BNP Paribas SA	Bank of America Merrill Lynch	(680)
(503)	BNP Paribas SA	Goldman Sachs	(418)
(1,475)	BNP Paribas SA	Morgan Stanley	(1,271)
(10)	Boiron SA	Bank of America Merrill Lynch	(9)
(14)	Boiron SA	Goldman Sachs	(13)
(15,647)	Bollore SE	Bank of America Merrill Lynch	(1,056)
(17,041)	Bollore SE	Goldman Sachs	(1,297)
(18,549)	Bollore SE	Morgan Stanley	(1,444)
(124)	Capgemini SE	Bank of America Merrill Lynch	1,130
(535)	Capgemini SE	Goldman Sachs	3,991
(679)	Capgemini SE	Morgan Stanley	3,923
19	Carmila SA (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(10)
851	Carrefour SA	Bank of America Merrill Lynch	(88)
1,587	Carrefour SA	Goldman Sachs	(165)
2,216	Carrefour SA	Morgan Stanley	161
(680)	CGG SA	Bank of America Merrill Lynch	23
(25,296)	CGG SA	Goldman Sachs	1,087
47	Cie de Saint-Gobain	Bank of America Merrill Lynch	(19)
1,969	Cie de Saint-Gobain	Goldman Sachs	(2,147)
468	Cie de Saint-Gobain	Morgan Stanley	(323)
93	Cie des Alpes	Bank of America Merrill Lynch	56
260	Cie des Alpes	Goldman Sachs	157
109	Cie Plastic Omnium SA	Bank of America Merrill Lynch	(55)
61	Cie Plastic Omnium SA	Goldman Sachs	4
284	Coface SA	Goldman Sachs	186
209	Dassault Aviation SA	Bank of America Merrill Lynch	1,671
129	Dassault Aviation SA	Goldman Sachs	1,031
223	Dassault Aviation SA	Morgan Stanley	116
85	Dassault Systemes SE	Bank of America Merrill Lynch	(85)
664	Dassault Systemes SE	Goldman Sachs	(1,424)
104	Dassault Systemes SE	Morgan Stanley	(68)
(133)	Eiffage SA	Bank of America Merrill Lynch	28
(288)	Eiffage SA	Goldman Sachs	(150)
(81)	Eiffage SA	Morgan Stanley	79
1,299	Elior Group SA	Goldman Sachs	200
(435)	Elis SA	Bank of America Merrill Lynch	(78)
(250)	Elis SA	Goldman Sachs	(26)

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)		
4,082	Engie SA	Bank of America Merrill Lynch	156
6,248	Engie SA	Goldman Sachs	457
39,063	Engie SA	Morgan Stanley	(2,278)
8	Esker SA	Bank of America Merrill Lynch	29
44	Esker SA	Goldman Sachs	160
(385)	EssilorLuxottica SA	Bank of America Merrill Lynch	(2,609)
(1,054)	EssilorLuxottica SA	Goldman Sachs	(7,668)
(311)	EssilorLuxottica SA	Morgan Stanley	(1,372)
579	Eurazeo SE	Bank of America Merrill Lynch	(782)
851	Eurazeo SE	Morgan Stanley	(1,060)
(1,949)	Euroapi SA	Bank of America Merrill Lynch	358
(1,391)	Euroapi SA	Goldman Sachs	356
(1,477)	Euroapi SA	Morgan Stanley	235
(326)	Eurofins Scientific SE	Bank of America Merrill Lynch	468
(812)	Eurofins Scientific SE	Goldman Sachs	2,512
(184)	Eurofins Scientific SE	Morgan Stanley	(160)
1,193	Eutelsat Communications SA	Bank of America Merrill Lynch	(1,988)
2,108	Faurecia SE	Morgan Stanley	722
356	Gecina SA (REIT)	Goldman Sachs	(1,645)
465	Gecina SA (REIT)	Morgan Stanley	(1,400)
708	ICADE (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(1,514)
652	ICADE (REIT)	Goldman Sachs	(1,395)
1,152	ICADE (REIT)	Morgan Stanley	(1,938)
(6)	ID Logistics Group	Bank of America Merrill Lynch	6
(2)	ID Logistics Group	Goldman Sachs	2
94	Imerys SA	Goldman Sachs	(141)
215	Interparfums SA	Goldman Sachs	670
(44)	Ipsen SA	Goldman Sachs	(238)
110	Kaufman & Broad SA	Bank of America Merrill Lynch	10
90	Kaufman & Broad SA	Goldman Sachs	5
(65)	Kering SA	Goldman Sachs	(1,572)
695	Klepierre SA (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(621)
1,812	Klepierre SA (REIT)	Goldman Sachs	(1,618)
2,011	Klepierre SA (REIT)	Morgan Stanley	(793)
(39)	LNA Sante SA	Bank of America Merrill Lynch	99
(9)	L'Oréal SA	Bank of America Merrill Lynch	(123)
(160)	L'Oréal SA	Goldman Sachs	(2,061)
(110)	L'Oréal SA	Morgan Stanley	(1,273)
55	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	Bank of America Merrill Lynch	1,682
151	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	Morgan Stanley	4,758
(667)	Maisons du Monde SA	Bank of America Merrill Lynch	(457)
(253)	Maisons du Monde SA	Goldman Sachs	(173)
155	Manitou BF SA	Goldman Sachs	137
(1,540)	Mercialys SA (REIT)	Goldman Sachs	384
166	Metropole Television SA	Bank of America Merrill Lynch	317

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)		
256	Metropole Television SA	Goldman Sachs	489
387	Neoen SA	Bank of America Merrill Lynch	156
489	Neoen SA	Goldman Sachs	205
387	Neoen SA	Morgan Stanley	264
26	Nexans SA	Bank of America Merrill Lynch	(186)
108	Nexans SA	Morgan Stanley	(561)
875	Nexity SA	Bank of America Merrill Lynch	1,282
502	Nexity SA	Goldman Sachs	751
(402)	Orange SA	Bank of America Merrill Lynch	40
(2,391)	Orange SA	Goldman Sachs	30
122	Pernod Ricard SA	Goldman Sachs	481
(862)	Publicis Groupe SA	Bank of America Merrill Lynch	236
(273)	Publicis Groupe SA	Goldman Sachs	79
(2,648)	Publicis Groupe SA	Morgan Stanley	3,464
(126)	Quadiant SA	Bank of America Merrill Lynch	41
(124)	Quadiant SA	Goldman Sachs	40
83	Remy Cointreau SA	Bank of America Merrill Lynch	26
99	Remy Cointreau SA	Goldman Sachs	31
420	Remy Cointreau SA	Morgan Stanley	349
424	Renault SA	Bank of America Merrill Lynch	742
1,660	Renault SA	Goldman Sachs	2,605
1,076	Renault SA	Morgan Stanley	1,685
818	Rexel SA	Bank of America Merrill Lynch	(1,202)
769	Rexel SA	Goldman Sachs	(1,130)
170	Rexel SA	Morgan Stanley	(237)
(30)	Sartorius Stedim Biotech	Bank of America Merrill Lynch	782
(65)	Sartorius Stedim Biotech	Goldman Sachs	1,694
(31)	Sartorius Stedim Biotech	Morgan Stanley	23
(110)	SCOR SE	Goldman Sachs	(30)
(365)	SCOR SE	Morgan Stanley	(174)
(83)	SEB SA	Morgan Stanley	(280)
2,287	SES SA	Bank of America Merrill Lynch	(693)
1,501	SES SA	Goldman Sachs	(455)
61	SES-imagotag SA	Goldman Sachs	(317)
1,510	SMCP SA	Bank of America Merrill Lynch	(63)
1,419	SMCP SA	Goldman Sachs	(59)
(244)	Societe BIC SA	Bank of America Merrill Lynch	(1,178)
(158)	Societe BIC SA	Goldman Sachs	(763)
(779)	Sodexo SA	Bank of America Merrill Lynch	(1,332)
(470)	Sodexo SA	Morgan Stanley	(732)
(289)	Solutions 30 SE	Bank of America Merrill Lynch	21
(363)	Solutions 30 SE	Goldman Sachs	125
(118)	Somfy SA	Bank of America Merrill Lynch	28
(138)	Somfy SA	Goldman Sachs	(23)
(46)	Somfy SA	Morgan Stanley	(10)

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)			
(98)	Sopra Steria Group SACA	Bank of America Merrill Lynch	159
(54)	Sopra Steria Group SACA	Goldman Sachs	79
1,376	Television Francaise 1	Bank of America Merrill Lynch	286
3,754	Television Francaise 1	Goldman Sachs	826
(31)	Trigano SA	Bank of America Merrill Lynch	(146)
(111)	Trigano SA	Goldman Sachs	(403)
383	Ubisoft Entertainment SA	Bank of America Merrill Lynch	(308)
137	Ubisoft Entertainment SA	Goldman Sachs	178
182	Ubisoft Entertainment SA	Morgan Stanley	206
3,519	Valeo	Bank of America Merrill Lynch	(283)
3,528	Valeo	Goldman Sachs	(1,600)
1,774	Valeo	Morgan Stanley	(28)
(1,306)	Vallourec SA	Bank of America Merrill Lynch	921
(1,689)	Vallourec SA	Goldman Sachs	863
(3,477)	Vallourec SA	Morgan Stanley	(785)
(1,297)	Veolia Environnement SA	Bank of America Merrill Lynch	302
(1,716)	Veolia Environnement SA	Goldman Sachs	428
(4,871)	Veolia Environnement SA	Morgan Stanley	1,669
(712)	Verallia SA	Goldman Sachs	(1,272)
608	Vicat SA	Bank of America Merrill Lynch	(410)
922	Vicat SA	Goldman Sachs	(622)
79	Vilmorin & Cie SA	Bank of America Merrill Lynch	180
25	Vilmorin & Cie SA	Goldman Sachs	57
874	Vinci SA	Morgan Stanley	60
(31)	Virbac SA	Bank of America Merrill Lynch	(32)
(42)	Virbac SA	Goldman Sachs	(44)
(1,098)	Voltalia SA (Right)	Bank of America Merrill Lynch	(1,539)
(813)	Voltalia SA Reg	Bank of America Merrill Lynch	1,064
117	Wendel SE	Goldman Sachs	79
186	Wendel SE	Morgan Stanley	(39)
(1,331)	Worldline SA	Bank of America Merrill Lynch	663
(452)	Worldline SA	Goldman Sachs	225
(1,273)	Worldline SA	Morgan Stanley	(846)
			(12,695)
ドイツ			
343	1&1 AG	Bank of America Merrill Lynch	(103)
880	1&1 AG	Goldman Sachs	(265)
977	1&1 AG	Morgan Stanley	162
(1,718)	About You Holding SE	Bank of America Merrill Lynch	571
(199)	About You Holding SE	Goldman Sachs	66
87	Adesso SE	Goldman Sachs	668
52	adidas AG	Bank of America Merrill Lynch	(224)
647	adidas AG	Goldman Sachs	(6,206)
919	adidas AG	Morgan Stanley	(236)
(739)	AIXTRON SE	Bank of America Merrill Lynch	(1,331)

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)		
(968)	AIXTRON SE	Goldman Sachs	(2,126)
(1,972)	AIXTRON SE	Morgan Stanley	(2,436)
(3,614)	Aroundtown SA	Goldman Sachs	1,062
(3,795)	Aroundtown SA	Morgan Stanley	938
53	Atoss Software AG	Bank of America Merrill Lynch	(35)
50	Atoss Software AG	Goldman Sachs	(71)
(928)	Auto1 Group SE	Bank of America Merrill Lynch	1,434
218	BASF SE	Bank of America Merrill Lynch	(379)
40	BASF SE	Goldman Sachs	(47)
65	BASF SE	Morgan Stanley	(72)
2,273	Bayerische Motoren Werke AG	Bank of America Merrill Lynch	1,908
555	Bayerische Motoren Werke AG	Goldman Sachs	1,234
539	Bayerische Motoren Werke AG	Morgan Stanley	1,035
73	Bayerische Motoren Werke AG (Pref)	Bank of America Merrill Lynch	160
(201)	BayWa AG	Bank of America Merrill Lynch	(140)
(382)	BayWa AG	Goldman Sachs	(278)
(1,483)	Bechtle AG	Bank of America Merrill Lynch	3,554
(1,221)	Bechtle AG	Goldman Sachs	2,914
(1,288)	Bechtle AG	Morgan Stanley	27
(90)	Befesa SA	Bank of America Merrill Lynch	21
(245)	Befesa SA	Goldman Sachs	36
388	Beiersdorf AG	Bank of America Merrill Lynch	1,493
796	Beiersdorf AG	Goldman Sachs	4,041
103	Beiersdorf AG	Morgan Stanley	118
12	Bilfinger SE	Bank of America Merrill Lynch	5
960	Bilfinger SE	Goldman Sachs	379
(147)	Borussia Dortmund GmbH & CoKGaA	Bank of America Merrill Lynch	15
(190)	Brenntag SE	Morgan Stanley	1,397
59	CANCOM SE	Bank of America Merrill Lynch	15
288	CANCOM SE	Goldman Sachs	72
(1,632)	CECONOMY AG	Bank of America Merrill Lynch	(146)
(2,762)	CECONOMY AG	Goldman Sachs	(247)
(8)	Cewe Stiftung & Co KGaA	Bank of America Merrill Lynch	(56)
(112)	Cewe Stiftung & Co KGaA	Goldman Sachs	(763)
6,501	Commerzbank AG	Bank of America Merrill Lynch	(459)
3,883	Commerzbank AG	Goldman Sachs	(274)
394	Commerzbank AG	Morgan Stanley	(38)
(63)	CompuGroup Medical SE & Co KgaA	Bank of America Merrill Lynch	167
(12)	CompuGroup Medical SE & Co KgaA	Goldman Sachs	32
77	Covestro AG	Goldman Sachs	79
205	Covestro AG	Morgan Stanley	126
(740)	CTS Eventim AG & Co KGaA	Bank of America Merrill Lynch	(653)
(196)	CTS Eventim AG & Co KGaA	Goldman Sachs	(173)
(40)	CTS Eventim AG & Co KGaA	Morgan Stanley	(110)
885	Daimler Truck Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	2,508

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)		
216	Daimler Truck Holding AG	Goldman Sachs	612
935	Daimler Truck Holding AG	Morgan Stanley	1,005
7	Datagroup SE	Bank of America Merrill Lynch	55
10	Datagroup SE	Goldman Sachs	79
(551)	Delivery Hero SE	Bank of America Merrill Lynch	192
(374)	Delivery Hero SE	Goldman Sachs	943
(626)	Delivery Hero SE	Morgan Stanley	(175)
944	Deutsche Pfandbriefbank AG	Bank of America Merrill Lynch	(93)
3,340	Deutsche Pfandbriefbank AG	Goldman Sachs	(329)
(403)	Deutsche Post AG Reg	Goldman Sachs	444
(436)	Deutsche Post AG Reg	Morgan Stanley	48
(388)	Deutsche Wohnen SE	Bank of America Merrill Lynch	733
(77)	Deutsche Wohnen SE	Goldman Sachs	145
(640)	Deutsche Wohnen SE	Morgan Stanley	193
3,757	Deutz AG	Bank of America Merrill Lynch	281
3,110	Deutz AG	Goldman Sachs	232
(8)	Draegerwerk AG & Co KGaA	Bank of America Merrill Lynch	(15)
(31)	Draegerwerk AG & Co KGaA	Goldman Sachs	(58)
199	Duerr AG	Bank of America Merrill Lynch	55
159	Duerr AG	Goldman Sachs	33
1,166	DWS Group GmbH & Co KGaA	Bank of America Merrill Lynch	397
289	DWS Group GmbH & Co KGaA	Goldman Sachs	138
707	DWS Group GmbH & Co KGaA	Morgan Stanley	305
8,724	E.ON SE	Bank of America Merrill Lynch	1,087
817	E.ON SE	Goldman Sachs	23
3,804	E.ON SE	Morgan Stanley	226
230	Eckert & Ziegler Strahlenund Medizintechnik AG	Goldman Sachs	621
(12)	Einhell Germany AG (Pref)	Goldman Sachs	151
46	Elmos Semiconductor SE	Bank of America Merrill Lynch	138
42	Elmos Semiconductor SE	Goldman Sachs	147
535	ElringKlinger AG	Bank of America Merrill Lynch	(131)
1,319	ElringKlinger AG	Goldman Sachs	(322)
385	Encavis AG	Morgan Stanley	360
(41)	Energiekontor AG	Bank of America Merrill Lynch	113
(16)	Energiekontor AG	Goldman Sachs	36
2,474	Evonik Industries AG	Bank of America Merrill Lynch	(1,253)
4,326	Evonik Industries AG	Goldman Sachs	(4,066)
2,512	Evonik Industries AG	Morgan Stanley	(1,625)
(415)	Evotec SE	Bank of America Merrill Lynch	547
(719)	Evotec SE	Morgan Stanley	(720)
583	flatexDEGIRO AG	Bank of America Merrill Lynch	(745)
294	flatexDEGIRO AG	Goldman Sachs	(344)
322	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	Bank of America Merrill Lynch	(543)
2,732	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	Goldman Sachs	(5,718)

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)		
1,711	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	Morgan Stanley	(1,234)
2,455	Freenet AG	Bank of America Merrill Lynch	(127)
2,381	Freenet AG	Goldman Sachs	(124)
1,836	Freenet AG	Morgan Stanley	(362)
(1,972)	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	Bank of America Merrill Lynch	1,065
(2,656)	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	Goldman Sachs	1,249
(1,287)	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	Morgan Stanley	(805)
(3,511)	Fresenius SE & Co KGaA	Bank of America Merrill Lynch	(7,905)
(3,323)	Fresenius SE & Co KGaA	Goldman Sachs	(7,649)
(4,636)	Fresenius SE & Co KGaA	Morgan Stanley	(7,706)
752	FUCHS PETROLUB SE (Pref)	Morgan Stanley	(1,296)
(591)	GEA Group AG	Bank of America Merrill Lynch	466
(83)	GEA Group AG	Goldman Sachs	7
(513)	GEA Group AG	Morgan Stanley	581
(45)	Gerresheimer AG	Bank of America Merrill Lynch	(40)
45	GFT Technologies SE	Bank of America Merrill Lynch	(68)
123	GFT Technologies SE	Goldman Sachs	(185)
(2,649)	Global Fashion Group SA	Bank of America Merrill Lynch	498
(908)	Global Fashion Group SA	Goldman Sachs	171
244	Grand City Properties SA	Goldman Sachs	(307)
(2,099)	Hamborner AG (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	828
(1,078)	Hamborner AG (REIT)	Goldman Sachs	425
(227)	Hamburger Hafen und Logistik AG	Bank of America Merrill Lynch	170
(226)	Hamburger Hafen und Logistik AG	Goldman Sachs	169
(125)	Hannover Rueck SE	Goldman Sachs	(694)
3,463	Heidelberger Druckmaschinen AG	Bank of America Merrill Lynch	(643)
3,396	Heidelberger Druckmaschinen AG	Goldman Sachs	(635)
(218)	Hella GmbH & Co KGaA	Morgan Stanley	68
(458)	Henkel AG & Co KGaA (Pref)	Bank of America Merrill Lynch	(542)
(1,386)	Henkel AG & Co KGaA (Pref)	Goldman Sachs	(1,640)
(759)	Henkel AG & Co KGaA (Pref)	Morgan Stanley	(347)
101	Hensoldt AG	Bank of America Merrill Lynch	23
290	Hensoldt AG	Goldman Sachs	63
40	HOCHTIEF AG	Goldman Sachs	32
704	HOCHTIEF AG	Morgan Stanley	205
26	Hypoport SE	Bank of America Merrill Lynch	(277)
29	Hypoport SE	Goldman Sachs	(296)
(422)	Indus Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	131
(356)	Indus Holding AG	Goldman Sachs	111
(162)	Instone Real Estate Group SE	Bank of America Merrill Lynch	17
(424)	Instone Real Estate Group SE	Goldman Sachs	44
(121)	Jenoptik AG	Bank of America Merrill Lynch	(10)
(387)	Jenoptik AG	Goldman Sachs	(32)
(121)	JOST Werke AG	Bank of America Merrill Lynch	(408)
(152)	JOST Werke AG	Goldman Sachs	(513)

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)		
(356)	Jungheinrich AG (Pref)	Goldman Sachs	322
227	K+S AG Reg	Goldman Sachs	(185)
326	K+S AG Reg	Morgan Stanley	(41)
(415)	KION Group AG	Morgan Stanley	(108)
(488)	Kloeckner & Co SE	Bank of America Merrill Lynch	175
(905)	Kloeckner & Co SE	Goldman Sachs	324
791	Knorr-Bremse AG	Bank of America Merrill Lynch	(739)
934	Knorr-Bremse AG	Goldman Sachs	(830)
2,414	Knorr-Bremse AG	Morgan Stanley	(702)
652	Kontron AG	Goldman Sachs	217
6	KWS Saat SE & Co KGaA	Bank of America Merrill Lynch	23
213	LEG Immobilien SE	Bank of America Merrill Lynch	(1,367)
385	LEG Immobilien SE	Morgan Stanley	(120)
(270)	Medios AG	Goldman Sachs	(774)
2,030	Mercedes-Benz Group AG	Bank of America Merrill Lynch	4,624
2,020	Mercedes-Benz Group AG	Goldman Sachs	(226)
578	Mercedes-Benz Group AG	Morgan Stanley	1,458
(80)	Merck KGaA	Bank of America Merrill Lynch	309
(487)	Merck KGaA	Goldman Sachs	4,121
(259)	Merck KGaA	Morgan Stanley	(538)
2,047	MLP SE	Goldman Sachs	64
20	MorphoSys AG	Bank of America Merrill Lynch	19
(39)	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen Reg	Bank of America Merrill Lynch	(377)
(212)	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen Reg	Goldman Sachs	(1,784)
(45)	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen Reg	Morgan Stanley	(159)
5	Nagarro SE	Bank of America Merrill Lynch	(28)
5	Nagarro SE	Goldman Sachs	(28)
339	Nemetschek SE	Bank of America Merrill Lynch	(496)
259	Nemetschek SE	Goldman Sachs	(379)
406	Nemetschek SE	Morgan Stanley	1,324
1,758	Nordex SE	Bank of America Merrill Lynch	1,113
2,049	Nordex SE	Goldman Sachs	1,298
711	Nordex SE	Morgan Stanley	125
176	Norma Group SE	Goldman Sachs	(239)
(26)	OHB SE	Goldman Sachs	(93)
(345)	PATRIZIA SE	Goldman Sachs	172
(2)	Pfeiffer Vacuum Technology AG	Goldman Sachs	(1)
(110)	PNE AG	Goldman Sachs	(200)
69	Porsche Automobil Holding SE (Pref)	Morgan Stanley	44
1,444	ProSiebenSat.1 Media SE	Bank of America Merrill Lynch	87
368	ProSiebenSat.1 Media SE	Goldman Sachs	22
1,254	ProSiebenSat.1 Media SE	Morgan Stanley	18
(236)	Puma SE	Bank of America Merrill Lynch	457
(169)	Puma SE	Goldman Sachs	18

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)		
(38)	Puma SE	Morgan Stanley	38
72	RWE AG	Goldman Sachs	72
500	RWE AG	Morgan Stanley	343
21	Salzgitter AG	Goldman Sachs	(7)
57	Schaeffler AG (Pref)	Bank of America Merrill Lynch	(10)
1,888	Schaeffler AG (Pref)	Goldman Sachs	(283)
165	Scout24 SE	Bank of America Merrill Lynch	(528)
74	Scout24 SE	Morgan Stanley	(106)
2	Secunet Security Networks AG	Bank of America Merrill Lynch	(19)
(627)	SGL Carbon SE	Goldman Sachs	159
29	Shop Apotheke Europe NV	Bank of America Merrill Lynch	(128)
183	Shop Apotheke Europe NV	Goldman Sachs	(809)
231	Siemens AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	2,255
30	Siemens AG Reg	Goldman Sachs	189
1,412	Siemens AG Reg	Morgan Stanley	3,988
3,539	Siemens Energy AG	Bank of America Merrill Lynch	5,015
423	Siemens Energy AG	Goldman Sachs	599
(639)	Siemens Healthineers AG	Goldman Sachs	372
(219)	Siemens Healthineers AG	Morgan Stanley	182
57	Siltronic AG	Bank of America Merrill Lynch	20
39	Siltronic AG	Goldman Sachs	10
(121)	Sixt SE	Goldman Sachs	182
23	SMA Solar Technology AG	Bank of America Merrill Lynch	162
77	SMA Solar Technology AG	Goldman Sachs	529
56	Steico SE	Bank of America Merrill Lynch	(110)
89	Steico SE	Goldman Sachs	(176)
(2)	STO SE & Co KGaA (Pref)	Goldman Sachs	(29)
(10)	STRATEC SE	Goldman Sachs	92
(204)	Stroeer SE & Co KGaA	Bank of America Merrill Lynch	792
(423)	Stroeer SE & Co KGaA	Goldman Sachs	1,643
(330)	Suedzucker AG	Bank of America Merrill Lynch	(3)
(469)	Suedzucker AG	Goldman Sachs	(5)
(516)	SUSE SA	Goldman Sachs	852
(651)	Symrise AG	Bank of America Merrill Lynch	834
(346)	Symrise AG	Goldman Sachs	797
(857)	Symrise AG	Morgan Stanley	(222)
(278)	Synlab AG	Goldman Sachs	(208)
1,535	TAG Immobilien AG	Bank of America Merrill Lynch	(1,908)
3,903	TAG Immobilien AG	Goldman Sachs	(5,218)
(719)	Takkt AG	Goldman Sachs	119
896	Talanx AG	Bank of America Merrill Lynch	2,772
731	Talanx AG	Goldman Sachs	2,262
362	Talanx AG	Morgan Stanley	180
1,201	TeamViewer AG	Bank of America Merrill Lynch	1,677
(28,772)	Telefonica Deutschland Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	2,718

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)			
(15,358)	Telefonica Deutschland Holding AG	Morgan Stanley	2,727
886	thyssenkrupp AG	Bank of America Merrill Lynch	82
(396)	Uniper SE	Bank of America Merrill Lynch	172
(994)	Uniper SE	Goldman Sachs	431
(1,117)	Uniper SE	Morgan Stanley	2,754
71	VERBIO Vereinigte BioEnergie AG	Bank of America Merrill Lynch	(509)
215	VERBIO Vereinigte BioEnergie AG	Goldman Sachs	(1,540)
213	VERBIO Vereinigte BioEnergie AG	Morgan Stanley	(1,504)
15	Vitesco Technologies Group AG	Bank of America Merrill Lynch	(1)
202	Vitesco Technologies Group AG	Goldman Sachs	(761)
320	Volkswagen AG	Bank of America Merrill Lynch	(2,342)
254	Volkswagen AG	Goldman Sachs	(1,859)
215	Volkswagen AG	Morgan Stanley	145
281	Volkswagen AG (Pref)	Goldman Sachs	(1,027)
91	Volkswagen AG (Pref)	Morgan Stanley	11
(3,979)	Vonovia SE	Bank of America Merrill Lynch	3,714
(2,128)	Vonovia SE	Goldman Sachs	1,541
(3,011)	Vonovia SE	Morgan Stanley	(1,091)
(8)	Vossloh AG	Bank of America Merrill Lynch	(13)
263	Wacker Chemie AG	Bank of America Merrill Lynch	(573)
107	Wacker Chemie AG	Goldman Sachs	(233)
167	Wacker Chemie AG	Morgan Stanley	(676)
(255)	Wuestenrot & Wuerttembergische AG	Bank of America Merrill Lynch	(37)
(311)	Wuestenrot & Wuerttembergische AG	Goldman Sachs	(45)
(975)	Zalando SE	Bank of America Merrill Lynch	3,786
(375)	Zalando SE	Goldman Sachs	1,456
(2,038)	Zalando SE	Morgan Stanley	(2,962)
(46)	Zeal Network SE	Bank of America Merrill Lynch	12
(94)	Zeal Network SE	Goldman Sachs	24
			2,735
ジブラルタル			
2,239	888 Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	13
			13
香港			
4,200	AIA Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,453
2,200	ASMPT Ltd	Goldman Sachs	144
2,200	ASMPT Ltd	Morgan Stanley	409
1,200	Bank of East Asia Ltd	Bank of America Merrill Lynch	18
9,600	Bank of East Asia Ltd	Goldman Sachs	148
7,000	Bank of East Asia Ltd	Morgan Stanley	449
9,100	Budweiser Brewing Co APAC Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,692
8,600	Budweiser Brewing Co APAC Ltd	Goldman Sachs	1,599
11,100	Budweiser Brewing Co APAC Ltd	Morgan Stanley	2,633
2,000	Cafe de Coral Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(128)
13,000	Cathay Pacific Airways Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,017

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	香港(続き)		
32,000	Cathay Pacific Airways Ltd	Goldman Sachs	1,844
67,000	Cathay Pacific Airways Ltd	Morgan Stanley	3,765
(5,000)	CK Asset Holdings Ltd	Goldman Sachs	353
(12,000)	CK Hutchison Holdings Ltd	Goldman Sachs	(1,770)
(4,000)	CK Infrastructure Holdings Ltd	Goldman Sachs	(410)
(20,000)	CK Life Sciences Int'l Holdings Inc	Goldman Sachs	26
(12,000)	CLP Holdings Ltd	Goldman Sachs	1,616
2,000	Comba Telecom Systems Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	23
2,000	Cowell e Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(200)
11,200	Dah Sing Banking Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	302
92,400	Dah Sing Banking Group Ltd	Goldman Sachs	2,488
6,000	Dah Sing Financial Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	92
14,000	Dah Sing Financial Holdings Ltd	Goldman Sachs	215
8,000	EC Healthcare	Goldman Sachs	(574)
(12,000)	E-Commodities Holdings Ltd	Goldman Sachs	(400)
2,000	First Pacific Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	15
16,000	First Pacific Co Ltd	Goldman Sachs	123
28,000	First Pacific Co Ltd	Morgan Stanley	826
(4,000)	Fortune (REIT)	Goldman Sachs	46
(8,800)	Fosun Tourism Group	Goldman Sachs	(237)
(7,000)	Galaxy Entertainment Group Ltd	Goldman Sachs	(269)
(3,000)	Guotai Junan International Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	8
11,000	Haitong International Securities Group Ltd	Morgan Stanley	42
4,000	Hang Lung Properties Ltd	Bank of America Merrill Lynch	626
7,000	Hang Lung Properties Ltd	Morgan Stanley	1,544
(2,600)	Hang Seng Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,900
(1,000)	Hang Seng Bank Ltd	Goldman Sachs	731
3,500	Health & Happiness H&H International Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	126
20,000	Health & Happiness H&H International Holdings Ltd	Goldman Sachs	718
(2,000)	Henderson Land Development Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(385)
(9,000)	Henderson Land Development Co Ltd	Goldman Sachs	(1,731)
15,000	HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd (Unit)	Bank of America Merrill Lynch	96
10,000	HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd (Unit)	Goldman Sachs	64
9,000	HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd (Unit)	Morgan Stanley	92
(35,000)	HKT Trust & HKT Ltd (Unit)	Goldman Sachs	45
(16,000)	Hong Kong & China Gas Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	144
(35,000)	Hong Kong & China Gas Co Ltd	Goldman Sachs	314
1,700	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	Goldman Sachs	(698)
3,000	Hysan Development Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	-
6,000	Hysan Development Co Ltd	Goldman Sachs	-
6,000	Hysan Development Co Ltd	Morgan Stanley	77
13,000	IGG Inc	Bank of America Merrill Lynch	(117)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	香港(続き)		
35,000	IGG Inc	Goldman Sachs	198
(11,000)	JS Global Lifestyle Co Ltd	Goldman Sachs	(240)
(13,000)	Kerry Logistics Network Ltd	Goldman Sachs	767
5,500	Kerry Properties Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(127)
1,000	Kerry Properties Ltd	Goldman Sachs	(23)
(2,000)	Lifestyle International Holdings Ltd	Goldman Sachs	(77)
600	Link (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(308)
5,000	Link (REIT)	Goldman Sachs	(2,565)
6,750	L'Occitane International SA	Bank of America Merrill Lynch	(303)
2,500	L'Occitane International SA	Goldman Sachs	(112)
4,000	Luk Fook Holdings International Ltd	Goldman Sachs	256
(28,000)	Man Wah Holdings Ltd	Goldman Sachs	(826)
(200)	MECOM Power and Construction Ltd	Goldman Sachs	-
28,400	MGM China Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	291
6,000	MGM China Holdings Ltd	Goldman Sachs	62
9,600	MGM China Holdings Ltd	Morgan Stanley	849
(17,002)	MTR Corp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(218)
30,000	New World Development Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(8,700)
25,000	New World Development Co Ltd	Goldman Sachs	(6,921)
9,000	New World Development Co Ltd	Morgan Stanley	(612)
10,000	Nissin Foods Co Ltd	Goldman Sachs	372
(11,000)	NWS Holdings Ltd	Goldman Sachs	14
47,000	Pacific Basin Shipping Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,386
40,000	Pacific Basin Shipping Ltd	Morgan Stanley	1,436
(4,000)	Pacific Textiles Holdings Ltd	Goldman Sachs	56
3,000	PAX Global Technology Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(50)
(127,000)	PCCW Ltd	Goldman Sachs	(2,117)
(7,000)	Power Assets Holdings Ltd	Goldman Sachs	(224)
3,000	PRADA SpA	Bank of America Merrill Lynch	289
7,500	PRADA SpA	Goldman Sachs	721
3,000	PRADA SpA	Morgan Stanley	789
(33,000)	Prosperity (REIT)	Goldman Sachs	466
134,000	Sa Sa International Holdings Ltd	Goldman Sachs	(515)
(6,000)	Sands China Ltd	Goldman Sachs	(862)
(46,214)	Sino Land Co Ltd	Goldman Sachs	(1,067)
15,000	SITC International Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	4,578
(3,000)	Sun Hung Kai & Co Ltd	Goldman Sachs	42
(14,000)	SUNeVision Holdings Ltd	Goldman Sachs	610
7,000	Swire Pacific Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	269
11,500	Swire Pacific Ltd 'A'	Morgan Stanley	885
26,400	Swire Properties Ltd	Morgan Stanley	609
(1,500)	Techtronic Industries Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(605)
(1,000)	Texhong Textile Group Ltd	Goldman Sachs	(6)
(10,000)	Theme International Holdings Ltd	Goldman Sachs	38
170,000	United Energy Group Ltd	Goldman Sachs	(1,962)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
香港(続き)			
164,000	United Energy Group Ltd	Morgan Stanley	-
2,000	United Laboratories International Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3)
(4,000)	Vesync Co Ltd	Goldman Sachs	(698)
(8,000)	Viva China Holdings Ltd	Goldman Sachs	21
(15,000)	Vobile Group Ltd	Goldman Sachs	858
(3,300)	VTech Holdings Ltd	Goldman Sachs	(994)
(1,000)	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	39
(3,000)	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	Morgan Stanley	(365)
19,600	Wynn Macau Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,637
12,000	Wynn Macau Ltd	Goldman Sachs	1,585
18,800	Wynn Macau Ltd	Morgan Stanley	3,568
(10,000)	Xinyi Glass Holdings Ltd	Goldman Sachs	(1,854)
10,500	Yue Yuen Industrial Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(660)
27,000	Yue Yuen Industrial Holdings Ltd	Goldman Sachs	(1,696)
36,500	Yue Yuen Industrial Holdings Ltd	Morgan Stanley	1,357
			11,242
アイルランド			
4,901	Bank of Ireland Group Plc	Morgan Stanley	509
(2,544)	Cairn Homes Plc	Bank of America Merrill Lynch	103
(8,328)	Cairn Homes Plc	Goldman Sachs	337
(90)	Flutter Entertainment Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1,115)
(2,253)	Flutter Entertainment Plc	Goldman Sachs	(23,466)
987	Glanbia Plc	Bank of America Merrill Lynch	596
635	Glanbia Plc	Goldman Sachs	415
2,453	Glanbia Plc	Morgan Stanley	(51)
(341)	Irish Residential Properties Plc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	9
(261)	Irish Residential Properties Plc (REIT)	Goldman Sachs	7
1,956	Kingspan Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(10,652)
834	Kingspan Group Plc	Goldman Sachs	(4,018)
2,025	Kingspan Group Plc	Morgan Stanley	(4,366)
1,194	Origin Enterprises Plc	Bank of America Merrill Lynch	409
1,691	Origin Enterprises Plc	Goldman Sachs	579
(1,865)	Smurfit Kappa Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	3,146
(2,133)	Smurfit Kappa Group Plc	Goldman Sachs	3,765
			(33,793)
イスラエル			
438	Airport City Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(160)
394	Airport City Ltd	Goldman Sachs	(144)
493	Airport City Ltd	Morgan Stanley	(9)
664	Alony Hetz Properties & Investments Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(847)
661	Alony Hetz Properties & Investments Ltd	Goldman Sachs	(1,186)
471	Alony Hetz Properties & Investments Ltd	Morgan Stanley	(524)
(216)	Ashtrom Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	541
(2,832)	Ashtrom Group Ltd	Morgan Stanley	2,733
(474)	Azrieli Group Ltd	Goldman Sachs	4,437

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	イスラエル(続き)		
(25,491)	Bank Leumi Le-Israel BM	Goldman Sachs	13,445
(172)	Big Shopping Centers Ltd	Morgan Stanley	(195)
(103)	Camtek Ltd	Goldman Sachs	237
1,128	Cellcom Israel Ltd	Bank of America Merrill Lynch	495
188	Cellcom Israel Ltd	Goldman Sachs	83
(249)	Clal Insurance Enterprises Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(50)
(19)	Danel Adir Yeoshua Ltd	Bank of America Merrill Lynch	593
285	Delek Automotive Systems Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(89)
(9)	Delta Galil Ltd	Bank of America Merrill Lynch	66
(6,530)	Doral Group Renewable Energy Resources Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,671
68	Elbit Systems Ltd	Goldman Sachs	(1,274)
231	Elbit Systems Ltd	Morgan Stanley	(3,850)
(25)	Electra Consumer Products 1970 Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(170)
(52)	Electra Real Estate Ltd	Bank of America Merrill Lynch	96
(106)	Equital Ltd	Bank of America Merrill Lynch	132
(566)	First International Bank Of Israel Ltd	Goldman Sachs	740
1,843	Gav-Yam Lands Corp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,002)
312	Gav-Yam Lands Corp Ltd	Goldman Sachs	(170)
734	Gav-Yam Lands Corp Ltd	Morgan Stanley	(371)
(230)	ICL Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	37
(1,791)	Isracard Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(422)
25	Israel Corp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	231
16	Israel Corp Ltd	Goldman Sachs	148
55	Israel Corp Ltd	Morgan Stanley	341
20	Isras Investment Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(149)
18	Isras Investment Co Ltd	Goldman Sachs	(134)
(931)	Kenon Holdings Ltd	Morgan Stanley	2,084
101	Matrix IT Ltd	Bank of America Merrill Lynch	14
99	Matrix IT Ltd	Goldman Sachs	14
(1,780)	Maytronics Ltd	Goldman Sachs	1,697
(1,463)	Migdal Insurance & Financial Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(106)
4,724	Mivne Real Estate KD Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(632)
893	Mivne Real Estate KD Ltd	Goldman Sachs	(119)
1,918	Mivne Real Estate KD Ltd	Morgan Stanley	(151)
(216)	Mizrahi Tefahot Bank Ltd	Goldman Sachs	609
(1,749)	Naphtha Israel Petroleum Corp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	229
2	Neto Malinda Trading Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(7)
149	Neto Malinda Trading Ltd	Goldman Sachs	(507)
103	Nice Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,210)
116	Nice Ltd	Morgan Stanley	(772)
7,610	Oil Refineries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(111)
6,450	Oil Refineries Ltd	Goldman Sachs	(94)
96	Paz Oil Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(776)
81	Paz Oil Co Ltd	Goldman Sachs	(655)
(71)	Perion Network Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(40)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
イスラエル(続き)			
(194)	Perion Network Ltd	Goldman Sachs	(110)
(9,261)	Shufersal Ltd	Goldman Sachs	2,288
(1,208)	Strauss Group Ltd	Goldman Sachs	1,756
(1,199)	Teva Pharmaceutical Industries Ltd	Goldman Sachs	1,004
73	YH Dimri Construction & Development Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(331)
69	YH Dimri Construction & Development Ltd	Goldman Sachs	(313)
			19,041
イタリア			
30,066	A2A SpA	Bank of America Merrill Lynch	(890)
63,379	A2A SpA	Goldman Sachs	(977)
51,834	A2A SpA	Morgan Stanley	(1,002)
100	Amplifon SpA	Bank of America Merrill Lynch	(160)
116	Amplifon SpA	Morgan Stanley	(8)
(96)	Antares Vision SpA	Goldman Sachs	(25)
(61)	Ariston Holding NV	Bank of America Merrill Lynch	(68)
(53)	Ariston Holding NV	Goldman Sachs	(59)
(814)	Assicurazioni Generali SpA	Bank of America Merrill Lynch	(43)
(1,334)	Assicurazioni Generali SpA	Goldman Sachs	221
(4,888)	Assicurazioni Generali SpA	Morgan Stanley	109
4,147	Atlantia SpA	Morgan Stanley	1,015
229	Autogrill SpA	Goldman Sachs	9
5,548	Banca Mediolanum SpA	Bank of America Merrill Lynch	(150)
1,061	Banca Mediolanum SpA	Goldman Sachs	(29)
2,249	Banca Mediolanum SpA	Morgan Stanley	397
(1,264)	Banca Popolare di Sondrio SPA	Goldman Sachs	(121)
(5,668)	Banco BPM SpA	Bank of America Merrill Lynch	(806)
219	Biesse SpA	Bank of America Merrill Lynch	(123)
287	Biesse SpA	Goldman Sachs	(161)
(3,839)	BPER Banca	Morgan Stanley	(301)
(31)	Brembo SpA	Bank of America Merrill Lynch	16
675	Brunello Cucinelli SpA	Goldman Sachs	315
717	Buzzi Unicem SpA	Morgan Stanley	707
(42)	Carel Industries SpA	Bank of America Merrill Lynch	111
(28)	Carel Industries SpA	Goldman Sachs	74
(5,250)	CNH Industrial NV	Bank of America Merrill Lynch	(2,535)
(525)	CNH Industrial NV	Goldman Sachs	(253)
(1,144)	Credito Emiliano SpA	Goldman Sachs	(356)
(21)	Danieli & C Officine Meccaniche SpA - RSP	Goldman Sachs	2
463	Datalogic SpA	Bank of America Merrill Lynch	(226)
517	Datalogic SpA	Goldman Sachs	(252)
(115)	DiaSorin SpA	Goldman Sachs	872
(261)	DiaSorin SpA	Morgan Stanley	1,070
(84)	Digital Bros SpA	Bank of America Merrill Lynch	41
(54)	Digital Bros SpA	Goldman Sachs	1
(4,255)	doValue SpA	Bank of America Merrill Lynch	(133)

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)		
(1,045)	doValue SpA	Goldman Sachs	(33)
255	El.En. SpA	Bank of America Merrill Lynch	254
(2,100)	Enav SpA	Bank of America Merrill Lynch	(488)
(474)	Enav SpA	Goldman Sachs	(110)
13,910	Enel SpA	Bank of America Merrill Lynch	173
8,198	Enel SpA	Goldman Sachs	102
12,394	Enel SpA	Morgan Stanley	154
(1,049)	Eni SpA	Bank of America Merrill Lynch	372
(1,981)	Eni SpA	Goldman Sachs	602
(4,263)	Eni SpA	Morgan Stanley	301
19	ERG SpA	Goldman Sachs	(1)
(133)	Esprinet SpA	Goldman Sachs	77
(1,296)	EXOR NV	Goldman Sachs	(12,702)
(30)	EXOR NV	Morgan Stanley	(335)
55	Ferrari NV	Bank of America Merrill Lynch	195
460	Ferrari NV	Goldman Sachs	1,948
220	Ferrari NV	Morgan Stanley	415
(517)	Fila SpA	Goldman Sachs	118
(2,527)	FinecoBank Banca Fineco SpA	Bank of America Merrill Lynch	(2,033)
(2,701)	FinecoBank Banca Fineco SpA	Goldman Sachs	(2,173)
(5,640)	FinecoBank Banca Fineco SpA	Morgan Stanley	(2,137)
(253)	Gruppo MutuiOnline SpA	Bank of America Merrill Lynch	74
(126)	Gruppo MutuiOnline SpA	Goldman Sachs	37
(2,616)	GVS SpA	Bank of America Merrill Lynch	1,755
(729)	GVS SpA	Goldman Sachs	489
(489)	Illimity Bank SpA	Bank of America Merrill Lynch	(74)
(264)	Illimity Bank SpA	Goldman Sachs	(40)
1,422	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	Bank of America Merrill Lynch	(351)
(1,318)	Interpump Group SpA	Bank of America Merrill Lynch	2,057
(341)	Interpump Group SpA	Goldman Sachs	353
(717)	Interpump Group SpA	Morgan Stanley	623
6,807	Iren SpA	Bank of America Merrill Lynch	71
6,241	Iren SpA	Goldman Sachs	65
(17)	Italmobiliare SpA	Bank of America Merrill Lynch	(9)
(7,380)	Iveco Group NV	Bank of America Merrill Lynch	(1,440)
(2,280)	Iveco Group NV	Goldman Sachs	(491)
(5,821)	Iveco Group NV	Morgan Stanley	(1,396)
2,696	Maire Tecnimont SpA	Bank of America Merrill Lynch	(134)
5,538	Maire Tecnimont SpA	Goldman Sachs	(276)
(29,184)	MFE-MediaForEurope NV 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(888)
(21,555)	MFE-MediaForEurope NV 'A'	Goldman Sachs	(624)
6,004	MFE-MediaForEurope NV 'B'	Bank of America Merrill Lynch	72
8,141	MFE-MediaForEurope NV 'B'	Goldman Sachs	97
333	Moncler SpA	Bank of America Merrill Lynch	291
186	Moncler SpA	Goldman Sachs	(212)

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)			
939	Moncler SpA	Morgan Stanley	648
(1,757)	Nexi SpA	Bank of America Merrill Lynch	534
(1,446)	Nexi SpA	Goldman Sachs	588
(779)	Nexi SpA	Morgan Stanley	16
4,225	OVS SpA	Goldman Sachs	149
13	Pharmanutra SpA	Bank of America Merrill Lynch	(32)
75	Pharmanutra SpA	Goldman Sachs	(187)
149	Piaggio & C SpA	Bank of America Merrill Lynch	(6)
112	Prysmian SpA	Bank of America Merrill Lynch	(23)
70	Prysmian SpA	Goldman Sachs	35
(1,502)	RAI Way SpA	Bank of America Merrill Lynch	(55)
(1,969)	RAI Way SpA	Goldman Sachs	(72)
245	Reply SpA	Bank of America Merrill Lynch	(382)
372	Reply SpA	Goldman Sachs	(579)
(217)	Safilo Group SpA	Goldman Sachs	(11)
67	Sanlorenzo SpA	Bank of America Merrill Lynch	42
187	Sanlorenzo SpA	Goldman Sachs	114
25	Sesa SpA	Bank of America Merrill Lynch	(50)
238	Sesa SpA	Goldman Sachs	(689)
2,099	Snam SpA	Goldman Sachs	102
468	Snam SpA	Morgan Stanley	14
(17,051)	Stellantis NV	Bank of America Merrill Lynch	(5,440)
(4,777)	Stellantis NV	Goldman Sachs	(1,450)
(1,637)	Stellantis NV	Morgan Stanley	(194)
(718)	Technogym SpA	Bank of America Merrill Lynch	(97)
(1,408)	Technogym SpA	Goldman Sachs	(190)
(194)	Technoprobe SpA	Bank of America Merrill Lynch	6
(99)	Technoprobe SpA	Goldman Sachs	6
(5,729)	Tenaris SA	Bank of America Merrill Lynch	297
(3,541)	Tenaris SA	Goldman Sachs	141
(4,481)	Tenaris SA	Morgan Stanley	(395)
301	Tinexta Spa	Goldman Sachs	(281)
4,788	UnipolSai Assicurazioni SpA	Bank of America Merrill Lynch	99
8,117	UnipolSai Assicurazioni SpA	Goldman Sachs	169
9,855	UnipolSai Assicurazioni SpA	Morgan Stanley	(20)
15,756	Webuild SpA	Bank of America Merrill Lynch	(131)
8,660	Webuild SpA	Goldman Sachs	(72)
166	Wiit SpA	Bank of America Merrill Lynch	(76)
311	Wiit SpA	Goldman Sachs	(142)
(23)	Zignago Vetro SpA	Bank of America Merrill Lynch	-
			(26,584)
日本			
21,600	Acom Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	916
33,900	Acom Co Ltd	Goldman Sachs	1,488
200	Adastria Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	80

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
1,200	Adastria Co Ltd	Goldman Sachs	429
(600)	ADEKA Corp	Goldman Sachs	(155)
(8)	Advance Logistics Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(126)
(6)	Advance Logistics Investment Corp (REIT)	Goldman Sachs	(95)
(1)	Advance Residence Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(14)
(22)	Advance Residence Investment Corp (REIT)	Goldman Sachs	(315)
(100)	Advantest Corp	Bank of America Merrill Lynch	(7)
(600)	Advantest Corp	Goldman Sachs	(43)
1,000	Aeon Delight Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(186)
1,300	Aeon Delight Co Ltd	Goldman Sachs	(242)
1,100	AEON Financial Service Co Ltd	Morgan Stanley	16
(2,100)	Aeon Hokkaido Corp	Bank of America Merrill Lynch	45
(200)	Aeon Hokkaido Corp	Goldman Sachs	4
(200)	AGC Inc	Bank of America Merrill Lynch	(122)
(400)	AGC Inc	Goldman Sachs	(244)
(100)	AGC Inc	Morgan Stanley	(7)
200	Ai Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	62
1,800	Ai Holdings Corp	Goldman Sachs	555
300	Aica Kogyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(32)
500	Aica Kogyo Co Ltd	Goldman Sachs	(54)
400	Aica Kogyo Co Ltd	Morgan Stanley	(158)
200	Aichi Corp	Bank of America Merrill Lynch	3
300	Aichi Corp	Goldman Sachs	5
(6,400)	Aiful Corp	Goldman Sachs	(275)
(1,300)	Ain Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,678)
(200)	Ain Holdings Inc	Goldman Sachs	(258)
(1,100)	Airtrip Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,232)
(200)	Airtrip Corp	Goldman Sachs	(451)
(2,000)	Ajinomoto Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,087)
(1,200)	Ajinomoto Co Inc	Goldman Sachs	(2,220)
(700)	Ajinomoto Co Inc	Morgan Stanley	(351)
1,200	Alfresa Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	336
900	Alfresa Holdings Corp	Goldman Sachs	252
2,600	Alfresa Holdings Corp	Morgan Stanley	(503)
(500)	Alpen Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(72)
(300)	Alpha Systems Inc	Goldman Sachs	183
200	Amano Corp	Morgan Stanley	(108)
1,200	ANA Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,206
1,200	ANA Holdings Inc	Goldman Sachs	1,132
1,200	ANA Holdings Inc	Morgan Stanley	452
2,400	Anicom Holdings Inc	Goldman Sachs	723
100	Anritsu Corp	Bank of America Merrill Lynch	(28)
1,800	Anritsu Corp	Goldman Sachs	(503)
1,100	Anritsu Corp	Morgan Stanley	(410)
2,100	AOKI Holdings Inc	Goldman Sachs	271

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
2,900	Aozora Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	986
2,500	Aozora Bank Ltd	Goldman Sachs	768
2,500	Aozora Bank Ltd	Morgan Stanley	(149)
(800)	Appier Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	212
(1,200)	Appier Group Inc	Goldman Sachs	377
400	Arata Corp	Bank of America Merrill Lynch	473
100	Arata Corp	Goldman Sachs	118
500	Arcland Service Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	150
1,600	Arcland Service Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	539
(3,200)	ARCLANDS Corp	Goldman Sachs	(413)
(500)	Ariake Japan Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	843
(200)	Ariake Japan Co Ltd	Morgan Stanley	265
(1,000)	ARTERIA Networks Corp	Bank of America Merrill Lynch	(14)
(300)	ARTERIA Networks Corp	Goldman Sachs	(4)
(100)	As One Corp	Morgan Stanley	136
(200)	Asahi Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(126)
(600)	Asahi Holdings Inc	Goldman Sachs	(297)
(1,300)	Asics Corp	Goldman Sachs	(392)
(1,400)	Asics Corp	Morgan Stanley	1,154
3,700	Astellas Pharma Inc	Bank of America Merrill Lynch	730
3,200	Astellas Pharma Inc	Goldman Sachs	631
2,100	Astellas Pharma Inc	Morgan Stanley	(166)
(2,100)	Atom Corp	Goldman Sachs	(136)
400	Autobacs Seven Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	146
100	Autobacs Seven Co Ltd	Goldman Sachs	36
800	Avex Inc	Goldman Sachs	83
(2,300)	Awa Bank Ltd	Goldman Sachs	(2,820)
(100)	Axial Retailing Inc	Bank of America Merrill Lynch	(36)
700	Azbil Corp	Bank of America Merrill Lynch	151
1,800	Azbil Corp	Goldman Sachs	387
1,200	Azbil Corp	Morgan Stanley	(602)
2,400	AZ-COM MARUWA Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,067)
1,600	AZ-COM MARUWA Holdings Inc	Goldman Sachs	(711)
1,800	AZ-COM MARUWA Holdings Inc	Morgan Stanley	(516)
(1,100)	Bank of Kyoto Ltd	Morgan Stanley	(394)
(100)	BayCurrent Consulting Inc	Bank of America Merrill Lynch	(65)
(100)	BayCurrent Consulting Inc	Goldman Sachs	(15)
(100)	BayCurrent Consulting Inc	Morgan Stanley	(18)
300	Belc Co Ltd	Goldman Sachs	301
1,300	Bell System24 Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	634
1,400	Bell System24 Holdings Inc	Goldman Sachs	683
100	Belluna Co Ltd	Goldman Sachs	-
(1,700)	Benefit One Inc	Bank of America Merrill Lynch	(98)
(1,700)	Benefit One Inc	Goldman Sachs	(98)
(1,000)	Benefit One Inc	Morgan Stanley	(509)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
2,500	Benesse Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	208
9,200	Benesse Holdings Inc	Goldman Sachs	757
11,100	Benesse Holdings Inc	Morgan Stanley	(150)
500	Bengo4.com Inc	Goldman Sachs	(161)
800	Bic Camera Inc	Bank of America Merrill Lynch	555
900	Bic Camera Inc	Goldman Sachs	936
1,700	Bic Camera Inc	Morgan Stanley	634
(100)	BIPROGY Inc	Goldman Sachs	(161)
(900)	BIPROGY Inc	Morgan Stanley	(581)
(1,000)	BML Inc	Goldman Sachs	(287)
(900)	Bridgestone Corp	Bank of America Merrill Lynch	756
(500)	Bridgestone Corp	Goldman Sachs	702
(300)	Bridgestone Corp	Morgan Stanley	417
1,400	Bunka Shutter Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	191
2,700	Bunka Shutter Co Ltd	Goldman Sachs	333
(800)	Calbee Inc	Bank of America Merrill Lynch	(590)
(1,100)	Calbee Inc	Goldman Sachs	(883)
400	Canon Electronics Inc	Bank of America Merrill Lynch	32
800	Canon Electronics Inc	Goldman Sachs	63
(100)	Canon Marketing Japan Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11)
(900)	Canon Marketing Japan Inc	Morgan Stanley	645
(1,400)	Casio Computer Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	361
(300)	Casio Computer Co Ltd	Goldman Sachs	77
(1,200)	Casio Computer Co Ltd	Morgan Stanley	26
(100)	Cawachi Ltd	Goldman Sachs	5
(400)	CellSource Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,463)
(100)	CellSource Co Ltd	Goldman Sachs	(366)
(900)	Central Glass Co Ltd	Goldman Sachs	2,000
200	Central Japan Railway Co	Morgan Stanley	108
(1,400)	Chiba Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(562)
(4,800)	Chiba Bank Ltd	Morgan Stanley	(241)
(5,300)	Chiyoda Corp	Bank of America Merrill Lynch	(76)
(100)	Chofu Seisakusho Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(28)
500	Chubu Electric Power Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	219
600	Chubu Electric Power Co Inc	Morgan Stanley	-
100	Chudenko Corp	Bank of America Merrill Lynch	35
1,100	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	Morgan Stanley	158
6,200	Chugoku Electric Power Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	267
2,400	Chugoku Electric Power Co Inc	Goldman Sachs	103
2,500	Chugoku Electric Power Co Inc	Morgan Stanley	(520)
1,300	Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	53
2,600	Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc	Goldman Sachs	287
4,100	Coca-Cola Bottlers Japan Holdings Inc	Morgan Stanley	(7)
(2,300)	COLOPL Inc	Goldman Sachs	-
(200)	Colowide Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(34)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(300)	Colowide Co Ltd	Goldman Sachs	(2)
(2)	Comforia Residential Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(14)
(3)	Comforia Residential Inc (REIT)	Goldman Sachs	(22)
2,600	COMSYS Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,174
1,700	COMSYS Holdings Corp	Goldman Sachs	768
6,600	COMSYS Holdings Corp	Morgan Stanley	(2,272)
500	Comture Corp	Goldman Sachs	118
(7,500)	Concordia Financial Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,828)
200	Cosmos Pharmaceutical Corp	Goldman Sachs	(1,004)
500	Cosmos Pharmaceutical Corp	Morgan Stanley	(3,334)
(700)	Create Restaurants Holdings Inc	Goldman Sachs	(55)
200	Create SD Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(179)
1,000	Create SD Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(896)
(5,100)	Credit Saison Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4,279)
(3,300)	Credit Saison Co Ltd	Goldman Sachs	(2,768)
(4,600)	Credit Saison Co Ltd	Morgan Stanley	(1,319)
(100)	Curves Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(69)
9,000	CyberAgent Inc	Bank of America Merrill Lynch	(529)
3,000	CyberAgent Inc	Goldman Sachs	(84)
1,500	CyberAgent Inc	Morgan Stanley	204
(300)	CYBERDYNE Inc	Bank of America Merrill Lynch	52
(600)	Cybozu Inc	Bank of America Merrill Lynch	396
(200)	Cybozu Inc	Goldman Sachs	132
400	Dai Nippon Printing Co Ltd	Goldman Sachs	422
100	Dai Nippon Printing Co Ltd	Morgan Stanley	4
(1,500)	Daicel Corp	Goldman Sachs	(312)
(2,200)	Daicel Corp	Morgan Stanley	16
(400)	Daido Steel Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(169)
(100)	Daido Steel Co Ltd	Goldman Sachs	(16)
100	Daifuku Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(258)
200	Daifuku Co Ltd	Goldman Sachs	(516)
100	Daifuku Co Ltd	Morgan Stanley	(36)
200	Daihen Corp	Bank of America Merrill Lynch	(93)
200	Daihen Corp	Goldman Sachs	(93)
(100)	Daiho Corp	Goldman Sachs	(265)
100	Dai-ichi Life Holdings Inc	Goldman Sachs	143
1,000	Dai-ichi Life Holdings Inc	Morgan Stanley	810
100	Daiichi Sankyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(26)
100	Daiken Corp	Bank of America Merrill Lynch	31
2,000	Daiken Corp	Goldman Sachs	617
(800)	Daiki Aluminium Industry Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	310
(3,500)	Daiki Aluminium Industry Co Ltd	Goldman Sachs	1,354
(100)	Daikokutenbussan Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(398)
(1,000)	Daio Paper Corp	Goldman Sachs	330
(2,700)	Daishi Hokuetsu Financial Group Inc	Goldman Sachs	(1,588)

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)	Daito Trust Construction Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,162)
(300)	Daito Trust Construction Co Ltd	Goldman Sachs	(1,044)
(200)	Daito Trust Construction Co Ltd	Morgan Stanley	201
2,400	Daiwa House Industry Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,040
1,400	Daiwa House Industry Co Ltd	Goldman Sachs	525
3,400	Daiwa House Industry Co Ltd	Morgan Stanley	(731)
(6)	Daiwa House Investment Corp (REIT)	Goldman Sachs	(86)
(18)	Daiwa House Investment Corp (REIT)	Morgan Stanley	(387)
(10)	Daiwa Office Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(574)
(1,700)	Daiwa Securities Group Inc	Morgan Stanley	37
(9)	Daiwa Securities Living Investments Corp (REIT)	Goldman Sachs	-
(400)	Daiwabo Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(52)
(700)	Daiwabo Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(70)
(200)	DCM Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	50
(800)	DCM Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	86
(5,900)	Demae-Can Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,685
1,000	DeNA Co Ltd	Goldman Sachs	(72)
1,300	DeNA Co Ltd	Morgan Stanley	(513)
(1,500)	Denka Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	794
(1,200)	Denka Co Ltd	Goldman Sachs	614
(800)	Denka Co Ltd	Morgan Stanley	287
(600)	Descente Ltd	Bank of America Merrill Lynch	194
(700)	Descente Ltd	Goldman Sachs	226
(500)	Descente Ltd	Morgan Stanley	36
(2,600)	Dexerials Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,334
(2,000)	Dexerials Corp	Goldman Sachs	1,488
(1,400)	Dexerials Corp	Morgan Stanley	703
400	Digital Arts Inc	Bank of America Merrill Lynch	(29)
300	Digital Arts Inc	Goldman Sachs	(22)
200	Digital Garage Inc	Bank of America Merrill Lynch	265
400	Digital Garage Inc	Goldman Sachs	531
(100)	dip Corp	Bank of America Merrill Lynch	(100)
400	DMG Mori Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	69
500	DMG Mori Co Ltd	Goldman Sachs	117
5,800	DMG Mori Co Ltd	Morgan Stanley	(931)
600	Doshisha Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(112)
2,100	Doshisha Co Ltd	Goldman Sachs	(392)
3,100	Doutor Nichires Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	1,311
200	Dowa Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	315
600	Dowa Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	172
(200)	DTS Corp	Bank of America Merrill Lynch	79
(500)	DTS Corp	Goldman Sachs	197
(300)	Duskin Co Ltd	Goldman Sachs	(73)
200	East Japan Railway Co	Morgan Stanley	73
600	Ebara Corp	Bank of America Merrill Lynch	344

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
1,800	Ebara Corp	Goldman Sachs	1,139
800	Ebara Corp	Morgan Stanley	1,147
(100)	eGuarantee Inc	Bank of America Merrill Lynch	16
200	Eiken Chemical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(27)
400	Eiken Chemical Co Ltd	Goldman Sachs	(54)
(100)	Eisai Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(415)
(100)	Eisai Co Ltd	Goldman Sachs	(415)
(100)	Eisai Co Ltd	Morgan Stanley	(87)
100	Eizo Corp	Goldman Sachs	(158)
1,300	Elan Corp	Bank of America Merrill Lynch	56
1,500	Elan Corp	Goldman Sachs	65
400	Elecom Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(112)
100	Elecom Co Ltd	Goldman Sachs	(28)
(800)	EM Systems Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(241)
1,800	en Japan Inc	Goldman Sachs	2,272
(15,400)	ENEOS Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,308
(6,700)	ENEOS Holdings Inc	Goldman Sachs	570
(14,600)	ENEOS Holdings Inc	Morgan Stanley	713
(500)	eRex Co Ltd	Goldman Sachs	(212)
(900)	ES-Con Japan Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(157)
(900)	ES-Con Japan Ltd	Goldman Sachs	(62)
(200)	Exedy Corp	Bank of America Merrill Lynch	(24)
(600)	Exedy Corp	Goldman Sachs	(73)
400	EXEO Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	204
4,100	EXEO Group Inc	Goldman Sachs	2,087
8,800	EXEO Group Inc	Morgan Stanley	(126)
300	Fancl Corp	Bank of America Merrill Lynch	(138)
800	Fancl Corp	Goldman Sachs	80
900	Fancl Corp	Morgan Stanley	(605)
200	Fast Retailing Co Ltd	Morgan Stanley	1,732
2,900	FCC Co Ltd	Goldman Sachs	561
(200)	Ferrotec Holdings Corp	Goldman Sachs	118
(400)	Food & Life Cos Ltd	Bank of America Merrill Lynch	703
(600)	FP Corp	Bank of America Merrill Lynch	297
(300)	FP Corp	Goldman Sachs	195
(100)	FP Corp	Morgan Stanley	61
100	Fuji Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(17)
500	Fuji Co Ltd	Goldman Sachs	9
400	Fuji Corp	Goldman Sachs	-
(600)	Fuji Electric Co Ltd	Morgan Stanley	1,162
(1,900)	Fuji Kyuko Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,499)
2,700	Fuji Media Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	677
4,500	Fuji Media Holdings Inc	Goldman Sachs	905
7,300	Fuji Media Holdings Inc	Morgan Stanley	516
(700)	Fuji Oil Holdings Inc	Goldman Sachs	(617)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(2,000)	Fuji Oil Holdings Inc	Morgan Stanley	143
(300)	Fuji Seal International Inc	Goldman Sachs	(196)
(100)	Fuji Soft Inc	Bank of America Merrill Lynch	(93)
(100)	Fuji Soft Inc	Goldman Sachs	(93)
(400)	Fujicco Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	54
(400)	Fujicco Co Ltd	Goldman Sachs	54
300	FUJIFILM Holdings Corp	Goldman Sachs	(176)
100	FUJIFILM Holdings Corp	Morgan Stanley	(20)
(400)	Fujikura Ltd	Morgan Stanley	(23)
500	Fujimi Inc	Goldman Sachs	1,685
100	Fujimori Kogyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4
(2,100)	Fujio Food Group Inc	Goldman Sachs	15
(1,700)	Fujitec Co Ltd	Goldman Sachs	(536)
(100)	Fujitsu General Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(41)
(1,800)	Fujitsu General Ltd	Morgan Stanley	258
200	Fujitsu Ltd	Bank of America Merrill Lynch	207
700	Fujitsu Ltd	Morgan Stanley	(276)
4	Fukuoka Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	153
4	Fukuoka Corp (REIT)	Goldman Sachs	125
(4,500)	Fukuoka Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,905)
(1,300)	Fukuoka Financial Group Inc	Morgan Stanley	(1,044)
(300)	Fukushima Galilei Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,011)
(500)	Fukushima Galilei Co Ltd	Goldman Sachs	(1,685)
500	FULLCAST Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	1,047
500	Funai Soken Holdings Inc	Goldman Sachs	419
300	Fuso Chemical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	22
400	Future Corp	Bank of America Merrill Lynch	278
600	Future Corp	Goldman Sachs	341
(200)	Fuyo General Lease Co Ltd	Morgan Stanley	(158)
400	G-7 Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9)
100	Geo Holdings Corp	Goldman Sachs	235
400	Giken Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(86)
800	Giken Ltd	Goldman Sachs	(172)
2	Global One Real Estate Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(37)
(1,400)	GLOBERIDE Inc	Goldman Sachs	(1,104)
(700)	Glory Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,280)
(3,600)	Glory Ltd	Goldman Sachs	(6,436)
(500)	GMO Financial Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	108
(2,500)	GMO Financial Holdings Inc	Goldman Sachs	538
400	GMO Payment Gateway Inc	Bank of America Merrill Lynch	(524)
500	GMO Payment Gateway Inc	Goldman Sachs	(1,164)
300	GMO Payment Gateway Inc	Morgan Stanley	(525)
(900)	GNI Group Ltd	Goldman Sachs	1,033
1,500	Goldcrest Co Ltd	Goldman Sachs	376
(600)	Goldwin Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,280)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(900)	Goldwin Inc	Goldman Sachs	(3,420)
100	Gree Inc	Bank of America Merrill Lynch	(30)
400	Gree Inc	Goldman Sachs	(158)
(3,000)	GS Yuasa Corp	Bank of America Merrill Lynch	43
(1,600)	GS Yuasa Corp	Goldman Sachs	23
(900)	GS Yuasa Corp	Morgan Stanley	123
400	G-Tekt Corp	Goldman Sachs	29
(2,000)	GungHo Online Entertainment Inc	Bank of America Merrill Lynch	774
(800)	GungHo Online Entertainment Inc	Morgan Stanley	315
1,900	Gunma Bank Ltd	Goldman Sachs	518
1,300	H2O Retailing Corp	Bank of America Merrill Lynch	438
1,000	H2O Retailing Corp	Goldman Sachs	338
(19,900)	Hachijuni Bank Ltd	Morgan Stanley	(1,998)
200	Halows Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	116
100	Halows Co Ltd	Goldman Sachs	58
100	Hamamatsu Photonics KK	Bank of America Merrill Lynch	(65)
100	Hankyu Hanshin Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	133
(2)	Hankyu Hanshin Inc (REIT)	Goldman Sachs	(11)
(300)	Hanwa Co Ltd	Goldman Sachs	172
(1,000)	Haseko Corp	Goldman Sachs	(466)
(2,200)	Haseko Corp	Morgan Stanley	(95)
(1,300)	Heiwa Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,109)
(700)	Heiwa Corp	Goldman Sachs	(597)
100	Heiwa Real Estate Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	158
1	Heiwa Real Estate Inc (REIT)	Goldman Sachs	47
100	Hiday Hidaka Corp	Bank of America Merrill Lynch	47
500	Hiday Hidaka Corp	Goldman Sachs	185
(300)	Hikari Tsushin Inc	Goldman Sachs	(149)
(100)	Hirata Corp	Bank of America Merrill Lynch	(86)
(200)	Hirata Corp	Goldman Sachs	(172)
(11,500)	Hirogin Holdings Inc	Morgan Stanley	(495)
(400)	HIS Co Ltd	Goldman Sachs	9
(100)	Hogy Medical Co Ltd	Goldman Sachs	(65)
(400)	Hokkoku Financial Holdings Inc	Goldman Sachs	(602)
(2,400)	Hokuetsu Corp	Bank of America Merrill Lynch	291
(5,900)	Hokuetsu Corp	Goldman Sachs	731
100	Hokuriku Electric Power Co	Bank of America Merrill Lynch	31
600	Hokuriku Electric Power Co	Goldman Sachs	185
(2,200)	Hokuto Corp	Goldman Sachs	(95)
4,100	Honda Motor Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	735
2,600	Honda Motor Co Ltd	Goldman Sachs	466
200	Honda Motor Co Ltd	Morgan Stanley	(36)
200	Horiba Ltd	Goldman Sachs	(288)
200	Horiba Ltd	Morgan Stanley	(301)
1	Hoshino Resorts Inc (REIT)	Goldman Sachs	65

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(2,300)	Hoshizaki Corp	Bank of America Merrill Lynch	(357)
(1,800)	Hoshizaki Corp	Goldman Sachs	(697)
(2,500)	Hoshizaki Corp	Morgan Stanley	783
3,500	Hulic Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	836
3,600	Hulic Co Ltd	Goldman Sachs	1,168
2,000	Hulic Co Ltd	Morgan Stanley	14
(2,600)	Hyakugo Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(485)
(7,700)	Hyakugo Bank Ltd	Goldman Sachs	(1,436)
(700)	Ibiden Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	964
(2,700)	Ibiden Co Ltd	Goldman Sachs	4,373
(2,000)	Ibiden Co Ltd	Morgan Stanley	(1,147)
(100)	Ichibanya Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	18
3,200	Ichigo Inc	Bank of America Merrill Lynch	(328)
900	Ichigo Inc	Goldman Sachs	(110)
(4,600)	Idemitsu Kosan Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,404)
(3,100)	Idemitsu Kosan Co Ltd	Goldman Sachs	(1,723)
900	IHI Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,136
900	IHI Corp	Goldman Sachs	1,780
300	IHI Corp	Morgan Stanley	570
(400)	Iida Group Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	84
(1,500)	Iida Group Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	202
(1,400)	Iida Group Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	268
(100)	Inabata & Co Ltd	Goldman Sachs	13
(500)	Inageya Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	29
(200)	Inageya Co Ltd	Goldman Sachs	11
(57)	Industrial & Infrastructure Fund Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(777)
(13)	Industrial & Infrastructure Fund Investment Corp (REIT)	Morgan Stanley	(19)
200	Infocom Corp	Bank of America Merrill Lynch	40
1,400	Infocom Corp	Goldman Sachs	281
3,100	Infomart Corp	Bank of America Merrill Lynch	89
5,300	Infomart Corp	Goldman Sachs	152
300	Information Services International-Dentsu Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(86)
300	Information Services International-Dentsu Ltd	Goldman Sachs	(86)
600	Information Services International-Dentsu Ltd	Morgan Stanley	(387)
1,324	INFRONEER Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	361
3,000	INFRONEER Holdings Inc	Goldman Sachs	817
800	INFRONEER Holdings Inc	Morgan Stanley	(172)
(3,800)	Inpex Corp	Bank of America Merrill Lynch	(214)
(15,600)	Inpex Corp	Goldman Sachs	(95)
(100)	Insource Co Ltd	Goldman Sachs	(97)
1,600	Internet Initiative Japan Inc	Goldman Sachs	574
200	Internet Initiative Japan Inc	Morgan Stanley	6

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
14	Invincible Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	261
3	Invincible Investment Corp (REIT)	Goldman Sachs	56
(400)	IR Japan Holdings Ltd	Goldman Sachs	330
(7,000)	Isuzu Motors Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,287)
(5,900)	Isuzu Motors Ltd	Goldman Sachs	(1,797)
(3,200)	Isuzu Motors Ltd	Morgan Stanley	797
(700)	Ito En Ltd	Bank of America Merrill Lynch	251
(200)	Ito En Ltd	Morgan Stanley	373
1,500	Itochu Techno-Solutions Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,243
2,400	Itochu Techno-Solutions Corp	Goldman Sachs	1,924
700	Itochu Techno-Solutions Corp	Morgan Stanley	199
(300)	Itochu-Shokuhin Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(108)
(400)	Iwatani Corp	Bank of America Merrill Lynch	(213)
(700)	Iwatani Corp	Goldman Sachs	(418)
(2,000)	Iwatani Corp	Morgan Stanley	(1,192)
(4,500)	Iyogin Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,775)
(4,800)	Iyogin Holdings Inc	Goldman Sachs	(2,960)
(1,200)	Izumi Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	725
(600)	Izumi Co Ltd	Morgan Stanley	349
4,000	J Front Retailing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	963
12,300	J Front Retailing Co Ltd	Goldman Sachs	4,648
14,100	J Front Retailing Co Ltd	Morgan Stanley	2,593
600	JAC Recruitment Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	902
1,300	JAC Recruitment Co Ltd	Goldman Sachs	1,072
(200)	Jaccs Co Ltd	Goldman Sachs	(351)
1,100	JAFCO Group Co Ltd	Goldman Sachs	1,065
(1,300)	Japan Airlines Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(932)
(3,500)	Japan Airlines Co Ltd	Morgan Stanley	(1,380)
(1,400)	Japan Airport Terminal Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,506)
(200)	Japan Airport Terminal Co Ltd	Morgan Stanley	(115)
(1,200)	Japan Aviation Electronics Industry Ltd	Bank of America Merrill Lynch	77
(1,000)	Japan Aviation Electronics Industry Ltd	Goldman Sachs	65
(4,400)	Japan Aviation Electronics Industry Ltd	Morgan Stanley	3,250
(3,800)	Japan Display Inc	Bank of America Merrill Lynch	(54)
(500)	Japan Elevator Service Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(151)
(100)	Japan Elevator Service Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(30)
(38)	Japan Hotel Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(572)
(41)	Japan Hotel Investment Corp (REIT)	Goldman Sachs	(617)
(88)	Japan Hotel Investment Corp (REIT)	Morgan Stanley	(379)
1,000	Japan Lifeline Co Ltd	Goldman Sachs	(93)
(1)	Japan Logistics Fund Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	32
(8)	Japan Logistics Fund Inc (REIT)	Goldman Sachs	258
(9)	Japan Logistics Fund Inc (REIT)	Morgan Stanley	387
(100)	Japan Material Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(20)
(400)	Japan Material Co Ltd	Goldman Sachs	(80)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(62)	Japan Metropolitan Fund Invest (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(2,134)
200	Japan Petroleum Exploration Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	394
400	Japan Post Bank Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	109
5,400	Japan Post Bank Co Ltd	Morgan Stanley	77
(1,000)	Japan Post Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(402)
(2,700)	Japan Post Insurance Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,110)
(1,100)	Japan Post Insurance Co Ltd	Goldman Sachs	(860)
(4,500)	Japan Post Insurance Co Ltd	Morgan Stanley	(2,033)
(12)	Japan Real Estate Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(1,033)
(1)	Japan Real Estate Investment Corp (REIT)	Morgan Stanley	(16)
(400)	Japan Steel Works Ltd	Goldman Sachs	152
(1,900)	Japan Steel Works Ltd	Morgan Stanley	1,499
(1,700)	JCR Pharmaceuticals Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	890
(600)	JCR Pharmaceuticals Co Ltd	Goldman Sachs	314
(1,000)	JCR Pharmaceuticals Co Ltd	Morgan Stanley	344
700	JCU Corp	Bank of America Merrill Lynch	251
300	JCU Corp	Goldman Sachs	103
(600)	Jeol Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,796
(500)	Jeol Ltd	Goldman Sachs	2,330
(500)	Jeol Ltd	Morgan Stanley	1,362
(6,400)	JFE Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(884)
(9,800)	JFE Holdings Inc	Goldman Sachs	(1,621)
(16,300)	JFE Holdings Inc	Morgan Stanley	701
(2,600)	JGC Holdings Corp	Morgan Stanley	690
700	JINS Holdings Inc	Goldman Sachs	1,133
(900)	JMDC Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,011
(400)	JMDC Inc	Goldman Sachs	411
(300)	J-Oil Mills Inc	Bank of America Merrill Lynch	9
(200)	J-Oil Mills Inc	Goldman Sachs	6
400	Joyful Honda Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	123
600	Joyful Honda Co Ltd	Goldman Sachs	185
300	JTEKT Corp	Bank of America Merrill Lynch	38
(300)	Justsystems Corp	Bank of America Merrill Lynch	312
(400)	Justsystems Corp	Goldman Sachs	416
(1,200)	Justsystems Corp	Morgan Stanley	-
100	Kadokawa Corp	Bank of America Merrill Lynch	(40)
100	Kaga Electronics Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	86
(500)	Kagome Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(473)
800	Kakaku.com Inc	Bank of America Merrill Lynch	574
2,300	Kakaku.com Inc	Goldman Sachs	1,649
(500)	Kameda Seika Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(448)
(400)	Kameda Seika Co Ltd	Goldman Sachs	(359)
800	Kanamoto Co Ltd	Goldman Sachs	132
10,000	Kandenko Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,434
7,600	Kandenko Co Ltd	Goldman Sachs	1,090

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
9,600	Kandenko Co Ltd	Morgan Stanley	(1,446)
(600)	Kaneka Corp	Bank of America Merrill Lynch	(413)
(300)	Kaneka Corp	Goldman Sachs	(188)
(100)	Kaneka Corp	Morgan Stanley	(14)
100	Kanematsu Corp	Bank of America Merrill Lynch	32
500	Kanematsu Corp	Goldman Sachs	161
1,200	Kansai Electric Power Co Inc	Goldman Sachs	336
(600)	Kansai Paint Co Ltd	Goldman Sachs	(172)
(2,800)	Kanto Denka Kogyo Co Ltd	Goldman Sachs	(582)
(700)	Kappa Create Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(85)
(300)	Kappa Create Co Ltd	Goldman Sachs	(37)
(2,600)	Katakura Industries Co Ltd	Goldman Sachs	(2,256)
(500)	Katitas Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	753
200	Kawasaki Kisen Kaisha Ltd	Bank of America Merrill Lynch	63
1,300	KDDI Corp	Bank of America Merrill Lynch	197
1,200	KDDI Corp	Goldman Sachs	559
1,500	KDDI Corp	Morgan Stanley	(65)
200	KeePer Technical Laboratory Co Ltd	Goldman Sachs	531
(700)	Keihan Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	226
(600)	Keihan Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	194
(900)	Keihan Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	290
200	Keihanshin Building Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(89)
200	Keihanshin Building Co Ltd	Goldman Sachs	(89)
400	Keio Corp	Bank of America Merrill Lynch	803
1,300	Keio Corp	Goldman Sachs	2,610
300	Keio Corp	Morgan Stanley	215
1,100	Keisei Electric Railway Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,366
600	Keisei Electric Railway Co Ltd	Morgan Stanley	839
(1,200)	Keiyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(77)
(2,100)	Keiyo Co Ltd	Goldman Sachs	(136)
(100)	Keyence Corp	Goldman Sachs	2,079
100	KFC Holdings Japan Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2)
(400)	KH Neochem Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	112
(300)	KH Neochem Co Ltd	Goldman Sachs	84
(2,300)	Kikkoman Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,154)
(1,100)	Kikkoman Corp	Goldman Sachs	(384)
(5,000)	Kikkoman Corp	Morgan Stanley	2,085
8,100	Kinden Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,743
6,400	Kinden Corp	Goldman Sachs	1,381
3,700	Kinden Corp	Morgan Stanley	(796)
(1,200)	Kisoji Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(224)
700	Kissei Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	562
400	Kissei Pharmaceutical Co Ltd	Goldman Sachs	321
(1,300)	Ki-Star Real Estate Co Ltd	Goldman Sachs	(1,140)
100	Kitz Corp	Goldman Sachs	24

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(4,400)	Kiyo Bank Ltd	Goldman Sachs	(2,461)
(1,200)	Koa Corp	Bank of America Merrill Lynch	(8)
(1,200)	Koa Corp	Goldman Sachs	(26)
(200)	Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	149
(9,100)	Kobe Steel Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(260)
(5,000)	Kobe Steel Ltd	Goldman Sachs	(321)
(4,200)	Kobe Steel Ltd	Morgan Stanley	107
(600)	Koei Tecmo Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(69)
(1,100)	Koei Tecmo Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	30
(600)	Koei Tecmo Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	116
(300)	Kohnan Shoji Co Ltd	Goldman Sachs	(108)
1,700	Kokuyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	280
1,800	Kokuyo Co Ltd	Goldman Sachs	297
2,300	Kokuyo Co Ltd	Morgan Stanley	(462)
400	Komatsu Ltd	Goldman Sachs	252
(600)	Komeri Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	77
(300)	Komeri Co Ltd	Goldman Sachs	39
(100)	Konami Group Corp	Goldman Sachs	43
(100)	Konishi Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	36
(900)	Konishi Co Ltd	Goldman Sachs	413
500	Konoike Transport Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	269
2,300	Konoike Transport Co Ltd	Goldman Sachs	1,237
(100)	Kose Corp	Bank of America Merrill Lynch	72
(300)	Kose Corp	Goldman Sachs	215
(500)	Kose Corp	Morgan Stanley	215
500	Koshidaka Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	298
300	Koshidaka Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	179
(100)	Kotobuki Spirits Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(330)
(500)	Kotobuki Spirits Co Ltd	Goldman Sachs	(1,649)
(800)	Kotobuki Spirits Co Ltd	Morgan Stanley	115
500	K's Holdings Corp	Goldman Sachs	147
200	Kubota Corp	Bank of America Merrill Lynch	(41)
700	Kubota Corp	Goldman Sachs	(196)
800	Kubota Corp	Morgan Stanley	(261)
800	Kumagai Gumi Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	585
1,700	Kumagai Gumi Co Ltd	Goldman Sachs	1,243
900	Kumiai Chemical Industry Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	74
900	Kumiai Chemical Industry Co Ltd	Goldman Sachs	70
300	Kura Sushi Inc	Goldman Sachs	(258)
200	Kuraray Co Ltd	Goldman Sachs	60
9,200	Kuraray Co Ltd	Morgan Stanley	1,253
(200)	Kureha Corp	Goldman Sachs	516
(500)	Kurita Water Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(466)
(700)	Kurita Water Industries Ltd	Goldman Sachs	(652)
(700)	Kurita Water Industries Ltd	Morgan Stanley	151

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
700	Kusuri no Aoki Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,255
700	Kusuri no Aoki Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	1,255
600	Kusuri no Aoki Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(946)
(700)	KYB Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,129)
(1,300)	KYB Corp	Goldman Sachs	(2,097)
100	Kyocera Corp	Goldman Sachs	118
100	Kyocera Corp	Morgan Stanley	(75)
(100)	Kyoei Steel Ltd	Bank of America Merrill Lynch	19
300	Kyokuto Kaihatsu Kogyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	37
2,900	Kyokuto Kaihatsu Kogyo Co Ltd	Goldman Sachs	353
(1,700)	KYORIN Holdings Inc	Goldman Sachs	61
100	Kyowa Kirin Co Ltd	Morgan Stanley	(100)
1,100	Kyushu Electric Power Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(32)
1,700	Kyushu Electric Power Co Inc	Goldman Sachs	(49)
1,400	Kyushu Electric Power Co Inc	Morgan Stanley	(221)
(6,700)	Kyushu Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(913)
(300)	Kyushu Financial Group Inc	Goldman Sachs	(41)
(8,200)	Kyushu Financial Group Inc	Morgan Stanley	(706)
(20)	LaSalle Logiport (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	774
(18)	LaSalle Logiport (REIT)	Goldman Sachs	697
(14)	LaSalle Logiport (REIT)	Morgan Stanley	391
1,700	Lawson Inc	Bank of America Merrill Lynch	750
3,900	Lawson Inc	Goldman Sachs	1,861
1,200	Lawson Inc	Morgan Stanley	(1,076)
(2,800)	Leopalace21 Corp	Goldman Sachs	(367)
200	Life Corp	Bank of America Merrill Lynch	-
1,400	Life Corp	Goldman Sachs	-
100	Link And Motivation Inc	Bank of America Merrill Lynch	-
(1,000)	Lintec Corp	Bank of America Merrill Lynch	(201)
(900)	Lintec Corp	Morgan Stanley	155
6,400	Lion Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,055
3,800	Lion Corp	Goldman Sachs	627
5,000	Lion Corp	Morgan Stanley	(1,327)
(100)	LITALICO Inc	Bank of America Merrill Lynch	68
200	Lixil Corp	Bank of America Merrill Lynch	(50)
300	Lixil Corp	Goldman Sachs	(75)
200	M&A Capital Partners Co Ltd	Goldman Sachs	595
(300)	M3 Inc	Bank of America Merrill Lynch	964
(1,200)	M3 Inc	Goldman Sachs	3,316
(800)	Mabuchi Motor Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(402)
(800)	Mabuchi Motor Co Ltd	Goldman Sachs	(402)
(500)	Mabuchi Motor Co Ltd	Morgan Stanley	233
300	Maeda Kosen Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	108
400	Maeda Kosen Co Ltd	Goldman Sachs	143
(100)	Management Solutions Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(255)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(600)	Management Solutions Co Ltd	Goldman Sachs	(1,527)
300	Mandom Corp	Bank of America Merrill Lynch	189
1,900	Mandom Corp	Goldman Sachs	1,199
700	Mani Inc	Bank of America Merrill Lynch	457
900	Mani Inc	Goldman Sachs	587
2,200	Mani Inc	Morgan Stanley	(79)
(400)	Maruha Nichiro Corp	Bank of America Merrill Lynch	(227)
(1,500)	Maruha Nichiro Corp	Goldman Sachs	(850)
(100)	MARUKA FURUSATO Corp	Bank of America Merrill Lynch	(323)
(400)	Maruwa Co Ltd	Goldman Sachs	(1,033)
300	Maruzen Showa Unyu Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	194
100	Maruzen Showa Unyu Co Ltd	Goldman Sachs	65
(50)	MatsukiyoCocokara & Co	Goldman Sachs	(86)
100	Maxell Ltd	Bank of America Merrill Lynch	67
1,900	Mazda Motor Corp	Goldman Sachs	232
400	Mazda Motor Corp	Morgan Stanley	(77)
(800)	Medley Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,635)
(500)	MedPeer Inc	Bank of America Merrill Lynch	366
(1,600)	MedPeer Inc	Goldman Sachs	1,170
200	Megachips Corp	Bank of America Merrill Lynch	(9)
200	Megmilk Snow Brand Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(73)
800	Megmilk Snow Brand Co Ltd	Goldman Sachs	(293)
700	Meidensha Corp	Bank of America Merrill Lynch	(60)
100	Meidensha Corp	Goldman Sachs	(9)
(100)	Meiko Electronics Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	208
(800)	Meiko Electronics Co Ltd	Goldman Sachs	1,503
500	Meitec Corp	Bank of America Merrill Lynch	373
1,200	Meitec Corp	Goldman Sachs	757
100	METAWATER Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(37)
300	METAWATER Co Ltd	Goldman Sachs	(112)
(500)	Micronics Japan Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	136
(400)	Micronics Japan Co Ltd	Goldman Sachs	109
(100)	Midac Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(100)
(2,000)	Mie Kotsu Group Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(14)
500	Milbon Co Ltd	Goldman Sachs	1,506
100	Mimasu Semiconductor Industry Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(9)
(500)	MINEBEA MITSUMI Inc	Bank of America Merrill Lynch	237
(900)	MINEBEA MITSUMI Inc	Goldman Sachs	426
(1,500)	MINEBEA MITSUMI Inc	Morgan Stanley	(75)
500	MIRAIT ONE corp	Bank of America Merrill Lynch	197
1,700	MIRAIT ONE corp	Goldman Sachs	670
(600)	Mitani Sekisan Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,119)
2,700	Mitsubishi Corp	Bank of America Merrill Lynch	5,223
300	Mitsubishi Corp	Goldman Sachs	538
2,800	Mitsubishi Corp	Morgan Stanley	944

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	Mitsubishi Electric Corp	Bank of America Merrill Lynch	(559)
5,800	Mitsubishi Electric Corp	Goldman Sachs	(197)
2,300	Mitsubishi Electric Corp	Morgan Stanley	(577)
3,300	Mitsubishi Estate Co Ltd	Goldman Sachs	1,053
9,100	Mitsubishi Estate Co Ltd	Morgan Stanley	555
(5)	Mitsubishi Estate Logistics Investment Corp (REIT)	Goldman Sachs	609
700	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	141
300	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	Goldman Sachs	23
600	Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	Morgan Stanley	(54)
2,600	Mitsubishi HC Capital Inc	Bank of America Merrill Lynch	503
11,500	Mitsubishi HC Capital Inc	Goldman Sachs	2,226
1,000	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,086
200	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Goldman Sachs	578
400	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Morgan Stanley	421
(100)	Mitsubishi Logisnext Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(19)
1,100	Mitsubishi Motors Corp	Goldman Sachs	160
600	Mitsubishi Pencil Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	86
1,200	Mitsubishi Pencil Co Ltd	Goldman Sachs	172
300	Mitsubishi Shokuhin Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(62)
800	Mitsubishi Shokuhin Co Ltd	Goldman Sachs	96
(100)	Mitsuboshi Belting Ltd	Goldman Sachs	(136)
1,800	Mitsui Chemicals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(387)
400	Mitsui Chemicals Inc	Goldman Sachs	(86)
1,400	Mitsui Chemicals Inc	Morgan Stanley	(100)
3,500	Mitsui Fudosan Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3,463
6,600	Mitsui Fudosan Co Ltd	Goldman Sachs	6,531
2,100	Mitsui Fudosan Co Ltd	Morgan Stanley	625
(13)	Mitsui Fudosan Logistics Park Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	326
(5)	Mitsui Fudosan Logistics Park Inc (REIT)	Morgan Stanley	161
(600)	Mitsui High-Tec Inc	Bank of America Merrill Lynch	914
(400)	Mitsui High-Tec Inc	Morgan Stanley	746
200	Mitsui-Soko Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	79
100	Mitsui-Soko Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	39
(1,500)	Mitsuuroko Group Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(699)
(1,200)	Miura Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	473
(600)	Miura Co Ltd	Goldman Sachs	237
(1,000)	Miura Co Ltd	Morgan Stanley	394
700	MIXI Inc	Goldman Sachs	994
600	Mizuho Leasing Co Ltd	Goldman Sachs	409
(100)	Mizuno Corp	Goldman Sachs	(134)
(1,200)	Modec Inc	Goldman Sachs	413
(1,800)	Money Forward Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,202
(900)	Money Forward Inc	Morgan Stanley	387
200	Monogatari Corp	Bank of America Merrill Lynch	(143)
300	Monogatari Corp	Goldman Sachs	(215)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(35)	Mori Hills Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(929)
(1)	Mori Trust Hotel Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	22
(3)	Mori Trust Hotel Inc (REIT)	Goldman Sachs	72
1	Mori Trust Sogo Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	20
3	Mori Trust Sogo Inc (REIT)	Goldman Sachs	60
(1,100)	Morinaga & Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(407)
(1,000)	Morinaga & Co Ltd	Goldman Sachs	(377)
(2,200)	Morinaga & Co Ltd	Morgan Stanley	1,191
200	Morita Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	82
1,500	Morita Holdings Corp	Goldman Sachs	613
500	MOS Food Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	520
300	MOS Food Services Inc	Goldman Sachs	268
2,300	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,813
2,700	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	Goldman Sachs	1,749
1,900	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	Morgan Stanley	817
(400)	Musashi Seimitsu Industry Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	95
(1,200)	Musashi Seimitsu Industry Co Ltd	Goldman Sachs	284
100	Nabtesco Corp	Bank of America Merrill Lynch	(25)
(600)	Nafco Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	77
(400)	Nafco Co Ltd	Goldman Sachs	52
(100)	Nagase & Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	43
(800)	Nagase & Co Ltd	Goldman Sachs	(258)
1,500	Nagoya Railroad Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,248
300	Nagoya Railroad Co Ltd	Goldman Sachs	250
1,000	Nagoya Railroad Co Ltd	Morgan Stanley	179
900	Nakanishi Inc	Bank of America Merrill Lynch	923
600	Nakanishi Inc	Goldman Sachs	615
1,000	Nankai Electric Railway Co Ltd	Goldman Sachs	1,355
700	Nankai Electric Railway Co Ltd	Morgan Stanley	181
1,200	NEC Corp	Bank of America Merrill Lynch	194
2,300	NEC Corp	Goldman Sachs	1,077
3,400	NEC Corp	Morgan Stanley	(396)
2,900	NEC Networks & System Integration Corp	Bank of America Merrill Lynch	(749)
2,900	NEC Networks & System Integration Corp	Goldman Sachs	(677)
2,300	NEC Networks & System Integration Corp	Morgan Stanley	(495)
400	NET One Systems Co Ltd	Goldman Sachs	(186)
1,500	NET One Systems Co Ltd	Morgan Stanley	(1,183)
(300)	Nextage Co Ltd	Goldman Sachs	(612)
(400)	Nextage Co Ltd	Morgan Stanley	(476)
1,500	NGK Insulators Ltd	Bank of America Merrill Lynch	450
1,200	NGK Insulators Ltd	Goldman Sachs	592
1,300	NGK Insulators Ltd	Morgan Stanley	333
700	NGK Spark Plug Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	8
(2,500)	NHK Spring Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(412)
(3,500)	NHK Spring Co Ltd	Goldman Sachs	(577)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(1,800)	NHK Spring Co Ltd	Morgan Stanley	39
300	Nichiha Corp	Bank of America Merrill Lynch	(140)
400	Nichiha Corp	Goldman Sachs	(186)
(200)	Nifco Inc	Bank of America Merrill Lynch	22
(700)	Nifco Inc	Goldman Sachs	75
(400)	Nifco Inc	Morgan Stanley	229
(700)	Nihon Kohden Corp	Bank of America Merrill Lynch	434
(1,200)	Nihon Kohden Corp	Morgan Stanley	561
1,000	Nihon M&A Center Holdings Inc	Morgan Stanley	(163)
(100)	Nintendo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(93)
(1,500)	Nintendo Co Ltd	Goldman Sachs	(1,207)
(3,700)	Nintendo Co Ltd	Morgan Stanley	1,061
(12)	Nippon Building Fund Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	-
(6)	Nippon Building Fund Inc (REIT)	Goldman Sachs	-
(800)	Nippon Carbon Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	29
(1,100)	Nippon Carbon Co Ltd	Goldman Sachs	39
600	Nippon Ceramic Co Ltd	Goldman Sachs	(43)
100	Nippon Densetsu Kogyo Co Ltd	Goldman Sachs	82
(1,600)	Nippon Electric Glass Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	229
(3,200)	Nippon Electric Glass Co Ltd	Morgan Stanley	597
2	NIPPON Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	65
3	NIPPON Investment Corp (REIT)	Goldman Sachs	97
100	Nippon Kanzai Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	32
(8,200)	Nippon Kayaku Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4,116)
(2,700)	Nippon Kayaku Co Ltd	Morgan Stanley	(716)
(1,300)	Nippon Paint Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(322)
(1,000)	Nippon Paint Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(110)
(900)	Nippon Paint Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(348)
2,100	Nippon Paper Industries Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	181
600	Nippon Paper Industries Co Ltd	Goldman Sachs	52
(200)	Nippon Road Co Ltd	Goldman Sachs	(129)
(1,700)	Nippon Sanso Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(366)
(500)	Nippon Sanso Holdings Corp	Goldman Sachs	(108)
(600)	Nippon Sanso Holdings Corp	Morgan Stanley	138
(500)	Nippon Shokubai Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(538)
(300)	Nippon Shokubai Co Ltd	Goldman Sachs	(323)
(100)	Nippon Signal Company Ltd	Goldman Sachs	(32)
200	Nippon Soda Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	215
(600)	Nippon Steel Corp	Bank of America Merrill Lynch	88
(3,700)	Nippon Steel Corp	Goldman Sachs	451
(2,600)	Nippon Steel Corp	Morgan Stanley	1,417
(100)	Nippon Steel Trading Corp	Bank of America Merrill Lynch	29
1,700	Nippon Telegraph & Telephone Corp	Bank of America Merrill Lynch	631
6,100	Nippon Telegraph & Telephone Corp	Goldman Sachs	1,247
7,400	Nippon Telegraph & Telephone Corp	Morgan Stanley	(3,997)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
2,800	Nippon Television Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(337)
500	Nippon Television Holdings Inc	Goldman Sachs	(70)
9,600	Nippon Television Holdings Inc	Morgan Stanley	(413)
3,700	Nipro Corp	Bank of America Merrill Lynch	133
3,100	Nipro Corp	Goldman Sachs	111
500	Nishimatsu Construction Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	726
700	Nishimatsu Construction Co Ltd	Goldman Sachs	581
700	Nishimatsuya Chain Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	98
100	Nishimatsuya Chain Co Ltd	Goldman Sachs	15
600	Nishi-Nippon Financial Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	105
300	Nishi-Nippon Financial Holdings Inc	Goldman Sachs	28
(2,200)	Nishi-Nippon Railroad Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,357)
(100)	Nishio Rent All Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(149)
(400)	Nissan Chemical Corp	Goldman Sachs	(315)
2,200	Nissan Shatai Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	63
300	Nissan Shatai Co Ltd	Goldman Sachs	9
(1,000)	Nissha Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(545)
(1,000)	Nissha Co Ltd	Goldman Sachs	(545)
(4,100)	Nisshin Seifun Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(683)
(2,000)	Nisshin Seifun Group Inc	Morgan Stanley	639
300	Nissin Electric Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(65)
100	Nissin Electric Co Ltd	Goldman Sachs	(22)
(300)	Nissin Foods Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(839)
(100)	Nissin Foods Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(280)
(100)	Nitori Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	227
100	Nitto Denko Corp	Goldman Sachs	43
500	Nitto Denko Corp	Morgan Stanley	(143)
(400)	Noevir Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(172)
(500)	Noevir Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(359)
(400)	NOF Corp	Bank of America Merrill Lynch	(655)
(300)	NOF Corp	Goldman Sachs	(710)
(700)	NOF Corp	Morgan Stanley	(81)
200	Nohmi Bosai Ltd	Bank of America Merrill Lynch	42
200	Nohmi Bosai Ltd	Goldman Sachs	42
(700)	Nojima Corp	Goldman Sachs	(592)
700	Nomura Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	70
2,700	Nomura Co Ltd	Goldman Sachs	271
(2,800)	Nomura Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(36)
(18,900)	Nomura Holdings Inc	Goldman Sachs	(241)
1,200	Nomura Real Estate Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	719
500	Nomura Real Estate Holdings Inc	Goldman Sachs	255
300	Nomura Real Estate Holdings Inc	Morgan Stanley	97
8	Nomura Real Estate Master Fund Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	183
39	Nomura Real Estate Master Fund Inc (REIT)	Goldman Sachs	790
5	Nomura Real Estate Master Fund Inc (REIT)	Morgan Stanley	111

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
1,500	Nomura Research Institute Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4,543)
1,700	Nomura Research Institute Ltd	Goldman Sachs	(4,238)
1,100	Nomura Research Institute Ltd	Morgan Stanley	(2,753)
100	Noritake Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	68
(300)	Noritz Corp	Bank of America Merrill Lynch	22
(500)	Noritz Corp	Goldman Sachs	36
(400)	NS United Kaiun Kaisha Ltd	Goldman Sachs	(14)
200	NSD Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	14
500	NSD Co Ltd	Goldman Sachs	36
11,300	NSK Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(541)
9,000	NSK Ltd	Goldman Sachs	(354)
7,900	NSK Ltd	Morgan Stanley	(806)
2,700	NTN Corp	Bank of America Merrill Lynch	58
1,500	NTN Corp	Goldman Sachs	32
(1)	NTT UD Investment Corp (REIT)	Goldman Sachs	(39)
1,000	Obara Group Inc	Goldman Sachs	(143)
12,200	Obayashi Corp	Bank of America Merrill Lynch	4,253
9,800	Obayashi Corp	Goldman Sachs	3,026
27,500	Obayashi Corp	Morgan Stanley	(667)
500	OBIC Business Consultants Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	917
800	OBIC Business Consultants Co Ltd	Goldman Sachs	2,312
900	OBIC Business Consultants Co Ltd	Morgan Stanley	1,753
700	Odakyu Electric Railway Co Ltd	Goldman Sachs	342
2,500	Odakyu Electric Railway Co Ltd	Morgan Stanley	574
(200)	Ogaki Kyoritsu Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(171)
(1,100)	Ogaki Kyoritsu Bank Ltd	Goldman Sachs	(943)
100	Oiles Corp	Bank of America Merrill Lynch	15
1,000	Oiles Corp	Goldman Sachs	186
(300)	Oisix ra daichi Inc	Bank of America Merrill Lynch	155
(1,600)	Oisix ra daichi Inc	Goldman Sachs	826
600	Okamura Corp	Goldman Sachs	65
(1,100)	Okasan Securities Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(166)
(1,400)	Okasan Securities Group Inc	Goldman Sachs	(211)
6,900	Oki Electric Industry Co Ltd	Goldman Sachs	(346)
200	Okinawa Cellular Telephone Co	Bank of America Merrill Lynch	32
400	Okinawa Cellular Telephone Co	Goldman Sachs	63
800	Okinawa Electric Power Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	258
1,100	Okinawa Electric Power Co Inc	Goldman Sachs	355
(1,100)	Okinawa Financial Group Inc	Goldman Sachs	(820)
(100)	OKUMA Corp	Bank of America Merrill Lynch	(143)
(1,100)	OKUMA Corp	Goldman Sachs	(1,577)
(700)	OKUMA Corp	Morgan Stanley	(50)
100	Okumura Corp	Bank of America Merrill Lynch	87
200	Okumura Corp	Goldman Sachs	162
800	Omron Corp	Morgan Stanley	(396)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(4)	One Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(310)
(5)	One Inc (REIT)	Goldman Sachs	(387)
(200)	Open Door Inc	Bank of America Merrill Lynch	(295)
(1,400)	Open Door Inc	Goldman Sachs	(2,005)
(100)	Open House Group Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	416
(700)	Open House Group Co Ltd	Goldman Sachs	2,911
(600)	Open House Group Co Ltd	Morgan Stanley	344
(400)	Optorun Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	92
(200)	Optorun Co Ltd	Goldman Sachs	46
100	Oracle Corp Japan	Bank of America Merrill Lynch	(208)
100	Oracle Corp Japan	Goldman Sachs	(208)
200	Oracle Corp Japan	Morgan Stanley	(703)
(800)	Organo Corp	Goldman Sachs	31
(3,570)	Orient Corp	Morgan Stanley	(77)
500	Osaka Organic Chemical Industry Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(82)
900	Osaka Organic Chemical Industry Ltd	Goldman Sachs	(148)
(1,200)	OSG Corp	Bank of America Merrill Lynch	177
(1,200)	OSG Corp	Goldman Sachs	129
1,700	Otsuka Corp	Bank of America Merrill Lynch	366
1,500	Otsuka Corp	Goldman Sachs	323
1,400	Otsuka Corp	Morgan Stanley	(1,154)
400	Otsuka Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	424
300	Otsuka Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	318
100	Otsuka Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(27)
(1,700)	Outsourcing Inc	Goldman Sachs	327
(200)	Pacific Metals Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(83)
(500)	Pacific Metals Co Ltd	Goldman Sachs	(443)
(500)	PAL GROUP Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(778)
(400)	PAL GROUP Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(622)
300	PALTAC Corp	Bank of America Merrill Lynch	65
400	PALTAC Corp	Goldman Sachs	86
200	PALTAC Corp	Morgan Stanley	(194)
(100)	Paramount Bed Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(72)
(200)	Park24 Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	7
(500)	Park24 Co Ltd	Morgan Stanley	7
3,100	Penta-Ocean Construction Co Ltd	Morgan Stanley	(245)
(200)	PeptiDream Inc	Bank of America Merrill Lynch	271
(200)	PeptiDream Inc	Goldman Sachs	171
(400)	Persol Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(984)
(1,400)	Persol Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(506)
(400)	Pharma Foods International Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	109
(1,800)	Pharma Foods International Co Ltd	Goldman Sachs	490
100	PHC Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(27)
900	Pigeon Corp	Bank of America Merrill Lynch	400
1,500	Pigeon Corp	Goldman Sachs	667

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
3,300	Pigeon Corp	Morgan Stanley	(355)
(300)	Pilot Corp	Bank of America Merrill Lynch	(355)
(600)	Pilot Corp	Goldman Sachs	(710)
(400)	PKSHA Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	161
(700)	PKSHA Technology Inc	Goldman Sachs	281
(100)	Plus Alpha Consulting Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(72)
2,200	Pola Orbis Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	161
3,500	Pola Orbis Holdings Inc	Goldman Sachs	974
6,300	Pola Orbis Holdings Inc	Morgan Stanley	(138)
100	Pressance Corp	Goldman Sachs	32
200	Prestige International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(16)
10,100	Prestige International Inc	Goldman Sachs	(797)
(500)	Raksul Inc	Bank of America Merrill Lynch	108
(1,000)	Raksul Inc	Goldman Sachs	215
(1,000)	Rakus Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,599
(1,800)	Rakus Co Ltd	Goldman Sachs	3,584
(1,700)	Rakus Co Ltd	Morgan Stanley	1,557
1,900	Rakuten Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(858)
3,300	Rakuten Group Inc	Goldman Sachs	(1,491)
9,400	Rakuten Group Inc	Morgan Stanley	741
800	Relia Inc	Bank of America Merrill Lynch	87
2,000	Relia Inc	Goldman Sachs	243
(1,100)	Relo Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(196)
(200)	Relo Group Inc	Goldman Sachs	83
(500)	Relo Group Inc	Morgan Stanley	72
(6,100)	Rengo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,050
(7,100)	Rengo Co Ltd	Goldman Sachs	1,230
(3,400)	Rengo Co Ltd	Morgan Stanley	658
(300)	RENOVA Inc	Bank of America Merrill Lynch	247
(700)	RENOVA Inc	Morgan Stanley	(291)
(800)	Resona Holdings Inc	Morgan Stanley	(26)
(100)	Retail Partners Co Ltd	Goldman Sachs	(11)
9,100	Ricoh Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,029
3,500	Ricoh Co Ltd	Goldman Sachs	708
9,200	Ricoh Co Ltd	Morgan Stanley	1,295
100	Ricoh Leasing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	50
200	Ricoh Leasing Co Ltd	Goldman Sachs	100
(200)	Riken Keiki Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(495)
(800)	Riken Keiki Co Ltd	Goldman Sachs	(1,979)
(700)	Riso Kagaku Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,079)
4,500	Riso Kyoiku Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(17)
2,100	Riso Kyoiku Co Ltd	Goldman Sachs	(9)
500	Rohm Co Ltd	Morgan Stanley	359
(900)	Rohto Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3,162)
(600)	Rohto Pharmaceutical Co Ltd	Goldman Sachs	(2,108)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(800)	Rohto Pharmaceutical Co Ltd	Morgan Stanley	(201)
(200)	Roland Corp	Bank of America Merrill Lynch	(244)
(100)	Roland Corp	Goldman Sachs	(122)
(400)	Rorze Corp	Goldman Sachs	516
200	Royal Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	185
(300)	RS Technologies Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,302
(200)	RS Technologies Co Ltd	Goldman Sachs	1,534
(100)	Ryosan Co Ltd	Goldman Sachs	44
(1,700)	Saibu Gas Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(463)
600	Saizeriya Co Ltd	Goldman Sachs	(159)
600	Sakai Moving Service Co Ltd	Goldman Sachs	(452)
(200)	Sakata INX Corp	Bank of America Merrill Lynch	(82)
(100)	Sakata INX Corp	Goldman Sachs	(41)
100	Sakata Seed Corp	Goldman Sachs	57
200	SAMTY Co Ltd	Goldman Sachs	(46)
(100)	San-Ai Obbli Co Ltd	Goldman Sachs	(72)
(200)	SanBio Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	110
(1,100)	SanBio Co Ltd	Goldman Sachs	607
300	Sanken Electric Co Ltd	Goldman Sachs	194
(400)	Sanki Engineering Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(287)
(1,100)	Sanki Engineering Co Ltd	Goldman Sachs	(789)
(800)	Sankyo Co Ltd	Goldman Sachs	(4,790)
300	Sanrio Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	774
100	Sanrio Co Ltd	Goldman Sachs	258
100	Sanrio Co Ltd	Morgan Stanley	172
(200)	Sansan Inc	Bank of America Merrill Lynch	115
(1,300)	Sansan Inc	Goldman Sachs	746
2,100	Santen Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	557
4,100	Santen Pharmaceutical Co Ltd	Goldman Sachs	1,260
3,900	Santen Pharmaceutical Co Ltd	Morgan Stanley	(783)
(200)	Sanwa Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(76)
(2,200)	Sanwa Holdings Corp	Goldman Sachs	(836)
(2,800)	Sanwa Holdings Corp	Morgan Stanley	40
(200)	Sanyo Denki Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	72
(300)	Sanyo Denki Co Ltd	Goldman Sachs	108
(100)	Sanyo Special Steel Co Ltd	Goldman Sachs	19
900	Sato Holdings Corp	Goldman Sachs	465
700	Sawai Group Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	997
700	Sawai Group Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	1,042
400	Sawai Group Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(86)
(300)	SBS Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(105)
(100)	SBS Holdings Inc	Goldman Sachs	(35)
100	SCREEN Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(132)
400	SCREEN Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	373
700	SCSK Corp	Bank of America Merrill Lynch	371

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
600	SCSK Corp	Goldman Sachs	318
1,000	SCSK Corp	Morgan Stanley	409
100	Secom Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	323
200	Secom Co Ltd	Goldman Sachs	645
200	Secom Co Ltd	Morgan Stanley	66
1,100	Sega Sammy Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	599
3,800	Sega Sammy Holdings Inc	Goldman Sachs	2,071
2,400	Sega Sammy Holdings Inc	Morgan Stanley	(688)
(100)	Seiko Group Corp	Bank of America Merrill Lynch	(148)
(200)	Seiko Group Corp	Goldman Sachs	(297)
500	Seino Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	108
2,000	Seino Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	430
2,400	Seino Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(34)
400	Seiren Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	462
400	Seiren Co Ltd	Goldman Sachs	462
700	Sekisui Jushi Corp	Bank of America Merrill Lynch	512
(900)	Senko Group Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(174)
300	Septeni Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	9
500	Septeni Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	14
900	Seria Co Ltd	Goldman Sachs	(1,310)
(500)	Seven & i Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	405
(400)	SG Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(117)
(1,100)	SG Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(414)
100	Shibaura Machine Co Ltd	Goldman Sachs	53
(400)	Shibuya Corp	Bank of America Merrill Lynch	(37)
(400)	Shibuya Corp	Goldman Sachs	(37)
(100)	SHIFT Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,463)
(210)	SHIFT Inc	Goldman Sachs	(3,072)
(300)	SHIFT Inc	Morgan Stanley	(3,076)
(700)	Shiga Bank Ltd	Goldman Sachs	(652)
100	Shikoku Chemicals Corp	Bank of America Merrill Lynch	26
(300)	Shima Seiki Manufacturing Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(226)
(600)	Shimano Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,460
(500)	Shimano Inc	Goldman Sachs	2,026
(300)	Shimano Inc	Morgan Stanley	(161)
7,100	Shimizu Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,425
9,700	Shimizu Corp	Goldman Sachs	1,947
8,300	Shimizu Corp	Morgan Stanley	(298)
(100)	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	132
(200)	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	Goldman Sachs	192
(500)	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	Morgan Stanley	(229)
(2,300)	Shinko Electric Industries Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4,037
(1,600)	Shinko Electric Industries Co Ltd	Goldman Sachs	3,216
(2,500)	Shinko Electric Industries Co Ltd	Morgan Stanley	2,225
100	Shinmaywa Industries Ltd	Goldman Sachs	6

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(7,900)	Shinsei Bank Ltd	Goldman Sachs	(10,819)
(100)	Shionogi & Co Ltd	Goldman Sachs	92
(600)	Shionogi & Co Ltd	Morgan Stanley	559
(100)	Ship Healthcare Holdings Inc	Morgan Stanley	19
1,500	Shiseido Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,053)
2,100	Shiseido Co Ltd	Goldman Sachs	(1,436)
600	Shiseido Co Ltd	Morgan Stanley	39
(2,700)	Shizuoka Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,800)
400	Shizuoka Gas Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	387
200	Shizuoka Gas Co Ltd	Goldman Sachs	194
(200)	SHO-BOND Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	-
(1,100)	SHO-BOND Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(2,062)
(400)	SHO-BOND Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	430
(200)	Shochiku Co Ltd	Goldman Sachs	(344)
(400)	Shochiku Co Ltd	Morgan Stanley	373
900	Shoei Co Ltd	Goldman Sachs	(323)
(200)	Shoei Foods Corp	Bank of America Merrill Lynch	(108)
(3,800)	Showa Denko KK	Bank of America Merrill Lynch	1,352
(4,400)	Showa Denko KK	Goldman Sachs	1,956
(4,000)	Showa Denko KK	Morgan Stanley	143
(100)	Showa Sangyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(14)
(200)	Showa Sangyo Co Ltd	Goldman Sachs	(27)
(100)	Siix Corp	Bank of America Merrill Lynch	(52)
(1,100)	Simplex Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(398)
(1,000)	Simplex Holdings Inc	Goldman Sachs	(245)
2,100	Skylark Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	261
600	Skylark Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(4)
300	Skylark Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(69)
1,000	SoftBank Group Corp	Bank of America Merrill Lynch	(649)
300	SoftBank Group Corp	Goldman Sachs	35
2,500	Sohgo Security Services Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,154
1,000	Sohgo Security Services Co Ltd	Goldman Sachs	296
2,700	Sohgo Security Services Co Ltd	Morgan Stanley	(1,924)
200	Sompo Holdings Inc	Morgan Stanley	386
(200)	Sony Group Corp	Goldman Sachs	480
(500)	Sony Group Corp	Morgan Stanley	681
400	Sosei Group Corp	Bank of America Merrill Lynch	(433)
(10)	SOSiLA Logistics Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	165
(13)	SOSiLA Logistics Inc (REIT)	Goldman Sachs	214
(100)	Square Enix Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	317
(100)	Square Enix Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	158
(400)	SRE Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(473)
(1,100)	Stanley Electric Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,152)
(1,900)	Stanley Electric Co Ltd	Morgan Stanley	1,444
(100)	Star Micronics Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(72)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(1,000)	Star Micronics Co Ltd	Goldman Sachs	(724)
100	Starts Corp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(22)
1,300	Strike Co Ltd	Goldman Sachs	1,864
300	Subaru Corp	Bank of America Merrill Lynch	75
200	Subaru Corp	Goldman Sachs	51
200	Subaru Corp	Morgan Stanley	(16)
900	Sugi Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(708)
500	Sugi Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	(645)
(1,200)	SUMCO Corp	Bank of America Merrill Lynch	654
(3,400)	SUMCO Corp	Goldman Sachs	1,853
(500)	Sumitomo Bakelite Co Ltd	Morgan Stanley	(197)
3,800	Sumitomo Corp	Morgan Stanley	-
800	Sumitomo Electric Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(104)
1,300	Sumitomo Electric Industries Ltd	Goldman Sachs	14
400	Sumitomo Forestry Co Ltd	Goldman Sachs	109
1,500	Sumitomo Forestry Co Ltd	Morgan Stanley	226
700	Sumitomo Heavy Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	448
1,100	Sumitomo Heavy Industries Ltd	Goldman Sachs	842
1,400	Sumitomo Heavy Industries Ltd	Morgan Stanley	(20)
(800)	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	Morgan Stanley	(866)
3,100	Sumitomo Mitsui Construction Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	378
8,600	Sumitomo Mitsui Construction Co Ltd	Goldman Sachs	1,048
400	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	674
100	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	Goldman Sachs	168
400	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	Morgan Stanley	175
700	Sumitomo Realty & Development Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	457
400	Sumitomo Realty & Development Co Ltd	Goldman Sachs	172
2,500	Sumitomo Realty & Development Co Ltd	Morgan Stanley	663
(100)	Sumitomo Riko Co Ltd	Goldman Sachs	(3)
(1,200)	Sumitomo Rubber Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(542)
(1,100)	Sumitomo Rubber Industries Ltd	Goldman Sachs	(497)
(400)	Sumitomo Rubber Industries Ltd	Morgan Stanley	(37)
100	Sumitomo Warehouse Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1
200	Sumitomo Warehouse Co Ltd	Goldman Sachs	1
900	Sun Frontier Fudousan Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	497
800	Sun Frontier Fudousan Co Ltd	Goldman Sachs	442
600	Sundrug Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	66
2,300	Sundrug Co Ltd	Goldman Sachs	1,633
1,900	Sundrug Co Ltd	Morgan Stanley	(1,362)
900	Suntory Beverage & Food Ltd	Morgan Stanley	(226)
1,300	Suzuki Motor Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,120)
300	Suzuki Motor Corp	Goldman Sachs	(221)
500	Suzuki Motor Corp	Morgan Stanley	(495)
200	Systemex Corp	Bank of America Merrill Lynch	(934)
200	Systemex Corp	Goldman Sachs	(934)

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	Sysmex Corp	Morgan Stanley	(120)
1,600	Systema Corp	Bank of America Merrill Lynch	(125)
4,400	Systema Corp	Goldman Sachs	(315)
(1,400)	T Hasegawa Co Ltd	Goldman Sachs	(1,385)
900	Tadano Ltd	Bank of America Merrill Lynch	374
600	Tadano Ltd	Goldman Sachs	250
(100)	Taihei Dengyo Kaisha Ltd	Goldman Sachs	(39)
(300)	Taiheiyo Cement Corp	Bank of America Merrill Lynch	(37)
(1,500)	Taiheiyo Cement Corp	Goldman Sachs	(808)
(2,500)	Taiheiyo Cement Corp	Morgan Stanley	(365)
200	Taikisha Ltd	Goldman Sachs	229
300	Taisei Corp	Bank of America Merrill Lynch	657
2,500	Taisei Corp	Goldman Sachs	5,826
1,100	Taisho Pharmaceutical Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,874
900	Taisho Pharmaceutical Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	2,080
200	Taisho Pharmaceutical Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	29
(1,300)	Taiyo Yuden Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,237
(1,700)	Taiyo Yuden Co Ltd	Goldman Sachs	2,433
(500)	Taiyo Yuden Co Ltd	Morgan Stanley	177
300	Takamatsu Construction Group Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	77
700	Takara Bio Inc	Bank of America Merrill Lynch	(547)
500	Takara Bio Inc	Goldman Sachs	(391)
(4,500)	Takara Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(472)
(1,800)	Takara Holdings Inc	Goldman Sachs	(246)
(4,000)	Takara Holdings Inc	Morgan Stanley	118
100	Takara Standard Co Ltd	Goldman Sachs	47
(200)	Takasago International Corp	Bank of America Merrill Lynch	(32)
(2,400)	Takashimaya Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,641)
(1,800)	Takashimaya Co Ltd	Goldman Sachs	(1,936)
(1,500)	Takashimaya Co Ltd	Morgan Stanley	(742)
1,300	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	Goldman Sachs	1,967
2,100	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	Morgan Stanley	572
(200)	Takeuchi Manufacturing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(244)
(400)	Takeuchi Manufacturing Co Ltd	Goldman Sachs	(488)
1,500	Takuma Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	226
3,000	Takuma Co Ltd	Goldman Sachs	378
100	Tama Home Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	58
100	Tama Home Co Ltd	Goldman Sachs	58
100	Tamron Co Ltd	Goldman Sachs	208
1,400	TBS Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	753
700	TBS Holdings Inc	Goldman Sachs	376
200	TBS Holdings Inc	Morgan Stanley	47
200	TechMatrix Corp	Bank of America Merrill Lynch	14
(1,800)	TechnoPro Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	452
(1,700)	TechnoPro Holdings Inc	Goldman Sachs	427

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(900)	TechnoPro Holdings Inc	Morgan Stanley	549
100	Teijin Ltd	Goldman Sachs	60
2,500	Teijin Ltd	Morgan Stanley	394
(1,000)	Tenma Corp	Goldman Sachs	186
(200)	T-Gaia Corp	Goldman Sachs	(20)
(300)	TIS Inc	Bank of America Merrill Lynch	297
(200)	TIS Inc	Goldman Sachs	216
(400)	TKP Corp	Bank of America Merrill Lynch	(81)
(400)	Toagosei Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(103)
(400)	Toagosei Co Ltd	Goldman Sachs	(103)
1,400	Tobu Railway Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,656
900	Tobu Railway Co Ltd	Goldman Sachs	1,065
1,100	Tobu Railway Co Ltd	Morgan Stanley	355
(100)	TOC Co Ltd	Goldman Sachs	(3)
200	Tocalo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	32
300	Tocalo Co Ltd	Goldman Sachs	47
500	Toda Corp	Bank of America Merrill Lynch	219
700	Toda Corp	Morgan Stanley	80
(500)	Toei Co Ltd	Goldman Sachs	(5,055)
(8,800)	Toho Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(381)
(9,200)	Toho Bank Ltd	Goldman Sachs	(407)
(500)	Toho Gas Co Ltd	Goldman Sachs	(197)
(600)	Toho Gas Co Ltd	Morgan Stanley	232
900	Tohoku Electric Power Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	265
600	Tohoku Electric Power Co Inc	Goldman Sachs	176
1,300	Tohoku Electric Power Co Inc	Morgan Stanley	65
(4,700)	Tokai Carbon Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,232
(2,600)	Tokai Carbon Co Ltd	Goldman Sachs	838
(10,800)	Tokai Carbon Co Ltd	Morgan Stanley	909
300	Tokai Corp	Bank of America Merrill Lynch	26
800	Tokai Corp	Goldman Sachs	69
(400)	TOKAI Holdings Corp	Goldman Sachs	(9)
300	Tokai Rika Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(22)
400	Tokai Rika Co Ltd	Goldman Sachs	(29)
(3,700)	Tokai Tokyo Financial Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(135)
(2,500)	Tokai Tokyo Financial Holdings Inc	Goldman Sachs	(90)
100	Token Corp	Bank of America Merrill Lynch	79
300	Token Corp	Goldman Sachs	237
(1,200)	Tokio Marine Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,270)
(500)	Tokio Marine Holdings Inc	Goldman Sachs	(383)
(1,200)	Tokio Marine Holdings Inc	Morgan Stanley	90
(200)	Tokushu Tokai Paper Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	123
(300)	Tokushu Tokai Paper Co Ltd	Goldman Sachs	185
(800)	Tokuyama Corp	Bank of America Merrill Lynch	(560)
(700)	Tokuyama Corp	Goldman Sachs	(506)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(23,300)	Tokyo Electric Power Co Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,778)
(9,700)	Tokyo Electric Power Co Holdings Inc	Goldman Sachs	(3,199)
(54,400)	Tokyo Electric Power Co Holdings Inc	Morgan Stanley	(7,429)
(2,400)	Tokyo Gas Co Ltd	Morgan Stanley	568
(100)	Tokyo Seimitsu Co Ltd	Goldman Sachs	75
(500)	Tokyo Steel Manufacturing Co Ltd	Goldman Sachs	(222)
1,000	Tokyo Tatemono Co Ltd	Goldman Sachs	280
200	Tokyo Tatemono Co Ltd	Morgan Stanley	(37)
100	Tokyotokeiba Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	39
300	Tokyotokeiba Co Ltd	Goldman Sachs	118
2,500	Tokyu Construction Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	448
4,200	Tokyu Construction Co Ltd	Goldman Sachs	745
2	Tokyu Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	169
(2,000)	TOMONY Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(387)
(9,700)	TOMONY Holdings Inc	Goldman Sachs	(1,878)
(2,000)	Tomy Co Ltd	Goldman Sachs	(1,018)
300	Topcon Corp	Bank of America Merrill Lynch	82
500	Topcon Corp	Goldman Sachs	136
(1,100)	TOPPAN Inc	Bank of America Merrill Lynch	(670)
(500)	Topre Corp	Bank of America Merrill Lynch	(222)
(700)	Topre Corp	Goldman Sachs	(311)
100	Toridoll Holdings Corp	Goldman Sachs	9
(100)	Torii Pharmaceutical Co Ltd	Goldman Sachs	-
100	Tosei Corp	Bank of America Merrill Lynch	1
1,900	Tosei Corp	Goldman Sachs	(33)
(600)	Toshiba TEC Corp	Bank of America Merrill Lynch	538
(500)	Toshiba TEC Corp	Goldman Sachs	448
200	Tosho Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	60
1,000	Tosho Co Ltd	Goldman Sachs	301
400	Totetsu Kogyo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	502
900	Totetsu Kogyo Co Ltd	Goldman Sachs	1,129
600	Towa Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	95
400	Towa Pharmaceutical Co Ltd	Goldman Sachs	63
400	Toyo Construction Co Ltd	Goldman Sachs	34
900	Toyo Ink SC Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	84
(4,800)	Toyo Seikan Group Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,406)
(300)	Toyo Seikan Group Holdings Ltd	Goldman Sachs	(41)
(700)	Toyo Seikan Group Holdings Ltd	Morgan Stanley	5
(400)	Toyo Suisan Kaisha Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(760)
(2,100)	Toyo Suisan Kaisha Ltd	Goldman Sachs	(4,298)
(300)	Toyo Suisan Kaisha Ltd	Morgan Stanley	129
(700)	Toyo Tanso Co Ltd	Goldman Sachs	(803)
500	Toyobo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	22
1,000	Toyobo Co Ltd	Goldman Sachs	43
300	Toyota Industries Corp	Goldman Sachs	172

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	Toyota Industries Corp	Morgan Stanley	7
600	Trend Micro Inc	Goldman Sachs	(774)
800	Tri Chemical Laboratories Inc	Bank of America Merrill Lynch	(235)
700	Tri Chemical Laboratories Inc	Goldman Sachs	(206)
2,900	Trusco Nakayama Corp	Goldman Sachs	1,227
700	TS Tech Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(327)
1,000	TS Tech Co Ltd	Goldman Sachs	(390)
800	TS Tech Co Ltd	Morgan Stanley	(511)
(100)	Tsugami Corp	Bank of America Merrill Lynch	(34)
400	Tsumura & Co	Bank of America Merrill Lynch	244
200	Tsumura & Co	Goldman Sachs	122
500	Tsumura & Co	Morgan Stanley	(165)
1,300	Tsuruha Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,129)
2,500	Tsuruha Holdings Inc	Goldman Sachs	(4,824)
2,800	Tsuruha Holdings Inc	Morgan Stanley	(14,545)
600	TV Asahi Holdings Corp	Goldman Sachs	232
(800)	UBE Corp	Morgan Stanley	98
900	Ulvac Inc	Goldman Sachs	(516)
200	Ulvac Inc	Morgan Stanley	(158)
(2,200)	Unicharm Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,187)
(400)	Unicharm Corp	Goldman Sachs	(217)
(500)	Unicharm Corp	Morgan Stanley	269
600	United Arrows Ltd	Bank of America Merrill Lynch	309
1,100	United Arrows Ltd	Goldman Sachs	737
(200)	Universal Entertainment Corp	Goldman Sachs	(192)
(100)	Ushio Inc	Goldman Sachs	(18)
(1,200)	Ushio Inc	Morgan Stanley	(9)
800	USS Co Ltd	Morgan Stanley	522
400	UT Group Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(254)
800	UT Group Co Ltd	Goldman Sachs	(556)
1,700	Valor Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(305)
1,100	Valor Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(197)
600	ValueCommerce Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(555)
500	ValueCommerce Co Ltd	Goldman Sachs	(462)
300	Vector Inc	Bank of America Merrill Lynch	258
300	Vector Inc	Goldman Sachs	258
(100)	Visional Inc	Bank of America Merrill Lynch	(208)
(300)	Visional Inc	Goldman Sachs	(521)
(200)	Visional Inc	Morgan Stanley	(760)
1,200	VT Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	177
1,100	VT Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	160
400	Wacoal Holdings Corp	Goldman Sachs	(80)
1,500	Wakita & Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	215
1,000	Wakita & Co Ltd	Goldman Sachs	143
100	Weathernews Inc	Bank of America Merrill Lynch	(158)

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	Weathernews Inc	Goldman Sachs	(158)
(200)	Welcia Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	72
(100)	Welcia Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	36
(100)	Welcia Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	115
(400)	West Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	761
400	Workman Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(860)
700	Workman Co Ltd	Goldman Sachs	(1,506)
600	Yakult Honsha Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4,302
500	Yakult Honsha Co Ltd	Goldman Sachs	3,585
13,500	Yamada Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	387
3,300	Yamaguchi Financial Group Inc	Morgan Stanley	663
(100)	Yamaha Corp	Bank of America Merrill Lynch	(33)
(200)	Yamaha Corp	Goldman Sachs	(56)
(100)	Yamaha Corp	Morgan Stanley	(93)
(200)	Yamaha Motor Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(60)
(100)	Yamaha Motor Co Ltd	Morgan Stanley	(29)
(1,200)	Yamato Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	336
(200)	Yamato Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	56
(2,400)	Yamato Holdings Co Ltd	Morgan Stanley	396
1,000	Yamazaki Baking Co Ltd	Goldman Sachs	(173)
1,400	Yamazaki Baking Co Ltd	Morgan Stanley	(157)
800	Yamazen Corp	Bank of America Merrill Lynch	14
400	Yamazen Corp	Goldman Sachs	17
500	Yaoko Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	143
500	Yaoko Co Ltd	Goldman Sachs	143
600	Yaoko Co Ltd	Morgan Stanley	(645)
900	Yaskawa Electric Corp	Bank of America Merrill Lynch	(611)
600	Yaskawa Electric Corp	Morgan Stanley	63
100	Yellow Hat Ltd	Bank of America Merrill Lynch	22
2,200	Yellow Hat Ltd	Goldman Sachs	473
300	Yokogawa Bridge Holdings Corp	Goldman Sachs	127
(2,900)	Yokogawa Electric Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,788)
(2,300)	Yokogawa Electric Corp	Goldman Sachs	(1,418)
(900)	Yokohama Rubber Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(962)
(2,200)	Yokohama Rubber Co Ltd	Goldman Sachs	(2,350)
(600)	Yokohama Rubber Co Ltd	Morgan Stanley	(417)
(1,100)	Yokowo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	599
(1,200)	Yokowo Co Ltd	Goldman Sachs	654
(100)	Yonex Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(55)
(400)	Yonex Co Ltd	Goldman Sachs	(221)
(400)	Yoshinoya Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(6)
500	Yuasa Trading Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	72
400	Yuasa Trading Co Ltd	Goldman Sachs	57
2,700	Yurtec Corp	Goldman Sachs	368
19,200	Z Holdings Corp	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)
	日本(続き)		
14,600	Z Holdings Corp	Goldman Sachs	(11)
14,000	Z Holdings Corp	Morgan Stanley	1,285
100	Zenkoku Hoshu Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	50
200	Zenkoku Hoshu Co Ltd	Goldman Sachs	100
700	Zenkoku Hoshu Co Ltd	Morgan Stanley	(50)
800	Zenrin Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	43
300	Zenrin Co Ltd	Goldman Sachs	22
(500)	Zeon Corp	Bank of America Merrill Lynch	197
(2,000)	Zeon Corp	Morgan Stanley	631
(100)	Zojirushi Corp	Bank of America Merrill Lynch	(26)
(500)	Zojirushi Corp	Goldman Sachs	(129)
200	ZOZO Inc	Bank of America Merrill Lynch	219
700	ZOZO Inc	Goldman Sachs	903
700	ZOZO Inc	Morgan Stanley	1,556
1,600	Zuken Inc	Goldman Sachs	1,893
			16,907
	オランダ		
(194)	Akzo Nobel NV	Bank of America Merrill Lynch	419
(749)	Akzo Nobel NV	Goldman Sachs	1,618
(818)	Akzo Nobel NV	Morgan Stanley	866
(30)	Alfen Beheer BV	Bank of America Merrill Lynch	(33)
(187)	Alfen Beheer BV	Goldman Sachs	75
(221)	Alfen Beheer BV	Morgan Stanley	(463)
(3,287)	Allfunds Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	1,634
(2,228)	Allfunds Group Plc	Goldman Sachs	1,197
(2,152)	Allfunds Group Plc	Morgan Stanley	(153)
211	AMG Advanced Metallurgical Group NV	Bank of America Merrill Lynch	303
299	AMG Advanced Metallurgical Group NV	Goldman Sachs	424
178	ArcelorMittal SA	Goldman Sachs	59
281	ArcelorMittal SA	Morgan Stanley	95
(84)	ASM International NV	Bank of America Merrill Lynch	131
(23)	ASM International NV	Goldman Sachs	36
(257)	ASM International NV	Morgan Stanley	(2,508)
428	ASR Nederland NV	Goldman Sachs	333
396	ASR Nederland NV	Morgan Stanley	(386)
(138)	B&S Group Sarl	Goldman Sachs	(21)
41	Basic-Fit NV	Bank of America Merrill Lynch	(52)
110	Basic-Fit NV	Goldman Sachs	(139)
(498)	BE Semiconductor Industries NV	Bank of America Merrill Lynch	1,613
(832)	BE Semiconductor Industries NV	Goldman Sachs	2,695
(247)	BE Semiconductor Industries NV	Morgan Stanley	246
79	Corbion NV	Goldman Sachs	23
622	EXOR NV	Goldman Sachs	733
30	EXOR NV	Morgan Stanley	109
(355)	Flow Traders	Bank of America Merrill Lynch	457

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)		
(648)	Flow Traders	Goldman Sachs	697
(407)	Galapagos NV	Bank of America Merrill Lynch	1,154
(442)	Galapagos NV	Goldman Sachs	1,253
(34)	Galapagos NV	Morgan Stanley	28
38	IMCD NV	Goldman Sachs	59
28	IMCD NV	Morgan Stanley	19
(1,807)	ING Groep NV	Morgan Stanley	(131)
(6,590)	InPost SA	Bank of America Merrill Lynch	547
(196)	InPost SA	Morgan Stanley	9
82	JDE Peet ' s NV	Bank of America Merrill Lynch	92
193	JDE Peet ' s NV	Goldman Sachs	216
106	JDE Peet ' s NV	Morgan Stanley	44
(4,785)	Just Eat Takeaway.com NV	Bank of America Merrill Lynch	2,276
(2,780)	Just Eat Takeaway.com NV	Goldman Sachs	1,724
(2,902)	Just Eat Takeaway.com NV	Morgan Stanley	(2,979)
(624)	Koninklijke Ahold Delhaize NV	Bank of America Merrill Lynch	(141)
(94)	Koninklijke Ahold Delhaize NV	Goldman Sachs	(4)
(635)	Koninklijke Ahold Delhaize NV	Morgan Stanley	43
1,333	Koninklijke DSM NV	Bank of America Merrill Lynch	(6,216)
1,053	Koninklijke DSM NV	Morgan Stanley	(4,264)
9,987	Koninklijke KPN NV	Bank of America Merrill Lynch	1,089
20,748	Koninklijke KPN NV	Goldman Sachs	1,458
8,571	Koninklijke KPN NV	Morgan Stanley	159
5,105	Koninklijke Philips NV	Bank of America Merrill Lynch	292
1,912	Koninklijke Philips NV	Goldman Sachs	(476)
531	Koninklijke Philips NV	Morgan Stanley	274
772	Koninklijke Vopak NV	Bank of America Merrill Lynch	1,803
41	Koninklijke Vopak NV	Goldman Sachs	96
(357)	NSI NV (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	519
(85)	NSI NV (REIT)	Goldman Sachs	124
1,983	Pharming Group NV	Bank of America Merrill Lynch	141
5,674	Pharming Group NV	Goldman Sachs	440
(2,227)	PostNL NV	Bank of America Merrill Lynch	329
(211)	Prosus NV	Bank of America Merrill Lynch	(814)
(541)	Prosus NV	Goldman Sachs	(2,445)
(421)	Prosus NV	Morgan Stanley	(2,789)
276	Randstad NV	Morgan Stanley	(453)
(2,452)	SBM Offshore NV	Bank of America Merrill Lynch	(1,461)
(1,073)	SBM Offshore NV	Goldman Sachs	(663)
(1,593)	SBM Offshore NV	Morgan Stanley	(289)
2,267	Signify NV	Bank of America Merrill Lynch	2,653
571	Signify NV	Goldman Sachs	374
1,275	Signify NV	Morgan Stanley	1,321
(115)	Sligro Food Group NV	Bank of America Merrill Lynch	(117)
(78)	Sligro Food Group NV	Goldman Sachs	(79)

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)			
(241)	TKH Group NV	Goldman Sachs	651
1,933	TomTom NV	Bank of America Merrill Lynch	(1,235)
1,192	TomTom NV	Goldman Sachs	(786)
(310)	Unibail-Rodamco-Westfield (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	1,258
(494)	Unibail-Rodamco-Westfield (REIT)	Goldman Sachs	2,005
(931)	Unibail-Rodamco-Westfield (REIT)	Morgan Stanley	754
(569)	Van Lanschot Kempen NV	Bank of America Merrill Lynch	(89)
319	Wereldhave NV (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(225)
499	Wereldhave NV (REIT)	Goldman Sachs	(352)
61	Wolters Kluwer NV	Bank of America Merrill Lynch	178
303	Wolters Kluwer NV	Goldman Sachs	1,494
247	Wolters Kluwer NV	Morgan Stanley	636
			9,512
ニュージーランド			
1,538	a2 Milk Co Ltd	Goldman Sachs	172
10,970	Contact Energy Ltd	Morgan Stanley	1,025
(4,123)	EBOS Group Ltd	Morgan Stanley	1,783
(10,811)	Fletcher Building Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,077
(4,325)	Fletcher Building Ltd	Goldman Sachs	431
(2,414)	Fletcher Building Ltd	Morgan Stanley	256
6,760	Infratil Ltd	Goldman Sachs	1,853
6,516	Infratil Ltd	Morgan Stanley	203
(144)	Mainfreight Ltd	Goldman Sachs	(130)
(309)	Mainfreight Ltd	Morgan Stanley	(96)
(2,991)	Mercury NZ Ltd	Morgan Stanley	-
(12,110)	Meridian Energy Ltd	Morgan Stanley	(1,773)
(15,781)	Pushpay Holdings Ltd	Goldman Sachs	(1)
(1,262)	Spark New Zealand Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(67)
(7,034)	Spark New Zealand Ltd	Goldman Sachs	(160)
(7,726)	Spark New Zealand Ltd	Morgan Stanley	332
(2,973)	Synlait Milk Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(148)
			4,757
ノルウェー			
(1,176)	Adevinta ASA	Bank of America Merrill Lynch	152
(759)	Adevinta ASA	Morgan Stanley	1
(808)	Aker Carbon Capture ASA	Bank of America Merrill Lynch	129
(2,126)	Aker Carbon Capture ASA	Goldman Sachs	340
(550)	Aker Solutions ASA	Bank of America Merrill Lynch	41
(2,301)	Aker Solutions ASA	Goldman Sachs	172
975	AutoStore Holdings Ltd	Goldman Sachs	27
(42)	Bonheur ASA	Bank of America Merrill Lynch	(9)
(116)	Bonheur ASA	Goldman Sachs	(24)
325	Borregaard ASA	Goldman Sachs	309
(1,508)	BW Energy Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(70)
(594)	BW Energy Ltd	Goldman Sachs	(28)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	ノルウェー(続き)		
272	BW LPG Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(36)
290	BW LPG Ltd	Goldman Sachs	(57)
(584)	Crayon Group Holding ASA	Bank of America Merrill Lynch	298
(1,205)	Crayon Group Holding ASA	Goldman Sachs	595
6,939	DNO ASA	Bank of America Merrill Lynch	(555)
6,000	DNO ASA	Goldman Sachs	(480)
1,756	Elkem ASA	Goldman Sachs	203
2,496	Equinor ASA	Bank of America Merrill Lynch	5,809
499	Equinor ASA	Goldman Sachs	1,161
8,608	Equinor ASA	Morgan Stanley	21,122
(536)	Europris ASA	Bank of America Merrill Lynch	(214)
(2,598)	Europris ASA	Goldman Sachs	(910)
376	Frontline Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(213)
757	Frontline Ltd	Goldman Sachs	(290)
324	Golden Ocean Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(432)
523	Golden Ocean Group Ltd	Goldman Sachs	(698)
796	Golden Ocean Group Ltd	Morgan Stanley	(322)
847	Hafnia Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(34)
2,538	Hafnia Ltd	Goldman Sachs	(103)
(395)	Hexagon Composites ASA	Bank of America Merrill Lynch	(40)
(1,260)	Hexagon Composites ASA	Goldman Sachs	(128)
(3,817)	Hexagon Purus ASA	Bank of America Merrill Lynch	(301)
(544)	Hexagon Purus ASA	Goldman Sachs	(43)
(1,076)	Kahoot! ASA	Bank of America Merrill Lynch	245
(4,079)	Kahoot! ASA	Goldman Sachs	929
2,017	Kongsberg Gruppen ASA	Bank of America Merrill Lynch	3,706
790	Kongsberg Gruppen ASA	Goldman Sachs	1,791
1,561	Kongsberg Gruppen ASA	Morgan Stanley	1,243
(337)	LINK Mobility Group Holding ASA	Goldman Sachs	38
7,147	NEL ASA	Bank of America Merrill Lynch	369
13,303	NEL ASA	Goldman Sachs	905
19,981	NEL ASA	Morgan Stanley	1,100
1,183	Norwegian Air Shuttle ASA	Bank of America Merrill Lynch	(9)
754	Norwegian Air Shuttle ASA	Goldman Sachs	37
311	Odfjell Drilling Ltd	Goldman Sachs	(31)
(2,823)	Orkla ASA	Bank of America Merrill Lynch	(641)
(456)	Orkla ASA	Morgan Stanley	(64)
112	Protector Forsikring ASA	Bank of America Merrill Lynch	(18)
112	Protector Forsikring ASA	Goldman Sachs	(13)
(2,451)	REC Silicon ASA	Goldman Sachs	692
1,109	Scatec ASA	Bank of America Merrill Lynch	(533)
1,701	Scatec ASA	Goldman Sachs	(918)
(2,558)	Schibsted ASA 'A'	Bank of America Merrill Lynch	725
(513)	Schibsted ASA 'A'	Morgan Stanley	(426)
1,203	Selvaag Bolig ASA	Goldman Sachs	(170)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
ノルウェー(続き)			
(6,725)	Storebrand ASA	Bank of America Merrill Lynch	(694)
(2,957)	Storebrand ASA	Morgan Stanley	126
1,242	Telenor ASA	Morgan Stanley	(440)
704	TOMRA Systems ASA	Bank of America Merrill Lynch	487
1,060	TOMRA Systems ASA	Goldman Sachs	181
878	TOMRA Systems ASA	Morgan Stanley	156
2,716	Var Energi ASA	Bank of America Merrill Lynch	390
11,586	Var Energi ASA	Goldman Sachs	1,469
20,895	Var Energi ASA	Morgan Stanley	2,393
(235)	Yara International ASA	Bank of America Merrill Lynch	347
(71)	Yara International ASA	Morgan Stanley	74
			38,818
ポルトガル			
916	Altri SGPS SA	Bank of America Merrill Lynch	(52)
359	Altri SGPS SA	Goldman Sachs	(21)
(407,938)	Banco Comercial Portugues SA 'R'	Goldman Sachs	691
(499,723)	Banco Comercial Portugues SA 'R'	Morgan Stanley	222
(30)	Corticeira Amorim SGPS SA	Bank of America Merrill Lynch	(7)
(6,606)	CTT-Correios de Portugal SA	Bank of America Merrill Lynch	1,337
(5,222)	CTT-Correios de Portugal SA	Goldman Sachs	1,057
36,214	EDP - Energias de Portugal SA	Morgan Stanley	1,504
966	EDP Renovaveis SA	Goldman Sachs	(120)
1,161	EDP Renovaveis SA	Morgan Stanley	(314)
(330)	Galp Energia SGPS SA	Bank of America Merrill Lynch	(86)
(744)	Galp Energia SGPS SA	Goldman Sachs	(286)
(8,444)	Galp Energia SGPS SA	Morgan Stanley	(3,901)
(1,613)	Greenvolt-Energias Renovaveis SA	Bank of America Merrill Lynch	273
(2,162)	Jeronimo Martins SGPS SA	Morgan Stanley	(314)
(1,820)	NOS SGPS SA	Bank of America Merrill Lynch	77
(756)	NOS SGPS SA	Goldman Sachs	25
7,854	REN - Redes Energeticas Nacionais SGPS SA	Bank of America Merrill Lynch	(163)
11,937	REN - Redes Energeticas Nacionais SGPS SA	Goldman Sachs	(248)
			(326)
シンガポール			
(3,200)	AEM Holdings Ltd	Goldman Sachs	(258)
3,700	AIMS APAC (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(162)
3,200	AIMS APAC (REIT)	Goldman Sachs	(140)
3,800	Bumitama Agri Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(83)
10,800	Bumitama Agri Ltd	Goldman Sachs	(237)
3,200	CapitaLand Ascendas (REIT)	Goldman Sachs	70
29,900	CapitaLand Ascendas (REIT)	Morgan Stanley	1,750
(14,100)	CapitaLand Ascott Trust (Unit)	Goldman Sachs	206
(7,000)	CapitaLand China Trust (REIT)	Goldman Sachs	(307)
16,400	Capitaland India Trust (Unit)	Bank of America Merrill Lynch	(360)
18,400	Capitaland India Trust (Unit)	Goldman Sachs	(404)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	シンガポール(続き)		
(9,800)	Capitaland Investment Ltd	Goldman Sachs	(359)
600	City Developments Ltd	Bank of America Merrill Lynch	66
1,500	City Developments Ltd	Morgan Stanley	187
5,400	ComfortDelGro Corp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(277)
2,900	ComfortDelGro Corp Ltd	Goldman Sachs	(149)
10,800	ComfortDelGro Corp Ltd	Morgan Stanley	(158)
(800)	DBS Group Holdings Ltd	Goldman Sachs	(127)
8,100	DFI Retail Group Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	486
5,100	DFI Retail Group Holdings Ltd	Goldman Sachs	306
7,600	DFI Retail Group Holdings Ltd	Morgan Stanley	532
2,800	ESR-LOGOS (REIT)	Goldman Sachs	(10)
17,300	Far East Hospitality Trust (Unit)	Bank of America Merrill Lynch	380
10,100	Far East Hospitality Trust (Unit)	Goldman Sachs	222
3,500	First Resources Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(77)
10,400	First Resources Ltd	Goldman Sachs	(228)
4,500	Frasers Centrepoint Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	66
(15,700)	Genting Singapore Ltd	Goldman Sachs	(345)
(4,800)	Genting Singapore Ltd	Morgan Stanley	(35)
(167,300)	Golden Agri-Resources Ltd	Morgan Stanley	(1,224)
600	Hongkong Land Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(5)
900	Hongkong Land Holdings Ltd	Goldman Sachs	57
1,600	Hongkong Land Holdings Ltd	Morgan Stanley	47
600	Hour Glass Ltd	Bank of America Merrill Lynch	22
2,900	Hour Glass Ltd	Goldman Sachs	106
92,700	Hutchison Port Holdings Trust (Unit)	Bank of America Merrill Lynch	1,020
65,300	Hutchison Port Holdings Trust (Unit)	Goldman Sachs	718
(73,200)	Japfa Ltd	Goldman Sachs	(268)
8,800	Keppel (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	56
7,000	Keppel (REIT)	Goldman Sachs	150
21,700	Mapletree Pan Asia Commercial Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(318)
11,900	Mapletree Pan Asia Commercial Trust (REIT)	Goldman Sachs	(174)
(228)	Maxeon Solar Technologies Ltd	Goldman Sachs	60
19,900	NETLINK NBN TRUST (Unit)	Bank of America Merrill Lynch	73
27,700	NETLINK NBN TRUST (Unit)	Goldman Sachs	101
22,800	NETLINK NBN TRUST (Unit)	Morgan Stanley	(83)
(34,300)	Olam Group Ltd	Morgan Stanley	-
(22,300)	OUE Commercial (REIT)	Goldman Sachs	(490)
(6,100)	OUE Ltd	Goldman Sachs	45
(300)	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(6)
600	Sasseur (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	4
15,400	Sasseur (REIT)	Goldman Sachs	113
10,100	SATS Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(217)
13,200	SATS Ltd	Goldman Sachs	(403)
11,100	SATS Ltd	Morgan Stanley	(166)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	シンガポール(続き)		
6,600	Sembcorp Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	385
9,700	Sembcorp Industries Ltd	Goldman Sachs	798
3,500	Sembcorp Industries Ltd	Morgan Stanley	(3)
4,600	Sheng Siong Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	135
900	Sheng Siong Group Ltd	Goldman Sachs	26
4,800	SIA Engineering Co Ltd	Morgan Stanley	-
24,100	Singapore Post Ltd	Goldman Sachs	(265)
165,400	Singapore Post Ltd	Morgan Stanley	(1,210)
10,400	StarHub Ltd	Bank of America Merrill Lynch	152
2,900	StarHub Ltd	Goldman Sachs	42
2,000	Suntec (REIT)	Goldman Sachs	-
4,200	Suntec (REIT)	Morgan Stanley	(31)
(1,400)	United Overseas Bank Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,175)
(3,300)	United Overseas Bank Ltd	Goldman Sachs	(2,919)
(5,800)	United Overseas Bank Ltd	Morgan Stanley	(4,550)
(3,200)	UOL Group Ltd	Goldman Sachs	211
(3,000)	UOL Group Ltd	Morgan Stanley	(373)
(900)	Venture Corp Ltd	Goldman Sachs	257
(18,700)	Yangzijiang Financial Holding Ltd	Goldman Sachs	274
(27,800)	Yanlord Land Group Ltd	Goldman Sachs	509
			(7,964)
	スペイン		
(3,049)	Acerinox SA	Bank of America Merrill Lynch	798
(1,089)	Acerinox SA	Goldman Sachs	285
(3,069)	Acerinox SA	Morgan Stanley	408
331	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	Goldman Sachs	112
373	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	Morgan Stanley	(16)
(56)	Aena SME SA	Bank of America Merrill Lynch	51
(38)	Aena SME SA	Morgan Stanley	(66)
63	Almirall SA	Bank of America Merrill Lynch	9
530	Almirall SA	Goldman Sachs	74
(1,169)	Amadeus IT Group SA	Bank of America Merrill Lynch	1,638
(808)	Amadeus IT Group SA	Goldman Sachs	1,048
(1,337)	Amadeus IT Group SA	Morgan Stanley	444
893	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Bank of America Merrill Lynch	169
4,628	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Goldman Sachs	875
2,058	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Morgan Stanley	158
23,435	Banco de Sabadell SA	Bank of America Merrill Lynch	1,202
16,398	Banco de Sabadell SA	Morgan Stanley	245
(6,416)	Banco Santander SA	Bank of America Merrill Lynch	(296)
(6,077)	Banco Santander SA	Goldman Sachs	(812)
(8,317)	Banco Santander SA	Morgan Stanley	(424)
2,503	Bankinter SA	Bank of America Merrill Lynch	1,601
3,979	Bankinter SA	Goldman Sachs	2,385

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)		
2,266	Bankinter SA	Morgan Stanley	(64)
(1,797)	CaixaBank SA	Bank of America Merrill Lynch	(593)
(490)	Cellnex Telecom SA	Bank of America Merrill Lynch	1,068
(586)	Cellnex Telecom SA	Goldman Sachs	1,278
(1,137)	Cellnex Telecom SA	Morgan Stanley	201
969	Cia de Distribucion Integral Logista Holdings SA	Bank of America Merrill Lynch	865
1,139	Cia de Distribucion Integral Logista Holdings SA	Goldman Sachs	1,017
(154)	Construcciones y Auxiliar de Ferrocarriles SA	Goldman Sachs	(120)
(138)	Corp Financiera Alba SA	Bank of America Merrill Lynch	(150)
(67)	Corp Financiera Alba SA	Goldman Sachs	(73)
(310)	Ebro Foods SA	Goldman Sachs	(77)
(3,553)	Endesa SA	Bank of America Merrill Lynch	2,558
(1,571)	Endesa SA	Goldman Sachs	1,221
(982)	Endesa SA	Morgan Stanley	1,519
88	Ferrovial SA	Morgan Stanley	(26)
525	Fluidra SA	Bank of America Merrill Lynch	(3)
196	Fluidra SA	Goldman Sachs	(87)
(1,442)	Global Dominion Access SA	Bank of America Merrill Lynch	(60)
(35)	Greenergy Renovables SA	Goldman Sachs	11
(849)	Grifols SA	Bank of America Merrill Lynch	119
(1,512)	Grifols SA	Goldman Sachs	212
(537)	Grifols SA	Morgan Stanley	(6)
(13)	Grupo Catalana Occidente SA	Bank of America Merrill Lynch	(20)
2,241	Iberdrola SA	Bank of America Merrill Lynch	(123)
1,225	Iberdrola SA	Goldman Sachs	219
11,042	Iberdrola SA	Morgan Stanley	(151)
519	Indra Sistemas SA	Goldman Sachs	156
(2,174)	Industria de Diseno Textil SA	Goldman Sachs	(1,399)
(636)	Linea Directa Aseguradora SA Cia de Seguros y Reaseguros	Goldman Sachs	(16)
16,893	Mapfre SA	Bank of America Merrill Lynch	(228)
59,267	Mapfre SA	Goldman Sachs	(922)
42,739	Mapfre SA	Morgan Stanley	(2,307)
1,388	Merlin Properties Socimi SA (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(440)
3,976	Merlin Properties Socimi SA (REIT)	Goldman Sachs	(1,259)
3,330	Merlin Properties Socimi SA (REIT)	Morgan Stanley	(1,003)
(469)	Naturgy Energy Group SA	Bank of America Merrill Lynch	129
(672)	Naturgy Energy Group SA	Goldman Sachs	258
(268)	Naturgy Energy Group SA	Morgan Stanley	161
1,092	Repsol SA	Bank of America Merrill Lynch	1,125
5,964	Repsol SA	Goldman Sachs	5,467
6,494	Repsol SA	Morgan Stanley	3,169
1,100	Solaria Energia y Medio Ambiente SA	Bank of America Merrill Lynch	(685)
1,120	Solaria Energia y Medio Ambiente SA	Goldman Sachs	(698)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
スペイン(続き)			
1,230	Solaria Energia y Medio Ambiente SA	Morgan Stanley	428
(2,668)	Soltec Power Holdings SA	Bank of America Merrill Lynch	188
(375)	Talgo SA	Bank of America Merrill Lynch	(18)
(479)	Talgo SA	Goldman Sachs	(22)
6,293	Unicaja Banco SA	Bank of America Merrill Lynch	203
7,409	Unicaja Banco SA	Goldman Sachs	238
(9)	Viscofan SA	Bank of America Merrill Lynch	(24)
			21,124
スウェーデン			
(1,436)	AcadeMedia AB	Bank of America Merrill Lynch	(19)
(3,448)	AcadeMedia AB	Goldman Sachs	73
106	AddTech AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	27
1,480	AddTech AB 'B'	Goldman Sachs	379
631	AFRY AB	Goldman Sachs	276
(779)	Assa Abloy AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	116
(624)	Assa Abloy AB 'B'	Morgan Stanley	107
(615)	Atlas Copco AB 'A'	Bank of America Merrill Lynch	76
3,266	Atlas Copco AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	43
2,028	Atlas Copco AB 'B'	Morgan Stanley	(112)
(244)	Attendo AB	Bank of America Merrill Lynch	26
(98)	Attendo AB	Goldman Sachs	10
(27)	Beijer Alma AB	Bank of America Merrill Lynch	(2)
(1,185)	Beijer Ref AB	Bank of America Merrill Lynch	(682)
(2,137)	Beijer Ref AB	Morgan Stanley	(467)
(4,283)	BHG Group AB	Bank of America Merrill Lynch	1,001
(7,785)	BHG Group AB	Goldman Sachs	1,918
(114)	Bilia AB 'A'	Bank of America Merrill Lynch	66
(223)	Bilia AB 'A'	Goldman Sachs	56
(3,346)	Billerud AB	Bank of America Merrill Lynch	385
(4,040)	Billerud AB	Morgan Stanley	(192)
(347)	BioArctic AB	Goldman Sachs	(284)
73	BioGaia AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(5)
105	BioGaia AB 'B'	Goldman Sachs	5
100	Biotage AB	Bank of America Merrill Lynch	15
2,160	Biotage AB	Goldman Sachs	328
(1,768)	Boliden AB	Bank of America Merrill Lynch	(1,683)
(693)	Boliden AB	Morgan Stanley	(823)
(1,387)	Bonava AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	291
(2,062)	Bonava AB 'B'	Goldman Sachs	800
(2,418)	Boozt AB	Bank of America Merrill Lynch	987
(248)	Bravida Holding AB	Bank of America Merrill Lynch	26
(100)	Bravida Holding AB	Goldman Sachs	10
(766)	Calliditas Therapeutics AB 'B'	Goldman Sachs	(855)
(619)	Castellum AB	Bank of America Merrill Lynch	623
19	Cellavision AB	Goldman Sachs	5

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	スウェーデン(続き)		
(1,073)	Cint Group AB	Bank of America Merrill Lynch	728
(507)	Cint Group AB	Goldman Sachs	334
(745)	Cint Group AB	Morgan Stanley	120
(191)	Clas Ohlson AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(5)
(2,447)	Clas Ohlson AB 'B'	Goldman Sachs	(70)
(286)	Coor Service Management Holding AB	Bank of America Merrill Lynch	(22)
(755)	Coor Service Management Holding AB	Goldman Sachs	(57)
3,067	Corem Property Group AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(75)
6,247	Corem Property Group AB 'B'	Goldman Sachs	(185)
(445)	Dios Fastigheter AB	Bank of America Merrill Lynch	182
(198)	Dios Fastigheter AB	Goldman Sachs	81
(2)	Duni AB	Bank of America Merrill Lynch	(1)
(908)	Duni AB	Goldman Sachs	(526)
(114)	Dustin Group AB	Bank of America Merrill Lynch	45
(1,273)	Dustin Group AB	Goldman Sachs	499
(1,459)	Electrolux Professional AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(241)
(348)	Electrolux Professional AB 'B'	Goldman Sachs	(57)
1,865	Elekta AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	223
1,309	Elekta AB 'B'	Goldman Sachs	192
(9,626)	Embracer Group AB	Bank of America Merrill Lynch	13,331
11,818	Embracer Group AB	Goldman Sachs	(16,366)
(6,646)	Embracer Group AB	Morgan Stanley	(2,401)
2,138	Epiroc AB 'B'	Morgan Stanley	1,594
(836)	EQT AB	Morgan Stanley	405
(311)	Essity AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(343)
(586)	Essity AB 'B'	Morgan Stanley	(33)
(359)	Evolution AB	Bank of America Merrill Lynch	(1,841)
(633)	Evolution AB	Morgan Stanley	(3,366)
(17,545)	Fastighets AB Balder 'B'	Bank of America Merrill Lynch	4,431
(7,327)	Fastighets AB Balder 'B'	Goldman Sachs	(184)
(4,969)	Fastighets AB Balder 'B'	Morgan Stanley	(83)
1,107	Fortnox AB	Bank of America Merrill Lynch	(537)
477	Fortnox AB	Goldman Sachs	(231)
(336)	Granges AB	Bank of America Merrill Lynch	59
(1,367)	Granges AB	Goldman Sachs	240
(71)	Hemnet Group AB	Bank of America Merrill Lynch	24
(116)	Hemnet Group AB	Goldman Sachs	48
(823)	Hexatronic Group AB	Bank of America Merrill Lynch	(103)
(2,221)	Hexatronic Group AB	Morgan Stanley	(559)
(139)	Hexpol AB	Bank of America Merrill Lynch	(34)
(1,253)	Hexpol AB	Goldman Sachs	(315)
103	HMS Networks AB	Bank of America Merrill Lynch	(209)
201	HMS Networks AB	Goldman Sachs	(408)
726	Holmen AB 'B'	Morgan Stanley	352
(1,229)	Hufvudstaden AB 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(515)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	スウェーデン(続き)		
(1,411)	Hufvudstaden AB 'A'	Goldman Sachs	(500)
(693)	Implantica AG SDR 'A'	Goldman Sachs	411
2,685	Industrivarden AB 'C'	Bank of America Merrill Lynch	(404)
3,808	Industrivarden AB 'C'	Goldman Sachs	(637)
2,363	Industrivarden AB 'C'	Morgan Stanley	561
(691)	Instalco AB	Bank of America Merrill Lynch	81
(650)	Instalco AB	Goldman Sachs	84
221	Intrum AB	Bank of America Merrill Lynch	(401)
407	Intrum AB	Goldman Sachs	(899)
29	Inwido AB	Bank of America Merrill Lynch	11
34	Inwido AB	Goldman Sachs	2
(104)	JM AB	Bank of America Merrill Lynch	122
(173)	JM AB	Goldman Sachs	204
207	Kambi Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	217
277	Kambi Group Plc	Goldman Sachs	157
(378)	Kindred Group Plc SDR	Goldman Sachs	(126)
(34)	KNOW IT AB	Bank of America Merrill Lynch	(1)
(14)	KNOW IT AB	Goldman Sachs	8
(81)	MEKO AB	Bank of America Merrill Lynch	18
420	Millicom International Cellular SA SDR	Goldman Sachs	(36)
129	MIPS AB	Bank of America Merrill Lynch	(218)
257	MIPS AB	Goldman Sachs	(434)
(476)	Munters Group AB	Bank of America Merrill Lynch	(61)
(483)	Munters Group AB	Goldman Sachs	(57)
(49)	New Wave Group AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(113)
(534)	New Wave Group AB 'B'	Goldman Sachs	(1,171)
(1,561)	Nibe Industrier AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(591)
(3,491)	Nibe Industrier AB 'B'	Morgan Stanley	398
683	Nolato AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	134
730	Nolato AB 'B'	Goldman Sachs	142
(9,286)	Nordea Bank Abp	Bank of America Merrill Lynch	(1,877)
(3,557)	Nordea Bank Abp	Morgan Stanley	(618)
(144)	Nordnet AB publ	Bank of America Merrill Lynch	190
(25)	Nordnet AB publ	Goldman Sachs	33
(32)	Note AB	Goldman Sachs	19
1,147	Nyfosa AB	Bank of America Merrill Lynch	65
771	Nyfosa AB	Goldman Sachs	44
815	OX2 AB	Bank of America Merrill Lynch	(395)
504	OX2 AB	Goldman Sachs	(244)
(419)	Peab AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	81
(245)	Peab AB 'B'	Goldman Sachs	40
(366)	PowerCell Sweden AB	Goldman Sachs	(21)
146	Ratos AB 'B'	Goldman Sachs	(12)
(166)	Re:NewCell AB	Bank of America Merrill Lynch	(15)
(1,044)	Re:NewCell AB	Goldman Sachs	(10)

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)		
(880)	Resurs Holding AB	Bank of America Merrill Lynch	(8)
(582)	Resurs Holding AB	Goldman Sachs	(6)
(978)	Rvrc Holding AB	Bank of America Merrill Lynch	(378)
(447)	Rvrc Holding AB	Goldman Sachs	(189)
899	Saab AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	1,740
766	Saab AB 'B'	Goldman Sachs	2,017
504	Saab AB 'B'	Morgan Stanley	297
(144)	Sagax AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	45
(771)	Sagax AB 'B'	Morgan Stanley	(51)
(2,205)	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 'D'	Bank of America Merrill Lynch	(174)
(2,583)	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 'D'	Goldman Sachs	(204)
(485)	Sandvik AB	Bank of America Merrill Lynch	53
(3,480)	Sandvik AB	Morgan Stanley	479
743	Scandic Hotels Group AB	Bank of America Merrill Lynch	98
5,418	Scandic Hotels Group AB	Goldman Sachs	370
21	Sdiptech AB 'B'	Goldman Sachs	(15)
611	Sectra AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	174
95	Sectra AB 'B'	Goldman Sachs	27
(4,487)	Securitas AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	1,681
(1,669)	Securitas AB 'B'	Morgan Stanley	526
(33)	Sedana Medical AB	Bank of America Merrill Lynch	6
(337)	Sedana Medical AB	Goldman Sachs	57
(4,242)	Sinch AB	Bank of America Merrill Lynch	544
(14,811)	Sinch AB	Goldman Sachs	5,942
(20,838)	Sinch AB	Morgan Stanley	(1,488)
(11,406)	Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,215)
(1,993)	Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A'	Morgan Stanley	(170)
(589)	Skanska AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	307
(1,205)	SSAB AB 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(240)
(403)	SSAB AB 'A'	Morgan Stanley	(11)
(1,174)	SSAB AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(234)
(1,866)	SSAB AB 'B'	Goldman Sachs	(372)
3,156	Storskogen Group AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(273)
(221)	Surgical Science Sweden AB	Goldman Sachs	(73)
(12,899)	Svenska Handelsbanken AB 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(338)
(2,250)	Svenska Handelsbanken AB 'A'	Morgan Stanley	(107)
(3,423)	Swedbank AB 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(929)
(1,715)	Swedbank AB 'A'	Morgan Stanley	(102)
(1,662)	Swedish Orphan Biovitrum AB	Morgan Stanley	(1,973)
742	Thule Group AB	Bank of America Merrill Lynch	99
93	Thule Group AB	Morgan Stanley	37
69	Troax Group AB	Bank of America Merrill Lynch	(5)
671	Troax Group AB	Goldman Sachs	(51)
(20)	Viaplay Group AB	Bank of America Merrill Lynch	(19)
(68)	Viaplay Group AB	Goldman Sachs	(65)

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)			
(10)	Vitec Software Group AB	Goldman Sachs	13
768	Volvo Car AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(295)
733	Volvo Car AB 'B'	Goldman Sachs	(281)
(1,513)	Wallenstam AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	305
(595)	Wallenstam AB 'B'	Goldman Sachs	120
(260)	Wihlborgs Fastigheter AB	Goldman Sachs	2
28	Xvivo Perfusion AB	Bank of America Merrill Lynch	(87)
			(3,587)
スイス			
(1,761)	Adecco Group AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	2,222
(1,962)	Adecco Group AG Reg	Goldman Sachs	3,516
(452)	Adecco Group AG Reg	Morgan Stanley	476
187	Alcon Inc	Morgan Stanley	118
(73)	ALSO Holding AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(154)
(74)	ALSO Holding AG Reg	Goldman Sachs	(156)
(2,790)	ams-OSRAM AG	Morgan Stanley	(446)
34,368	Aryzta AG	Goldman Sachs	3,043
(315)	Bachem Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	(912)
(160)	Bachem Holding AG	Goldman Sachs	(506)
(80)	Bachem Holding AG	Morgan Stanley	(206)
(172)	Baloise Holding AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(272)
(91)	Baloise Holding AG Reg	Goldman Sachs	(292)
(39)	Baloise Holding AG Reg	Morgan Stanley	(53)
118	Banque Cantonale Vaudoise Reg	Bank of America Merrill Lynch	385
24	Banque Cantonale Vaudoise Reg	Goldman Sachs	78
208	Banque Cantonale Vaudoise Reg	Morgan Stanley	44
310	Basilea Pharmaceutica AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(80)
220	Basilea Pharmaceutica AG Reg	Goldman Sachs	(42)
15	BKW AG	Bank of America Merrill Lynch	38
443	BKW AG	Goldman Sachs	1,119
(8)	Bossard Holding AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	29
(2)	Bossard Holding AG Reg	Goldman Sachs	11
(13)	Bucher Industries AG Reg	Goldman Sachs	60
7	Burckhardt Compression Holding AG	Goldman Sachs	147
43	Burkhalter Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	9
24	Burkhalter Holding AG	Goldman Sachs	5
(10)	Bystronic AG	Bank of America Merrill Lynch	(189)
(7)	Bystronic AG	Goldman Sachs	(133)
10	Cembra Money Bank AG	Bank of America Merrill Lynch	9
27	Cembra Money Bank AG	Goldman Sachs	26
1	Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	Bank of America Merrill Lynch	32
1	Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	Goldman Sachs	32
5	Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	Morgan Stanley	(263)
1	Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG Reg	Morgan Stanley	(421)
(3)	Comet Holding AG Reg	Goldman Sachs	(11)

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)		
(18)	COSMO Pharmaceuticals NV	Bank of America Merrill Lynch	(15)
(183)	COSMO Pharmaceuticals NV	Goldman Sachs	(154)
7,299	Credit Suisse Group AG (Right)	Bank of America Merrill Lynch	737
2,792	Credit Suisse Group AG (Right)	Goldman Sachs	282
15,451	Credit Suisse Group AG (Right)	Morgan Stanley	1,561
7,299	Credit Suisse Group AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(10,662)
4,360	Credit Suisse Group AG Reg	Goldman Sachs	(4,080)
17,639	Credit Suisse Group AG Reg	Morgan Stanley	(16,350)
(32)	Daetwyler Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	(1)
(46)	Daetwyler Holding AG	Goldman Sachs	35
305	DKSH Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	177
167	DKSH Holding AG	Morgan Stanley	(193)
(58)	dormakaba Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	528
(38)	dormakaba Holding AG	Goldman Sachs	330
1,543	Dufry AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(775)
431	Dufry AG Reg	Goldman Sachs	283
1,463	Dufry AG Reg	Morgan Stanley	1,463
(3)	EMS-Chemie Holding AG Reg	Morgan Stanley	47
(10)	Forbo Holding AG Reg	Goldman Sachs	2,042
(546)	Galenica AG	Bank of America Merrill Lynch	(1,779)
(363)	Galenica AG	Goldman Sachs	(489)
(1,067)	Galenica AG	Morgan Stanley	(1,706)
184	Geberit AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(5,332)
273	Geberit AG Reg	Goldman Sachs	(8,964)
130	Geberit AG Reg	Morgan Stanley	(1,382)
11	Givaudan SA Reg	Morgan Stanley	382
75	Gurit Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	(95)
107	Gurit Holding AG	Goldman Sachs	(135)
(51)	Huber + Suhner AG Reg	Goldman Sachs	86
232	Idorsia Ltd	Morgan Stanley	(32)
141	Implenia AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(89)
140	Implenia AG Reg	Goldman Sachs	(88)
11	Inficon Holding AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(961)
11	Inficon Holding AG Reg	Goldman Sachs	(961)
(1)	Interroll Holding AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	32
(3)	Interroll Holding AG Reg	Goldman Sachs	95
(1)	Intershop Holding AG	Goldman Sachs	(15)
(85)	Julius Baer Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	5
(559)	Julius Baer Group Ltd	Morgan Stanley	235
(8)	Kardex Holding AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	138
(21)	Kardex Holding AG Reg	Goldman Sachs	362
(8)	Komax Holding AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(76)
(18)	Komax Holding AG Reg	Goldman Sachs	(171)
(107)	Kuehne + Nagel International AG Reg	Goldman Sachs	495
1	LEM Holding SA Reg	Goldman Sachs	(169)

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)		
(347)	Logitech International SA Reg	Bank of America Merrill Lynch	171
(279)	Logitech International SA Reg	Goldman Sachs	192
(476)	Logitech International SA Reg	Morgan Stanley	(501)
(190)	Lonza Group AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	4,319
(55)	Lonza Group AG Reg	Goldman Sachs	1,250
(25)	Lonza Group AG Reg	Morgan Stanley	(76)
36	Medartis Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	152
47	Medartis Holding AG	Goldman Sachs	198
(13,245)	Meyer Burger Technology AG	Bank of America Merrill Lynch	(407)
(4,849)	Meyer Burger Technology AG	Goldman Sachs	(328)
(23)	Mobimo Holding AG Reg	Goldman Sachs	230
(212)	Montana Aerospace AG	Bank of America Merrill Lynch	(67)
(64)	Montana Aerospace AG	Goldman Sachs	(20)
(110)	Nestle SA Reg	Bank of America Merrill Lynch	(236)
(397)	Nestle SA Reg	Goldman Sachs	(1,698)
(12)	Partners Group Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	1,240
(327)	Peach Property Group AG	Bank of America Merrill Lynch	1,032
(655)	Peach Property Group AG	Goldman Sachs	2,068
(83)	PolyPeptide Group AG	Bank of America Merrill Lynch	73
19	Roche Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	8
(164)	Roche Holding AG	Goldman Sachs	200
34	Roche Holding AG	Goldman Sachs	14
(725)	Roche Holding AG	Morgan Stanley	(4,807)
64	Roche Holding AG	Morgan Stanley	876
(182)	Schindler Holding AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	1,571
(106)	Schindler Holding AG Reg	Goldman Sachs	915
(93)	Schindler Holding AG Reg	Morgan Stanley	(294)
(1)	Schweiter Technologies AG	Goldman Sachs	(19)
50	Sensirion Holding AG	Goldman Sachs	(379)
(99)	SFS Group AG	Bank of America Merrill Lynch	780
(103)	SFS Group AG	Goldman Sachs	835
(4)	Siegfried Holding AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	177
29	Sika AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(491)
45	Sika AG Reg	Goldman Sachs	(762)
349	Sika AG Reg	Morgan Stanley	(1,836)
(894)	Softwareone Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	(1,242)
(491)	Softwareone Holding AG	Goldman Sachs	(682)
(27)	St Galler Kantonalbank AG Reg	Goldman Sachs	(256)
163	Stadler Rail AG	Bank of America Merrill Lynch	(194)
39	Stadler Rail AG	Goldman Sachs	4
(75)	Straumann Holding AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	371
(312)	Straumann Holding AG Reg	Morgan Stanley	(328)
24	Sulzer AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	15
126	Sulzer AG Reg	Goldman Sachs	(146)
96	Swatch Group AG	Bank of America Merrill Lynch	778

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)		
63	Swatch Group AG	Goldman Sachs	214
107	Swatch Group AG	Morgan Stanley	765
(395)	Swatch Group AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	183
(494)	Swatch Group AG Reg	Goldman Sachs	229
(22)	Swiss Life Holding AG Reg	Goldman Sachs	33
(9)	Swiss Life Holding AG Reg	Morgan Stanley	(30)
(176)	Swiss Prime Site AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	824
(338)	Swiss Re AG	Bank of America Merrill Lynch	(1,448)
(514)	Swiss Re AG	Goldman Sachs	(2,190)
(1,434)	Swiss Re AG	Morgan Stanley	(5,976)
(181)	Swisscom AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(2,407)
(91)	Swisscom AG Reg	Morgan Stanley	(331)
60	Swissquote Group Holding SA Reg	Goldman Sachs	44
(42)	Tecan Group AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(495)
(53)	Tecan Group AG Reg	Goldman Sachs	(625)
(52)	Tecan Group AG Reg	Morgan Stanley	197
(9)	TX Group AG	Bank of America Merrill Lynch	17
(4)	TX Group AG	Goldman Sachs	8
84	u-blox Holding AG	Goldman Sachs	389
222	UBS Group AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(47)
764	UBS Group AG Reg	Goldman Sachs	(161)
477	UBS Group AG Reg	Morgan Stanley	(24)
(65)	Valiant Holding AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(137)
(38)	Valiant Holding AG Reg	Goldman Sachs	(80)
(7)	V-ZUG Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	12
168	Ypsomed Holding AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	4,682
116	Ypsomed Holding AG Reg	Goldman Sachs	3,167
(92)	Zehnder Group AG	Goldman Sachs	(19)
			<u>(38,602)</u>
	英国		
(2,406)	3i Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	28
(17,338)	abrdn Plc	Bank of America Merrill Lynch	974
(4,774)	abrdn Plc	Goldman Sachs	246
(2,128)	Admiral Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	722
(1,518)	Admiral Group Plc	Goldman Sachs	419
(1,572)	Admiral Group Plc	Morgan Stanley	714
305	Advanced Medical Solutions Group Plc	Goldman Sachs	(53)
110	AG Barr Plc	Bank of America Merrill Lynch	42
(13,426)	Airtel Africa Plc	Bank of America Merrill Lynch	(659)
(9,286)	Airtel Africa Plc	Goldman Sachs	(540)
(7,547)	Airtel Africa Plc	Morgan Stanley	(393)
176	AJ Bell Plc	Bank of America Merrill Lynch	31
106	AJ Bell Plc	Goldman Sachs	6
830	Alliance Pharma Plc	Bank of America Merrill Lynch	(112)
146	Anglo American Plc	Goldman Sachs	96

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	英国(続き)		
280	Anglo American Plc	Morgan Stanley	834
(6,807)	AO World Plc	Bank of America Merrill Lynch	(482)
(3,889)	AO World Plc	Goldman Sachs	(275)
(20,697)	Argo Blockchain Plc	Bank of America Merrill Lynch	394
(6,917)	Associated British Foods Plc	Bank of America Merrill Lynch	(3,321)
(1,149)	Associated British Foods Plc	Goldman Sachs	(552)
(2,650)	Associated British Foods Plc	Morgan Stanley	(2,417)
(1,286)	Assura Plc (REIT)	Goldman Sachs	14
(1,954)	Aston Martin Lagonda Global Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	(85)
(2,551)	Aston Martin Lagonda Global Holdings Plc	Goldman Sachs	(2)
(420)	Auction Technology Group Plc	Goldman Sachs	222
(1,893)	Avacta Group Plc	Goldman Sachs	297
(597)	B&M European Value Retail SA	Bank of America Merrill Lynch	(145)
(906)	B&M European Value Retail SA	Goldman Sachs	(220)
(980)	B&M European Value Retail SA	Morgan Stanley	(139)
1,831	Babcock International Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	108
4,742	Babcock International Group Plc	Goldman Sachs	249
10,644	Balanced Commercial Property Trust Ltd (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	121
11,035	Balanced Commercial Property Trust Ltd (REIT)	Goldman Sachs	126
(959)	Balfour Beatty Plc	Bank of America Merrill Lynch	(262)
(6,259)	Balfour Beatty Plc	Goldman Sachs	(1,556)
234	Bank of Georgia Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	427
591	Bank of Georgia Group Plc	Goldman Sachs	1,064
(13,807)	Barratt Developments Plc	Bank of America Merrill Lynch	895
(2,950)	Barratt Developments Plc	Goldman Sachs	191
11,260	Beazley Plc	Bank of America Merrill Lynch	2,854
9,329	Beazley Plc	Goldman Sachs	2,266
26,090	Beazley Plc	Morgan Stanley	(1,646)
(1,523)	Berkeley Group Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	(795)
(2,012)	Berkeley Group Holdings Plc	Goldman Sachs	(921)
(365)	Berkeley Group Holdings Plc	Morgan Stanley	(351)
(1,785)	Biffa Plc	Bank of America Merrill Lynch	(8)
(5,660)	Biffa Plc	Goldman Sachs	(13)
106	Big Yellow Group Plc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(95)
73	Big Yellow Group Plc (REIT)	Goldman Sachs	(66)
586	boohoo Group Plc	Goldman Sachs	13
(4,010)	Bridgepoint Group Plc Reg	Goldman Sachs	1,453
(1,450)	British American Tobacco Plc	Goldman Sachs	(2,749)
(1,752)	British American Tobacco Plc	Morgan Stanley	(925)
(3,547)	British Land Co Plc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	501
(850)	British Land Co Plc (REIT)	Goldman Sachs	112
(1,530)	British Land Co Plc (REIT)	Morgan Stanley	241
(499)	Britvic Plc	Goldman Sachs	(296)
9,753	BT Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(94)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	英国(続き)		
4,865	BT Group Plc	Goldman Sachs	(9)
33,212	BT Group Plc	Morgan Stanley	(1,136)
89	Burberry Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	153
783	Burberry Group Plc	Goldman Sachs	1,109
3,926	Burberry Group Plc	Morgan Stanley	3,635
(1,156)	Burford Capital Ltd	Goldman Sachs	(236)
1,559	Bytes Technology Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(273)
3,734	Bytes Technology Group Plc	Goldman Sachs	(654)
(5,294)	C&C Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(182)
(17,099)	C&C Group Plc	Goldman Sachs	(676)
3,895	Carnival Plc	Goldman Sachs	(3,620)
8,442	Carnival Plc	Morgan Stanley	208
1,283	Centamin Plc	Bank of America Merrill Lynch	71
19,352	Centamin Plc	Goldman Sachs	1,068
(620)	Central Asia Metals Plc	Bank of America Merrill Lynch	20
(300)	Central Asia Metals Plc	Goldman Sachs	10
50,489	Centrica Plc	Bank of America Merrill Lynch	4,073
68,009	Centrica Plc	Goldman Sachs	4,148
35,296	Centrica Plc	Morgan Stanley	(263)
686	Ceres Power Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	(102)
1,309	Ceres Power Holdings Plc	Goldman Sachs	(195)
2,150	Chemring Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	176
4,591	Chemring Group Plc	Goldman Sachs	425
(1,450)	Close Brothers Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	70
(387)	Close Brothers Group Plc	Goldman Sachs	19
2,483	CLS Holdings Plc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	95
4,107	CLS Holdings Plc (REIT)	Goldman Sachs	158
(4,329)	Coats Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	2
(1,274)	Coats Group Plc	Goldman Sachs	(12)
(1,496)	Coca-Cola HBC AG	Bank of America Merrill Lynch	189
(3,114)	Coca-Cola HBC AG	Goldman Sachs	191
(2,747)	Coca-Cola HBC AG	Morgan Stanley	330
5	Craneware Plc	Bank of America Merrill Lynch	4
329	Craneware Plc	Goldman Sachs	276
(244)	Cranswick Plc	Bank of America Merrill Lynch	(37)
(236)	Cranswick Plc	Goldman Sachs	22
986	Croda International Plc	Morgan Stanley	118
(2,217)	Currys Plc	Bank of America Merrill Lynch	102
(401)	Currys Plc	Goldman Sachs	19
340	CVS Group Plc	Goldman Sachs	147
1,674	Darktrace Plc	Bank of America Merrill Lynch	(328)
1,219	Darktrace Plc	Morgan Stanley	(271)
(385)	DCC Plc	Bank of America Merrill Lynch	(153)
(360)	DCC Plc	Goldman Sachs	105
(2,561)	DCC Plc	Morgan Stanley	(1,042)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	英国(続き)		
(182)	Dechra Pharmaceuticals Plc	Bank of America Merrill Lynch	306
(221)	Dechra Pharmaceuticals Plc	Morgan Stanley	(11)
(274)	Deliveroo Plc	Bank of America Merrill Lynch	11
(137)	Derwent London Plc (REIT)	Goldman Sachs	118
11,841	Direct Line Insurance Group Plc	Morgan Stanley	(1,435)
(2,005)	Domino's Pizza Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(159)
(4,364)	Domino's Pizza Group Plc	Goldman Sachs	(367)
5,340	Dr Martens Plc	Bank of America Merrill Lynch	(3,949)
9,710	Dr Martens Plc	Goldman Sachs	(10,208)
7,852	Dr Martens Plc	Morgan Stanley	(7,349)
1,651	Drax Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	491
6,735	Drax Group Plc	Goldman Sachs	2,647
7,093	Drax Group Plc	Morgan Stanley	(1,258)
(2,886)	DS Smith Plc	Morgan Stanley	80
464	Dunelm Group Plc	Goldman Sachs	231
5,577	easyJet Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1,725)
5,703	easyJet Plc	Goldman Sachs	(943)
4,715	easyJet Plc	Morgan Stanley	320
257	Electrocomponents Plc	Bank of America Merrill Lynch	(106)
1,180	Electrocomponents Plc	Goldman Sachs	(489)
2,488	Electrocomponents Plc	Morgan Stanley	(1,388)
(9,989)	Elementis Plc	Goldman Sachs	(1,103)
(46)	EMIS Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	1
(703)	EMIS Group Plc	Goldman Sachs	17
10,238	EnQuest Plc	Goldman Sachs	(356)
(1,475)	Entain Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1,665)
(1,554)	Entain Plc	Goldman Sachs	(1,553)
(3,301)	Entain Plc	Morgan Stanley	(2,179)
48	FD Technologies Plc	Bank of America Merrill Lynch	(84)
1,371	Ferrexpo Plc	Bank of America Merrill Lynch	(48)
824	Fevertree Drinks Plc	Goldman Sachs	880
(3,843)	Filtrona Plc	Goldman Sachs	(415)
(4,530)	Firstgroup Plc	Goldman Sachs	(476)
(610)	Frasers Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(813)
(651)	Fresnillo Plc	Bank of America Merrill Lynch	(220)
(3,927)	Fresnillo Plc	Goldman Sachs	(1,329)
(5,277)	Fresnillo Plc	Morgan Stanley	-
101	Frontier Developments Plc	Bank of America Merrill Lynch	(261)
83	Frontier Developments Plc	Goldman Sachs	(261)
(4,503)	Future Plc	Bank of America Merrill Lynch	8,216
(922)	Future Plc	Goldman Sachs	1,632
(1,577)	Future Plc	Morgan Stanley	2,246
(6)	Games Workshop Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(16)
(3)	Games Workshop Group Plc	Goldman Sachs	(4)
262	Gamma Communications Plc	Bank of America Merrill Lynch	(75)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	英国(続き)		
185	Gamma Communications Plc	Goldman Sachs	(53)
(507)	GB Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	331
(364)	GB Group Plc	Goldman Sachs	238
287	Genel Energy Plc	Goldman Sachs	50
2,504	Grafton Group Plc (Unit)	Goldman Sachs	(803)
1,041	Grainger Plc	Bank of America Merrill Lynch	50
(1,284)	Great Portland Estates Plc (REIT)	Goldman Sachs	886
(20,539)	Greatland Gold Plc	Bank of America Merrill Lynch	77
(47,772)	Greatland Gold Plc	Goldman Sachs	168
3,119	Greencore Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(215)
1,830	Greencore Group Plc	Goldman Sachs	(53)
(2,791)	Greggs Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2,444)
(3,466)	Greggs Plc	Goldman Sachs	(2,869)
(2,498)	Greggs Plc	Morgan Stanley	(2,578)
(1,909)	Gym Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(80)
(256)	Gym Group Plc	Goldman Sachs	(7)
(10,842)	Haleon Plc	Bank of America Merrill Lynch	(211)
(5,568)	Haleon Plc	Goldman Sachs	(224)
(14,557)	Haleon Plc	Morgan Stanley	970
(4,278)	Halfords Group Plc	Goldman Sachs	657
159,207	Hammerson Plc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(536)
1,531	Hammerson Plc (REIT)	Goldman Sachs	(3)
7	Hammerson Plc (REIT)	Morgan Stanley	-
(783)	Harbour Energy Plc	Goldman Sachs	(104)
(6,899)	Harbour Energy Plc	Morgan Stanley	(58)
2,361	Hargreaves Lansdown Plc	Morgan Stanley	1,184
(2,572)	Helios Towers Plc	Bank of America Merrill Lynch	92
(882)	Helios Towers Plc	Goldman Sachs	35
192	Hill & Smith Plc	Goldman Sachs	237
7,073	Hiscox Ltd	Bank of America Merrill Lynch	2,211
5,931	Hiscox Ltd	Goldman Sachs	1,680
7,645	Hiscox Ltd	Morgan Stanley	496
(1,578)	Home Plc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	535
(12,625)	Home Plc (REIT)	Goldman Sachs	4,284
(238)	Hotel Chocolat Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	34
(8,000)	Howden Joinery Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	1,997
619	Hunting Plc	Bank of America Merrill Lynch	(234)
3,350	Hunting Plc	Goldman Sachs	(1,266)
1,901	IMI Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2,053)
517	Impax Asset Management Group Plc	Goldman Sachs	230
(1,078)	Inchcape Plc	Bank of America Merrill Lynch	129
(1,710)	Inchcape Plc	Morgan Stanley	636
3,773	Indivior Plc	Bank of America Merrill Lynch	1,959
3,652	Indivior Plc	Goldman Sachs	1,510
4,610	Indivior Plc	Morgan Stanley	719

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	英国(続き)		
75	IntegraFin Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	3
103	IntegraFin Holdings Plc	Goldman Sachs	(8)
3,303	Intermediate Capital Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(521)
1,641	Intermediate Capital Group Plc	Goldman Sachs	(358)
1,255	Intermediate Capital Group Plc	Morgan Stanley	625
(4,399)	International Distributions Services Plc	Bank of America Merrill Lynch	688
(5,985)	International Distributions Services Plc	Goldman Sachs	1,301
(2,816)	International Distributions Services Plc	Morgan Stanley	591
846	Intertek Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	45
474	Intertek Group Plc	Goldman Sachs	9
2,144	Intertek Group Plc	Morgan Stanley	4,040
(1,999)	IP Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	157
(5,775)	IP Group Plc	Goldman Sachs	454
(63,611)	JD Sports Fashion Plc	Morgan Stanley	(3,245)
1,611	JET2 Plc	Bank of America Merrill Lynch	1,350
2,171	JET2 Plc	Goldman Sachs	1,611
124	Johnson Matthey Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1)
806	Johnson Matthey Plc	Goldman Sachs	(10)
9,774	Johnson Matthey Plc	Morgan Stanley	8,275
(392)	Johnson Service Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	33
(29)	JTC Plc	Goldman Sachs	(4)
88	Judges Scientific Plc	Bank of America Merrill Lynch	444
166	Judges Scientific Plc	Goldman Sachs	837
287	Kainos Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	140
265	Kainos Group Plc	Goldman Sachs	(181)
(3,848)	Kape Technologies Plc	Bank of America Merrill Lynch	(175)
(700)	Kape Technologies Plc	Goldman Sachs	(32)
(1,103)	Keller Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(437)
(116)	Keywords Studios Plc	Bank of America Merrill Lynch	(358)
(94)	Keywords Studios Plc	Goldman Sachs	(181)
(2,071)	Kier Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(104)
(1,708)	Kier Group Plc	Goldman Sachs	(86)
15,545	Kingfisher Plc	Morgan Stanley	(1,381)
110	Lancashire Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	37
1,104	Lancashire Holdings Ltd	Goldman Sachs	371
(7,199)	Land Securities Group Plc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	225
(606)	Land Securities Group Plc (REIT)	Goldman Sachs	19
(1,451)	Land Securities Group Plc (REIT)	Morgan Stanley	258
5,670	Learning Technologies Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	524
4,375	Learning Technologies Group Plc	Goldman Sachs	404
(14,007)	Lloyds Banking Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(536)
(18,033)	Lloyds Banking Group Plc	Goldman Sachs	(689)
(96,787)	Lloyds Banking Group Plc	Morgan Stanley	(1,550)
477	London Stock Exchange Group Plc	Goldman Sachs	1,614
160	London Stock Exchange Group Plc	Morgan Stanley	200

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	英国(続き)		
4,697	Luceco Plc	Goldman Sachs	(686)
(8,445)	M&G Plc	Goldman Sachs	(213)
(17,463)	M&G Plc	Morgan Stanley	(84)
(235)	Marlowe Plc	Goldman Sachs	154
(4,493)	Marston's Plc	Bank of America Merrill Lynch	17
(2,483)	Marston's Plc	Goldman Sachs	10
3,722	Melrose Industries Plc	Goldman Sachs	63
5,347	Melrose Industries Plc	Morgan Stanley	141
2,182	Mitchells & Butlers Plc	Bank of America Merrill Lynch	(32)
793	Mitchells & Butlers Plc	Goldman Sachs	34
(5,326)	Mitie Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(101)
(11,439)	Mitie Group Plc	Goldman Sachs	(233)
(1,538)	Mondi Plc	Bank of America Merrill Lynch	369
3,836	Moneysupermarket.com Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(319)
2,740	Moneysupermarket.com Group Plc	Goldman Sachs	(247)
2	Moneysupermarket.com Group Plc	Morgan Stanley	-
617	Morgan Crucible Co Plc	Bank of America Merrill Lynch	(48)
3,760	Morgan Crucible Co Plc	Goldman Sachs	(293)
6,362	National Express Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(313)
6,761	National Express Group Plc	Goldman Sachs	(333)
(1,649)	National Grid Plc	Morgan Stanley	336
30,123	NatWest Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	4,230
3,714	NatWest Group Plc	Goldman Sachs	522
9,030	NatWest Group Plc	Morgan Stanley	824
(746)	NCC Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(72)
(1,537)	NCC Group Plc	Goldman Sachs	(148)
4,685	Network International Holdings Plc	Goldman Sachs	607
528	Next Fifteen Communications Group Plc	Goldman Sachs	(355)
(844)	Next Plc	Goldman Sachs	(1,479)
(362)	Next Plc	Morgan Stanley	(739)
(297)	Ocado Group Plc	Goldman Sachs	111
(8,134)	On the Beach Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	351
(3,336)	On the Beach Group Plc	Goldman Sachs	144
899	OSB Group Plc	Goldman Sachs	97
(1,980)	Oxford Biomedica Plc	Goldman Sachs	(1,212)
(2,644)	Oxford Nanopore Technologies Plc	Goldman Sachs	730
1,570	Pan African Resources Plc	Bank of America Merrill Lynch	-
3,345	Paragon Group of Cos Plc	Bank of America Merrill Lynch	606
3,328	Paragon Group of Cos Plc	Goldman Sachs	696
(10,470)	Petrofac Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4,939
(31,422)	Petrofac Ltd	Goldman Sachs	13,835
(3,819)	Phoenix Group Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	(783)
(469)	Phoenix Group Holdings Plc	Goldman Sachs	(118)
(381)	Phoenix Group Holdings Plc	Morgan Stanley	34
437	Plus500 Ltd	Goldman Sachs	493

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	英国(続き)		
94	Polar Capital Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	13
52	Polar Capital Holdings Plc	Goldman Sachs	-
(3,649)	Prudential Plc	Bank of America Merrill Lynch	752
(2,585)	Prudential Plc	Goldman Sachs	203
(15,216)	Prudential Plc	Morgan Stanley	(5,614)
(2,750)	Quilter Plc	Bank of America Merrill Lynch	112
(910)	Quilter Plc	Goldman Sachs	37
(1,346)	Rank Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(323)
(2,128)	Rank Group Plc	Goldman Sachs	(511)
(260)	Rathbone Brothers Plc	Goldman Sachs	(250)
(248)	Renewi Plc	Goldman Sachs	(11)
197	Renishaw Plc	Bank of America Merrill Lynch	(789)
90	Renishaw Plc	Goldman Sachs	(389)
560	Renishaw Plc	Morgan Stanley	(2,151)
(44,552)	Rentokil Initial Plc	Morgan Stanley	(535)
23,057	Restaurant Group Plc	Goldman Sachs	(1,848)
(75)	Restore Plc	Bank of America Merrill Lynch	47
4,705	Rolls-Royce Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	(34)
28,203	Rolls-Royce Holdings Plc	Goldman Sachs	(203)
9,435	Rolls-Royce Holdings Plc	Morgan Stanley	591
344	RWS Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	35
3,373	RWS Holdings Plc	Goldman Sachs	177
(825)	S4 Capital Plc	Bank of America Merrill Lynch	186
(515)	S4 Capital Plc	Goldman Sachs	116
248	Safestore Holdings Plc (REIT)	Goldman Sachs	(106)
(8,937)	Saga Plc	Bank of America Merrill Lynch	(116)
(1,819)	Saga Plc	Goldman Sachs	26
681	Sage Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	353
726	Sage Group Plc	Goldman Sachs	376
1,629	Sage Group Plc	Morgan Stanley	(184)
9,582	Segro Plc (REIT)	Goldman Sachs	(4,554)
4,057	Segro Plc (REIT)	Morgan Stanley	(847)
282	Senior Plc	Goldman Sachs	4
(864)	Severn Trent Plc	Bank of America Merrill Lynch	220
(873)	Severn Trent Plc	Goldman Sachs	(193)
(537)	Severn Trent Plc	Morgan Stanley	226
256	Shaftesbury Plc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(12)
2,762	Shell Plc	Bank of America Merrill Lynch	1,898
729	Shell Plc	Goldman Sachs	503
1,157	Shell Plc	Morgan Stanley	694
1,351	SIG Plc	Bank of America Merrill Lynch	(18)
24,225	SIG Plc	Goldman Sachs	(320)
2,026	Smart Metering Systems Plc	Goldman Sachs	(681)
151	Softcat Plc	Bank of America Merrill Lynch	5
1,044	Softcat Plc	Goldman Sachs	38

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	英国(続き)		
(22,967)	SolGold Plc	Goldman Sachs	(11)
1,616	Spectris Plc	Bank of America Merrill Lynch	(679)
629	Spectris Plc	Goldman Sachs	(264)
936	Spectris Plc	Morgan Stanley	(865)
153	Spirax-Sarco Engineering Plc	Morgan Stanley	9
(792)	Spirent Communications Plc	Bank of America Merrill Lynch	(44)
5,351	SSE Plc	Bank of America Merrill Lynch	4,430
2,634	SSE Plc	Goldman Sachs	2,163
10,774	SSE Plc	Morgan Stanley	(719)
19,611	SSP Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1,671)
15,295	SSP Group Plc	Goldman Sachs	(1,303)
1,509	SSP Group Plc	Morgan Stanley	85
24	St James ' s Place Plc	Bank of America Merrill Lynch	(12)
1,093	St James ' s Place Plc	Goldman Sachs	(525)
3,304	St James ' s Place Plc	Morgan Stanley	377
184	SThree Plc	Bank of America Merrill Lynch	(11)
3,096	SThree Plc	Goldman Sachs	(186)
(616)	Strix Group Plc	Goldman Sachs	341
(5,906)	Supermarket Income Plc (REIT)	Goldman Sachs	79
(753)	Synthomer Plc	Bank of America Merrill Lynch	83
(2,013)	Synthomer Plc	Goldman Sachs	222
(28,128)	Taylor Wimpey Plc	Bank of America Merrill Lynch	152
(28,164)	Taylor Wimpey Plc	Goldman Sachs	61
140	TBC Bank Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	50
524	TBC Bank Group Plc	Goldman Sachs	189
(7,008)	TI Fluid Systems Plc	Bank of America Merrill Lynch	1,036
(7,312)	TI Fluid Systems Plc	Goldman Sachs	1,081
3,440	TP ICAP Group Plc	Goldman Sachs	(78)
90	Trainline Plc	Bank of America Merrill Lynch	14
1,489	Trainline Plc	Goldman Sachs	234
4,938	Travis Perkins Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2,892)
4,534	Travis Perkins Plc	Goldman Sachs	(2,655)
5,869	Travis Perkins Plc	Morgan Stanley	(2,240)
(3,108)	Trustpilot Group Plc	Goldman Sachs	408
(18,709)	Tullow Oil Plc	Bank of America Merrill Lynch	768
(51,825)	Tullow Oil Plc	Goldman Sachs	1,680
150	Tyman Plc	Bank of America Merrill Lynch	8
1,278	Tyman Plc	Goldman Sachs	69
7,298	UK Commercial Property Ltd (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(368)
51,379	UK Commercial Property Ltd (REIT)	Goldman Sachs	(2,590)
(2,689)	Unilever Plc	Goldman Sachs	(3,953)
(1,676)	Unilever Plc	Morgan Stanley	(3,017)
(919)	United Utilities Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	154
(477)	United Utilities Group Plc	Goldman Sachs	(70)
(1,998)	United Utilities Group Plc	Morgan Stanley	228

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	英国(続き)		
(2,638)	Urban Logistics Plc (REIT)	Goldman Sachs	253
3,007	Vesuvius Plc	Goldman Sachs	36
158	Vistry Group Plc	Goldman Sachs	(126)
(1,053)	Volex Plc	Bank of America Merrill Lynch	196
(507)	Volex Plc	Goldman Sachs	94
(214)	Warehouse Plc (REIT)	Goldman Sachs	6
2,093	Watkin Jones Plc	Bank of America Merrill Lynch	10
439	Watkin Jones Plc	Goldman Sachs	2
185	WH Smith Plc	Bank of America Merrill Lynch	99
154	WH Smith Plc	Goldman Sachs	29
(4,039)	Whitbread Plc	Bank of America Merrill Lynch	(3,515)
(1,684)	Whitbread Plc	Goldman Sachs	(1,233)
(3,479)	Whitbread Plc	Morgan Stanley	(2,923)
(1,034)	Wincanton Plc	Bank of America Merrill Lynch	(59)
(1,164)	Wincanton Plc	Goldman Sachs	(65)
120	Workspace Group Plc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(68)
658	Workspace Group Plc (REIT)	Goldman Sachs	(374)
(5,313)	Yellow Cake Plc	Goldman Sachs	1,454
643	YouGov Plc	Bank of America Merrill Lynch	77
692	YouGov Plc	Goldman Sachs	83
			(4,603)
	米国		
1,131	1-800-Flowers.com Inc 'A'	Goldman Sachs	(1,221)
(1,693)	23andMe Holding Co 'A'	Bank of America Merrill Lynch	496
(1,154)	23andMe Holding Co 'A'	Goldman Sachs	646
445	2U Inc	Bank of America Merrill Lynch	(623)
1,300	2U Inc	Goldman Sachs	(1,820)
(545)	3D Systems Corp	Bank of America Merrill Lynch	649
297	3M Co	Bank of America Merrill Lynch	(1,831)
223	3M Co	Goldman Sachs	(1,510)
411	3M Co	Morgan Stanley	(1,618)
(57)	4D Molecular Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(251)
(135)	4D Molecular Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(595)
3,805	8x8 Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,199)
7,828	8x8 Inc	Goldman Sachs	(2,466)
(226)	908 Devices Inc	Bank of America Merrill Lynch	163
123	A O Smith Corp	Bank of America Merrill Lynch	(102)
276	A O Smith Corp	Goldman Sachs	(229)
212	A O Smith Corp	Morgan Stanley	(496)
531	A10 Networks Inc	Bank of America Merrill Lynch	(112)
77	A10 Networks Inc	Goldman Sachs	(16)
6	AAON Inc	Bank of America Merrill Lynch	(21)
6	AAON Inc	Goldman Sachs	(12)
54	AAR Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1)
40	AAR Corp	Goldman Sachs	5

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)	Aaron's Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(47)
(491)	Aaron's Co Inc	Goldman Sachs	(408)
(80)	AbCellera Biologics Inc	Bank of America Merrill Lynch	62
(675)	AbCellera Biologics Inc	Goldman Sachs	523
(581)	AbCellera Biologics Inc	Morgan Stanley	154
(238)	ABM Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(53)
(332)	ABM Industries Inc	Goldman Sachs	(69)
(39)	Academy Sports & Outdoors Inc	Bank of America Merrill Lynch	78
121	ACADIA Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(61)
533	ACADIA Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(383)
321	Acadia Realty Trust (REIT)	Goldman Sachs	(83)
661	Accel Entertainment Inc	Goldman Sachs	(443)
274	Accenture Plc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,304)
45	Accenture Plc 'A'	Goldman Sachs	(126)
96	Accenture Plc 'A'	Morgan Stanley	(480)
2,099	ACCO Brands Corp	Goldman Sachs	(126)
(1,124)	Accolade Inc	Goldman Sachs	1,517
80	ACI Worldwide Inc	Bank of America Merrill Lynch	(130)
995	ACI Worldwide Inc	Goldman Sachs	(1,612)
(222)	ACM Research Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	324
(671)	ACM Research Inc 'A'	Goldman Sachs	980
(122)	Acushnet Holdings Corp	Goldman Sachs	415
(359)	ACV Auctions Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	269
(1,619)	ACV Auctions Inc 'A'	Goldman Sachs	1,214
(106)	AdaptHealth Corp	Bank of America Merrill Lynch	49
(761)	AdaptHealth Corp	Goldman Sachs	350
670	Adaptive Biotechnologies Corp	Goldman Sachs	(811)
(25)	Addus HomeCare Corp	Bank of America Merrill Lynch	(11)
(37)	Addus HomeCare Corp	Goldman Sachs	(17)
(429)	Adicet Bio Inc	Bank of America Merrill Lynch	746
(110)	Adicet Bio Inc	Goldman Sachs	251
1,446	Adient Plc	Morgan Stanley	(2,849)
2	Adobe Inc	Goldman Sachs	(32)
209	Adobe Inc	Morgan Stanley	(157)
(94)	Adtalem Global Education Inc	Bank of America Merrill Lynch	(80)
(351)	Adtalem Global Education Inc	Goldman Sachs	(298)
(59)	ADTRAN Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	114
(201)	ADTRAN Holdings Inc	Goldman Sachs	388
297	Advance Auto Parts Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,982)
164	Advance Auto Parts Inc	Goldman Sachs	(452)
721	Advance Auto Parts Inc	Morgan Stanley	(2,681)
127	Advanced Drainage Systems Inc	Morgan Stanley	(188)
75	Advanced Energy Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(179)
505	Advanced Energy Industries Inc	Goldman Sachs	(1,480)
28	AdvanSix Inc	Bank of America Merrill Lynch	1

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
236	AdvanSix Inc	Goldman Sachs	5
651	Advantage Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	(195)
536	Advantage Solutions Inc	Goldman Sachs	(161)
741	AECOM	Bank of America Merrill Lynch	2,353
908	AECOM	Goldman Sachs	2,844
823	AECOM	Morgan Stanley	(543)
(383)	AerCap Holdings NV	Bank of America Merrill Lynch	(514)
(835)	AerCap Holdings NV	Goldman Sachs	(1,237)
(2,214)	AerCap Holdings NV	Morgan Stanley	44
464	AerSale Corp	Bank of America Merrill Lynch	(797)
350	AerSale Corp	Goldman Sachs	(359)
(4,207)	Aeva Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,903
(1,142)	Aeva Technologies Inc	Goldman Sachs	788
(3,307)	AEye Inc	Goldman Sachs	132
(644)	AGCO Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,858)
(202)	AGCO Corp	Goldman Sachs	(1,023)
(137)	AGCO Corp	Morgan Stanley	(196)
(932)	Agiliti Inc	Bank of America Merrill Lynch	270
(549)	Agiliti Inc	Goldman Sachs	159
(514)	agilon health Inc	Bank of America Merrill Lynch	285
(2,533)	agilon health Inc	Goldman Sachs	1,238
(1,813)	agilon health Inc	Morgan Stanley	(578)
235	Agios Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	216
(1,052)	Agree Realty Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	1,364
(795)	Agree Realty Corp (REIT)	Goldman Sachs	950
(496)	Agree Realty Corp (REIT)	Morgan Stanley	1,106
(317)	Air Lease Corp	Bank of America Merrill Lynch	(22)
(80)	Air Lease Corp	Goldman Sachs	(6)
(170)	Air Products and Chemicals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(804)
(74)	Air Products and Chemicals Inc	Goldman Sachs	(429)
(52)	Air Products and Chemicals Inc	Morgan Stanley	472
(1,121)	Airbnb Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	3,831
(200)	Airbnb Inc 'A'	Goldman Sachs	182
(2,723)	Airbnb Inc 'A'	Morgan Stanley	(4,226)
(144)	Akero Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(371)
(310)	Akero Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(816)
(39)	Alamo Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	23
(22)	Alamo Group Inc	Goldman Sachs	13
26	Alarm.com Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(169)
61	Alarm.com Holdings Inc	Goldman Sachs	(132)
(43)	Albany International Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	147
(367)	Albany International Corp 'A'	Goldman Sachs	1,797
346	Alcoa Corp	Goldman Sachs	(394)
481	Alcoa Corp	Morgan Stanley	(620)
1,128	Alector Inc	Bank of America Merrill Lynch	(722)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
1,437	Alector Inc	Goldman Sachs	(920)
(49)	Alexander's Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(307)
(136)	Alexander's Inc (REIT)	Goldman Sachs	(853)
(1,038)	Alight Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	430
(12,353)	Alight Inc 'A'	Goldman Sachs	5,169
(4,532)	Alight Inc 'A'	Morgan Stanley	861
282	Align Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,882)
138	Align Technology Inc	Goldman Sachs	(1,862)
401	Align Technology Inc	Morgan Stanley	(347)
191	Alignment Healthcare Inc	Bank of America Merrill Lynch	105
356	Alignment Healthcare Inc	Goldman Sachs	118
(1,004)	Alkami Technology Inc	Goldman Sachs	1,968
258	Alkermes Plc	Bank of America Merrill Lynch	428
923	Alkermes Plc	Goldman Sachs	1,458
670	Alkermes Plc	Morgan Stanley	(228)
(7,002)	Allbirds Inc 'A'	Goldman Sachs	2,766
144	Allegiant Travel Co	Bank of America Merrill Lynch	(543)
279	Allegiant Travel Co	Goldman Sachs	(1,052)
(18)	Allegion Plc	Bank of America Merrill Lynch	64
85	Allegro MicroSystems Inc	Bank of America Merrill Lynch	16
174	Allegro MicroSystems Inc	Goldman Sachs	33
(2,032)	Alliant Energy Corp	Goldman Sachs	(2,343)
(1,440)	Alliant Energy Corp	Morgan Stanley	418
77	Allison Transmission Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	118
68	Allison Transmission Holdings Inc	Goldman Sachs	104
206	Allogene Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(19)
954	Allogene Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(86)
(76)	Allovir Inc	Bank of America Merrill Lynch	46
(155)	Allovir Inc	Goldman Sachs	93
1,823	Allscripts Healthcare Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	547
76	Allstate Corp	Bank of America Merrill Lynch	(78)
175	Allstate Corp	Goldman Sachs	(180)
409	Allstate Corp	Morgan Stanley	(1,174)
3,126	Ally Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,933)
594	Ally Financial Inc	Goldman Sachs	(625)
2,291	Ally Financial Inc	Morgan Stanley	(1,352)
100	Alnylam Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	108
11	Alnylam Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	10
103	Alnylam Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	597
(2)	Alpha & Omega Semiconductor Ltd	Bank of America Merrill Lynch	9
(474)	Alpha & Omega Semiconductor Ltd	Goldman Sachs	2,067
24	Alpha Metallurgical Resources Inc	Goldman Sachs	106
375	Alphabet Inc 'A'	Goldman Sachs	(596)
2,490	Alphabet Inc 'A'	Morgan Stanley	(3,071)
684	Alphabet Inc 'C'	Bank of America Merrill Lynch	(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)		
802	Alphabet Inc 'C'	Goldman Sachs	(2,035)
3,340	Alphabet Inc 'C'	Morgan Stanley	(3,952)
129	Altair Engineering Inc 'A'	Goldman Sachs	(217)
127	Altice USA Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(8)
(80)	Altus Power Inc	Goldman Sachs	80
(42)	ALX Oncology Holdings Inc	Goldman Sachs	29
78	Amalgamated Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	-
41	Amalgamated Financial Corp	Goldman Sachs	8
493	Amazon.com Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,183)
294	Amazon.com Inc	Goldman Sachs	(1,893)
96	Amazon.com Inc	Morgan Stanley	(67)
118	Ambarella Inc	Bank of America Merrill Lynch	211
75	Ambarella Inc	Goldman Sachs	68
3,857	AMC Entertainment Holdings Inc	Goldman Sachs	(1,720)
512	AMC Entertainment Holdings Inc	Morgan Stanley	(141)
(195)	AMC Networks Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	456
(189)	AMC Networks Inc 'A'	Goldman Sachs	416
(4,649)	Ancor Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1,071)
(4,913)	Ancor Plc	Goldman Sachs	(1,258)
(2,866)	Ancor Plc	Morgan Stanley	(64)
(667)	Amdocs Ltd	Morgan Stanley	207
413	Amedisys Inc	Bank of America Merrill Lynch	(621)
311	Amedisys Inc	Goldman Sachs	(236)
432	Amedisys Inc	Morgan Stanley	406
(455)	Amerant Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	664
(469)	Amerant Bancorp Inc	Goldman Sachs	685
(423)	AMERCO	Morgan Stanley	(677)
(51)	Ameresco Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	16
1,588	American Airlines Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(969)
3,618	American Airlines Group Inc	Morgan Stanley	72
106	American Assets Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	(21)
250	American Axle & Manufacturing Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3)
656	American Axle & Manufacturing Holdings Inc	Goldman Sachs	(7)
207	American Eagle Outfitters Inc	Bank of America Merrill Lynch	118
337	American Eagle Outfitters Inc	Goldman Sachs	(51)
(584)	American Electric Power Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,136)
(867)	American Electric Power Co Inc	Goldman Sachs	(4,375)
(1,835)	American Electric Power Co Inc	Morgan Stanley	(1,615)
(107)	American Equity Investment Life Holding Co	Goldman Sachs	(234)
215	American Express Co	Bank of America Merrill Lynch	(305)
199	American Express Co	Goldman Sachs	(283)
136	American Express Co	Morgan Stanley	(287)
55	American Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	27
169	American Financial Group Inc	Goldman Sachs	83

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
289	American Financial Group Inc	Morgan Stanley	(1,049)
(744)	American Public Education Inc	Goldman Sachs	(97)
(100)	American States Water Co	Bank of America Merrill Lynch	48
(261)	American States Water Co	Goldman Sachs	103
244	American Vanguard Corp	Goldman Sachs	(107)
(42)	American Water Works Co Inc	Goldman Sachs	(97)
(631)	American Well Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	336
315	American Woodmark Corp	Goldman Sachs	(296)
(66)	America's Car-Mart Inc	Bank of America Merrill Lynch	(24)
(195)	America's Car-Mart Inc	Goldman Sachs	(179)
(3,408)	Americold Realty Trust Inc	Goldman Sachs	(524)
(8,953)	Americold Realty Trust Inc	Morgan Stanley	(1,453)
(306)	Ameriprise Financial Inc	Goldman Sachs	(3)
160	Amgen Inc	Goldman Sachs	(505)
(63)	Amicus Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7)
(44)	Amicus Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(5)
(740)	Amkor Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	666
(1,198)	Amkor Technology Inc	Goldman Sachs	2,112
(1,354)	Amkor Technology Inc	Morgan Stanley	1,232
(26)	AMN Healthcare Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(22)
(62)	AMN Healthcare Services Inc	Goldman Sachs	(186)
(182)	AMN Healthcare Services Inc	Morgan Stanley	544
1,704	Amneal Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	358
1,008	Amneal Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	212
214	Amphastar Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	214
371	Amphastar Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	371
(629)	Amplitude Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	591
(697)	Amplitude Inc 'A'	Goldman Sachs	655
486	Analog Devices Inc	Bank of America Merrill Lynch	(431)
274	Analog Devices Inc	Goldman Sachs	(680)
626	Analog Devices Inc	Morgan Stanley	(1,597)
53	AnaptysBio Inc	Bank of America Merrill Lynch	(109)
87	AnaptysBio Inc	Goldman Sachs	(179)
(51)	Anavex Life Sciences Corp	Bank of America Merrill Lynch	265
(563)	Anavex Life Sciences Corp	Goldman Sachs	2,928
372	Angi Inc	Bank of America Merrill Lynch	(69)
(9)	ANI Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(39)
236	Anika Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(404)
81	Anika Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(139)
352	ANSYS Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,985)
56	ANSYS Inc	Morgan Stanley	(64)
22	Anterix Inc	Bank of America Merrill Lynch	(82)
358	Antero Resources Corp	Bank of America Merrill Lynch	(183)
52	Antero Resources Corp	Goldman Sachs	(27)
389	Antero Resources Corp	Morgan Stanley	86

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
248	Aon Plc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	2,645
64	Aon Plc 'A'	Goldman Sachs	678
113	Aon Plc 'A'	Morgan Stanley	(129)
6	APA Corp	Bank of America Merrill Lynch	5
309	APA Corp	Goldman Sachs	(627)
1,397	APA Corp	Morgan Stanley	(1,076)
(983)	Apartment Income Corp (REIT)	Goldman Sachs	128
(968)	Apartment Income Corp (REIT)	Morgan Stanley	39
(183)	API Group Corp	Bank of America Merrill Lynch	37
(100)	API Group Corp	Goldman Sachs	20
(289)	Apollo Commercial Real Estate Finance Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	12
(160)	Apollo Commercial Real Estate Finance Inc (REIT)	Goldman Sachs	11
(1,280)	Apollo Global Management Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,728)
(2,311)	Apollo Global Management Inc	Goldman Sachs	(5,320)
(3,340)	Apollo Global Management Inc	Morgan Stanley	(6,565)
(263)	Appian Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1,218
(109)	Appian Corp 'A'	Goldman Sachs	505
(224)	Appian Corp 'A'	Morgan Stanley	(141)
(170)	Apple Hospitality Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(61)
(138)	Apple Hospitality Inc (REIT)	Morgan Stanley	29
809	Apple Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,206)
686	Apple Inc	Goldman Sachs	(5,413)
658	Apple Inc	Morgan Stanley	(4,686)
(40)	Applied Industrial Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	20
(40)	Applied Industrial Technologies Inc	Goldman Sachs	38
(1,980)	AppLovin Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	3,402
(9,210)	AppLovin Corp 'A'	Morgan Stanley	4,393
(99)	AptarGroup Inc	Bank of America Merrill Lynch	377
(111)	AptarGroup Inc	Goldman Sachs	335
(35)	AptarGroup Inc	Morgan Stanley	135
348	Aptiv Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2,421)
514	Aptiv Plc	Goldman Sachs	(3,999)
293	Aptiv Plc	Morgan Stanley	(1,084)
(2,595)	Aramark	Morgan Stanley	(727)
18	Arbor Realty Trust Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	-
36	Arbor Realty Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	26
9	ArcBest Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3)
29	ArcBest Corp	Goldman Sachs	(126)
(28)	Arch Capital Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(31)
(104)	Arch Capital Group Ltd	Goldman Sachs	(226)
(531)	Archer-Daniels-Midland Co	Bank of America Merrill Lynch	(557)
(522)	Archer-Daniels-Midland Co	Goldman Sachs	(805)
(5,762)	Archer-Daniels-Midland Co	Morgan Stanley	8,382
(597)	Arcturus Therapeutics Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	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)		
(491)	Arcturus Therapeutics Holdings Inc	Goldman Sachs	148
126	Arcus Biosciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	150
313	Arcus Biosciences Inc	Goldman Sachs	372
(322)	Arcutis Biotherapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	633
(253)	Arcutis Biotherapeutics Inc	Goldman Sachs	552
(527)	Ares Commercial Real Estate Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(50)
(770)	Ares Commercial Real Estate Corp (REIT)	Goldman Sachs	-
(271)	Argan Inc	Bank of America Merrill Lynch	(70)
(254)	Argan Inc	Goldman Sachs	(66)
251	Argo Group International Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	95
574	Argo Group International Holdings Ltd	Goldman Sachs	218
(1,001)	Arista Networks Inc	Goldman Sachs	(2,057)
(201)	Arista Networks Inc	Morgan Stanley	285
(615)	Arko Corp	Bank of America Merrill Lynch	(25)
(689)	Arko Corp	Goldman Sachs	(28)
(1,269)	ARMOUR Residential Inc (REIT)	Goldman Sachs	(76)
365	Armstrong World Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(913)
245	Armstrong World Industries Inc	Goldman Sachs	(268)
234	Armstrong World Industries Inc	Morgan Stanley	(517)
171	Arrow Electronics Inc	Goldman Sachs	(1,233)
226	Arrow Electronics Inc	Morgan Stanley	(1,193)
19	Arthur J Gallagher & Co	Morgan Stanley	(63)
119	Artisan Partners Asset Management Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	13
346	Artisan Partners Asset Management Inc 'A'	Goldman Sachs	38
41	Artivion Inc	Bank of America Merrill Lynch	(21)
182	Artivion Inc	Goldman Sachs	(93)
167	Arvinas Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,029)
197	Arvinas Inc	Goldman Sachs	(3,574)
(340)	Asana Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1,646
(729)	Asana Inc 'A'	Goldman Sachs	3,528
85	ASGN Inc	Bank of America Merrill Lynch	(268)
22	ASGN Inc	Goldman Sachs	(14)
225	ASGN Inc	Morgan Stanley	(869)
(20)	Aspen Technology Inc	Goldman Sachs	472
(98)	Aspen Technology Inc	Morgan Stanley	1,372
657	AssetMark Financial Holdings Inc	Goldman Sachs	782
217	Associated Banc-Corp	Goldman Sachs	9
6	Assured Guaranty Ltd	Bank of America Merrill Lynch	10
339	Assured Guaranty Ltd	Goldman Sachs	1,690
(1,301)	Astra Space Inc	Bank of America Merrill Lynch	136
(6,096)	Astra Space Inc	Goldman Sachs	576
(2,129)	AT&T Inc	Morgan Stanley	245
(800)	Atea Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	434
(339)	Atkore Inc	Bank of America Merrill Lynch	(742)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(353)	Atkore Inc	Goldman Sachs	(1,938)
(406)	Atkore Inc	Morgan Stanley	2,452
1,841	Atlantica Sustainable Infrastructure Plc	Bank of America Merrill Lynch	150
737	Atlantica Sustainable Infrastructure Plc	Goldman Sachs	74
2,401	Atlantica Sustainable Infrastructure Plc	Morgan Stanley	(1,176)
(40)	Atlanticus Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	38
(13)	Atlanticus Holdings Corp	Goldman Sachs	12
427	Atlassian Corp Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,870)
710	Atlassian Corp Ltd 'A'	Goldman Sachs	(3,576)
229	Atlassian Corp Ltd 'A'	Morgan Stanley	1,379
2	Atrion Corp	Bank of America Merrill Lynch	(76)
(601)	Aurinia Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	48
(948)	Aurinia Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	76
261	Autodesk Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,564)
350	Autodesk Inc	Goldman Sachs	(5,878)
332	Autodesk Inc	Morgan Stanley	(3,698)
406	Autoliv Inc	Bank of America Merrill Lynch	(610)
584	Autoliv Inc	Goldman Sachs	(401)
909	Autoliv Inc	Morgan Stanley	(1,027)
(64)	Automatic Data Processing Inc	Bank of America Merrill Lynch	(251)
(128)	Automatic Data Processing Inc	Goldman Sachs	(502)
(107)	Automatic Data Processing Inc	Morgan Stanley	506
251	AutoNation Inc	Bank of America Merrill Lynch	256
190	AutoNation Inc	Goldman Sachs	181
54	AutoNation Inc	Morgan Stanley	89
3	AutoZone Inc	Bank of America Merrill Lynch	102
12	AutoZone Inc	Goldman Sachs	1,566
85	AutoZone Inc	Morgan Stanley	2,196
214	Avanos Medical Inc	Bank of America Merrill Lynch	(56)
442	Avanos Medical Inc	Goldman Sachs	(115)
(233)	Aveanna Healthcare Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	40
(2,670)	AvePoint Inc	Goldman Sachs	1,121
22	Avid Bioservices Inc	Bank of America Merrill Lynch	15
69	Avid Bioservices Inc	Goldman Sachs	(50)
(191)	Avid Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	225
(153)	Avid Technology Inc	Goldman Sachs	169
428	AvidXchange Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(315)
1,033	AvidXchange Holdings Inc	Goldman Sachs	(782)
39	Avient Corp	Bank of America Merrill Lynch	(20)
727	Avient Corp	Goldman Sachs	(378)
369	Avnet Inc	Morgan Stanley	(565)
12	Axcelis Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(39)
128	Axcelis Technologies Inc	Goldman Sachs	(416)
531	Axis Capital Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	685
685	Axis Capital Holdings Ltd	Goldman Sachs	884

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
527	Axis Capital Holdings Ltd	Morgan Stanley	(153)
(590)	Axon Enterprise Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,177
(318)	Axon Enterprise Inc	Morgan Stanley	1,724
230	Axos Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,033)
475	Axos Financial Inc	Goldman Sachs	(2,133)
1	AZEK Co Inc	Goldman Sachs	(2)
2,077	AZEK Co Inc	Morgan Stanley	(1,059)
80	Azenta Inc	Goldman Sachs	96
88	Azenta Inc	Morgan Stanley	42
(20)	AZZ Inc	Bank of America Merrill Lynch	28
(72)	AZZ Inc	Goldman Sachs	99
(103)	B Riley Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	161
(236)	B Riley Financial Inc	Goldman Sachs	368
(1,050)	Babcock & Wilcox Enterprises Inc	Bank of America Merrill Lynch	509
(1,667)	Babcock & Wilcox Enterprises Inc	Goldman Sachs	758
32	Badger Meter Inc	Bank of America Merrill Lynch	(115)
38	Badger Meter Inc	Goldman Sachs	(137)
980	Baker Hughes Co	Bank of America Merrill Lynch	(527)
2,445	Baker Hughes Co	Goldman Sachs	(3,556)
2,060	Baker Hughes Co	Morgan Stanley	(1,421)
(77)	Balchem Corp	Bank of America Merrill Lynch	417
(309)	Balchem Corp	Goldman Sachs	1,297
475	Bandwidth Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(812)
1,096	Bandwidth Inc 'A'	Goldman Sachs	(1,874)
688	Bank of New York Mellon Corp	Bank of America Merrill Lynch	407
474	Bank of New York Mellon Corp	Goldman Sachs	203
1,472	Bank of New York Mellon Corp	Morgan Stanley	(1,222)
(968)	Banner Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,500
(12)	Banner Corp	Goldman Sachs	14
235	Bar Harbor Bankshares	Bank of America Merrill Lynch	(174)
88	Bar Harbor Bankshares	Goldman Sachs	(65)
(308)	BARK Inc	Bank of America Merrill Lynch	105
(7,164)	BARK Inc	Goldman Sachs	2,436
(372)	Barnes Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(657)
(338)	Barnes Group Inc	Goldman Sachs	(566)
15	Barrett Business Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4)
7	Barrett Business Services Inc	Goldman Sachs	(2)
(515)	Bath & Body Works Inc	Bank of America Merrill Lynch	130
(661)	Bath & Body Works Inc	Goldman Sachs	6
(2,979)	Bath & Body Works Inc	Morgan Stanley	2,931
(258)	Beachbody Co Inc	Goldman Sachs	50
(388)	Beauty Health Co	Goldman Sachs	107
24	Becton Dickinson and Co	Bank of America Merrill Lynch	67
196	Becton Dickinson and Co	Goldman Sachs	4,053
333	Becton Dickinson and Co	Morgan Stanley	2,023

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(384)	BellRing Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	22
(1,350)	BellRing Brands Inc	Goldman Sachs	65
54	Benefitfocus Inc	Goldman Sachs	1
(94)	Benson Hill Inc	Bank of America Merrill Lynch	34
(1,687)	Benson Hill Inc	Goldman Sachs	607
(994)	Bentley Systems Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	1,290
(864)	Bentley Systems Inc 'B'	Goldman Sachs	1,425
(526)	Bentley Systems Inc 'B'	Morgan Stanley	146
(203)	Berkshire Hills Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	156
(319)	Berkshire Hills Bancorp Inc	Goldman Sachs	244
1,081	Berry Corp	Bank of America Merrill Lynch	(119)
860	Berry Corp	Goldman Sachs	(95)
859	Berry Global Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(540)
420	Berry Global Group Inc	Goldman Sachs	(244)
874	Berry Global Group Inc	Morgan Stanley	664
1,365	Best Buy Co Inc	Morgan Stanley	5,390
67	Big Lots Inc	Bank of America Merrill Lynch	(65)
445	Big Lots Inc	Goldman Sachs	(84)
(419)	BigCommerce Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	838
(108)	BioCryst Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	6
(827)	BioCryst Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	190
148	Biogen Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,301
8	Biogen Inc	Goldman Sachs	139
461	BioMarin Pharmaceutical Inc	Morgan Stanley	3,965
(5,971)	Bionano Genomics Inc	Goldman Sachs	698
19	Bio-Rad Laboratories Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(365)
24	Bio-Rad Laboratories Inc 'A'	Morgan Stanley	(86)
(76)	Bioventus Inc 'A'	Goldman Sachs	103
(99)	Bioxcel Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	41
(644)	Bioxcel Therapeutics Inc	Goldman Sachs	264
156	BJ's Restaurants Inc	Goldman Sachs	(140)
7	Blackbaud Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9)
(37)	Blackline Inc	Morgan Stanley	(147)
(2,083)	Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(374)
(1,013)	Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (REIT)	Goldman Sachs	(96)
(1,754)	Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (REIT)	Morgan Stanley	452
(716)	Blade Air Mobility Inc	Goldman Sachs	164
(678)	Block Inc	Bank of America Merrill Lynch	5,316
(672)	Block Inc	Goldman Sachs	5,124
(1,722)	Block Inc	Morgan Stanley	(422)
(1,994)	Bloom Energy Corp 'A'	Morgan Stanley	1,137
(259)	Bloomin' Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	456
(928)	Bloomin' Brands Inc	Goldman Sachs	1,702
(187)	Blue Bird Corp	Bank of America Merrill Lynch	14

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(692)	Blue Bird Corp	Goldman Sachs	325
(1,771)	Blue Owl Capital Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,586
(2,112)	Blue Owl Capital Inc	Goldman Sachs	3,084
(4,278)	Blue Owl Capital Inc	Morgan Stanley	1,968
302	Blueprint Medicines Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,096
178	Blueprint Medicines Corp	Goldman Sachs	646
524	Blueprint Medicines Corp	Morgan Stanley	1,934
144	Boise Cascade Co	Bank of America Merrill Lynch	(98)
173	Boise Cascade Co	Goldman Sachs	(129)
28	Booking Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	656
87	Booking Holdings Inc	Goldman Sachs	2,065
29	Booking Holdings Inc	Morgan Stanley	2,213
1,485	BorgWarner Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,886)
2,059	BorgWarner Inc	Goldman Sachs	(1,955)
2,411	BorgWarner Inc	Morgan Stanley	(2,315)
52	Boston Beer Co Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(299)
47	Boston Beer Co Inc 'A'	Goldman Sachs	(380)
215	Boston Beer Co Inc 'A'	Morgan Stanley	725
(450)	Boston Omaha Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(321)
(316)	Boston Omaha Corp 'A'	Goldman Sachs	(237)
(282)	Boston Properties Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	1,368
(576)	Boston Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	2,794
(140)	Boston Properties Inc (REIT)	Morgan Stanley	137
773	Boston Scientific Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,505
860	Boston Scientific Corp	Goldman Sachs	1,797
486	Boston Scientific Corp	Morgan Stanley	472
1,182	Box Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(2,778)
2,125	Box Inc 'A'	Goldman Sachs	(4,994)
2,079	Box Inc 'A'	Morgan Stanley	(3,202)
722	Boyd Gaming Corp	Morgan Stanley	(975)
699	Brandywine Realty Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	7
176	Brandywine Realty Trust (REIT)	Goldman Sachs	2
(12)	Braze Inc 'A'	Goldman Sachs	(3)
406	Bread Financial Holdings Inc	Goldman Sachs	(207)
160	Bridgebio Pharma Inc	Bank of America Merrill Lynch	(221)
107	Bridgebio Pharma Inc	Goldman Sachs	(148)
295	Brigham Minerals Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(260)
328	Brigham Minerals Inc 'A'	Goldman Sachs	(289)
(443)	Bright Horizons Family Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,113
(490)	Bright Horizons Family Solutions Inc	Morgan Stanley	691
396	Brighthouse Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(337)
1,872	Brighthouse Financial Inc	Goldman Sachs	(1,591)
1,002	Brighthouse Financial Inc	Morgan Stanley	(1,643)
(872)	Brightsphere Investment Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	366
(735)	Brightsphere Investment Group Inc	Goldman Sachs	309

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(71)	BrightSpire Capital Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	25
(100)	BrightSpire Capital Inc (REIT)	Goldman Sachs	35
(30)	Brinker International Inc	Bank of America Merrill Lynch	50
(305)	Brinker International Inc	Goldman Sachs	503
(56)	Brink's Co	Bank of America Merrill Lynch	87
(7)	Brink's Co	Goldman Sachs	11
(313)	Bristow Group Inc	Goldman Sachs	463
(265)	Broadcom Inc	Bank of America Merrill Lynch	662
(49)	Broadcom Inc	Goldman Sachs	365
(533)	Broadcom Inc	Morgan Stanley	4,746
(300)	Broadmark Realty Capital Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	354
(4,046)	Broadmark Realty Capital Inc (REIT)	Goldman Sachs	4,774
3,529	Brookdale Senior Living Inc	Goldman Sachs	(7,129)
(553)	BRP Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(946)
(523)	BRP Group Inc 'A'	Goldman Sachs	(894)
53	Bruker Corp	Bank of America Merrill Lynch	(184)
37	Bruker Corp	Goldman Sachs	(128)
898	Bruker Corp	Morgan Stanley	(2,622)
(439)	Brunswick Corp	Bank of America Merrill Lynch	619
(467)	Brunswick Corp	Goldman Sachs	1,149
(1,296)	Brunswick Corp	Morgan Stanley	1,076
87	Buckle Inc	Bank of America Merrill Lynch	262
400	Buckle Inc	Goldman Sachs	1,204
259	Builders FirstSource Inc	Bank of America Merrill Lynch	(546)
391	Builders FirstSource Inc	Goldman Sachs	(825)
693	Builders FirstSource Inc	Morgan Stanley	679
(1,139)	Bumble Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	3,406
(1,750)	Bumble Inc 'A'	Goldman Sachs	2,539
(3,534)	Bumble Inc 'A'	Morgan Stanley	(2,474)
(175)	Bunge Ltd	Morgan Stanley	(543)
(546)	Burlington Stores Inc	Bank of America Merrill Lynch	(16,202)
(355)	Burlington Stores Inc	Morgan Stanley	496
(848)	Butterfly Network Inc	Bank of America Merrill Lynch	135
(3,412)	Butterfly Network Inc	Goldman Sachs	2,337
311	Byline Bancorp Inc	Goldman Sachs	(187)
(212)	C3.ai Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	416
(228)	C3.ai Inc 'A'	Goldman Sachs	269
55	C4 Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(85)
(24)	Cable One Inc	Bank of America Merrill Lynch	409
(19)	Cable One Inc	Goldman Sachs	324
(37)	Cable One Inc	Morgan Stanley	289
(392)	Cabot Corp	Goldman Sachs	286
(411)	Cabot Corp	Morgan Stanley	682
38	CACI International Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	617
438	CACI International Inc 'A'	Goldman Sachs	7,113

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
53	CACI International Inc 'A'	Morgan Stanley	(75)
(231)	Cactus Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	182
(102)	Cactus Inc 'A'	Goldman Sachs	(17)
(144)	Cactus Inc 'A'	Morgan Stanley	163
(491)	Cadence Bank	Bank of America Merrill Lynch	511
(565)	Cadence Bank	Morgan Stanley	412
21	Cadence Design Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(80)
137	Cadence Design Systems Inc	Goldman Sachs	(271)
14	Cadence Design Systems Inc	Morgan Stanley	(2)
(91)	Calavo Growers Inc	Bank of America Merrill Lynch	233
(80)	Calavo Growers Inc	Goldman Sachs	205
(115)	Caleres Inc	Bank of America Merrill Lynch	405
(164)	Caleres Inc	Goldman Sachs	577
(738)	California Resources Corp	Goldman Sachs	1,830
(151)	California Water Service Group	Bank of America Merrill Lynch	(35)
(125)	California Water Service Group	Goldman Sachs	45
(766)	Calix Inc	Bank of America Merrill Lynch	128
(412)	Calix Inc	Goldman Sachs	105
(432)	Calix Inc	Morgan Stanley	244
(207)	Callon Petroleum Co	Goldman Sachs	667
53	Cal-Maine Foods Inc	Bank of America Merrill Lynch	209
49	Cal-Maine Foods Inc	Goldman Sachs	35
(37)	Canadian Solar Inc	Goldman Sachs	61
(683)	Canadian Solar Inc	Morgan Stanley	649
416	Cannae Holdings Inc	Goldman Sachs	(1,107)
(623)	Cano Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	187
(2,572)	Cano Health Inc	Goldman Sachs	479
793	Capital City Bank Group Inc	Goldman Sachs	(547)
63	Capital One Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(20)
472	Capital One Financial Corp	Goldman Sachs	(1,728)
468	Capital One Financial Corp	Morgan Stanley	(1,001)
(83)	Capri Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(132)
51	Cara Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	1
797	Cara Therapeutics Inc	Goldman Sachs	16
311	Cardinal Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,241
384	Cardinal Health Inc	Goldman Sachs	1,532
1,271	Cardinal Health Inc	Morgan Stanley	(737)
624	Cardiovascular Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(846)
1,186	Cardiovascular Systems Inc	Goldman Sachs	(1,607)
321	CareDx Inc	Bank of America Merrill Lynch	(442)
602	CareDx Inc	Goldman Sachs	(620)
291	CareTrust Inc (REIT)	Goldman Sachs	64
28	Cargurus Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4)
713	Cargurus Inc	Goldman Sachs	(1,676)
(328)	Caribou Biosciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	482

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(787)	Caribou Biosciences Inc	Goldman Sachs	605
190	Carlisle Cos Inc	Morgan Stanley	(315)
(479)	CarMax Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,965
(434)	CarMax Inc	Goldman Sachs	2,020
1,383	Carnival Corp	Morgan Stanley	118
(205)	Carpenter Technology Corp	Goldman Sachs	355
285	Carriage Services Inc	Goldman Sachs	(658)
(126)	Cars.com Inc	Bank of America Merrill Lynch	102
(304)	Cars.com Inc	Goldman Sachs	246
453	Carter's Inc	Bank of America Merrill Lynch	(618)
757	Carter's Inc	Goldman Sachs	(1,143)
2,608	Carter's Inc	Morgan Stanley	(7,589)
621	Casa Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(211)
1,420	Casa Systems Inc	Goldman Sachs	(483)
(12)	Cass Information Systems Inc	Goldman Sachs	13
318	Catalent Inc	Goldman Sachs	(134)
447	Catalent Inc	Morgan Stanley	3,107
443	Catalyst Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	310
(99)	Caterpillar Inc	Bank of America Merrill Lynch	73
(180)	Caterpillar Inc	Goldman Sachs	118
(609)	Caterpillar Inc	Morgan Stanley	2,272
(12)	Cathay General Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	1
(155)	Cathay General Bancorp	Goldman Sachs	193
68	Cavco Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	266
73	Cavco Industries Inc	Goldman Sachs	219
(57)	CBL & Associates Properties Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(68)
(10)	CBL & Associates Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	(20)
(547)	CCC Intelligent Solutions Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	109
(1,161)	CCC Intelligent Solutions Holdings Inc	Goldman Sachs	232
(31)	Celanese Corp	Goldman Sachs	(2)
(384)	Celanese Corp	Morgan Stanley	465
(103)	Celldex Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	3
(699)	Celldex Therapeutics Inc	Goldman Sachs	878
(424)	Celsius Holdings Inc	Morgan Stanley	(5,669)
(95)	Centene Corp	Bank of America Merrill Lynch	(324)
(164)	Centene Corp	Goldman Sachs	(815)
(555)	Centene Corp	Morgan Stanley	(932)
(3,824)	CenterPoint Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,212)
(3,623)	CenterPoint Energy Inc	Goldman Sachs	(2,989)
(1,577)	CenterPoint Energy Inc	Morgan Stanley	133
(126)	Centerspace (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	328
(110)	Centerspace (REIT)	Goldman Sachs	286
100	Central Garden & Pet Co 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(385)
18	Central Garden & Pet Co 'A'	Goldman Sachs	(69)
(127)	Centrus Energy Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	259

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(575)	Centrus Energy Corp 'A'	Goldman Sachs	1,239
292	Cerence Inc	Bank of America Merrill Lynch	263
118	Cerence Inc	Goldman Sachs	106
(193)	Cerevel Therapeutics Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	187
(457)	Cerevel Therapeutics Holdings Inc	Goldman Sachs	443
(70)	Ceridian HCM Holding Inc	Bank of America Merrill Lynch	341
(36)	Ceridian HCM Holding Inc	Morgan Stanley	26
250	Certara Inc	Bank of America Merrill Lynch	231
158	Certara Inc	Goldman Sachs	109
763	Cerus Corp	Bank of America Merrill Lynch	(272)
948	Cerus Corp	Goldman Sachs	(351)
551	CH Robinson Worldwide Inc	Bank of America Merrill Lynch	475
393	CH Robinson Worldwide Inc	Goldman Sachs	(11)
304	CH Robinson Worldwide Inc	Morgan Stanley	(106)
(350)	ChampionX Corp	Bank of America Merrill Lynch	462
(2,043)	ChampionX Corp	Goldman Sachs	2,545
(247)	ChampionX Corp	Morgan Stanley	296
(6,122)	ChargePoint Holdings Inc	Goldman Sachs	5,850
(1,574)	ChargePoint Holdings Inc	Morgan Stanley	84
61	Charles River Laboratories International Inc	Goldman Sachs	(561)
385	Charles River Laboratories International Inc	Morgan Stanley	(485)
(530)	Charles Schwab Corp	Bank of America Merrill Lynch	(822)
(312)	Charles Schwab Corp	Goldman Sachs	(484)
(372)	Charles Schwab Corp	Morgan Stanley	525
178	Chart Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,119
136	Chart Industries Inc	Goldman Sachs	1,652
429	Chart Industries Inc	Morgan Stanley	2,616
57	Chase Corp	Bank of America Merrill Lynch	(400)
57	Chase Corp	Goldman Sachs	(400)
1,381	Chatham Lodging Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	173
1,237	Chatham Lodging Trust (REIT)	Goldman Sachs	161
222	Check Point Software Technologies Ltd	Bank of America Merrill Lynch	69
366	Check Point Software Technologies Ltd	Goldman Sachs	54
336	Check Point Software Technologies Ltd	Morgan Stanley	(884)
405	Cheesecake Factory Inc	Goldman Sachs	(1,061)
1,601	Chegg Inc	Goldman Sachs	(897)
12	Chemed Corp	Bank of America Merrill Lynch	187
27	Chemed Corp	Goldman Sachs	422
22	Chemed Corp	Morgan Stanley	92
(798)	Chemours Co	Bank of America Merrill Lynch	2,657
(869)	Chemours Co	Goldman Sachs	2,894
(493)	Chemours Co	Morgan Stanley	1,356
372	Cheniere Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,162
434	Cheniere Energy Inc	Goldman Sachs	3,696

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
762	Cheniere Energy Inc	Morgan Stanley	1,369
891	Chesapeake Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,058
1,598	Chesapeake Energy Corp	Morgan Stanley	(1,934)
(23)	Chesapeake Utilities Corp	Bank of America Merrill Lynch	(88)
(18)	Chesapeake Utilities Corp	Goldman Sachs	(69)
90	Chewy Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(167)
399	Chewy Inc 'A'	Morgan Stanley	(28)
972	Chico's FAS Inc	Bank of America Merrill Lynch	(948)
2,471	Chico's FAS Inc	Goldman Sachs	(2,188)
(271)	Children's Place Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,014
(236)	Children's Place Inc	Goldman Sachs	883
2,673	Chimera Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(267)
337	Chimera Investment Corp (REIT)	Goldman Sachs	(34)
65	Chord Energy Corp	Goldman Sachs	(833)
22	Chord Energy Corp	Morgan Stanley	(70)
(20)	Chubb Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(35)
(183)	Chubb Ltd	Goldman Sachs	160
(82)	Chubb Ltd	Morgan Stanley	(7)
289	Chuy's Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(876)
85	Chuy's Holdings Inc	Goldman Sachs	(258)
14	Ciena Corp	Bank of America Merrill Lynch	(29)
187	Ciena Corp	Goldman Sachs	(387)
1,156	Ciena Corp	Morgan Stanley	(92)
126	Cigna Corp	Morgan Stanley	165
12	Cimpress Plc	Bank of America Merrill Lynch	(15)
204	Cimpress Plc	Goldman Sachs	(251)
912	Cinemark Holdings Inc	Goldman Sachs	356
(2,613)	Cipher Mining Inc	Goldman Sachs	350
1,106	Cirrus Logic Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,252)
854	Cirrus Logic Inc	Goldman Sachs	(5,006)
758	Cirrus Logic Inc	Morgan Stanley	(3,533)
(3,076)	Cisco Systems Inc	Morgan Stanley	12
649	Citigroup Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,687)
536	Citigroup Inc	Goldman Sachs	(1,394)
316	Citigroup Inc	Morgan Stanley	(916)
(44)	City Holding Co	Bank of America Merrill Lynch	(27)
(130)	City Holding Co	Goldman Sachs	(81)
(356)	Civitas Resources Inc	Morgan Stanley	445
(10,321)	Clarivate Plc	Bank of America Merrill Lynch	7,669
(3,392)	Clarivate Plc	Goldman Sachs	2,772
(3,488)	Clarivate Plc	Morgan Stanley	34
(280)	Clarus Corp	Goldman Sachs	238
1,777	Clean Energy Fuels Corp	Goldman Sachs	(1,724)
1,845	Clear Channel Outdoor Holdings Inc	Goldman Sachs	(526)
(595)	Clear Secure Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,369)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(199)	Clear Secure Inc 'A'	Morgan Stanley	92
(22)	Clearfield Inc	Bank of America Merrill Lynch	(613)
(121)	Clearfield Inc	Goldman Sachs	(3,674)
59	Clearwater Paper Corp	Bank of America Merrill Lynch	12
245	Clearwater Paper Corp	Goldman Sachs	147
111	Clearway Energy Inc 'A'	Goldman Sachs	(24)
2,716	Clearway Energy Inc 'C'	Goldman Sachs	(1,008)
1,807	Clearway Energy Inc 'C'	Morgan Stanley	(2,186)
(5,068)	Cleveland-Cliffs Inc	Bank of America Merrill Lynch	(448)
(4,905)	Cleveland-Cliffs Inc	Goldman Sachs	2,060
(6,723)	Cleveland-Cliffs Inc	Morgan Stanley	3,468
(35)	Clorox Co	Bank of America Merrill Lynch	(61)
(194)	Clorox Co	Goldman Sachs	(336)
(610)	Cloudflare Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	6,332
(458)	Cloudflare Inc 'A'	Goldman Sachs	4,067
(668)	Cloudflare Inc 'A'	Morgan Stanley	(701)
188	Clover Health Investments Corp	Bank of America Merrill Lynch	(44)
628	Clover Health Investments Corp	Goldman Sachs	(128)
2	Clovis Oncology Inc	Goldman Sachs	-
369	CNO Financial Group Inc	Goldman Sachs	140
2,234	Codexis Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,620)
2,551	Codexis Inc	Goldman Sachs	(3,604)
1,978	Coeur Mining Inc	Bank of America Merrill Lynch	(287)
1,005	Coeur Mining Inc	Goldman Sachs	(146)
(114)	Cogent Communications Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	136
(78)	Cogent Communications Holdings Inc	Goldman Sachs	101
789	Cognizant Technology Solutions Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(292)
133	Cognizant Technology Solutions Corp 'A'	Goldman Sachs	(49)
279	Cognizant Technology Solutions Corp 'A'	Morgan Stanley	100
(261)	Cognyte Software Ltd	Bank of America Merrill Lynch	108
(131)	Coherent Corp	Bank of America Merrill Lynch	235
(53)	Coherent Corp	Goldman Sachs	163
(226)	Coherent Corp	Morgan Stanley	262
150	Coherus Biosciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	(192)
2,394	Coherus Biosciences Inc	Goldman Sachs	(3,064)
(13)	Cohu Inc	Bank of America Merrill Lynch	-
(76)	Cohu Inc	Goldman Sachs	170
2,215	Colgate-Palmolive Co	Bank of America Merrill Lynch	1,415
792	Colgate-Palmolive Co	Goldman Sachs	447
1,378	Colgate-Palmolive Co	Morgan Stanley	(503)
(42)	Columbia Banking System Inc	Bank of America Merrill Lynch	34
(111)	Columbia Banking System Inc	Goldman Sachs	152
(295)	Columbia Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	145
(279)	Columbia Financial Inc	Goldman Sachs	137

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(601)	Columbia Sportswear Co	Morgan Stanley	198
(679)	Comcast Corp 'A'	Goldman Sachs	(815)
(104)	Comcast Corp 'A'	Morgan Stanley	(1)
273	Commercial Metals Co	Bank of America Merrill Lynch	180
1,209	Commercial Metals Co	Goldman Sachs	798
569	Commercial Metals Co	Morgan Stanley	(432)
(147)	Community Bank System Inc	Goldman Sachs	313
635	Community Health Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(173)
1,163	Community Health Systems Inc	Goldman Sachs	(385)
(43)	Community Trust Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	6
(34)	Community Trust Bancorp Inc	Goldman Sachs	5
441	CommVault Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(660)
108	CommVault Systems Inc	Goldman Sachs	(149)
1,204	Comstock Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	(566)
214	Comstock Resources Inc	Goldman Sachs	(101)
(31)	Comtech Telecommunications Corp	Goldman Sachs	27
(214)	Concentrix Corp	Morgan Stanley	505
(542)	Conduent Inc	Bank of America Merrill Lynch	(27)
(743)	Conduent Inc	Goldman Sachs	(37)
(656)	Confluent Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1,752
(1,208)	Confluent Inc 'A'	Goldman Sachs	3,225
(434)	Confluent Inc 'A'	Morgan Stanley	(312)
627	ConnectOne Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(192)
659	ConnectOne Bancorp Inc	Goldman Sachs	(147)
(75)	Consensus Cloud Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	412
(54)	Consensus Cloud Solutions Inc	Goldman Sachs	296
(150)	Consolidated Communications Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	77
(37)	Constellation Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	(37)
(419)	Constellation Energy Corp	Goldman Sachs	(415)
(252)	Constellation Energy Corp	Morgan Stanley	449
50	Container Store Group Inc	Goldman Sachs	(11)
(8,309)	ContextLogic Inc 'A'	Goldman Sachs	1,107
26	Cooper Cos Inc	Morgan Stanley	18
891	Corcept Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(1,007)
(4,564)	Corebridge Financial Inc	Goldman Sachs	2,239
(7,616)	Corebridge Financial Inc	Morgan Stanley	4,036
209	CoreCivic Inc	Bank of America Merrill Lynch	291
86	CoreCivic Inc	Goldman Sachs	120
(1,781)	Corporate Office Properties Trust (REIT)	Goldman Sachs	358
(1,192)	Corteva Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,140
(889)	Corteva Inc	Goldman Sachs	1,325
(3,134)	Corteva Inc	Morgan Stanley	2,695
2	CorVel Corp	Goldman Sachs	(10)
170	Coterra Energy Inc	Goldman Sachs	(16)
(5,729)	Coty Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	917

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(8,398)	Coty Inc 'A'	Goldman Sachs	1,344
(7,470)	Coty Inc 'A'	Morgan Stanley	747
(816)	Couchbase Inc	Goldman Sachs	(69)
(877)	Coupa Software Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9,681)
(948)	Coupa Software Inc	Goldman Sachs	(8,064)
(1,440)	Coupa Software Inc	Morgan Stanley	(19,691)
(301)	Coursera Inc	Bank of America Merrill Lynch	214
(1,034)	Coursera Inc	Goldman Sachs	734
(727)	Cousins Properties Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(102)
(7,966)	Cousins Properties Inc (REIT)	Morgan Stanley	478
(111)	Crane Holdings Co	Goldman Sachs	288
(846)	Crane Holdings Co	Morgan Stanley	1,138
162	Credit Acceptance Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4,361)
39	Credit Acceptance Corp	Goldman Sachs	(1,310)
22	Credit Acceptance Corp	Morgan Stanley	(261)
(428)	Credo Technology Group Holding Ltd	Goldman Sachs	446
(522)	Crinetics Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	402
(222)	Crinetics Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	171
(24)	Crocs Inc	Bank of America Merrill Lynch	6
(170)	Cross Country Healthcare Inc	Bank of America Merrill Lynch	(272)
(285)	Cross Country Healthcare Inc	Goldman Sachs	(456)
38	CrossFirst Bankshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4)
494	CrossFirst Bankshares Inc	Goldman Sachs	(49)
171	CrowdStrike Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(5,277)
145	CrowdStrike Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	(4,843)
426	CrowdStrike Holdings Inc 'A'	Morgan Stanley	(8,903)
170	Crown Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	221
339	Crown Holdings Inc	Goldman Sachs	441
71	Crown Holdings Inc	Morgan Stanley	(109)
(105)	CryoPort Inc	Bank of America Merrill Lynch	293
(103)	CryoPort Inc	Goldman Sachs	287
(552)	CS Disco Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,551
(1,016)	CS Disco Inc	Goldman Sachs	2,855
(236)	CSG Systems International Inc	Bank of America Merrill Lynch	4
(459)	CSG Systems International Inc	Goldman Sachs	16
(5)	CSW Industrials Inc	Goldman Sachs	(3)
(853)	CSX Corp	Morgan Stanley	(60)
294	CubeSmart (REIT)	Goldman Sachs	(218)
(66)	Cullen/Frost Bankers Inc	Morgan Stanley	282
(501)	Cullinan Oncology Inc	Bank of America Merrill Lynch	251
(100)	Curo Group Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	37
(274)	Curtiss-Wright Corp	Goldman Sachs	(151)
(190)	Curtiss-Wright Corp	Morgan Stanley	403
(43)	Cutera Inc	Bank of America Merrill Lynch	(69)
(27)	Cutera Inc	Goldman Sachs	(42)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(98)	CVB Financial Corp	Goldman Sachs	(25)
(308)	CVB Financial Corp	Morgan Stanley	163
(28)	Cytek Biosciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1)
(458)	Cytek Biosciences Inc	Goldman Sachs	1,095
67	Cytokinetics Inc	Goldman Sachs	17
106	Cytokinetics Inc	Morgan Stanley	100
235	Dana Inc	Goldman Sachs	(378)
318	Danaher Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,378)
490	Danaher Corp	Goldman Sachs	(2,991)
296	Danaher Corp	Morgan Stanley	436
31	Darling Ingredients Inc	Goldman Sachs	1
180	Darling Ingredients Inc	Morgan Stanley	(260)
(255)	Datadog Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	2,481
(177)	Datadog Inc 'A'	Goldman Sachs	1,941
(237)	Datadog Inc 'A'	Morgan Stanley	114
94	DaVita Inc	Bank of America Merrill Lynch	(82)
85	DaVita Inc	Morgan Stanley	(116)
278	Deckers Outdoor Corp	Bank of America Merrill Lynch	10,939
69	Deckers Outdoor Corp	Goldman Sachs	1,075
187	Deckers Outdoor Corp	Morgan Stanley	3,069
(120)	Deere & Co	Goldman Sachs	(3,373)
569	Delek US Holdings Inc	Goldman Sachs	(1,189)
(1,785)	Delta Air Lines Inc	Morgan Stanley	(161)
448	Deluxe Corp	Goldman Sachs	(605)
(326)	DermTech Inc	Bank of America Merrill Lynch	(36)
(1,098)	DermTech Inc	Goldman Sachs	(121)
(160)	Diamondback Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	553
99	DiamondRock Hospitality Co (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	6
304	DiamondRock Hospitality Co (REIT)	Goldman Sachs	47
(1,712)	Diebold Nixdorf Inc	Goldman Sachs	1,147
(145)	Digi International Inc	Bank of America Merrill Lynch	120
(321)	Digi International Inc	Goldman Sachs	266
95	Digital Realty Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	(316)
172	Digital Realty Trust Inc (REIT)	Morgan Stanley	(165)
(47)	Digital Turbine Inc	Bank of America Merrill Lynch	14
(99)	Digital Turbine Inc	Goldman Sachs	(43)
(353)	DigitalBridge Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	508
(681)	DigitalBridge Group Inc	Goldman Sachs	981
(31)	Dillard's Inc 'A'	Morgan Stanley	200
64	Dime Community Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	(74)
39	Dime Community Bancshares Inc	Goldman Sachs	(45)
(90)	Dine Brands Global Inc	Goldman Sachs	(12)
(1,369)	DISH Network Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	739
(996)	DISH Network Corp 'A'	Morgan Stanley	(20)
2,288	Diversified Healthcare Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(464)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
872	Diversified Healthcare Trust (REIT)	Goldman Sachs	(177)
(12)	DMC Global Inc	Bank of America Merrill Lynch	27
(200)	DMC Global Inc	Goldman Sachs	450
(93)	DocGo Inc	Bank of America Merrill Lynch	107
(708)	DocGo Inc	Goldman Sachs	814
117	DocuSign Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,031)
1,242	DocuSign Inc	Morgan Stanley	807
311	Dolby Laboratories Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	563
495	Dolby Laboratories Inc 'A'	Goldman Sachs	741
554	Dolby Laboratories Inc 'A'	Morgan Stanley	1,385
(4,994)	Doma Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	301
(7,455)	Doma Holdings Inc	Goldman Sachs	450
113	Domino's Pizza Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,903
423	Domino's Pizza Inc	Goldman Sachs	6,961
208	Domino's Pizza Inc	Morgan Stanley	1,595
1,034	Donegal Group Inc 'A'	Goldman Sachs	(579)
(20)	Donnelley Financial Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	-
(285)	Donnelley Financial Solutions Inc	Goldman Sachs	322
(1,172)	DoorDash Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	5,029
(211)	DoorDash Inc 'A'	Goldman Sachs	901
(506)	DoorDash Inc 'A'	Morgan Stanley	(951)
310	Dorian LPG Ltd	Bank of America Merrill Lynch	115
566	Dorian LPG Ltd	Goldman Sachs	209
(2,601)	Douglas Elliman Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,014
(2,929)	Douglas Elliman Inc	Goldman Sachs	1,142
(62)	Dow Inc	Bank of America Merrill Lynch	111
(249)	Dow Inc	Goldman Sachs	446
(2,762)	Dow Inc	Morgan Stanley	4,861
(236)	Doximity Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	66
(76)	Doximity Inc 'A'	Goldman Sachs	21
(478)	Doximity Inc 'A'	Morgan Stanley	(492)
(763)	DR Horton Inc	Bank of America Merrill Lynch	732
(407)	DR Horton Inc	Morgan Stanley	(224)
(929)	DraftKings Inc 'A'	Morgan Stanley	-
(9)	Driven Brands Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	14
(140)	Driven Brands Holdings Inc	Goldman Sachs	225
221	Dropbox Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(75)
623	Dropbox Inc 'A'	Goldman Sachs	(212)
470	Dropbox Inc 'A'	Morgan Stanley	99
(139)	DTE Midstream LLC	Bank of America Merrill Lynch	68
(951)	Duck Creek Technologies Inc	Goldman Sachs	1,284
532	Duckhorn Portfolio Inc	Bank of America Merrill Lynch	670
854	Duckhorn Portfolio Inc	Goldman Sachs	1,076
148	Ducommun Inc	Bank of America Merrill Lynch	(284)
290	Ducommun Inc	Goldman Sachs	(557)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(127)	Duke Energy Corp	Morgan Stanley	(85)
(4,246)	Dun & Bradstreet Holdings Inc	Morgan Stanley	531
(570)	Duolingo Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,491
(407)	Duolingo Inc	Morgan Stanley	436
351	DXP Enterprises Inc	Goldman Sachs	(407)
189	Dynatrace Inc	Bank of America Merrill Lynch	(321)
101	Dynatrace Inc	Goldman Sachs	(172)
259	Dynatrace Inc	Morgan Stanley	145
857	Dyne Therapeutics Inc	Goldman Sachs	1,217
(702)	Dynex Capital Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	28
(1,021)	Dynex Capital Inc (REIT)	Goldman Sachs	41
(686)	E2open Parent Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	442
(2,187)	E2open Parent Holdings Inc	Goldman Sachs	1,430
247	Eagle Bulk Shipping Inc	Bank of America Merrill Lynch	(585)
30	Eagle Bulk Shipping Inc	Goldman Sachs	(31)
(65)	Eagle Materials Inc	Morgan Stanley	198
40	Eagle Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(68)
99	Eagle Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(161)
(402)	Eastern Bankshares Inc	Goldman Sachs	52
(38)	EastGroup Properties Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	212
(277)	EastGroup Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	1,369
(351)	EastGroup Properties Inc (REIT)	Morgan Stanley	1,931
25	Eastman Chemical Co	Morgan Stanley	(38)
(6,849)	Eastman Kodak Co	Goldman Sachs	4,178
1,003	eBay Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,486)
829	eBay Inc	Goldman Sachs	(2,512)
9,480	eBay Inc	Morgan Stanley	(10,535)
21	Ebix Inc	Bank of America Merrill Lynch	(160)
604	EchoStar Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(499)
1,029	EchoStar Corp 'A'	Goldman Sachs	(919)
1,826	Ecovyst Inc	Bank of America Merrill Lynch	396
3,943	Ecovyst Inc	Goldman Sachs	862
(36)	Edgewell Personal Care Co	Bank of America Merrill Lynch	(53)
(777)	Edgewell Personal Care Co	Goldman Sachs	(1,134)
(309)	Edgio Inc	Bank of America Merrill Lynch	(23)
671	Editas Medicine Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,174)
864	Editas Medicine Inc	Goldman Sachs	(2,799)
2,162	Edwards Lifesciences Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,417)
1,688	Edwards Lifesciences Corp	Goldman Sachs	(1,363)
1,233	Edwards Lifesciences Corp	Morgan Stanley	922
(859)	El Pollo Loco Holdings Inc	Goldman Sachs	490
290	Elanco Animal Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	(131)
374	Elanco Animal Health Inc	Morgan Stanley	(45)
(39)	Elastic NV	Bank of America Merrill Lynch	(90)
17	Electronic Arts Inc	Bank of America Merrill Lynch	(21)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
116	Electronic Arts Inc	Goldman Sachs	(27)
44	Elevance Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	138
17	Elevance Health Inc	Goldman Sachs	62
177	Elevance Health Inc	Morgan Stanley	2,012
69	elf Beauty Inc	Bank of America Merrill Lynch	148
502	elf Beauty Inc	Goldman Sachs	1,067
99	Eli Lilly & Co	Bank of America Merrill Lynch	1,177
398	Eli Lilly & Co	Goldman Sachs	5,060
439	Eli Lilly & Co	Morgan Stanley	1,637
(103)	Elme Communities (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(4)
(195)	Elme Communities (REIT)	Goldman Sachs	(7)
(20)	Embecta Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4)
(1,012)	Embecta Corp	Goldman Sachs	805
(456)	EMCOR Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	901
(266)	EMCOR Group Inc	Goldman Sachs	414
(457)	EMCOR Group Inc	Morgan Stanley	1,442
77	Emergent BioSolutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	(126)
779	Emergent BioSolutions Inc	Goldman Sachs	(1,270)
(1,317)	Empire State Realty Trust Inc 'A' (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(86)
(1,545)	Empire State Realty Trust Inc 'A' (REIT)	Goldman Sachs	10
3	Enanta Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(13)
140	Enanta Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(629)
(1,302)	Encompass Health Corp	Goldman Sachs	312
(1,242)	Encompass Health Corp	Morgan Stanley	99
(269)	Encore Capital Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	140
(399)	Encore Capital Group Inc	Goldman Sachs	207
(3)	Encore Wire Corp	Goldman Sachs	(5)
(575)	Endeavor Group Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	(48)
(1,454)	Endeavor Group Holdings Inc 'A'	Morgan Stanley	107
(109)	Energizer Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(62)
(298)	Energizer Holdings Inc	Goldman Sachs	(276)
321	Energy Recovery Inc	Goldman Sachs	266
(400)	Energy Vault Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(25)
(155)	Energy Vault Holdings Inc	Goldman Sachs	137
(324)	EnerSys	Goldman Sachs	1,779
(347)	Enhabit Inc	Bank of America Merrill Lynch	(20)
(401)	Enhabit Inc	Goldman Sachs	(7)
38	Ennis Inc	Bank of America Merrill Lynch	8
73	Ennis Inc	Goldman Sachs	16
7	Enova International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4)
77	Enova International Inc	Goldman Sachs	(46)
43	Enovis Corp	Goldman Sachs	(85)
(386)	Enovix Corp	Bank of America Merrill Lynch	643
(1,181)	Enovix Corp	Goldman Sachs	2,634

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(22)	EnPro Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	163
(51)	EnPro Industries Inc	Goldman Sachs	473
(48)	Ensign Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(34)
(78)	Ensign Group Inc	Goldman Sachs	(55)
50	Entegris Inc	Bank of America Merrill Lynch	(225)
28	Entegris Inc	Morgan Stanley	(35)
(99)	Entergy Corp	Bank of America Merrill Lynch	(380)
(361)	Entergy Corp	Goldman Sachs	(1,386)
(434)	Entergy Corp	Morgan Stanley	(295)
(80)	Enterprise Financial Services Corp	Bank of America Merrill Lynch	80
(152)	Enterprise Financial Services Corp	Goldman Sachs	152
416	Envista Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(586)
847	Envista Holdings Corp	Goldman Sachs	(1,428)
523	Envista Holdings Corp	Morgan Stanley	(518)
394	EOG Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,895)
500	EOG Resources Inc	Goldman Sachs	(931)
368	EOG Resources Inc	Morgan Stanley	(673)
13	EPAM Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	46
(1,972)	EQRx Inc	Goldman Sachs	177
12	Equinix Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	198
63	Equinix Inc (REIT)	Goldman Sachs	1,037
112	Equinix Inc (REIT)	Morgan Stanley	1,590
(2,724)	Equitable Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(105)
(1,637)	Equitable Holdings Inc	Goldman Sachs	62
(2,852)	Equitable Holdings Inc	Morgan Stanley	2,494
(1,526)	Equitrans Midstream Corp	Goldman Sachs	137
345	Erie Indemnity Co 'A'	Bank of America Merrill Lynch	2,964
107	Erie Indemnity Co 'A'	Goldman Sachs	919
86	Erie Indemnity Co 'A'	Morgan Stanley	75
(76)	Esab Corp	Bank of America Merrill Lynch	(287)
(56)	Esab Corp	Goldman Sachs	41
(93)	ESCO Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(387)
(121)	ESCO Technologies Inc	Goldman Sachs	(501)
(2,194)	ESS Tech Inc	Goldman Sachs	1,605
442	Essent Group Ltd	Goldman Sachs	(299)
(318)	Essential Utilities Inc	Bank of America Merrill Lynch	(116)
(302)	Essential Utilities Inc	Goldman Sachs	5
(164)	Essential Utilities Inc	Morgan Stanley	172
453	Essex Property Trust Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(67)
59	Essex Property Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	(41)
656	Essex Property Trust Inc (REIT)	Morgan Stanley	(1,332)
121	Ethan Allen Interiors Inc	Bank of America Merrill Lynch	(295)
893	Ethan Allen Interiors Inc	Goldman Sachs	(2,241)
(90)	European Wax Center Inc 'A'	Goldman Sachs	(22)
2,599	Eventbrite Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,118)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
811	Eventbrite Inc 'A'	Goldman Sachs	(349)
152	Everbridge Inc	Bank of America Merrill Lynch	(277)
201	Everbridge Inc	Goldman Sachs	(380)
(242)	Evercore Inc 'A'	Goldman Sachs	1,181
(395)	Evercore Inc 'A'	Morgan Stanley	205
115	Evergy Inc	Goldman Sachs	(104)
36	Evergy Inc	Morgan Stanley	(25)
1,138	Everi Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,031)
1,790	Everi Holdings Inc	Goldman Sachs	(1,595)
(18)	EVERTEC Inc	Goldman Sachs	37
(582)	Evolus Inc	Bank of America Merrill Lynch	279
(760)	Evolus Inc	Goldman Sachs	365
(2,612)	Evolv Technologies Holdings Inc	Goldman Sachs	793
1,249	EW Scripps Co 'A'	Goldman Sachs	(674)
757	Exelixis Inc	Bank of America Merrill Lynch	(136)
548	Exelixis Inc	Goldman Sachs	(99)
1,325	Exelixis Inc	Morgan Stanley	(663)
(88)	ExlService Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	45
(98)	ExlService Holdings Inc	Goldman Sachs	50
(169)	ExlService Holdings Inc	Morgan Stanley	762
2,149	eXp World Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,666)
1,696	eXp World Holdings Inc	Goldman Sachs	(2,101)
204	Expedia Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	541
418	Expedia Group Inc	Goldman Sachs	1,191
560	Expedia Group Inc	Morgan Stanley	1,294
63	Expensify Inc 'A'	Goldman Sachs	(81)
150	Exponent Inc	Bank of America Merrill Lynch	(140)
147	Exponent Inc	Goldman Sachs	(135)
(459)	Expro Group Holdings NV	Bank of America Merrill Lynch	767
(857)	Expro Group Holdings NV	Goldman Sachs	1,431
(885)	Extra Space Storage Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	887
(213)	Extra Space Storage Inc (REIT)	Goldman Sachs	226
(102)	Extra Space Storage Inc (REIT)	Morgan Stanley	301
(80)	F45 Training Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	58
(3,933)	F45 Training Holdings Inc	Goldman Sachs	1,227
(31)	Fabrinet	Bank of America Merrill Lynch	19
(93)	Fabrinet	Goldman Sachs	55
(143)	Fabrinet	Morgan Stanley	419
248	FactSet Research Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,194
28	FactSet Research Systems Inc	Goldman Sachs	283
36	FactSet Research Systems Inc	Morgan Stanley	(73)
13	Fair Isaac Corp	Morgan Stanley	160
(1,599)	Farfetch Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	3,174
(2,219)	Farfetch Ltd 'A'	Goldman Sachs	2,473
(2,902)	Farfetch Ltd 'A'	Morgan Stanley	(2,162)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(75)	Farmland Partners Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	46
(468)	Farmland Partners Inc (REIT)	Goldman Sachs	171
167	Fastenal Co	Morgan Stanley	(418)
292	Fate Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(680)
344	Fate Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(802)
302	FB Financial Corp	Goldman Sachs	(535)
27	Federal Agricultural Mortgage Corp 'C'	Goldman Sachs	18
(411)	Federal Realty Investment Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(575)
(205)	Federal Realty Investment Trust (REIT)	Goldman Sachs	(295)
(489)	Federal Signal Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,293
(14)	Federal Signal Corp	Goldman Sachs	38
322	FedEx Corp	Bank of America Merrill Lynch	505
169	FedEx Corp	Goldman Sachs	209
296	FedEx Corp	Morgan Stanley	651
1,246	FibroGen Inc	Goldman Sachs	(436)
(475)	Fidelity National Financial Inc	Goldman Sachs	492
(237)	Fidelity National Financial Inc	Morgan Stanley	389
870	Fidelity National Information Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,590
1,046	Fidelity National Information Services Inc	Goldman Sachs	5,342
165	Fidelity National Information Services Inc	Morgan Stanley	551
(510)	Figs Inc 'A'	Goldman Sachs	(281)
119	First Advantage Corp	Bank of America Merrill Lynch	(24)
327	First Advantage Corp	Goldman Sachs	(65)
(6)	First BanCorp	Bank of America Merrill Lynch	5
(45)	First BanCorp	Bank of America Merrill Lynch	23
(2,134)	First BanCorp	Goldman Sachs	1,110
(58)	First BanCorp	Goldman Sachs	20
419	First Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	(457)
788	First Bancshares Inc	Goldman Sachs	(859)
(59)	First Citizens BancShares Inc 'A'	Morgan Stanley	1,374
(278)	First Financial Bankshares Inc	Goldman Sachs	792
(58)	First Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	53
(31)	First Financial Corp	Goldman Sachs	28
1,516	First Foundation Inc	Goldman Sachs	(2,577)
(158)	First Hawaiian Inc	Goldman Sachs	60
(382)	First Merchants Corp	Bank of America Merrill Lynch	198
(1,022)	First Merchants Corp	Goldman Sachs	615
315	First of Long Island Corp	Bank of America Merrill Lynch	321
464	First of Long Island Corp	Goldman Sachs	473
23	First Solar Inc	Goldman Sachs	(115)
163	First Solar Inc	Morgan Stanley	(111)
(58)	FirstCash Holdings Inc	Goldman Sachs	3
(731)	FirstEnergy Corp	Goldman Sachs	(1,360)
(1,648)	FirstEnergy Corp	Morgan Stanley	(1,697)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(524)	Fiserv Inc	Bank of America Merrill Lynch	(514)
(409)	Fiserv Inc	Goldman Sachs	(54)
(423)	Fiserv Inc	Morgan Stanley	(88)
365	Fiverr International Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,045)
56	Fiverr International Ltd	Goldman Sachs	(142)
1,896	Flex Ltd	Bank of America Merrill Lynch	769
547	Flex Ltd	Goldman Sachs	450
4,162	Flex Ltd	Morgan Stanley	(422)
2,009	Fluor Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,535)
3,110	Fluor Corp	Goldman Sachs	(2,610)
1,288	Fluor Corp	Morgan Stanley	(1,211)
187	Flushing Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(133)
650	Flushing Financial Corp	Goldman Sachs	(462)
(176)	FMC Corp	Goldman Sachs	235
(257)	FMC Corp	Morgan Stanley	270
(3,547)	FNB Corp	Bank of America Merrill Lynch	620
(3,317)	FNB Corp	Goldman Sachs	273
(6,427)	FNB Corp	Morgan Stanley	2,120
(122)	Focus Financial Partners Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	416
19	Foot Locker Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7)
80	Foot Locker Inc	Goldman Sachs	230
8	Forrester Research Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4)
476	Forrester Research Inc	Goldman Sachs	(436)
53	Forward Air Corp	Bank of America Merrill Lynch	(305)
56	Forward Air Corp	Goldman Sachs	(322)
1,606	Fox Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1,301
5,347	Fox Corp 'A'	Goldman Sachs	4,841
3,546	Fox Corp 'A'	Morgan Stanley	2,613
761	Fox Corp 'B'	Bank of America Merrill Lynch	639
502	Fox Corp 'B'	Goldman Sachs	422
1,183	Fox Corp 'B'	Morgan Stanley	798
(26)	Fox Factory Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	89
(75)	Franchise Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	74
(329)	Franchise Group Inc	Goldman Sachs	207
248	Franklin Covey Co	Bank of America Merrill Lynch	395
310	Franklin Covey Co	Goldman Sachs	543
(1,633)	Franklin Resources Inc	Goldman Sachs	1,894
(1,998)	Franklin Resources Inc	Morgan Stanley	1,439
39	Fresh Del Monte Produce Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5)
(138)	Freshpet Inc	Bank of America Merrill Lynch	351
(149)	Freshpet Inc	Goldman Sachs	378
(1,265)	Freshworks Inc 'A'	Goldman Sachs	816
(3,041)	Freshworks Inc 'A'	Morgan Stanley	(3,573)
942	Frontdoor Inc	Goldman Sachs	(1,630)
(1,210)	Frontier Communications Parent Inc	Morgan Stanley	12

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
466	Frontier Group Holdings Inc	Goldman Sachs	(610)
174	FRP Holdings Inc	Goldman Sachs	52
(4,151)	FuelCell Energy Inc	Goldman Sachs	1,777
(692)	Fulton Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	269
(1,161)	Fulton Financial Corp	Goldman Sachs	538
(835)	Funko Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(75)
(1,900)	Funko Inc 'A'	Goldman Sachs	(220)
(159)	Futu Holdings Ltd ADR	Morgan Stanley	(800)
106	FutureFuel Corp	Bank of America Merrill Lynch	35
186	FutureFuel Corp	Goldman Sachs	11
(7,870)	Gannett Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(202)
(3,000)	Gannett Co Inc	Goldman Sachs	(15)
1,468	Gap Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,202
2,389	Gap Inc	Goldman Sachs	3,584
3,553	Gap Inc	Morgan Stanley	(1,172)
31	Garmin Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(92)
912	Garmin Ltd	Goldman Sachs	(1,495)
1,964	Garmin Ltd	Morgan Stanley	(1,770)
9	Gartner Inc	Goldman Sachs	(29)
82	Gartner Inc	Morgan Stanley	(171)
(182)	Gates Industrial Corp Plc	Bank of America Merrill Lynch	124
(117)	Gates Industrial Corp Plc	Goldman Sachs	80
(1,372)	Gen Digital Inc	Bank of America Merrill Lynch	399
(462)	Gen Digital Inc	Goldman Sachs	301
(949)	Gen Digital Inc	Morgan Stanley	1,063
137	Genco Shipping & Trading Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(226)
93	Genco Shipping & Trading Ltd	Goldman Sachs	(153)
(136)	Generac Holdings Inc	Goldman Sachs	350
(245)	Generac Holdings Inc	Morgan Stanley	685
615	General Electric Co	Bank of America Merrill Lynch	(1,334)
838	General Electric Co	Goldman Sachs	(1,468)
1,308	General Electric Co	Morgan Stanley	(3,420)
(409)	Generation Bio Co	Bank of America Merrill Lynch	454
(210)	Generation Bio Co	Goldman Sachs	233
(86)	Genesco Inc	Bank of America Merrill Lynch	(151)
(222)	Genesco Inc	Goldman Sachs	(389)
199	Gentex Corp	Bank of America Merrill Lynch	(137)
851	Gentex Corp	Goldman Sachs	(587)
1,490	Gentex Corp	Morgan Stanley	(834)
(6)	Gentherm Inc	Bank of America Merrill Lynch	27
(195)	Gentherm Inc	Goldman Sachs	881
(334)	Genuine Parts Co	Morgan Stanley	1,359
(132)	Genworth Financial Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(8)
(1,688)	Genworth Financial Inc 'A'	Goldman Sachs	(100)
(121)	German American Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	94

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(19)	German American Bancorp Inc	Goldman Sachs	15
(2,296)	Geron Corp	Bank of America Merrill Lynch	(172)
(491)	Geron Corp	Goldman Sachs	(37)
(286)	Getty Realty Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(106)
(199)	Getty Realty Corp (REIT)	Goldman Sachs	(59)
(1,033)	Gevo Inc	Goldman Sachs	439
155	Gibraltar Industries Inc	Goldman Sachs	(330)
(139)	Gitlab Inc 'A'	Goldman Sachs	1,243
(1,429)	Gitlab Inc 'A'	Morgan Stanley	(693)
(32)	Glacier Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	55
(704)	Glacier Bancorp Inc	Goldman Sachs	1,216
(136)	Gladstone Commercial Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	46
(185)	Gladstone Commercial Corp (REIT)	Goldman Sachs	93
(150)	Gladstone Land Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	84
(194)	Glatfelter Corp	Bank of America Merrill Lynch	(23)
(4)	Glaukos Corp	Bank of America Merrill Lynch	22
(55)	Glaukos Corp	Goldman Sachs	299
11	Global Indemnity Group LLC 'A'	Goldman Sachs	(12)
50	Global Medical Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	21
222	Global Medical Inc (REIT)	Goldman Sachs	91
543	Global Payments Inc	Bank of America Merrill Lynch	(613)
470	Global Payments Inc	Goldman Sachs	271
152	Global Payments Inc	Morgan Stanley	-
(145)	Global-e Online Ltd	Bank of America Merrill Lynch	829
(119)	Global-e Online Ltd	Goldman Sachs	681
(790)	Global-e Online Ltd	Morgan Stanley	(356)
(210)	GLOBALFOUNDRIES Inc	Goldman Sachs	805
(3,562)	Globalstar Inc	Bank of America Merrill Lynch	71
(37)	Globant SA	Bank of America Merrill Lynch	353
(19)	Globant SA	Goldman Sachs	316
(243)	Globant SA	Morgan Stanley	65
434	Globus Medical Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(117)
712	Globus Medical Inc 'A'	Goldman Sachs	(192)
120	Globus Medical Inc 'A'	Morgan Stanley	102
133	GMS Inc	Bank of America Merrill Lynch	(394)
172	GMS Inc	Goldman Sachs	(611)
(614)	GoDaddy Inc 'A'	Morgan Stanley	(571)
658	Golar LNG Ltd	Goldman Sachs	(612)
359	Golden Entertainment Inc	Bank of America Merrill Lynch	(72)
59	Golden Entertainment Inc	Goldman Sachs	(12)
1,479	GoodRx Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(884)
1,084	GoodRx Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	(627)
98	Goosehead Insurance Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(221)
155	Goosehead Insurance Inc 'A'	Goldman Sachs	(350)
4,766	GoPro Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(2,001)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
2,970	GoPro Inc 'A'	Goldman Sachs	(1,249)
372	Gossamer Bio Inc	Bank of America Merrill Lynch	(547)
391	Gossamer Bio Inc	Goldman Sachs	(575)
(5,712)	Grab Holdings Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1,314
(9,300)	Grab Holdings Ltd 'A'	Morgan Stanley	(126)
209	Graco Inc	Bank of America Merrill Lynch	(87)
49	Graco Inc	Goldman Sachs	(82)
(456)	GrafTech International Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(194)
(730)	GrafTech International Ltd	Goldman Sachs	(256)
(44)	Graham Holdings Co 'B'	Bank of America Merrill Lynch	186
(67)	Graham Holdings Co 'B'	Goldman Sachs	295
(109)	Grand Canyon Education Inc	Bank of America Merrill Lynch	36
(209)	Grand Canyon Education Inc	Goldman Sachs	6
(285)	Graphic Packaging Holding Co	Bank of America Merrill Lynch	(95)
(590)	Graphic Packaging Holding Co	Morgan Stanley	(24)
47	Gray Television Inc	Bank of America Merrill Lynch	(13)
545	Gray Television Inc	Goldman Sachs	(147)
56	Great Lakes Dredge & Dock Corp	Goldman Sachs	-
(14)	Green Dot Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	3
(16)	Green Dot Corp 'A'	Goldman Sachs	5
(142)	Green Plains Inc	Bank of America Merrill Lynch	564
(244)	Green Plains Inc	Goldman Sachs	887
(57)	Greif Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	325
(64)	Greif Inc 'A'	Goldman Sachs	353
(260)	Grid Dynamics Holdings Inc	Goldman Sachs	325
(10)	Griffon Corp	Bank of America Merrill Lynch	11
(105)	Griffon Corp	Goldman Sachs	1
599	Grocery Outlet Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	(651)
1,729	Grocery Outlet Holding Corp	Goldman Sachs	(2,281)
157	Grocery Outlet Holding Corp	Morgan Stanley	(160)
7	Group 1 Automotive Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1)
36	Group 1 Automotive Inc	Goldman Sachs	(5)
108	GrowGeneration Corp	Bank of America Merrill Lynch	(17)
(126)	Guardant Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	135
(42)	Guardant Health Inc	Goldman Sachs	45
(1,223)	Guardant Health Inc	Morgan Stanley	(3,852)
424	Guess? Inc	Bank of America Merrill Lynch	373
291	Guess? Inc	Goldman Sachs	256
138	Gulfport Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	(815)
201	Gulfport Energy Corp	Goldman Sachs	(1,107)
(956)	GXO Logistics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(15)
(125)	GXO Logistics Inc	Goldman Sachs	104
(791)	GXO Logistics Inc	Morgan Stanley	(1,250)
508	H&E Equipment Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,245)
668	H&E Equipment Services Inc	Goldman Sachs	(1,637)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
346	H&R Block Inc	Goldman Sachs	616
16	H&R Block Inc	Morgan Stanley	(9)
494	Hackett Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	20
281	Hackett Group Inc	Goldman Sachs	11
(203)	Hagerty Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(124)
(281)	Hagerty Inc 'A'	Goldman Sachs	(171)
422	Hain Celestial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,076)
576	Hain Celestial Group Inc	Goldman Sachs	(1,469)
317	Halliburton Co	Bank of America Merrill Lynch	(170)
906	Halliburton Co	Goldman Sachs	(879)
1,030	Halliburton Co	Morgan Stanley	127
(28)	Hamilton Lane Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	48
(22)	Hamilton Lane Inc 'A'	Goldman Sachs	13
(522)	Hancock Whitney Corp	Bank of America Merrill Lynch	680
(1,081)	Hancock Whitney Corp	Goldman Sachs	1,360
(1,001)	Hancock Whitney Corp	Morgan Stanley	1,535
655	Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(394)
429	Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital Inc (REIT)	Goldman Sachs	(270)
(290)	Harley-Davidson Inc	Bank of America Merrill Lynch	172
(581)	Harley-Davidson Inc	Goldman Sachs	825
(361)	Harley-Davidson Inc	Morgan Stanley	478
(166)	Harmonic Inc	Bank of America Merrill Lynch	(219)
(598)	Harmonic Inc	Goldman Sachs	(789)
14	Harmony Biosciences Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	29
446	Harmony Biosciences Holdings Inc	Goldman Sachs	928
630	Harsco Corp	Bank of America Merrill Lynch	41
1,365	Harsco Corp	Goldman Sachs	89
(325)	Hasbro Inc	Bank of America Merrill Lynch	193
(473)	Hasbro Inc	Goldman Sachs	276
(151)	Hasbro Inc	Morgan Stanley	(22)
(1,950)	HashiCorp Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1,186
(934)	HashiCorp Inc 'A'	Morgan Stanley	(1,793)
197	Haverty Furniture Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	(418)
886	Haverty Furniture Cos Inc	Goldman Sachs	(1,878)
(13)	Hawaiian Electric Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10)
(358)	Hawaiian Electric Industries Inc	Goldman Sachs	(298)
614	Hawaiian Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(841)
1,346	Hawaiian Holdings Inc	Goldman Sachs	(1,898)
(58)	HCI Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	293
(214)	HCI Group Inc	Goldman Sachs	1,083
236	Health Catalyst Inc	Goldman Sachs	(253)
(2,349)	Healthcare Realty Trust Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(543)
(2,676)	Healthcare Realty Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	(703)
(1,791)	Healthcare Realty Trust Inc (REIT)	Morgan Stanley	(549)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
529	Healthpeak Properties Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	190
2,878	Healthpeak Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	1,036
2,704	Healthpeak Properties Inc (REIT)	Morgan Stanley	433
89	Heartland Financial USA Inc	Goldman Sachs	(231)
393	HEICO Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,073)
417	HEICO Corp	Goldman Sachs	(1,140)
178	HEICO Corp	Morgan Stanley	(1,050)
154	HEICO Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(436)
447	HEICO Corp 'A'	Goldman Sachs	(1,265)
351	HEICO Corp 'A'	Morgan Stanley	(1,748)
170	Heidrick & Struggles International Inc	Bank of America Merrill Lynch	89
377	Heidrick & Struggles International Inc	Goldman Sachs	173
1,136	Helix Energy Solutions Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(579)
3,627	Helix Energy Solutions Group Inc	Goldman Sachs	(1,850)
(46)	Helmerich & Payne Inc	Morgan Stanley	7
278	Henry Schein Inc	Bank of America Merrill Lynch	171
211	Henry Schein Inc	Goldman Sachs	106
956	Henry Schein Inc	Morgan Stanley	(143)
218	Herbalife Nutrition Ltd	Bank of America Merrill Lynch	93
94	Herbalife Nutrition Ltd	Goldman Sachs	75
(301)	Heritage Commerce Corp	Bank of America Merrill Lynch	248
(288)	Heritage Commerce Corp	Goldman Sachs	257
(122)	Heritage Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	122
(109)	Heritage Financial Corp	Goldman Sachs	109
231	Heritage-Crystal Clean Inc	Bank of America Merrill Lynch	245
683	Heritage-Crystal Clean Inc	Goldman Sachs	724
1,941	Heron Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,116)
426	Heron Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(245)
(2,469)	Hertz Global Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,120
(1,465)	Hertz Global Holdings Inc	Morgan Stanley	73
5,320	Hewlett Packard Enterprise Co	Bank of America Merrill Lynch	1,702
1,227	Hewlett Packard Enterprise Co	Goldman Sachs	393
5,277	Hewlett Packard Enterprise Co	Morgan Stanley	1,055
291	Hexcel Corp	Bank of America Merrill Lynch	(81)
206	Hexcel Corp	Goldman Sachs	(103)
979	Hexcel Corp	Morgan Stanley	(1,684)
(218)	HF Sinclair Corp	Bank of America Merrill Lynch	340
(82)	HF Sinclair Corp	Goldman Sachs	271
(322)	HF Sinclair Corp	Morgan Stanley	782
(219)	Hibbett Inc	Goldman Sachs	604
(5,991)	Highwoods Properties Inc (REIT)	Morgan Stanley	1,138
(1,635)	Hillman Solutions Corp	Bank of America Merrill Lynch	196
(346)	Hillman Solutions Corp	Goldman Sachs	42
(595)	Hilton Grand Vacations Inc	Bank of America Merrill Lynch	(333)
(1,416)	Hilton Grand Vacations Inc	Goldman Sachs	(793)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(394)	Hilton Grand Vacations Inc	Morgan Stanley	(276)
(113)	Hims & Hers Health Inc	Goldman Sachs	49
6	Hingham Institution For Savings The	Bank of America Merrill Lynch	121
5	Hingham Institution For Savings The	Goldman Sachs	47
(149)	Hippo Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	9
(295)	Hippo Holdings Inc	Goldman Sachs	18
23	HireRight Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	55
(123)	HNI Corp	Goldman Sachs	242
(2,023)	Home BancShares Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,584
(1,754)	Home BancShares Inc	Goldman Sachs	726
(3,053)	Home BancShares Inc	Morgan Stanley	2,059
(3,464)	Honest Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,567
(1,615)	Honest Co Inc	Goldman Sachs	390
(43)	Honeywell International Inc	Bank of America Merrill Lynch	19
(142)	Honeywell International Inc	Goldman Sachs	602
(83)	Horace Mann Educators Corp	Goldman Sachs	(43)
632	Horizon Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(32)
679	Horizon Bancorp Inc	Goldman Sachs	(34)
(144)	Hostess Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	99
(1,459)	Hostess Brands Inc	Goldman Sachs	1,170
(232)	Houlihan Lokey Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,132
(182)	Houlihan Lokey Inc	Goldman Sachs	824
(418)	Houlihan Lokey Inc	Morgan Stanley	1,402
(193)	Hovnanian Enterprises Inc 'A'	Goldman Sachs	(276)
53	Howard Hughes Corp	Bank of America Merrill Lynch	83
51	Howard Hughes Corp	Goldman Sachs	80
259	HP Inc	Bank of America Merrill Lynch	(137)
2,083	HP Inc	Goldman Sachs	(1,910)
3,553	HP Inc	Morgan Stanley	(1,885)
62	Hub Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(226)
13	Hub Group Inc 'A'	Goldman Sachs	(47)
(415)	Hubbell Inc	Bank of America Merrill Lynch	(216)
165	HubSpot Inc	Bank of America Merrill Lynch	(791)
104	HubSpot Inc	Goldman Sachs	(1,351)
199	HubSpot Inc	Morgan Stanley	3,557
31	Hudson Pacific Properties Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(9)
1,255	Hudson Pacific Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	(364)
(113)	Humacyte Inc	Goldman Sachs	(5)
(5,202)	Huntington Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	433
(1,978)	Huntington Bancshares Inc	Goldman Sachs	202
(2,699)	Huntington Bancshares Inc	Morgan Stanley	351
3,588	Huntsman Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3,428)
4,818	Huntsman Corp	Goldman Sachs	(5,802)
1,272	Huntsman Corp	Morgan Stanley	(2,118)
(90)	Huron Consulting Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(255)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(115)	Huron Consulting Group Inc	Goldman Sachs	(325)
170	Hyatt Hotels Corp 'A'	Morgan Stanley	202
(1,108)	Hydrofarm Holdings Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	792
(2,016)	Hydrofarm Holdings Group Inc	Goldman Sachs	1,441
(141)	Hyllion Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	24
(1,990)	Hyllion Holdings Corp	Goldman Sachs	253
(188)	Hyster-Yale Materials Handling Inc	Bank of America Merrill Lynch	484
(126)	Hyster-Yale Materials Handling Inc	Goldman Sachs	333
138	I3 Verticals Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	301
(371)	IAA Inc	Goldman Sachs	1,833
(2,038)	IAA Inc	Morgan Stanley	3,322
(499)	IAC Inc	Morgan Stanley	(803)
(41)	ICF International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4)
(60)	ICF International Inc	Goldman Sachs	(3)
(242)	Ichor Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	695
(670)	Ichor Holdings Ltd	Goldman Sachs	1,923
118	ICON Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1,383)
127	ICON Plc	Goldman Sachs	(1,734)
157	ICON Plc	Morgan Stanley	(937)
25	ICU Medical Inc	Bank of America Merrill Lynch	(143)
18	ICU Medical Inc	Morgan Stanley	(49)
(137)	Ideaya Biosciences Inc	Goldman Sachs	(18)
(208)	IDEX Corp	Bank of America Merrill Lynch	149
(123)	IDEX Corp	Goldman Sachs	89
(289)	IDEX Corp	Morgan Stanley	1,133
522	IDT Corp 'B'	Bank of America Merrill Lynch	1,081
143	IDT Corp 'B'	Goldman Sachs	281
(50)	IES Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(90)
(31)	IES Holdings Inc	Goldman Sachs	(55)
61	IGM Biosciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	(285)
245	IGM Biosciences Inc	Goldman Sachs	(1,147)
(395)	iHeartMedia Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	506
(19)	Illumina Inc	Bank of America Merrill Lynch	625
(75)	Illumina Inc	Morgan Stanley	1,242
(1,368)	ImmunityBio Inc	Goldman Sachs	871
(663)	Immunovant Inc	Bank of America Merrill Lynch	60
(208)	Immunovant Inc	Goldman Sachs	19
(1)	Impinj Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10)
(159)	Impinj Inc	Goldman Sachs	(1,584)
40	Incyte Corp	Bank of America Merrill Lynch	50
402	Incyte Corp	Goldman Sachs	507
133	Incyte Corp	Morgan Stanley	(52)
(4,643)	Independence Realty Trust Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	1,707
(3,928)	Independence Realty Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	2,193
(3,855)	Independence Realty Trust Inc (REIT)	Morgan Stanley	814

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(44)	Independent Bank Corp	Bank of America Merrill Lynch	(61)
980	Independent Bank Corp	Bank of America Merrill Lynch	(647)
1,204	Independent Bank Corp	Goldman Sachs	(795)
(433)	Independent Bank Corp	Goldman Sachs	(567)
(105)	indie Semiconductor Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(105)
(1,076)	indie Semiconductor Inc 'A'	Goldman Sachs	968
(452)	Indus Realty Trust Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(3,856)
(293)	Indus Realty Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	(2,499)
357	Industrial Logistics Properties Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	36
443	Industrial Logistics Properties Trust (REIT)	Goldman Sachs	44
550	Infinera Corp	Bank of America Merrill Lynch	(182)
(112)	Ingersoll Rand Inc	Bank of America Merrill Lynch	304
63	Ingles Markets Inc 'A'	Goldman Sachs	207
(326)	Ingredion Inc	Bank of America Merrill Lynch	(727)
(189)	Ingredion Inc	Goldman Sachs	(421)
(315)	Ingredion Inc	Morgan Stanley	406
(236)	Inhibrx Inc	Bank of America Merrill Lynch	880
(195)	Inhibrx Inc	Goldman Sachs	685
(968)	Inmode Ltd	Goldman Sachs	2,217
(1,218)	Inmode Ltd	Morgan Stanley	(183)
(133)	Innospec Inc	Goldman Sachs	250
(555)	Innovative Industrial Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	(1,404)
(438)	Innovative Industrial Properties Inc (REIT)	Morgan Stanley	346
(1,718)	Innovid Corp	Bank of America Merrill Lynch	378
(224)	Innovid Corp	Goldman Sachs	49
1,260	Innoviva Inc	Goldman Sachs	(958)
170	Inovio Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(101)
(1,516)	Inseego Corp	Bank of America Merrill Lynch	373
(3,380)	Inseego Corp	Goldman Sachs	976
(63)	Insight Enterprises Inc	Goldman Sachs	44
201	Insmmed Inc	Bank of America Merrill Lynch	(96)
167	Insmmed Inc	Goldman Sachs	(79)
86	Insperty Inc	Bank of America Merrill Lynch	(112)
184	Insperty Inc	Goldman Sachs	(160)
125	Installed Building Products Inc	Bank of America Merrill Lynch	(104)
125	Installed Building Products Inc	Goldman Sachs	(215)
(167)	Insteel Industries Inc	Goldman Sachs	(159)
35	Intapp Inc	Goldman Sachs	(4)
(13)	Integer Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	2
(24)	Integer Holdings Corp	Goldman Sachs	7
970	Integra LifeSciences Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(320)
215	Integra LifeSciences Holdings Corp	Goldman Sachs	(71)
49	Integra LifeSciences Holdings Corp	Morgan Stanley	(18)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
243	Intel Corp	Bank of America Merrill Lynch	(140)
340	Intel Corp	Goldman Sachs	(809)
1,015	Intel Corp	Morgan Stanley	(1,512)
(192)	Interactive Brokers Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(730)
(405)	Interactive Brokers Group Inc 'A'	Goldman Sachs	(1,539)
(231)	Interactive Brokers Group Inc 'A'	Morgan Stanley	(529)
823	Intercept Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(907)
986	Intercept Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(1,193)
93	InterDigital Inc	Bank of America Merrill Lynch	(168)
173	InterDigital Inc	Goldman Sachs	(387)
(917)	Interface Inc	Goldman Sachs	459
(203)	International Bancshares Corp	Bank of America Merrill Lynch	164
(282)	International Bancshares Corp	Goldman Sachs	228
(393)	International Business Machines Corp	Bank of America Merrill Lynch	(865)
(365)	International Business Machines Corp	Goldman Sachs	(803)
(468)	International Flavors & Fragrances Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,806)
(251)	International Flavors & Fragrances Inc	Goldman Sachs	(969)
(272)	International Flavors & Fragrances Inc	Morgan Stanley	(530)
2,314	International Game Technology Plc	Morgan Stanley	(833)
746	International Paper Co	Bank of America Merrill Lynch	(148)
2,605	International Paper Co	Goldman Sachs	(1,728)
2,972	International Paper Co	Morgan Stanley	(2,387)
323	International Seaways Inc	Goldman Sachs	(547)
(638)	Interpublic Group of Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	(325)
(689)	Intra-Cellular Therapies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,771)
(111)	Intra-Cellular Therapies Inc	Goldman Sachs	(285)
(1,383)	Intra-Cellular Therapies Inc	Morgan Stanley	(498)
(16)	Intrepid Potash Inc	Bank of America Merrill Lynch	64
(20)	Intrepid Potash Inc	Goldman Sachs	56
(311)	InvenTrust Properties Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	120
(162)	InvenTrust Properties Corp (REIT)	Goldman Sachs	65
2,221	Invesco Ltd	Goldman Sachs	(1,910)
3,594	Invesco Ltd	Morgan Stanley	(2,588)
(394)	Invesco Mortgage Capital Inc (REIT)	Goldman Sachs	193
(1,187)	Invitation Homes Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	126
(159)	Invitation Homes Inc (REIT)	Goldman Sachs	17
(905)	Invitation Homes Inc (REIT)	Morgan Stanley	18
745	Ionis Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,174)
350	Ionis Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(988)
(651)	IonQ Inc	Bank of America Merrill Lynch	478
(351)	IonQ Inc	Goldman Sachs	159
(266)	Iovance Biotherapeutics Inc	Goldman Sachs	371
406	IPG Photonics Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3,630)
27	IPG Photonics Corp	Goldman Sachs	(241)
67	IPG Photonics Corp	Morgan Stanley	(267)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
50	IQVIA Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(583)
77	IQVIA Holdings Inc	Goldman Sachs	(897)
(318)	iRhythm Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	787
(264)	iRhythm Technologies Inc	Goldman Sachs	662
(76)	iRhythm Technologies Inc	Morgan Stanley	(207)
598	Ironwood Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	283
1,776	Ironwood Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	826
1,806	iStar Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(5,933)
1,448	iStar Inc (REIT)	Goldman Sachs	(4,587)
(20)	iTeos Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	1
(299)	Ituran Location and Control Ltd	Goldman Sachs	(141)
(127)	IVERIC bio Inc	Bank of America Merrill Lynch	(527)
(1,064)	IVERIC bio Inc	Goldman Sachs	(5,000)
151	Jabil Inc	Bank of America Merrill Lynch	260
595	Jabil Inc	Goldman Sachs	880
386	Jabil Inc	Morgan Stanley	(764)
(118)	Jack in the Box Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,844
(402)	Jack in the Box Inc	Goldman Sachs	6,283
66	Jackson Financial Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(29)
395	Jackson Financial Inc 'A'	Goldman Sachs	(313)
116	Jacobs Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	(353)
418	Jacobs Solutions Inc	Goldman Sachs	(1,313)
356	Jacobs Solutions Inc	Morgan Stanley	(655)
30	Jamf Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	(100)
938	Jamf Holding Corp	Goldman Sachs	(2,977)
(830)	Janus Henderson Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	1,087
(1,309)	Janus Henderson Group Plc	Goldman Sachs	1,715
(651)	Janus Henderson Group Plc	Morgan Stanley	299
350	Janus International Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(49)
647	Janus International Group Inc	Goldman Sachs	(91)
(157)	Jazz Pharmaceuticals Plc	Morgan Stanley	(466)
56	JB Hunt Transport Services Inc	Morgan Stanley	164
(562)	JBG SMITH Properties (REIT)	Goldman Sachs	(303)
635	Jefferies Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(680)
860	Jefferies Financial Group Inc	Goldman Sachs	(711)
632	Jefferies Financial Group Inc	Morgan Stanley	(530)
2,475	JetBlue Airways Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,332)
5,318	JetBlue Airways Corp	Goldman Sachs	(2,624)
(1,256)	JFrog Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4,009
(25)	JFrog Ltd	Goldman Sachs	81
(201)	John Wiley & Sons Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	218
(182)	John Wiley & Sons Inc 'A'	Goldman Sachs	187
61	Johnson Controls International Plc	Goldman Sachs	(46)
218	Joint Corp	Goldman Sachs	(183)
448	Jones Lang LaSalle Inc	Bank of America Merrill Lynch	(333)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
385	Jones Lang LaSalle Inc	Goldman Sachs	100
485	Jones Lang LaSalle Inc	Morgan Stanley	(1,159)
(790)	JPMorgan Chase & Co	Bank of America Merrill Lynch	(909)
(492)	JPMorgan Chase & Co	Goldman Sachs	(566)
(889)	JPMorgan Chase & Co	Morgan Stanley	872
2	Kadant Inc	Goldman Sachs	4
14	Kaman Corp	Goldman Sachs	(7)
644	KAR Auction Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,230)
566	KAR Auction Services Inc	Goldman Sachs	(1,081)
(105)	Karuna Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	73
(62)	Karuna Therapeutics Inc	Goldman Sachs	48
(28)	Karuna Therapeutics Inc	Morgan Stanley	52
823	Karyopharm Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(407)
316	Karyopharm Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(156)
885	Kearny Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(204)
198	Kearny Financial Corp	Goldman Sachs	(46)
28	Kellogg Co	Morgan Stanley	(29)
(95)	Kennametal Inc	Bank of America Merrill Lynch	149
(217)	Kennametal Inc	Goldman Sachs	307
(947)	Kennedy-Wilson Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	521
(2,353)	Kennedy-Wilson Holdings Inc	Goldman Sachs	1,064
(49)	Keros Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(154)
(98)	Keros Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(309)
(2,958)	Keurig Dr Pepper Inc	Morgan Stanley	991
3,247	KeyCorp	Bank of America Merrill Lynch	(4,189)
236	KeyCorp	Goldman Sachs	(304)
498	KeyCorp	Morgan Stanley	(508)
(377)	Kezar Life Sciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	109
(93)	Kezar Life Sciences Inc	Goldman Sachs	27
170	Kforce Inc	Bank of America Merrill Lynch	(397)
292	Kforce Inc	Goldman Sachs	(698)
67	Kilroy Realty Corp (REIT)	Goldman Sachs	64
(1,042)	Kimball Electronics Inc	Goldman Sachs	146
357	Kimco Realty Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	114
21	Kimco Realty Corp (REIT)	Goldman Sachs	7
139	Kimco Realty Corp (REIT)	Morgan Stanley	(49)
4,362	Kinder Morgan Inc	Goldman Sachs	1,208
649	Kinder Morgan Inc	Morgan Stanley	127
(104)	Kinsale Capital Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,378)
(27)	Kinsale Capital Group Inc	Goldman Sachs	(358)
(298)	Kinsale Capital Group Inc	Morgan Stanley	3,236
(6,691)	Kite Realty Group Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(2,719)
(1,519)	Kite Realty Group Trust (REIT)	Goldman Sachs	(532)
(6,676)	Kite Realty Group Trust (REIT)	Morgan Stanley	(502)
(486)	KKR Real Estate Finance Trust Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	340

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(3,697)	KKR Real Estate Finance Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	2,011
153	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(278)
815	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	Morgan Stanley	978
1,467	Knowles Corp	Bank of America Merrill Lynch	(822)
1,430	Knowles Corp	Goldman Sachs	(801)
93	Kodiak Sciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	(70)
373	Kodiak Sciences Inc	Goldman Sachs	(265)
(232)	Kontoor Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	25
(546)	Kontoor Brands Inc	Goldman Sachs	108
35	Korn Ferry	Bank of America Merrill Lynch	(81)
198	Korn Ferry	Goldman Sachs	(493)
(612)	Kosmos Energy Ltd	Bank of America Merrill Lynch	239
(1,510)	Kosmos Energy Ltd	Goldman Sachs	589
(509)	Kraft Heinz Co	Bank of America Merrill Lynch	(728)
(825)	Kraft Heinz Co	Goldman Sachs	(958)
(52)	Kraft Heinz Co	Morgan Stanley	25
54	Kratos Defense & Security Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	(86)
343	Kratos Defense & Security Solutions Inc	Goldman Sachs	(545)
(904)	Krispy Kreme Inc	Goldman Sachs	(656)
138	Kronos Worldwide Inc	Bank of America Merrill Lynch	(155)
27	Kronos Worldwide Inc	Goldman Sachs	(30)
(216)	Krystal Biotech Inc	Bank of America Merrill Lynch	(151)
(131)	Krystal Biotech Inc	Goldman Sachs	(83)
(40)	Kymera Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	51
(19)	Kymera Therapeutics Inc	Goldman Sachs	24
791	Kyndryl Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	269
477	Kyndryl Holdings Inc	Goldman Sachs	162
(9)	Lakeland Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	13
(46)	Lakeland Financial Corp	Goldman Sachs	69
6	Lam Research Corp	Morgan Stanley	(68)
117	Lamar Advertising Co 'A' (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	269
157	Lamar Advertising Co 'A' (REIT)	Goldman Sachs	361
298	Lamar Advertising Co 'A' (REIT)	Morgan Stanley	(6)
412	Lamb Weston Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,648
92	Lamb Weston Holdings Inc	Goldman Sachs	368
49	Lamb Weston Holdings Inc	Morgan Stanley	(44)
92	Landstar System Inc	Bank of America Merrill Lynch	284
12	Landstar System Inc	Goldman Sachs	25
131	Landstar System Inc	Morgan Stanley	97
(178)	Laredo Petroleum Inc	Goldman Sachs	1,048
330	Las Vegas Sands Corp	Bank of America Merrill Lynch	936
149	Las Vegas Sands Corp	Goldman Sachs	385
246	Las Vegas Sands Corp	Morgan Stanley	285
(296)	Latch Inc	Bank of America Merrill Lynch	77
(6,398)	Latch Inc	Goldman Sachs	1,663

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(181)	Latham Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	1
(70)	Latham Group Inc	Goldman Sachs	(8)
882	Lattice Semiconductor Corp	Morgan Stanley	(1,764)
172	LCI Industries	Bank of America Merrill Lynch	(1,013)
201	LCI Industries	Goldman Sachs	(1,128)
196	Lear Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,671)
767	Lear Corp	Goldman Sachs	(5,113)
397	Lear Corp	Morgan Stanley	(2,196)
(2,647)	Leggett & Platt Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,706
(1,967)	Leggett & Platt Inc	Goldman Sachs	2,754
(1,840)	Leggett & Platt Inc	Morgan Stanley	1,969
107	LeMaitre Vascular Inc	Bank of America Merrill Lynch	(151)
571	LeMaitre Vascular Inc	Goldman Sachs	(805)
489	LendingTree Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,619)
536	LendingTree Inc	Goldman Sachs	(1,643)
(854)	Leonardo DRS Inc	Bank of America Merrill Lynch	(359)
(422)	Leonardo DRS Inc	Goldman Sachs	(177)
(2,850)	Leslie's Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,967
(1,979)	Leslie's Inc	Goldman Sachs	2,464
(3,010)	Leslie's Inc	Morgan Stanley	2,309
(4,988)	Lexicon Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	1,297
(79)	Liberty Energy Inc	Goldman Sachs	80
1,052	Liberty Global Plc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(778)
3,535	Liberty Global Plc 'A'	Goldman Sachs	(2,616)
1,578	Liberty Global Plc 'A'	Morgan Stanley	(284)
1,284	Liberty Global Plc 'C'	Morgan Stanley	(244)
432	Liberty Latin America Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(333)
144	Liberty Latin America Ltd 'A'	Goldman Sachs	(111)
5	Liberty Media Corp-Liberty Braves 'A'	Bank of America Merrill Lynch	5
172	Liberty Media Corp-Liberty Braves 'A'	Goldman Sachs	182
(114)	Liberty Media Corp-Liberty Braves 'C'	Bank of America Merrill Lynch	(131)
(164)	Liberty Media Corp-Liberty Braves 'C'	Goldman Sachs	(171)
63	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	Goldman Sachs	128
56	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	Morgan Stanley	3
639	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(919)
1,194	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'A'	Goldman Sachs	(1,890)
1,445	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'A'	Morgan Stanley	(442)
2,083	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C'	Bank of America Merrill Lynch	(3,602)
812	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C'	Goldman Sachs	(1,191)
402	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C'	Morgan Stanley	(149)
1	Liberty TripAdvisor Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	-

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)	Life Time Group Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	95
(35)	Life Time Group Holdings Inc	Goldman Sachs	7
77	Ligand Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(522)
100	Ligand Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(724)
(515)	Light & Wonder Inc	Bank of America Merrill Lynch	57
(1,560)	Lightwave Logic Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,128
(367)	Lightwave Logic Inc	Goldman Sachs	366
(90)	Lincoln Electric Holdings Inc	Morgan Stanley	473
865	Lincoln National Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,612
2,300	Lincoln National Corp	Goldman Sachs	5,681
2,724	Lincoln National Corp	Morgan Stanley	(4,794)
(55)	Linde Plc	Bank of America Merrill Lynch	97
(308)	Linde Plc	Goldman Sachs	346
(162)	Linde Plc	Morgan Stanley	1,367
741	Lions Gate Entertainment Corp 'A'	Goldman Sachs	(237)
338	Lions Gate Entertainment Corp 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(105)
334	Lions Gate Entertainment Corp 'B'	Goldman Sachs	(104)
15	Liquidity Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(25)
(70)	Littelfuse Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,012
(24)	Littelfuse Inc	Goldman Sachs	347
(132)	Littelfuse Inc	Morgan Stanley	1,163
457	LivaNova Plc	Bank of America Merrill Lynch	(215)
217	LivaNova Plc	Goldman Sachs	53
383	LivaNova Plc	Morgan Stanley	(203)
1,476	LivePerson Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,996)
1,724	LivePerson Inc	Goldman Sachs	(3,500)
834	LiveRamp Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,358)
628	LiveRamp Holdings Inc	Goldman Sachs	(981)
(441)	LL Flooring Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	459
(160)	LL Flooring Holdings Inc	Goldman Sachs	166
(683)	Loews Corp	Goldman Sachs	(929)
(1,013)	Loews Corp	Morgan Stanley	162
927	Louisiana-Pacific Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,371)
216	Louisiana-Pacific Corp	Goldman Sachs	(299)
547	Louisiana-Pacific Corp	Morgan Stanley	(2,009)
(10)	Lovesac Co	Bank of America Merrill Lynch	1
167	Lowe's Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	(942)
215	Lowe's Cos Inc	Goldman Sachs	(937)
472	Lowe's Cos Inc	Morgan Stanley	(4,715)
(2,988)	Loyalty Ventures Inc	Goldman Sachs	(179)
485	LPL Financial Holdings Inc	Morgan Stanley	3,200
803	LSB Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,116
757	LSB Industries Inc	Goldman Sachs	1,052
174	Lululemon Athletica Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,183
101	Lululemon Athletica Inc	Morgan Stanley	1,083

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
4,850	Lumen Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,541)
2,934	Lumen Technologies Inc	Goldman Sachs	(2,142)
1,966	Lumen Technologies Inc	Morgan Stanley	(944)
1,121	Lumentum Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,540)
827	Lumentum Holdings Inc	Goldman Sachs	(2,695)
1,053	Lumentum Holdings Inc	Morgan Stanley	(1,948)
259	Luther Burbank Corp	Bank of America Merrill Lynch	(114)
1,202	Luther Burbank Corp	Goldman Sachs	(529)
35	Luxfer Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	(15)
210	Luxfer Holdings Plc	Goldman Sachs	(88)
384	LXP Industrial Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(27)
(608)	LyondellBasell Industries NV 'A'	Bank of America Merrill Lynch	628
(591)	LyondellBasell Industries NV 'A'	Goldman Sachs	1,193
(666)	LyondellBasell Industries NV 'A'	Morgan Stanley	2,564
304	M&T Bank Corp	Goldman Sachs	(1,126)
16	M/I Homes Inc	Bank of America Merrill Lynch	(26)
211	M/I Homes Inc	Goldman Sachs	(340)
1,078	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,611)
25	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	Goldman Sachs	(177)
995	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	Morgan Stanley	(4,418)
1,474	Macy's Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,270
2,999	Macy's Inc	Goldman Sachs	5,159
187	Macy's Inc	Morgan Stanley	(45)
(4)	Madrigal Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2)
288	Magnite Inc	Bank of America Merrill Lynch	(265)
179	Magnite Inc	Goldman Sachs	(165)
779	Malibu Boats Inc 'A'	Goldman Sachs	(2,025)
89	Manhattan Associates Inc	Bank of America Merrill Lynch	(779)
312	Manhattan Associates Inc	Goldman Sachs	(2,730)
214	Manhattan Associates Inc	Morgan Stanley	(678)
761	ManpowerGroup Inc	Bank of America Merrill Lynch	(145)
702	ManpowerGroup Inc	Goldman Sachs	183
804	ManpowerGroup Inc	Morgan Stanley	(3,240)
660	Marathon Petroleum Corp	Goldman Sachs	2,352
143	Marathon Petroleum Corp	Morgan Stanley	(439)
(1,997)	Maravai LifeSciences Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	869
(2,840)	Maravai LifeSciences Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	934
(1,470)	Maravai LifeSciences Holdings Inc 'A'	Morgan Stanley	134
458	Marcus & Millichap Inc	Goldman Sachs	(518)
375	Marcus Corp	Bank of America Merrill Lynch	52
1,918	Marcus Corp	Goldman Sachs	221
218	MarineMax Inc	Bank of America Merrill Lynch	(312)
522	MarineMax Inc	Goldman Sachs	(746)
(3,383)	Markforged Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,962
(2,026)	Markforged Holding Corp	Goldman Sachs	1,175

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(847)	Marqeta Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	906
(3,153)	Marqeta Inc 'A'	Goldman Sachs	3,374
(3,691)	Marqeta Inc 'A'	Morgan Stanley	295
113	Marsh & McLennan Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	334
262	Marsh & McLennan Cos Inc	Goldman Sachs	1,409
113	Marsh & McLennan Cos Inc	Morgan Stanley	(127)
280	Marten Transport Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(154)
267	Marten Transport Ltd	Goldman Sachs	(147)
293	Masco Corp	Bank of America Merrill Lynch	(560)
49	Masco Corp	Morgan Stanley	(60)
25	Masonite International Corp	Bank of America Merrill Lynch	(30)
22	Masonite International Corp	Goldman Sachs	(31)
(328)	MasTec Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,220
(391)	MasTec Inc	Goldman Sachs	1,436
(274)	MasTec Inc	Morgan Stanley	962
120	Mastercard Inc 'A'	Goldman Sachs	(38)
518	Mastercard Inc 'A'	Morgan Stanley	(917)
(375)	Mativ Holdings Inc	Goldman Sachs	(495)
7	Matson Inc	Goldman Sachs	(15)
918	Mattel Inc	Morgan Stanley	64
(670)	Matterport Inc	Bank of America Merrill Lynch	409
(4,537)	Matterport Inc	Goldman Sachs	2,716
(749)	Matthews International Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(2,932)
(898)	Matthews International Corp 'A'	Goldman Sachs	(3,391)
(18)	Maxar Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	52
(376)	Maxar Technologies Inc	Goldman Sachs	1,094
(1,310)	MaxCyte Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,297
(1,595)	Maximus Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,736)
(1,421)	Maximus Inc	Goldman Sachs	(6,198)
(4,408)	Maximus Inc	Morgan Stanley	10,708
726	MaxLinear Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,543)
2,330	MaxLinear Inc	Goldman Sachs	(4,561)
1,513	MaxLinear Inc	Morgan Stanley	(2,016)
901	McCormick & Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	200
110	McCormick & Co Inc	Goldman Sachs	30
1,546	McCormick & Co Inc	Morgan Stanley	(3,413)
87	McDonald's Corp	Morgan Stanley	(433)
42	MDC Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(26)
160	MDC Holdings Inc	Goldman Sachs	(159)
(724)	MDU Resources Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(380)
(1,479)	MDU Resources Group Inc	Goldman Sachs	(772)
(3,105)	MDU Resources Group Inc	Morgan Stanley	1,211
3,302	Medical Properties Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	495
212	Medical Properties Trust Inc (REIT)	Morgan Stanley	6
36	Medifast Inc	Bank of America Merrill Lynch	189

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
51	Medifast Inc	Goldman Sachs	300
(191)	Medpace Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,827
(309)	Medpace Holdings Inc	Goldman Sachs	7,835
(179)	Medpace Holdings Inc	Morgan Stanley	3,453
416	Medtronic Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2,527)
1,502	Medtronic Plc	Goldman Sachs	(10,655)
1,390	Medtronic Plc	Morgan Stanley	(2,249)
(49)	MercadoLibre Inc	Bank of America Merrill Lynch	5,543
(73)	MercadoLibre Inc	Goldman Sachs	7,173
(17)	MercadoLibre Inc	Morgan Stanley	896
55	Mercantile Bank Corp	Bank of America Merrill Lynch	(36)
61	Mercantile Bank Corp	Goldman Sachs	(40)
368	Merchants Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	7
90	Merchants Bancorp	Goldman Sachs	2
515	Mercury General Corp	Bank of America Merrill Lynch	(740)
503	Mercury General Corp	Goldman Sachs	(733)
(96)	Mercury Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	115
(118)	Mercury Systems Inc	Goldman Sachs	23
(77)	MeridianLink Inc	Goldman Sachs	50
19	Meritage Homes Corp	Bank of America Merrill Lynch	14
23	Meritage Homes Corp	Goldman Sachs	17
303	Meritage Homes Corp	Morgan Stanley	142
(228)	Mersana Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	48
(488)	Mersana Therapeutics Inc	Goldman Sachs	102
(70)	Mesa Laboratories Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,669
(71)	Mesa Laboratories Inc	Goldman Sachs	1,693
1,186	Meta Platforms Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(6,321)
627	Meta Platforms Inc 'A'	Goldman Sachs	(3,725)
436	Meta Platforms Inc 'A'	Morgan Stanley	(490)
(116)	Methode Electronics Inc	Goldman Sachs	252
(267)	MetLife Inc	Bank of America Merrill Lynch	(217)
(403)	MetLife Inc	Goldman Sachs	749
(836)	MetLife Inc	Morgan Stanley	811
16	Metropolitan Bank Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	(106)
12	Metropolitan Bank Holding Corp	Goldman Sachs	(80)
12	Mettler-Toledo International Inc	Bank of America Merrill Lynch	115
30	Mettler-Toledo International Inc	Goldman Sachs	322
41	Mettler-Toledo International Inc	Morgan Stanley	(880)
(27)	MFA Financial Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(3)
(101)	MFA Financial Inc (REIT)	Goldman Sachs	(9)
2,544	MGIC Investment Corp	Bank of America Merrill Lynch	51
2,397	MGIC Investment Corp	Goldman Sachs	48
4,994	MGIC Investment Corp	Morgan Stanley	(699)
2,138	MGM Resorts International	Bank of America Merrill Lynch	586
2,310	MGM Resorts International	Goldman Sachs	(2,971)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
1,849	MGM Resorts International	Morgan Stanley	746
(631)	Microchip Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,843
(26)	Microchip Technology Inc	Morgan Stanley	54
(819)	Micron Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	6,368
(1,435)	Micron Technology Inc	Goldman Sachs	13,792
(1,996)	Micron Technology Inc	Morgan Stanley	11,577
826	Microsoft Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,328
110	Microsoft Corp	Goldman Sachs	372
46	Microsoft Corp	Morgan Stanley	(40)
(126)	Microvast Holdings Inc	Goldman Sachs	37
(604)	MicroVision Inc	Goldman Sachs	74
632	Midland States Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(449)
2,051	Midland States Bancorp Inc	Goldman Sachs	(1,456)
525	MidWestOne Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(609)
493	MidWestOne Financial Group Inc	Goldman Sachs	(572)
105	MillerKnoll Inc	Bank of America Merrill Lynch	(392)
112	MillerKnoll Inc	Goldman Sachs	(418)
(68)	Minerals Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(109)
(181)	Minerals Technologies Inc	Goldman Sachs	(293)
(329)	Mirati Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(5,549)
(134)	Mirati Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(436)
(2,310)	Mirion Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	819
(33)	Mirum Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	41
(686)	Mission Produce Inc	Bank of America Merrill Lynch	597
(507)	Mission Produce Inc	Goldman Sachs	441
1,313	Mister Car Wash Inc	Bank of America Merrill Lynch	(142)
847	Mister Car Wash Inc	Goldman Sachs	(64)
76	Mitek Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(119)
337	Mitek Systems Inc	Goldman Sachs	(427)
(79)	Mobileye Global Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	56
72	Model N Inc	Bank of America Merrill Lynch	(89)
1,082	Model N Inc	Goldman Sachs	(1,369)
(40)	Moderna Inc	Goldman Sachs	563
(77)	Moderna Inc	Morgan Stanley	631
76	ModivCare Inc	Bank of America Merrill Lynch	(447)
85	ModivCare Inc	Goldman Sachs	(500)
48	Moelis & Co 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(89)
355	Moelis & Co 'A'	Goldman Sachs	(1,562)
73	Mohawk Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(438)
1,205	Mohawk Industries Inc	Goldman Sachs	(9,346)
422	Mohawk Industries Inc	Morgan Stanley	(1,431)
62	Molina Healthcare Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,117
8	Molina Healthcare Inc	Goldman Sachs	144
23	Molina Healthcare Inc	Morgan Stanley	310
435	Momentive Global Inc	Bank of America Merrill Lynch	(465)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
339	Momentive Global Inc	Goldman Sachs	(363)
283	Monarch Casino & Resort Inc	Bank of America Merrill Lynch	691
248	Monarch Casino & Resort Inc	Goldman Sachs	605
12	Monolithic Power Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(615)
39	Monolithic Power Systems Inc	Goldman Sachs	(860)
66	Monolithic Power Systems Inc	Morgan Stanley	(1,335)
10	Monro Inc	Bank of America Merrill Lynch	6
580	Monro Inc	Goldman Sachs	(431)
103	Montauk Renewables Inc	Bank of America Merrill Lynch	(100)
87	Montauk Renewables Inc	Goldman Sachs	(66)
(41)	Monte Rosa Therapeutics Inc	Goldman Sachs	35
(221)	Montrose Environmental Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,418
(361)	Montrose Environmental Group Inc	Goldman Sachs	2,325
85	Moody's Corp	Bank of America Merrill Lynch	(914)
360	Moody's Corp	Goldman Sachs	(3,870)
226	Moody's Corp	Morgan Stanley	(1,440)
(1,213)	Morgan Stanley	Bank of America Merrill Lynch	380
(2,965)	Morgan Stanley	Goldman Sachs	891
203	Morningstar Inc	Morgan Stanley	(1,486)
(193)	Motorola Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,253)
(196)	Motorola Solutions Inc	Goldman Sachs	(3,087)
(904)	Motorola Solutions Inc	Morgan Stanley	(1,993)
(922)	MP Materials Corp	Bank of America Merrill Lynch	246
(694)	MP Materials Corp	Morgan Stanley	(312)
(53)	Mr Cooper Group Inc	Goldman Sachs	11
3,282	MRC Global Inc	Goldman Sachs	(394)
2	MSA Safety Inc	Bank of America Merrill Lynch	2
6	MSCI Inc	Bank of America Merrill Lynch	(161)
84	MSCI Inc	Morgan Stanley	(1,462)
45	Mueller Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(60)
132	Mueller Industries Inc	Goldman Sachs	(166)
(35)	Mueller Water Products Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	3
(18)	Murphy USA Inc	Bank of America Merrill Lynch	38
(29)	Murphy USA Inc	Morgan Stanley	65
127	Myers Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	48
124	Myers Industries Inc	Goldman Sachs	67
(199)	N-able Inc	Bank of America Merrill Lynch	37
(508)	N-able Inc	Goldman Sachs	121
11	Nabors Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(93)
139	Nabors Industries Ltd	Goldman Sachs	(3,050)
303	Napco Security Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(605)
178	Napco Security Technologies Inc	Goldman Sachs	(383)
(369)	Natera Inc	Morgan Stanley	(1,129)
162	National Beverage Corp	Bank of America Merrill Lynch	(277)
308	National Beverage Corp	Goldman Sachs	(527)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(78)	National HealthCare Corp	Bank of America Merrill Lynch	(55)
(178)	National HealthCare Corp	Goldman Sachs	(125)
(65)	National Presto Industries Inc	Goldman Sachs	53
23	National Research Corp	Bank of America Merrill Lynch	6
(1,131)	National Storage Affiliates Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	1,293
(463)	National Storage Affiliates Trust (REIT)	Goldman Sachs	547
(1,828)	National Storage Affiliates Trust (REIT)	Morgan Stanley	1,090
(3)	National Western Life Group Inc 'A'	Goldman Sachs	27
(14)	Navient Corp	Bank of America Merrill Lynch	-
(325)	Navient Corp	Goldman Sachs	-
(97)	Navitas Semiconductor Corp	Bank of America Merrill Lynch	113
(960)	Navitas Semiconductor Corp	Goldman Sachs	1,114
(336)	NBT Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	722
(774)	NBT Bancorp Inc	Goldman Sachs	1,607
(2,619)	nCino Inc	Bank of America Merrill Lynch	8,453
(1,780)	nCino Inc	Goldman Sachs	4,823
(1,822)	nCino Inc	Morgan Stanley	1,767
(241)	NCR Corp	Bank of America Merrill Lynch	71
(61)	NCR Corp	Goldman Sachs	18
(820)	NCR Corp	Morgan Stanley	86
(1,070)	Necessity Retail Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(74)
(999)	Necessity Retail Inc (REIT)	Goldman Sachs	(65)
2,592	Nektar Therapeutics	Bank of America Merrill Lynch	(2,376)
793	Nektar Therapeutics	Goldman Sachs	(679)
(3)	Nelnet Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	-
(465)	Nelnet Inc 'A'	Goldman Sachs	(112)
(253)	Neogen Corp	Bank of America Merrill Lynch	64
(1,388)	Neogen Corp	Goldman Sachs	323
1,073	NeoGenomics Inc	Goldman Sachs	(1,234)
127	NetApp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,044)
288	NetApp Inc	Goldman Sachs	(2,367)
470	NetApp Inc	Morgan Stanley	(3,826)
(333)	Netflix Inc	Bank of America Merrill Lynch	9,584
(72)	Netflix Inc	Goldman Sachs	2,072
256	NETGEAR Inc	Bank of America Merrill Lynch	38
685	NETGEAR Inc	Goldman Sachs	103
(40)	NetScout Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	7
(239)	NetScout Systems Inc	Goldman Sachs	(160)
(204)	NETSTREIT Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(139)
(815)	NETSTREIT Corp (REIT)	Goldman Sachs	(554)
16	Neurocrine Biosciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	166
356	Neurocrine Biosciences Inc	Morgan Stanley	1,118
632	Nevro Corp	Bank of America Merrill Lynch	(390)
373	Nevro Corp	Goldman Sachs	(81)
(568)	New Fortress Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	11

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(292)	New Fortress Energy Inc	Goldman Sachs	6
(577)	New Fortress Energy Inc	Morgan Stanley	640
(147)	New Jersey Resources Corp	Bank of America Merrill Lynch	(544)
(743)	New Jersey Resources Corp	Goldman Sachs	(2,796)
26	New Relic Inc	Goldman Sachs	(156)
170	New Relic Inc	Morgan Stanley	318
8,852	New York Community Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,220)
11,401	New York Community Bancorp Inc	Goldman Sachs	(7,236)
6,406	New York Community Bancorp Inc	Morgan Stanley	(2,407)
(193)	Newell Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	261
(1,065)	Newmark Group Inc 'A'	Goldman Sachs	415
1,537	Newmont Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,134
2,234	Newmont Corp	Goldman Sachs	1,061
3,630	Newmont Corp	Morgan Stanley	(145)
(5,640)	News Corp 'A'	Goldman Sachs	(2,221)
(1,328)	News Corp 'A'	Morgan Stanley	(865)
273	NexPoint Residential Trust Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(386)
807	NexPoint Residential Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	(1,373)
(976)	NextDecade Corp	Goldman Sachs	453
(7,422)	Nextdoor Holdings Inc	Goldman Sachs	4,379
96	NextGen Healthcare Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7)
459	NextGen Healthcare Inc	Goldman Sachs	(32)
(930)	NiSource Inc	Goldman Sachs	(1,404)
(1,096)	NiSource Inc	Morgan Stanley	(427)
(309)	nLight Inc	Bank of America Merrill Lynch	222
(924)	nLight Inc	Goldman Sachs	484
(80)	NMI Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	70
(15)	NMI Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	13
978	Nomad Foods Ltd	Bank of America Merrill Lynch	675
1,739	Nomad Foods Ltd	Goldman Sachs	1,200
5,821	Nomad Foods Ltd	Morgan Stanley	4,191
(290)	Norfolk Southern Corp	Bank of America Merrill Lynch	(565)
(243)	Norfolk Southern Corp	Goldman Sachs	(575)
(238)	Norfolk Southern Corp	Morgan Stanley	170
(293)	Northern Oil and Gas Inc	Goldman Sachs	586
236	Northern Trust Corp	Bank of America Merrill Lynch	(701)
54	Northern Trust Corp	Goldman Sachs	(160)
229	Northern Trust Corp	Morgan Stanley	(1,081)
(137)	Northwest Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	24
(1,664)	Northwest Bancshares Inc	Goldman Sachs	266
410	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(143)
346	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	Goldman Sachs	(62)
1,048	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	Morgan Stanley	(94)
(144)	NOV Inc	Morgan Stanley	1
221	Nova Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,638)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
293	Nova Ltd	Goldman Sachs	(2,171)
120	Nova Ltd	Morgan Stanley	(466)
(160)	Novanta Inc	Bank of America Merrill Lynch	71
(1,303)	Novanta Inc	Morgan Stanley	8,812
211	Novavax Inc	Bank of America Merrill Lynch	(585)
475	Novavax Inc	Goldman Sachs	(2,360)
114	NOW Inc	Bank of America Merrill Lynch	(60)
149	NOW Inc	Goldman Sachs	(65)
57	NRG Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(40)
52	Nurix Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(113)
293	Nutanix Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(607)
1,394	Nutanix Inc 'A'	Morgan Stanley	(1,770)
67	NuVasive Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5)
182	NuVasive Inc	Goldman Sachs	(13)
(142)	Nuvation Bio Inc	Bank of America Merrill Lynch	14
89	NV5 Global Inc	Goldman Sachs	(1,177)
(1,643)	nVent Electric Plc	Morgan Stanley	1,232
4	NVR Inc	Bank of America Merrill Lynch	136
9	NVR Inc	Goldman Sachs	306
3	NVR Inc	Morgan Stanley	271
(120)	Oak Street Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	462
(184)	Oak Street Health Inc	Goldman Sachs	708
620	Oceaneering International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(70)
676	Oceaneering International Inc	Goldman Sachs	(62)
(3,430)	Ocugen Inc	Goldman Sachs	(25)
(33)	ODP Corp	Bank of America Merrill Lynch	(13)
(787)	ODP Corp	Goldman Sachs	(285)
(1,852)	Offerpad Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	123
(11,250)	Offerpad Solutions Inc	Goldman Sachs	129
(890)	OGE Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,255)
(495)	OGE Energy Corp	Goldman Sachs	(698)
(2,144)	OGE Energy Corp	Morgan Stanley	(251)
(42)	O-I Glass Inc	Bank of America Merrill Lynch	41
(1,009)	O-I Glass Inc	Goldman Sachs	949
(1,926)	Okta Inc	Bank of America Merrill Lynch	(989)
(337)	Okta Inc	Goldman Sachs	(480)
(825)	Okta Inc	Morgan Stanley	(2,235)
(37)	Old Dominion Freight Line Inc	Bank of America Merrill Lynch	242
(52)	Old Dominion Freight Line Inc	Goldman Sachs	1,408
(182)	Old National Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	25
(744)	Old National Bancorp	Goldman Sachs	126
(1,479)	Old National Bancorp	Morgan Stanley	843
(1,311)	Old Republic International Corp	Bank of America Merrill Lynch	(249)
(4,373)	Old Republic International Corp	Goldman Sachs	(831)
(3,267)	Old Republic International Corp	Morgan Stanley	817

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
783	Old Second Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(337)
944	Old Second Bancorp Inc	Goldman Sachs	(406)
(210)	Olin Corp	Bank of America Merrill Lynch	599
(1,046)	Olin Corp	Goldman Sachs	2,981
(212)	Olin Corp	Morgan Stanley	477
(1,153)	Olo Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1,614
(2,055)	Olo Inc 'A'	Goldman Sachs	2,694
10	Omega Flex Inc	Bank of America Merrill Lynch	(33)
7	Omega Flex Inc	Goldman Sachs	(22)
1,779	Omega Healthcare Investors Inc (REIT)	Morgan Stanley	(2,259)
14	Omniab Inc*	Bank of America Merrill Lynch	-
14	Omniab Inc*	Bank of America Merrill Lynch	-
148	Omicell Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,060)
330	Omicell Inc	Goldman Sachs	(1,187)
(164)	Omnicom Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(186)
(531)	Omnicom Group Inc	Goldman Sachs	(328)
(1,009)	Omnicom Group Inc	Morgan Stanley	383
(199)	On Holding AG	Morgan Stanley	(86)
(976)	ON Semiconductor Corp	Morgan Stanley	3,504
(2,489)	ON24 Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,518
(100)	ONE Gas Inc	Bank of America Merrill Lynch	(321)
(128)	ONE Gas Inc	Goldman Sachs	(411)
(289)	ONE Gas Inc	Morgan Stanley	587
(25)	OneSpan Inc	Bank of America Merrill Lynch	43
(929)	OneSpan Inc	Goldman Sachs	1,598
(113)	OneSpaWorld Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	63
(548)	OneSpaWorld Holdings Ltd	Goldman Sachs	307
(347)	Onto Innovation Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,033
(716)	Onto Innovation Inc	Goldman Sachs	6,258
(719)	Onto Innovation Inc	Morgan Stanley	2,934
(3,340)	Opendoor Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,186
(7,669)	Opendoor Technologies Inc	Goldman Sachs	2,722
230	OPKO Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	(75)
(27)	OptimizeRx Corp	Bank of America Merrill Lynch	53
(175)	OptimizeRx Corp	Goldman Sachs	343
(73)	OraSure Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	37
53	O'Reilly Automotive Inc	Bank of America Merrill Lynch	856
76	O'Reilly Automotive Inc	Goldman Sachs	648
211	O'Reilly Automotive Inc	Morgan Stanley	384
345	Organogenesis Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(64)
143	Organogenesis Holdings Inc	Goldman Sachs	(26)
441	Origin Bancorp Inc	Goldman Sachs	(1,089)
556	Origin Materials Inc	Bank of America Merrill Lynch	(167)
16	Orion Engineered Carbons SA	Bank of America Merrill Lynch	-
(1,236)	Orion Office Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	507

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(491)	Orion Office Inc (REIT)	Goldman Sachs	201
337	Orthofix Medical Inc	Bank of America Merrill Lynch	81
408	Orthofix Medical Inc	Goldman Sachs	98
411	Oscar Health Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(55)
85	Oscar Health Inc 'A'	Goldman Sachs	(11)
42	Otter Tail Corp	Bank of America Merrill Lynch	85
151	Otter Tail Corp	Goldman Sachs	87
2,055	Outfront Media Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(986)
1,566	Outfront Media Inc (REIT)	Goldman Sachs	(752)
1,096	Outfront Media Inc (REIT)	Morgan Stanley	33
(687)	Outset Medical Inc	Bank of America Merrill Lynch	(62)
(1,192)	Outset Medical Inc	Goldman Sachs	(107)
402	Ovintiv Inc	Goldman Sachs	(1,371)
(33)	Owens & Minor Inc	Bank of America Merrill Lynch	20
(421)	Owens & Minor Inc	Goldman Sachs	253
52	Oxford Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(69)
156	Oxford Industries Inc	Goldman Sachs	(553)
(250)	Pacific Biosciences of California Inc	Bank of America Merrill Lynch	393
(655)	Pacific Biosciences of California Inc	Goldman Sachs	1,028
(65)	Pacific Premier Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	104
(68)	Pacific Premier Bancorp Inc	Goldman Sachs	109
32	Pacira BioSciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	(76)
110	Pacira BioSciences Inc	Goldman Sachs	(193)
68	Pactiv Evergreen Inc	Bank of America Merrill Lynch	(14)
110	Pactiv Evergreen Inc	Goldman Sachs	(22)
3,306	PacWest Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	(5,748)
899	PacWest Bancorp	Goldman Sachs	(1,468)
3,683	PacWest Bancorp	Morgan Stanley	(5,406)
279	PagerDuty Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,132)
437	PagerDuty Inc	Goldman Sachs	(1,845)
(2,137)	Palantir Technologies Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	2,500
(6,694)	Palantir Technologies Inc 'A'	Goldman Sachs	7,832
(2,339)	Palantir Technologies Inc 'A'	Morgan Stanley	117
39	Palomar Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6)
22	Palomar Holdings Inc	Goldman Sachs	19
269	Papa John's International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(823)
686	Papa John's International Inc	Goldman Sachs	(2,099)
436	Papa John's International Inc	Morgan Stanley	(253)
284	Par Pacific Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(363)
683	Par Pacific Holdings Inc	Goldman Sachs	(713)
797	Paramount Group Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	57
412	Paramount Group Inc (REIT)	Goldman Sachs	(14)
1,488	Park Hotels & Resorts Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(264)
3,345	Park Hotels & Resorts Inc (REIT)	Goldman Sachs	(400)
1,873	Park Hotels & Resorts Inc (REIT)	Morgan Stanley	(243)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(7)	Park National Corp	Bank of America Merrill Lynch	13
(38)	Park National Corp	Goldman Sachs	68
(75)	Parker-Hannifin Corp	Bank of America Merrill Lynch	722
(282)	Parker-Hannifin Corp	Goldman Sachs	4,501
(656)	Parker-Hannifin Corp	Morgan Stanley	10,651
(3,754)	Party City Holdco Inc	Bank of America Merrill Lynch	950
(21,657)	Party City Holdco Inc	Goldman Sachs	3,636
229	Patrick Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	75
54	Patrick Industries Inc	Goldman Sachs	23
(35)	Patterson Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	26
(278)	Patterson Cos Inc	Goldman Sachs	457
1,721	Patterson-UTI Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,444)
1,997	Patterson-UTI Energy Inc	Goldman Sachs	(2,836)
425	Patterson-UTI Energy Inc	Morgan Stanley	(404)
312	Paya Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	81
144	Paychex Inc	Bank of America Merrill Lynch	(161)
204	Paychex Inc	Goldman Sachs	(228)
144	Paychex Inc	Morgan Stanley	(321)
(1,757)	Paymentus Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	3,742
(436)	PayPal Holdings Inc	Morgan Stanley	1,548
906	PBF Energy Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(7,393)
9	PC Connection Inc	Goldman Sachs	20
99	PDC Energy Inc	Morgan Stanley	(272)
(14)	Peapack-Gladstone Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	5
505	Pebblebrook Hotel Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(163)
4,731	Pebblebrook Hotel Trust (REIT)	Goldman Sachs	(1,378)
(126)	Pediatrix Medical Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	130
(36)	Pegasystems Inc	Bank of America Merrill Lynch	86
(155)	Pegasystems Inc	Goldman Sachs	369
(7,860)	Peloton Interactive Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	4,993
(3,845)	Peloton Interactive Inc 'A'	Goldman Sachs	1,779
(3,851)	Peloton Interactive Inc 'A'	Morgan Stanley	(2,002)
131	PennyMac Financial Services Inc	Goldman Sachs	80
(244)	PennyMac Mortgage Investment Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	122
(482)	PennyMac Mortgage Investment Trust (REIT)	Goldman Sachs	241
574	Penske Automotive Group Inc	Morgan Stanley	(763)
(85)	Pentair Plc	Morgan Stanley	161
65	Peoples Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8)
682	Peoples Bancorp Inc	Goldman Sachs	(87)
(1,527)	Perella Weinberg Partners	Goldman Sachs	92
(915)	Performance Food Group Co	Morgan Stanley	238
1,007	Perrigo Co Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1,148)
2,109	Perrigo Co Plc	Goldman Sachs	(2,271)
1,821	Perrigo Co Plc	Morgan Stanley	(1,129)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
510	Petco Health & Wellness Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(143)
1,554	Petco Health & Wellness Co Inc	Morgan Stanley	839
48	PetIQ Inc	Goldman Sachs	(9)
(1,245)	Pfizer Inc	Morgan Stanley	(448)
(5,343)	PG&E Corp	Goldman Sachs	(3,794)
(6,411)	PG&E Corp	Morgan Stanley	(192)
427	PGT Innovations Inc	Bank of America Merrill Lynch	(355)
1,303	PGT Innovations Inc	Goldman Sachs	(1,122)
(55)	Phathom Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	52
(220)	Phathom Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	209
(70)	Philip Morris International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(126)
(180)	Philip Morris International Inc	Goldman Sachs	(162)
(4,100)	Philip Morris International Inc	Morgan Stanley	(1,517)
(240)	Phillips 66	Bank of America Merrill Lynch	710
(128)	Phillips 66	Goldman Sachs	379
(559)	Phillips 66	Morgan Stanley	2,199
(885)	Phillips Edison & Co Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	23
(576)	Phillips Edison & Co Inc (REIT)	Goldman Sachs	(148)
(271)	Phillips Edison & Co Inc (REIT)	Morgan Stanley	98
702	Photronics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(719)
330	Photronics Inc	Goldman Sachs	(274)
(122)	Physicians Realty Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(1)
(476)	Physicians Realty Trust (REIT)	Goldman Sachs	(16)
(614)	Pilgrim's Pride Corp	Bank of America Merrill Lynch	(75)
(359)	Pilgrim's Pride Corp	Goldman Sachs	84
(658)	Pilgrim's Pride Corp	Morgan Stanley	201
(145)	Pinterest Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	19
(1,578)	Pinterest Inc 'A'	Goldman Sachs	2,993
(998)	Pinterest Inc 'A'	Morgan Stanley	359
(1,257)	Pitney Bowes Inc	Bank of America Merrill Lynch	(71)
(1,525)	Pitney Bowes Inc	Goldman Sachs	(91)
822	Plains GP Holdings LP 'A'	Bank of America Merrill Lynch	197
1,548	Plains GP Holdings LP 'A'	Goldman Sachs	313
(57)	Planet Fitness Inc 'A'	Goldman Sachs	(236)
(1,331)	Planet Labs PBC	Bank of America Merrill Lynch	427
(1,947)	Planet Labs PBC	Goldman Sachs	701
1,721	Playa Hotels & Resorts NV	Bank of America Merrill Lynch	(23)
1,514	Playa Hotels & Resorts NV	Goldman Sachs	(25)
(245)	Plexus Corp	Goldman Sachs	(39)
(4,334)	Plug Power Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,250
(4,485)	Plug Power Inc	Goldman Sachs	9,345
(3,529)	Plug Power Inc	Morgan Stanley	(177)
(469)	Plymouth Industrial Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(65)
(1,052)	Plymouth Industrial Inc (REIT)	Goldman Sachs	(161)
235	Popular Inc	Bank of America Merrill Lynch	(385)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
429	Popular Inc	Morgan Stanley	(669)
(3,807)	Porch Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,789)
(1,119)	Porch Group Inc	Goldman Sachs	(526)
(333)	Portillo's Inc 'A'	Goldman Sachs	1,082
67	Portland General Electric Co	Goldman Sachs	92
277	Portland General Electric Co	Morgan Stanley	(55)
614	Post Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,008
521	Post Holdings Inc	Goldman Sachs	2,674
773	Post Holdings Inc	Morgan Stanley	(812)
274	Power Integrations Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,148)
459	Power Integrations Inc	Morgan Stanley	110
31	PRA Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8)
(1,821)	Praxis Precision Medicines Inc	Bank of America Merrill Lynch	73
(726)	Praxis Precision Medicines Inc	Goldman Sachs	29
1,065	Premier Financial Corp	Goldman Sachs	(2,396)
18	Prestige Consumer Healthcare Inc	Bank of America Merrill Lynch	32
211	Prestige Consumer Healthcare Inc	Goldman Sachs	351
(82)	PriceSmart Inc	Goldman Sachs	192
53	Primoris Services Corp	Bank of America Merrill Lynch	(23)
223	Primoris Services Corp	Goldman Sachs	(98)
(239)	Principal Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,242
(366)	Principal Financial Group Inc	Goldman Sachs	1,809
(2,331)	Principal Financial Group Inc	Morgan Stanley	8,601
(338)	Privia Health Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,457
(152)	ProAssurance Corp	Bank of America Merrill Lynch	67
(90)	ProAssurance Corp	Goldman Sachs	40
(113)	PROCEPT BioRobotics Corp	Bank of America Merrill Lynch	59
(269)	PROCEPT BioRobotics Corp	Goldman Sachs	176
(226)	Procore Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,759
(1,285)	Procore Technologies Inc	Morgan Stanley	3,431
(91)	Procter & Gamble Co	Bank of America Merrill Lynch	55
(146)	Procter & Gamble Co	Goldman Sachs	(84)
454	PROG Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	95
(33)	Progress Software Corp	Bank of America Merrill Lynch	2
(389)	Progress Software Corp	Goldman Sachs	23
(187)	Progyny Inc	Bank of America Merrill Lynch	88
(507)	Progyny Inc	Goldman Sachs	238
(607)	Progyny Inc	Morgan Stanley	(1,839)
101	Prologis Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(136)
348	Prologis Inc (REIT)	Morgan Stanley	(693)
(109)	Prometheus Biosciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	634
(104)	Prometheus Biosciences Inc	Goldman Sachs	727
304	ProPetro Holding Corp	Goldman Sachs	(225)
7	PROS Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(24)
273	PROS Holdings Inc	Goldman Sachs	(887)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(191)	Prosperity Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	437
(1,940)	Prosperity Bancshares Inc	Morgan Stanley	4,889
267	Protagonist Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(125)
(5,018)	Proterra Inc	Goldman Sachs	7,347
195	Proto Labs Inc	Bank of America Merrill Lynch	250
388	Proto Labs Inc	Goldman Sachs	578
235	PTC Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	681
828	PTC Therapeutics Inc	Goldman Sachs	2,393
62	PTC Therapeutics Inc	Morgan Stanley	52
37	Public Service Enterprise Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	58
220	Public Service Enterprise Group Inc	Goldman Sachs	345
354	Public Service Enterprise Group Inc	Morgan Stanley	117
(86)	Public Storage (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(31)
(36)	Public Storage (REIT)	Goldman Sachs	(13)
(482)	Public Storage (REIT)	Morgan Stanley	4,767
(33)	PubMatic Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	48
(574)	PubMatic Inc 'A'	Goldman Sachs	832
(444)	Pulmonx Corp	Bank of America Merrill Lynch	222
(802)	Pulmonx Corp	Goldman Sachs	401
1,502	PulteGroup Inc	Morgan Stanley	(871)
565	Pure Storage Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,504)
309	Pure Storage Inc 'A'	Goldman Sachs	(557)
148	Pure Storage Inc 'A'	Morgan Stanley	(270)
(5,077)	Purple Innovation Inc	Goldman Sachs	3,757
212	PVH Corp	Bank of America Merrill Lynch	600
156	PVH Corp	Goldman Sachs	720
621	PVH Corp	Morgan Stanley	1,987
349	Q2 Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(875)
794	Q2 Holdings Inc	Goldman Sachs	(2,415)
9	Quaker Chemical Corp	Bank of America Merrill Lynch	(18)
61	Quaker Chemical Corp	Goldman Sachs	(123)
(76)	QUALCOMM Inc	Bank of America Merrill Lynch	568
(137)	QUALCOMM Inc	Goldman Sachs	1,025
(447)	QUALCOMM Inc	Morgan Stanley	2,284
(4,930)	Qualtrics International Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	6,849
(3,829)	Qualtrics International Inc 'A'	Goldman Sachs	5,407
(4,190)	Qualtrics International Inc 'A'	Morgan Stanley	1,131
134	Quanex Building Products Corp	Bank of America Merrill Lynch	(48)
173	Quanex Building Products Corp	Goldman Sachs	(62)
(294)	Quanta Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(435)
(134)	Quanta Services Inc	Goldman Sachs	(198)
(360)	Quanta Services Inc	Morgan Stanley	814
(295)	Quanterix Corp	Bank of America Merrill Lynch	(280)
(296)	Quanterix Corp	Goldman Sachs	(281)
(136)	Quantum-Si Inc	Bank of America Merrill Lynch	49

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(1,107)	Quantum-Si Inc	Goldman Sachs	533
(408)	Quest Diagnostics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(23)
(277)	Quidel Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,832
(455)	Quidel Corp	Goldman Sachs	2,833
(325)	Quidel Corp	Morgan Stanley	1,446
552	QuinStreet Inc	Goldman Sachs	(270)
(145)	R1 RCM Inc	Bank of America Merrill Lynch	(92)
(932)	R1 RCM Inc	Goldman Sachs	1
(916)	Rackspace Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,011
(6,513)	Rackspace Technology Inc	Goldman Sachs	6,824
89	Radian Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(32)
2,119	Radian Group Inc	Goldman Sachs	(763)
1,120	Radian Group Inc	Morgan Stanley	(515)
144	Ralph Lauren Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,080
1,792	Ralph Lauren Corp	Goldman Sachs	14,165
1,005	Ralph Lauren Corp	Morgan Stanley	5,537
(731)	Rambus Inc	Bank of America Merrill Lynch	586
(267)	Rambus Inc	Goldman Sachs	69
(383)	Rambus Inc	Morgan Stanley	103
302	Rapid7 Inc	Bank of America Merrill Lynch	(562)
347	Rapid7 Inc	Goldman Sachs	(1,394)
(31)	Raymond James Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	254
(573)	Raymond James Financial Inc	Goldman Sachs	4,374
(393)	Rayonier Inc (REIT)	Morgan Stanley	534
(383)	RBC Bearings Inc	Morgan Stanley	6,653
200	RE/MAX Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	42
766	RE/MAX Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	161
(1,554)	Ready Capital Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	513
(3,423)	Ready Capital Corp (REIT)	Goldman Sachs	765
131	Reata Pharmaceuticals Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(186)
129	Reata Pharmaceuticals Inc 'A'	Goldman Sachs	(183)
(1,378)	Recursion Pharmaceuticals Inc 'A'	Goldman Sachs	3,448
(317)	Redfin Corp	Bank of America Merrill Lynch	(22)
(172)	Redwood Trust Inc (REIT)	Goldman Sachs	22
(175)	Regency Centers Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	59
(58)	Regency Centers Corp (REIT)	Goldman Sachs	(21)
(200)	Regency Centers Corp (REIT)	Morgan Stanley	254
43	Reinsurance Group of America Inc	Bank of America Merrill Lynch	168
118	Reinsurance Group of America Inc	Goldman Sachs	461
166	Reinsurance Group of America Inc	Morgan Stanley	(166)
(123)	Relay Therapeutics Inc	Goldman Sachs	105
584	Reliance Steel & Aluminum Co	Morgan Stanley	(3,854)
(199)	Relmada Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	237
(877)	Relmada Therapeutics Inc	Goldman Sachs	1,044
29	Remitly Global Inc	Bank of America Merrill Lynch	(31)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(390)	Rent-A-Center Inc	Goldman Sachs	(250)
299	Repay Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	129
424	Repay Holdings Corp	Goldman Sachs	182
64	Repligen Corp	Goldman Sachs	(2,359)
20	Repligen Corp	Morgan Stanley	41
(62)	Replimune Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(42)
182	Republic Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	129
(44)	ResMed Inc	Morgan Stanley	239
(81)	Retail Opportunity Investments Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	31
(440)	Retail Opportunity Investments Corp (REIT)	Goldman Sachs	167
(403)	REV Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	302
(2,183)	REV Group Inc	Goldman Sachs	1,637
(57)	Revance Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	115
(486)	Revance Therapeutics Inc	Goldman Sachs	977
156	REX American Resources Corp	Bank of America Merrill Lynch	(393)
60	REX American Resources Corp	Goldman Sachs	(151)
(161)	Reynolds Consumer Products Inc	Goldman Sachs	(61)
(647)	Rhythm Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(755)
1,637	Rigel Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(100)
369	Rigel Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(23)
(2,962)	Rimini Street Inc	Goldman Sachs	267
(301)	Rite Aid Corp	Goldman Sachs	352
(1,357)	Rithm Capital Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	113
(1,973)	Rithm Capital Corp (REIT)	Goldman Sachs	(127)
(10,738)	Rithm Capital Corp (REIT)	Morgan Stanley	(430)
(1,164)	Rivian Automotive Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	6,635
(1,481)	Rivian Automotive Inc 'A'	Morgan Stanley	(755)
(139)	RLI Corp	Goldman Sachs	368
784	RLJ Lodging Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	19
2,645	RLJ Lodging Trust (REIT)	Goldman Sachs	(43)
661	RMR Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1,058
738	RMR Group Inc 'A'	Goldman Sachs	1,137
280	Robert Half International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(683)
559	Robert Half International Inc	Morgan Stanley	(855)
(3,703)	Robinhood Markets Inc 'A'	Morgan Stanley	(130)
804	ROBLOX Corp 'A'	Morgan Stanley	(875)
(1,870)	Rocket Lab USA Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,561
(5,423)	Rocket Lab USA Inc	Goldman Sachs	7,185
(75)	Roivant Sciences Ltd	Goldman Sachs	24
(279)	Ross Stores Inc	Goldman Sachs	(2,374)
(1,740)	Ross Stores Inc	Morgan Stanley	(1,994)
(2,414)	Rover Group Inc	Goldman Sachs	700
105	Royal Caribbean Cruises Ltd	Bank of America Merrill Lynch	73
498	Royal Caribbean Cruises Ltd	Goldman Sachs	(655)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
1,674	Royal Caribbean Cruises Ltd	Morgan Stanley	(96)
7	Royal Gold Inc	Goldman Sachs	31
209	Royal Gold Inc	Morgan Stanley	132
205	RPM International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(168)
181	RPM International Inc	Goldman Sachs	(38)
114	RPM International Inc	Morgan Stanley	(232)
265	RPT Realty (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(16)
746	RPT Realty (REIT)	Goldman Sachs	(45)
224	Rush Enterprises Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	4
323	Rush Enterprises Inc 'A'	Goldman Sachs	6
290	Rush Enterprises Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(307)
448	Rush Enterprises Inc 'B'	Goldman Sachs	(475)
(1,318)	Rush Street Interactive Inc	Bank of America Merrill Lynch	982
(1,678)	Rush Street Interactive Inc	Goldman Sachs	1,250
15	RXO Inc	Bank of America Merrill Lynch	27
(23)	Ryan Specialty Holdings Inc	Goldman Sachs	(7)
157	S&P Global Inc	Morgan Stanley	(1,484)
(74)	S&T Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	79
(157)	S&T Bancorp Inc	Goldman Sachs	222
976	Sabra Health Care Inc (REIT)	Goldman Sachs	202
1,191	Sabre Corp	Bank of America Merrill Lynch	167
1,177	Sabre Corp	Goldman Sachs	165
138	Safehold Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	3,854
110	Safehold Inc (REIT)	Goldman Sachs	3,072
(345)	Safety Insurance Group Inc	Goldman Sachs	(1,708)
107	Sage Therapeutics Inc	Goldman Sachs	452
311	Salesforce Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,856)
377	Salesforce Inc	Goldman Sachs	(653)
(2)	Sally Beauty Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	2
(647)	Sally Beauty Holdings Inc	Goldman Sachs	666
136	Sandy Spring Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(230)
551	Sandy Spring Bancorp Inc	Goldman Sachs	(931)
1,287	Sangamo Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(476)
1,690	Sangamo Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(625)
(147)	Sanmina Corp	Bank of America Merrill Lynch	239
(277)	Sanmina Corp	Goldman Sachs	470
(134)	Sarcos Technology and Robotics Corp	Goldman Sachs	34
114	Sarepta Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	789
19	Sarepta Therapeutics Inc	Goldman Sachs	131
252	Sarepta Therapeutics Inc	Morgan Stanley	1,164
(31)	Saul Centers Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	22
158	ScanSource Inc	Bank of America Merrill Lynch	(376)
86	ScanSource Inc	Goldman Sachs	(205)
229	Schneider National Inc 'B'	Goldman Sachs	32
(126)	Schnitzer Steel Industries Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(183)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(14)	Schnitzer Steel Industries Inc 'A'	Goldman Sachs	(20)
158	Scholastic Corp	Bank of America Merrill Lynch	115
(13)	Schrodinger Inc	Goldman Sachs	60
(22)	Science Applications International Corp	Goldman Sachs	(30)
(97)	Science Applications International Corp	Morgan Stanley	33
(1,140)	Sea Ltd ADR	Bank of America Merrill Lynch	3,605
(1,036)	Sea Ltd ADR	Goldman Sachs	4,426
(595)	Sea Ltd ADR	Morgan Stanley	(1,400)
(7)	Seaboard Corp	Goldman Sachs	(821)
(182)	Seagate Technology Holdings Plc	Goldman Sachs	1,081
(803)	Seagate Technology Holdings Plc	Morgan Stanley	3,469
40	Seagen Inc	Bank of America Merrill Lynch	(303)
111	Seagen Inc	Goldman Sachs	(1,486)
214	Seagen Inc	Morgan Stanley	(893)
(139)	Sealed Air Corp	Goldman Sachs	18
(93)	Sealed Air Corp	Morgan Stanley	43
(702)	SeaWorld Entertainment Inc	Goldman Sachs	1,039
(72)	Seer Inc	Bank of America Merrill Lynch	138
(2,004)	Seer Inc	Goldman Sachs	3,848
149	Select Medical Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(161)
193	Select Medical Holdings Corp	Goldman Sachs	(208)
(172)	Selective Insurance Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(533)
(71)	Selective Insurance Group Inc	Goldman Sachs	(220)
(91)	Selective Insurance Group Inc	Morgan Stanley	(70)
(2,503)	Selectquote Inc	Bank of America Merrill Lynch	287
(4,151)	Selectquote Inc	Goldman Sachs	476
(674)	Sema4 Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	292
(8,033)	Sema4 Holdings Corp	Goldman Sachs	2,856
(109)	Sempra Energy	Bank of America Merrill Lynch	(700)
(533)	Sempra Energy	Goldman Sachs	(4,057)
(228)	Sempra Energy	Morgan Stanley	(563)
22	SEMrush Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(20)
29	SEMrush Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	(27)
383	Semtech Corp	Bank of America Merrill Lynch	(397)
2,628	Semtech Corp	Goldman Sachs	(3,512)
(219)	Sensata Technologies Holding Plc	Bank of America Merrill Lynch	296
(1,272)	Sensata Technologies Holding Plc	Goldman Sachs	1,717
(123)	Sensata Technologies Holding Plc	Morgan Stanley	167
(4,118)	SentinelOne Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	17,165
(2,587)	SentinelOne Inc 'A'	Goldman Sachs	12,010
(2,419)	SentinelOne Inc 'A'	Morgan Stanley	5,856
(29)	Seres Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	6
(135)	Seres Therapeutics Inc	Goldman Sachs	28
115	ServiceNow Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,263)
134	ServiceNow Inc	Goldman Sachs	(2,287)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
256	ServiceNow Inc	Morgan Stanley	422
(956)	SES AI Corp	Goldman Sachs	526
10	Shake Shack Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(4)
165	Shake Shack Inc 'A'	Goldman Sachs	(164)
(161)	Shenandoah Telecommunications Co	Bank of America Merrill Lynch	18
(577)	Shenandoah Telecommunications Co	Goldman Sachs	63
13	Sherwin-Williams Co	Bank of America Merrill Lynch	(1)
114	Sherwin-Williams Co	Goldman Sachs	(848)
219	Sherwin-Williams Co	Morgan Stanley	(646)
(1,027)	Shift4 Payments Inc 'A'	Morgan Stanley	514
(261)	Shoals Technologies Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(237)
(1,227)	Shoals Technologies Group Inc 'A'	Goldman Sachs	(1,362)
(124)	Shoals Technologies Group Inc 'A'	Morgan Stanley	233
(37)	Shockwave Medical Inc	Morgan Stanley	33
205	Shutterstock Inc	Bank of America Merrill Lynch	(884)
250	Shutterstock Inc	Goldman Sachs	(871)
518	Shyft Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,761)
293	Shyft Group Inc	Goldman Sachs	(996)
(1,047)	SI-BONE Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,712
(675)	SI-BONE Inc	Goldman Sachs	1,748
90	SIGA Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(30)
227	SIGA Technologies Inc	Goldman Sachs	(75)
(85)	Signature Bank	Morgan Stanley	271
113	Signet Jewelers Ltd	Bank of America Merrill Lynch	166
234	Signet Jewelers Ltd	Goldman Sachs	391
(82)	Silgan Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(159)
(2,691)	Silgan Holdings Inc	Goldman Sachs	(6,356)
356	Silicon Laboratories Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,332)
236	Silicon Laboratories Inc	Goldman Sachs	(2,209)
67	Silicon Laboratories Inc	Morgan Stanley	(337)
(122)	Silk Road Medical Inc	Goldman Sachs	(209)
111	Simpson Manufacturing Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(379)
236	Simpson Manufacturing Co Inc	Goldman Sachs	(792)
207	Simulations Plus Inc	Bank of America Merrill Lynch	(604)
102	Simulations Plus Inc	Goldman Sachs	(298)
(234)	Sinclair Broadcast Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	557
(165)	Sinclair Broadcast Group Inc 'A'	Goldman Sachs	393
499	Sirius XM Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	15
4,785	Sirius XM Holdings Inc	Goldman Sachs	(365)
25,278	Sirius XM Holdings Inc	Morgan Stanley	(2,149)
1,288	SiriusPoint Ltd	Bank of America Merrill Lynch	335
3,176	SiriusPoint Ltd	Goldman Sachs	826
331	SiteOne Landscape Supply Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,509)
146	SiteOne Landscape Supply Inc	Goldman Sachs	(1,548)
217	SiteOne Landscape Supply Inc	Morgan Stanley	(848)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(34)	SiTime Corp	Bank of America Merrill Lynch	264
(192)	SiTime Corp	Goldman Sachs	2,623
(38)	Six Flags Entertainment Corp	Goldman Sachs	32
(39)	SJW Group	Bank of America Merrill Lynch	(53)
(11)	SJW Group	Goldman Sachs	(15)
44	Skyline Champion Corp	Bank of America Merrill Lynch	(89)
130	Skyline Champion Corp	Goldman Sachs	(162)
317	SkyWest Inc	Goldman Sachs	67
863	SL Green Realty Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(26)
1,147	SL Green Realty Corp (REIT)	Goldman Sachs	927
1,674	SL Green Realty Corp (REIT)	Morgan Stanley	(134)
(683)	SLM Corp	Bank of America Merrill Lynch	198
(117)	SLM Corp	Goldman Sachs	34
(1,487)	SLM Corp	Morgan Stanley	(74)
18	SMART Global Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(26)
193	SMART Global Holdings Inc	Goldman Sachs	(275)
(748)	SmartRent Inc	Goldman Sachs	399
3,952	Snap Inc 'A'	Goldman Sachs	(6,499)
3,981	Snap Inc 'A'	Morgan Stanley	(358)
(84)	Snap One Holdings Corp	Goldman Sachs	147
30	Snap-on Inc	Bank of America Merrill Lynch	20
241	Snap-on Inc	Morgan Stanley	(643)
(378)	Snowflake Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	10,202
(3,739)	Solid Power Inc	Goldman Sachs	8,150
(1,772)	SomaLogic Inc	Bank of America Merrill Lynch	487
(3,976)	SomaLogic Inc	Goldman Sachs	1,093
(1,480)	Sonoco Products Co	Bank of America Merrill Lynch	(1,324)
(1,756)	Sonoco Products Co	Goldman Sachs	(1,112)
(497)	Sonoco Products Co	Morgan Stanley	754
(80)	Sonos Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1)
(48)	Sonos Inc	Goldman Sachs	25
493	Sotera Health Co	Bank of America Merrill Lynch	584
395	Sotera Health Co	Goldman Sachs	468
(628)	SouthState Corp	Bank of America Merrill Lynch	937
(119)	SouthState Corp	Goldman Sachs	205
(879)	SouthState Corp	Morgan Stanley	2,927
223	Southwest Airlines Co	Goldman Sachs	(105)
(1,534)	Southwest Gas Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(972)
(1,285)	Southwest Gas Holdings Inc	Goldman Sachs	(992)
(512)	Southwest Gas Holdings Inc	Morgan Stanley	1,454
(495)	Southwestern Energy Co	Goldman Sachs	114
(1,510)	Southwestern Energy Co	Morgan Stanley	438
60	Spectrum Brands Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(13)
45	Spectrum Brands Holdings Inc	Goldman Sachs	(16)
(433)	Spirit Realty Capital Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	130

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(185)	Spirit Realty Capital Inc (REIT)	Goldman Sachs	56
(434)	Spirit Realty Capital Inc (REIT)	Morgan Stanley	842
(55)	Splunk Inc	Bank of America Merrill Lynch	165
(45)	Splunk Inc	Morgan Stanley	111
388	Sportsman's Warehouse Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(81)
93	Sportsman's Warehouse Holdings Inc	Goldman Sachs	(20)
475	Spotify Technology SA	Bank of America Merrill Lynch	(4,010)
491	Spotify Technology SA	Goldman Sachs	(4,078)
855	Spotify Technology SA	Morgan Stanley	(967)
(181)	SpringWorks Therapeutics Inc	Goldman Sachs	534
53	Sprinklr Inc 'A'	Goldman Sachs	(16)
(19)	Sprout Social Inc 'A'	Goldman Sachs	7
(19)	SPS Commerce Inc	Morgan Stanley	(92)
(1,281)	SS&C Technologies Holdings Inc	Morgan Stanley	(13)
(70)	St Joe Co	Bank of America Merrill Lynch	16
(56)	St Joe Co	Goldman Sachs	13
(2,507)	STAG Industrial Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	2,604
(1,856)	STAG Industrial Inc (REIT)	Goldman Sachs	1,823
(1,653)	STAG Industrial Inc (REIT)	Morgan Stanley	1,672
72	Standex International Corp	Bank of America Merrill Lynch	(339)
102	Standex International Corp	Goldman Sachs	(480)
(432)	Stanley Black & Decker Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,951
(91)	Stanley Black & Decker Inc	Goldman Sachs	622
(82)	Starbucks Corp	Bank of America Merrill Lynch	(125)
(636)	Starwood Property Trust Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	114
(3,110)	Starwood Property Trust Inc (REIT)	Morgan Stanley	218
53	Steelcase Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(56)
215	Steelcase Inc 'A'	Goldman Sachs	(226)
(229)	Stem Inc	Bank of America Merrill Lynch	320
(854)	Stem Inc	Goldman Sachs	1,221
(514)	StepStone Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1,126
(290)	StepStone Group Inc 'A'	Goldman Sachs	650
131	Sterling Infrastructure Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4)
254	Sterling Infrastructure Inc	Goldman Sachs	(32)
422	Stifel Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(716)
344	Stifel Financial Corp	Goldman Sachs	(573)
887	Stifel Financial Corp	Morgan Stanley	(1,513)
683	Stitch Fix Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(468)
2,109	Stitch Fix Inc 'A'	Goldman Sachs	(1,445)
(134)	Stock Yards Bancorp Inc	Goldman Sachs	303
439	Stoke Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(997)
(44)	Strategic Education Inc	Bank of America Merrill Lynch	(57)
(139)	Strategic Education Inc	Goldman Sachs	(115)
(10)	Stride Inc	Bank of America Merrill Lynch	4
(61)	Stride Inc	Goldman Sachs	27

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
42	Stryker Corp	Goldman Sachs	236
44	Stryker Corp	Morgan Stanley	60
984	Summit Hotel Properties Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	138
203	Summit Hotel Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	15
245	Summit Materials Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(56)
741	Summit Materials Inc 'A'	Goldman Sachs	(170)
(272)	Sumo Logic Inc	Bank of America Merrill Lynch	264
(1,169)	Sumo Logic Inc	Goldman Sachs	1,134
(574)	Sun Country Airlines Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,061
(446)	Sun Country Airlines Holdings Inc	Goldman Sachs	1,601
91	SunCoke Energy Inc	Goldman Sachs	(15)
153	Sunnova Energy International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(136)
698	Sunnova Energy International Inc	Goldman Sachs	(977)
(268)	Sunrun Inc	Bank of America Merrill Lynch	(157)
(339)	Sunrun Inc	Goldman Sachs	(54)
(118)	Sunrun Inc	Morgan Stanley	(64)
(746)	Sunstone Hotel Investors Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(60)
(1,538)	Sunstone Hotel Investors Inc (REIT)	Goldman Sachs	(44)
(850)	Super Micro Computer Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,797)
(194)	Super Micro Computer Inc	Goldman Sachs	(1,063)
(410)	Super Micro Computer Inc	Morgan Stanley	(1,009)
566	Supernus Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,158
714	Supernus Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	1,605
307	Surgery Partners Inc	Bank of America Merrill Lynch	(550)
101	Surgery Partners Inc	Goldman Sachs	(181)
591	SVB Financial Group	Bank of America Merrill Lynch	(12,682)
543	SVB Financial Group	Goldman Sachs	(13,303)
291	SVB Financial Group	Morgan Stanley	(535)
252	Syndax Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	156
233	Syndax Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	144
1,120	Syneos Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	277
1,586	Syneos Health Inc	Goldman Sachs	362
2,328	Syneos Health Inc	Morgan Stanley	1,583
1,582	Taboola.com Ltd	Bank of America Merrill Lynch	862
1,185	Taboola.com Ltd	Goldman Sachs	646
53	Tactile Systems Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1)
934	Tactile Systems Technology Inc	Goldman Sachs	(19)
(145)	Talos Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	235
(18)	Talos Energy Inc	Goldman Sachs	(5)
130	Tandem Diabetes Care Inc	Bank of America Merrill Lynch	37
101	Tandem Diabetes Care Inc	Goldman Sachs	192
20	Target Hospitality Corp	Bank of America Merrill Lynch	28
19	Taro Pharmaceutical Industries Ltd	Goldman Sachs	4
(676)	TaskUS Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	2,515
(574)	TaskUS Inc 'A'	Goldman Sachs	2,135

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
116	Taylor Morrison Home Corp	Goldman Sachs	108
549	TD SYNEX Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,187)
1,003	TD SYNEX Corp	Goldman Sachs	(2,403)
432	TD SYNEX Corp	Morgan Stanley	(943)
(1,258)	TDCX Inc ADR	Bank of America Merrill Lynch	918
(431)	TDCX Inc ADR	Goldman Sachs	315
258	TE Connectivity Ltd	Morgan Stanley	(1,040)
654	TechnipFMC Plc	Bank of America Merrill Lynch	(70)
5,243	TechnipFMC Plc	Goldman Sachs	(1,096)
282	TechnipFMC Plc	Morgan Stanley	(48)
3	TechTarget Inc	Bank of America Merrill Lynch	(13)
70	TechTarget Inc	Goldman Sachs	(294)
(155)	Tejon Ranch Co	Bank of America Merrill Lynch	(153)
(514)	Tejon Ranch Co	Goldman Sachs	(509)
(388)	Teledyne Technologies Inc	Goldman Sachs	2,048
(46)	Teledyne Technologies Inc	Morgan Stanley	330
401	Teleflex Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,401
240	Teleflex Inc	Morgan Stanley	2,159
537	Tenet Healthcare Corp	Bank of America Merrill Lynch	(147)
625	Tenet Healthcare Corp	Goldman Sachs	171
369	Tenet Healthcare Corp	Morgan Stanley	(118)
(9)	Tennant Co	Bank of America Merrill Lynch	36
(82)	Tennant Co	Goldman Sachs	328
1,109	Teradata Corp	Bank of America Merrill Lynch	(81)
261	Teradata Corp	Goldman Sachs	(137)
510	Teradata Corp	Morgan Stanley	27
864	Teradyne Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,042)
2,314	Teradyne Inc	Goldman Sachs	(16,444)
1,405	Teradyne Inc	Morgan Stanley	(5,998)
(90)	Terex Corp	Bank of America Merrill Lynch	25
(248)	Terex Corp	Goldman Sachs	140
(695)	Terreno Realty Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	744
(77)	Terreno Realty Corp (REIT)	Goldman Sachs	82
(1,456)	Terreno Realty Corp (REIT)	Morgan Stanley	2,533
379	Tesla Inc	Morgan Stanley	301
177	Tetra Tech Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,358)
215	Tetra Tech Inc	Goldman Sachs	(1,649)
15	Tetra Tech Inc	Morgan Stanley	(69)
2,789	Teva Pharmaceutical Industries Ltd ADR	Goldman Sachs	(1,562)
410	Teva Pharmaceutical Industries Ltd ADR	Morgan Stanley	(144)
20	Texas Capital Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	3
79	Texas Capital Bancshares Inc	Goldman Sachs	(111)
5	Texas Instruments Inc	Goldman Sachs	(30)
212	Texas Instruments Inc	Morgan Stanley	(1,208)
386	TG Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(127)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
384	TG Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(127)
(1,982)	ThredUp Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(139)
(5,491)	ThredUp Inc 'A'	Goldman Sachs	(384)
423	Timken Co	Morgan Stanley	(486)
(154)	TimkenSteel Corp	Bank of America Merrill Lynch	145
(255)	TimkenSteel Corp	Goldman Sachs	240
280	Titan Machinery Inc	Goldman Sachs	1,610
(1,478)	T-Mobile US Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,850)
(22)	T-Mobile US Inc	Goldman Sachs	(103)
(1,195)	T-Mobile US Inc	Morgan Stanley	2,271
(160)	Toast Inc 'A'	Goldman Sachs	453
(1,983)	Toast Inc 'A'	Morgan Stanley	1,190
1,344	Toll Brothers Inc	Bank of America Merrill Lynch	96
1,254	Toll Brothers Inc	Goldman Sachs	218
736	Toll Brothers Inc	Morgan Stanley	191
372	Tootsie Roll Industries Inc	Goldman Sachs	446
89	TopBuild Corp	Bank of America Merrill Lynch	(842)
78	TopBuild Corp	Goldman Sachs	(738)
82	TopBuild Corp	Morgan Stanley	(207)
(313)	Topgolf Callaway Brands Corp	Bank of America Merrill Lynch	(19)
(1,040)	Topgolf Callaway Brands Corp	Goldman Sachs	201
(1,014)	Topgolf Callaway Brands Corp	Morgan Stanley	40
(15)	Towne Bank	Bank of America Merrill Lynch	26
(14)	Towne Bank	Goldman Sachs	24
(192)	TPG Inc	Goldman Sachs	1,089
1,027	TPG RE Finance Trust Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(370)
(25)	TPI Composites Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2)
(33)	TPI Composites Inc	Goldman Sachs	14
(654)	Trade Desk Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	2,097
(122)	Trade Desk Inc 'A'	Goldman Sachs	515
(645)	Trade Desk Inc 'A'	Morgan Stanley	(468)
(75)	Traeger Inc	Bank of America Merrill Lynch	83
(4,784)	Traeger Inc	Goldman Sachs	3,843
(199)	TransMedics Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(587)
(120)	TransMedics Group Inc	Goldman Sachs	(386)
3,166	Transocean Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,061)
8,269	Transocean Ltd	Goldman Sachs	(2,723)
1,384	Travel + Leisure Co	Goldman Sachs	(2,201)
2,657	Travel + Leisure Co	Morgan Stanley	(452)
115	TravelCenters of America Inc	Bank of America Merrill Lynch	(253)
13	Traverse Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(29)
30	Traverse Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(66)
(104)	Treace Medical Concepts Inc	Bank of America Merrill Lynch	(138)
(471)	Treace Medical Concepts Inc	Goldman Sachs	(626)
(4,568)	Tredegear Corp	Goldman Sachs	(731)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(137)	TreeHouse Foods Inc	Bank of America Merrill Lynch	(141)
(594)	TreeHouse Foods Inc	Goldman Sachs	(441)
1,219	Trex Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,592)
159	Trex Co Inc	Goldman Sachs	(484)
354	Trex Co Inc	Morgan Stanley	(623)
680	Tri Pointe Homes Inc	Goldman Sachs	(564)
(94)	TriCo Bancshares	Bank of America Merrill Lynch	156
(319)	TriCo Bancshares	Goldman Sachs	785
86	Trimble Inc	Bank of America Merrill Lynch	(322)
150	Trimble Inc	Goldman Sachs	(220)
303	Trimble Inc	Morgan Stanley	(351)
209	TriNet Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	199
699	TriNet Group Inc	Goldman Sachs	632
(130)	Trinity Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	39
(371)	Trinity Industries Inc	Goldman Sachs	81
(371)	Trinseo Plc	Bank of America Merrill Lynch	646
(471)	Trinseo Plc	Goldman Sachs	820
(1,027)	Triton International Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(126)
(427)	Triton International Ltd	Goldman Sachs	(120)
(326)	Triton International Ltd	Morgan Stanley	71
43	Triumph Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(46)
(28)	Tronox Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	22
(89)	Tronox Holdings Plc	Goldman Sachs	53
194	TrueBlue Inc	Bank of America Merrill Lynch	(105)
329	TrueBlue Inc	Goldman Sachs	(178)
1,233	TrueCar Inc	Goldman Sachs	(191)
37	Trupanion Inc	Bank of America Merrill Lynch	(507)
153	Trupanion Inc	Goldman Sachs	(2,096)
(313)	Trustmark Corp	Bank of America Merrill Lynch	491
(712)	Trustmark Corp	Goldman Sachs	1,212
(48)	Tucows Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	205
(36)	Tucows Inc 'A'	Goldman Sachs	154
125	Turning Point Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	(34)
925	Turning Point Brands Inc	Goldman Sachs	(250)
1,511	Tutor Perini Corp	Bank of America Merrill Lynch	(546)
1,540	Tutor Perini Corp	Goldman Sachs	(489)
(248)	Twist Bioscience Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,250
(191)	Twist Bioscience Corp	Goldman Sachs	963
(996)	Two Harbors Investment Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	453
(423)	Two Harbors Investment Corp (REIT)	Goldman Sachs	192
608	Tyson Foods Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	827
405	Tyson Foods Inc 'A'	Goldman Sachs	429
401	Tyson Foods Inc 'A'	Morgan Stanley	(650)
(309)	Uber Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,171
(86)	Uber Technologies Inc	Goldman Sachs	326

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(1,758)	Uber Technologies Inc	Morgan Stanley	527
(140)	UGI Corp	Goldman Sachs	17
(845)	UGI Corp	Morgan Stanley	2,096
(2,703)	UiPath Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	3,652
(1,080)	UiPath Inc 'A'	Goldman Sachs	1,566
(1,841)	UiPath Inc 'A'	Morgan Stanley	479
454	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	Goldman Sachs	450
(221)	UMH Properties Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	27
(592)	UMH Properties Inc (REIT)	Goldman Sachs	113
819	Umpqua Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(663)
1,256	Umpqua Holdings Corp	Goldman Sachs	(1,017)
4,555	Under Armour Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	783
3,311	Under Armour Inc 'A'	Goldman Sachs	364
4,067	Under Armour Inc 'A'	Morgan Stanley	1,057
227	Under Armour Inc 'C'	Bank of America Merrill Lynch	41
329	Under Armour Inc 'C'	Goldman Sachs	59
(17)	UniFirst Corp	Bank of America Merrill Lynch	1
(291)	UniFirst Corp	Goldman Sachs	(130)
(80)	Union Pacific Corp	Bank of America Merrill Lynch	182
(224)	Union Pacific Corp	Morgan Stanley	296
204	uniQure NV	Bank of America Merrill Lynch	828
741	uniQure NV	Goldman Sachs	3,008
(146)	Unisys Corp	Bank of America Merrill Lynch	107
(790)	Unisys Corp	Goldman Sachs	577
397	United Airlines Holdings Inc	Goldman Sachs	(473)
(1,366)	United Bankshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,402
(2,910)	United Bankshares Inc	Goldman Sachs	3,689
(3,306)	United Bankshares Inc	Morgan Stanley	3,501
(1,056)	United Community Banks Inc	Bank of America Merrill Lynch	(114)
(1,333)	United Community Banks Inc	Goldman Sachs	(287)
(892)	United Community Banks Inc	Morgan Stanley	968
769	United Fire Group Inc	Goldman Sachs	331
(292)	United Natural Foods Inc	Goldman Sachs	(169)
(28)	United Rentals Inc	Bank of America Merrill Lynch	585
(43)	United Rentals Inc	Goldman Sachs	500
(90)	United Rentals Inc	Morgan Stanley	1,728
164	United States Cellular Corp	Bank of America Merrill Lynch	(238)
1,198	United States Cellular Corp	Goldman Sachs	(1,737)
6	United States Lime & Minerals Inc	Goldman Sachs	43
16	United States Steel Corp	Bank of America Merrill Lynch	22
483	United States Steel Corp	Goldman Sachs	667
1,138	United States Steel Corp	Morgan Stanley	(296)
68	United Therapeutics Corp	Goldman Sachs	911
65	United Therapeutics Corp	Morgan Stanley	136
(3,716)	Uniti Group Inc (REIT)	Goldman Sachs	1,765

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
66	Unitil Corp	Bank of America Merrill Lynch	11
287	Unitil Corp	Goldman Sachs	49
(699)	Unity Software Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,383)
(113)	Unity Software Inc	Goldman Sachs	(201)
(858)	Unity Software Inc	Morgan Stanley	(3,835)
(35)	Universal Corp	Bank of America Merrill Lynch	9
(285)	Universal Corp	Goldman Sachs	322
107	Universal Display Corp	Bank of America Merrill Lynch	(73)
489	Universal Display Corp	Goldman Sachs	(2,784)
907	Universal Display Corp	Morgan Stanley	(2,602)
(304)	Universal Health Realty Income Trust (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(471)
(337)	Universal Health Realty Income Trust (REIT)	Goldman Sachs	(512)
(367)	Universal Health Services Inc 'B'	Morgan Stanley	(393)
42	Universal Insurance Holdings Inc	Goldman Sachs	7
290	Univest Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(212)
819	Univest Financial Corp	Goldman Sachs	(598)
1,500	Upland Software Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,635)
1,351	Upland Software Inc	Goldman Sachs	(1,473)
636	Upwork Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,982)
1,698	Upwork Inc	Goldman Sachs	(4,700)
(2,855)	Uranium Energy Corp	Goldman Sachs	1,228
198	Urban Outfitters Inc	Bank of America Merrill Lynch	496
83	Urban Outfitters Inc	Goldman Sachs	213
(701)	Urstadt Biddle Properties Inc 'A' (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	81
(277)	Urstadt Biddle Properties Inc 'A' (REIT)	Goldman Sachs	39
598	US Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	88
1,316	US Bancorp	Goldman Sachs	1
2,313	US Bancorp	Morgan Stanley	(116)
391	US Foods Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	572
175	US Foods Holding Corp	Morgan Stanley	(4)
925	US Silica Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,020)
1,406	US Silica Holdings Inc	Goldman Sachs	(1,528)
200	USANA Health Sciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	384
72	USANA Health Sciences Inc	Goldman Sachs	147
77	UWM Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	9
309	V2X Inc	Goldman Sachs	(942)
19	Vail Resorts Inc	Bank of America Merrill Lynch	215
40	Vail Resorts Inc	Goldman Sachs	452
(212)	Valaris Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(125)
(38)	Valaris Ltd	Goldman Sachs	85
(73)	Valaris Ltd	Morgan Stanley	148
(6,685)	Valley National Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	1,083
(9,740)	Valley National Bancorp	Goldman Sachs	4,590

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(11,924)	Valley National Bancorp	Morgan Stanley	4,397
(72)	Valmont Industries Inc	Goldman Sachs	(494)
(247)	Valmont Industries Inc	Morgan Stanley	1,447
206	Valvoline Inc	Bank of America Merrill Lynch	(130)
416	Valvoline Inc	Goldman Sachs	(440)
736	Vanda Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(78)
1,210	Vanda Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(146)
237	Varex Imaging Corp	Bank of America Merrill Lynch	(412)
521	Varex Imaging Corp	Goldman Sachs	(907)
422	Varonis Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(355)
233	Varonis Systems Inc	Goldman Sachs	(171)
(4,344)	Vaxart Inc	Goldman Sachs	1,672
(400)	VBI Vaccines Inc	Goldman Sachs	52
222	Veeco Instruments Inc	Bank of America Merrill Lynch	(246)
542	Veeco Instruments Inc	Goldman Sachs	(587)
205	Veeva Systems Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,738)
364	Veeva Systems Inc 'A'	Goldman Sachs	(2,888)
693	Veeva Systems Inc 'A'	Morgan Stanley	(1,553)
(1,238)	Velo3D Inc	Bank of America Merrill Lynch	682
(2,108)	Velo3D Inc	Goldman Sachs	913
(13,588)	Velodyne Lidar Inc	Goldman Sachs	1,699
564	Ventas Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	220
411	Ventas Inc (REIT)	Goldman Sachs	160
419	Ventas Inc (REIT)	Morgan Stanley	268
(127)	Vera Therapeutics Inc	Goldman Sachs	62
23	Veracyte Inc	Bank of America Merrill Lynch	(70)
213	Veracyte Inc	Goldman Sachs	(628)
567	Verint Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(967)
566	Verint Systems Inc	Goldman Sachs	(1,109)
62	VeriSign Inc	Bank of America Merrill Lynch	(123)
89	VeriSign Inc	Goldman Sachs	(176)
200	VeriSign Inc	Morgan Stanley	(822)
176	Verisk Analytics Inc	Bank of America Merrill Lynch	568
66	Verisk Analytics Inc	Goldman Sachs	168
254	Verisk Analytics Inc	Morgan Stanley	247
434	Veritex Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(599)
407	Veritex Holdings Inc	Goldman Sachs	(562)
(110)	Veritone Inc	Goldman Sachs	119
(824)	Verizon Communications Inc	Bank of America Merrill Lynch	261
(489)	Verizon Communications Inc	Goldman Sachs	(51)
(1,745)	Verizon Communications Inc	Morgan Stanley	1,588
(67)	Verra Mobility Corp	Bank of America Merrill Lynch	(14)
(861)	Verra Mobility Corp	Goldman Sachs	(181)
381	Vertex Inc 'A'	Goldman Sachs	(579)
66	Vertex Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	853

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
28	Vertex Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	362
47	Vertex Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(154)
(1,287)	Vertiv Holdings Co	Bank of America Merrill Lynch	1,656
(1,257)	Vertiv Holdings Co	Goldman Sachs	1,923
(1,039)	Vertiv Holdings Co	Morgan Stanley	665
(1,009)	Veru Inc	Goldman Sachs	(47)
(120)	VF Corp	Goldman Sachs	184
(2,144)	VF Corp	Morgan Stanley	4,202
(1,997)	Viatis Inc	Bank of America Merrill Lynch	267
(1,417)	Viatis Inc	Goldman Sachs	70
224	Vicor Corp	Bank of America Merrill Lynch	(771)
236	Vicor Corp	Goldman Sachs	(1,226)
(124)	Victoria's Secret & Co	Bank of America Merrill Lynch	35
(820)	Victoria's Secret & Co	Goldman Sachs	448
737	ViewRay Inc	Bank of America Merrill Lynch	184
972	ViewRay Inc	Goldman Sachs	243
474	Vimeo Inc	Bank of America Merrill Lynch	(229)
259	Vimeo Inc	Goldman Sachs	(111)
(359)	Vir Biotechnology Inc	Goldman Sachs	(149)
(94)	Vir Biotechnology Inc	Morgan Stanley	(8)
(607)	Virgin Galactic Holdings Inc	Goldman Sachs	52
(148)	Viridian Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(463)
540	Visa Inc 'A'	Goldman Sachs	(286)
1,769	Visa Inc 'A'	Morgan Stanley	(1,539)
296	Vishay Intertechnology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(195)
333	Vishay Intertechnology Inc	Goldman Sachs	(220)
(507)	Vista Outdoor Inc	Bank of America Merrill Lynch	(148)
(459)	Vista Outdoor Inc	Goldman Sachs	(116)
5,918	Vistra Corp	Bank of America Merrill Lynch	6,053
1,786	Vistra Corp	Goldman Sachs	2,590
8,641	Vistra Corp	Morgan Stanley	5,847
254	Vital Farms Inc	Bank of America Merrill Lynch	(78)
58	Vital Farms Inc	Goldman Sachs	(39)
(1,074)	Vontier Corp	Goldman Sachs	1,471
(658)	Vontier Corp	Morgan Stanley	283
(8,020)	Vornado Realty Trust (REIT)	Morgan Stanley	(2,526)
(748)	Vuzix Corp	Bank of America Merrill Lynch	501
(824)	Vuzix Corp	Goldman Sachs	472
(856)	W&T Offshore Inc	Bank of America Merrill Lynch	865
(311)	W&T Offshore Inc	Goldman Sachs	314
586	Walgreens Boots Alliance Inc	Goldman Sachs	94
1,069	Walgreens Boots Alliance Inc	Morgan Stanley	(1,048)
124	Walmart Inc	Bank of America Merrill Lynch	615
115	Walmart Inc	Morgan Stanley	82
(1,327)	Warner Bros Discovery Inc	Bank of America Merrill Lynch	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)		
(401)	Warner Music Group Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,168)
(1,098)	Warner Music Group Corp 'A'	Goldman Sachs	(4,798)
(780)	Warner Music Group Corp 'A'	Morgan Stanley	(1,685)
163	Warrior Met Coal Inc	Bank of America Merrill Lynch	244
89	Warrior Met Coal Inc	Goldman Sachs	128
38	Waste Management Inc	Bank of America Merrill Lynch	39
47	Waste Management Inc	Morgan Stanley	117
17	Waters Corp	Bank of America Merrill Lynch	79
162	Waters Corp	Goldman Sachs	748
96	Waters Corp	Morgan Stanley	(246)
16	Waterstone Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3)
41	Watsco Inc	Bank of America Merrill Lynch	(779)
179	Watsco Inc	Goldman Sachs	(3,124)
219	Watsco Inc	Morgan Stanley	(4,058)
32	Watts Water Technologies Inc 'A'	Goldman Sachs	(122)
(16)	WD-40 Co	Bank of America Merrill Lynch	129
(83)	WD-40 Co	Goldman Sachs	669
(643)	Webster Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	170
(1,207)	Webster Financial Corp	Goldman Sachs	313
(167)	Webster Financial Corp	Morgan Stanley	150
(1,092)	WEC Energy Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,802)
(773)	WEC Energy Group Inc	Goldman Sachs	(2,769)
(1,192)	WEC Energy Group Inc	Morgan Stanley	(119)
1,262	Wells Fargo & Co	Bank of America Merrill Lynch	(382)
747	Wells Fargo & Co	Goldman Sachs	(606)
1,321	Wells Fargo & Co	Morgan Stanley	(990)
(3,761)	Wendy's Co	Morgan Stanley	(2,595)
(103)	WesBanco Inc	Bank of America Merrill Lynch	63
(17)	WesBanco Inc	Goldman Sachs	10
601	West Pharmaceutical Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,203)
249	West Pharmaceutical Services Inc	Goldman Sachs	(4,495)
264	West Pharmaceutical Services Inc	Morgan Stanley	(542)
483	Western Digital Corp	Goldman Sachs	(2,251)
(823)	Western Union Co	Bank of America Merrill Lynch	(282)
(4,961)	Western Union Co	Goldman Sachs	(1,273)
(2,472)	Western Union Co	Morgan Stanley	(667)
(35)	Westlake Corp	Bank of America Merrill Lynch	112
(595)	Westlake Corp	Morgan Stanley	1,119
703	Westrock Co	Goldman Sachs	(316)
1,106	Westrock Co	Morgan Stanley	(1,515)
(10,893)	WeWork Inc 'A'	Goldman Sachs	3,703
(152)	Wheels Up Experience Inc	Bank of America Merrill Lynch	50
(6,752)	Wheels Up Experience Inc	Goldman Sachs	2,228
378	Whirlpool Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3,417)
794	Whirlpool Corp	Goldman Sachs	(8,255)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
410	Whirlpool Corp	Morgan Stanley	(1,929)
(9)	White Mountains Insurance Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(594)
(39)	White Mountains Insurance Group Ltd	Goldman Sachs	(2,576)
(57)	WideOpenWest Inc	Bank of America Merrill Lynch	61
(270)	WideOpenWest Inc	Goldman Sachs	289
(18)	Willdan Group Inc	Goldman Sachs	(3)
2,228	Williams Cos Inc	Morgan Stanley	691
(724)	WillScot Mobile Mini Holdings Corp	Goldman Sachs	(615)
(371)	Wingstop Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,194
(282)	Wingstop Inc	Goldman Sachs	1,397
(91)	Wingstop Inc	Morgan Stanley	(35)
63	Winmark Corp	Bank of America Merrill Lynch	(240)
142	Winmark Corp	Goldman Sachs	(550)
343	Wintrust Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(777)
60	Wintrust Financial Corp	Goldman Sachs	(136)
98	Wintrust Financial Corp	Morgan Stanley	(214)
341	Wix.com Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,063)
386	Wix.com Ltd	Goldman Sachs	(1,805)
559	Wix.com Ltd	Morgan Stanley	749
(403)	Wolfspeed Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,596
(22)	Wolfspeed Inc	Goldman Sachs	26
(24)	Wolfspeed Inc	Morgan Stanley	(22)
(265)	Wolverine World Wide Inc	Bank of America Merrill Lynch	129
(663)	Wolverine World Wide Inc	Goldman Sachs	253
33	Workday Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(41)
17	Workday Inc 'A'	Goldman Sachs	(21)
329	Workday Inc 'A'	Morgan Stanley	4,385
(8,245)	Workhorse Group Inc	Goldman Sachs	2,767
(331)	Workiva Inc	Goldman Sachs	1,221
(91)	Workiva Inc	Morgan Stanley	(190)
109	World Fuel Services Corp	Bank of America Merrill Lynch	19
254	World Fuel Services Corp	Goldman Sachs	43
207	World Wrestling Entertainment Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	165
719	World Wrestling Entertainment Inc 'A'	Goldman Sachs	1,125
317	World Wrestling Entertainment Inc 'A'	Morgan Stanley	(247)
5	Worthington Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1)
14	Worthington Industries Inc	Goldman Sachs	(9)
(64)	WSFS Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	182
(567)	WSFS Financial Corp	Goldman Sachs	1,616
(393)	WW International Inc	Bank of America Merrill Lynch	96
(1,904)	WW International Inc	Goldman Sachs	466
413	Xencor Inc	Bank of America Merrill Lynch	(429)
527	Xencor Inc	Goldman Sachs	(585)
(565)	Xenia Hotels & Resorts Inc (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	62
(637)	Xenia Hotels & Resorts Inc (REIT)	Goldman Sachs	70

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価 益/(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(56)	Xenon Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(97)
(219)	Xenon Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(380)
142	Xylem Inc	Bank of America Merrill Lynch	(253)
81	Xylem Inc	Goldman Sachs	(166)
343	Xylem Inc	Morgan Stanley	(858)
137	Yelp Inc	Bank of America Merrill Lynch	19
597	Yelp Inc	Goldman Sachs	(480)
(49)	YETI Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(73)
672	Yext Inc	Bank of America Merrill Lynch	(67)
2,094	Yext Inc	Goldman Sachs	(209)
59	Yum! Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	174
550	Yum! Brands Inc	Morgan Stanley	555
(119)	Zentalis Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	100
(560)	Zentalis Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	627
849	Zeta Global Holdings Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(68)
758	Zeta Global Holdings Corp 'A'	Goldman Sachs	(61)
(325)	Ziff Davis Inc	Bank of America Merrill Lynch	634
(126)	Ziff Davis Inc	Goldman Sachs	246
(159)	Ziff Davis Inc	Morgan Stanley	72
190	ZIM Integrated Shipping Services Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,049)
506	ZIM Integrated Shipping Services Ltd	Goldman Sachs	(2,793)
423	ZIM Integrated Shipping Services Ltd	Morgan Stanley	(1,717)
(287)	Zimmer Biomet Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,013)
43	Zions Bancorp NA	Morgan Stanley	(69)
782	ZipRecruiter Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(993)
1,205	ZipRecruiter Inc 'A'	Goldman Sachs	(1,530)
(567)	Zoom Video Communications Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	9,786
(252)	ZoomInfo Technologies Inc	Goldman Sachs	1,326
(1,835)	ZoomInfo Technologies Inc	Morgan Stanley	1,707
(27)	Zscaler Inc	Bank of America Merrill Lynch	223
17	Zumiez Inc	Bank of America Merrill Lynch	(12)
906	Zuora Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(861)
3,821	Zuora Inc 'A'	Goldman Sachs	(3,630)
217	Zurn Elkay Water Solutions Corp	Bank of America Merrill Lynch	(336)
1,937	Zurn Elkay Water Solutions Corp	Goldman Sachs	(1,317)
2,664	Zurn Elkay Water Solutions Corp	Morgan Stanley	(3,783)
			<u>16,440</u>
合計			<u>(135,585)</u>

* 注記2(a)に記載のとおり、公正価値調整の対象である有価証券。

0.5米ドル未満の金額は端数切捨てにより0と表示されている。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

契約数	契約通貨	契約 / 摘要		満期日	未実現純評価損 (米ドル)
デリバティブ金融商品					
先物取引					
11	USD	NASDAQ 100 E-Mini Stock Index Futures December 2022		2022年12月	(38,205)
合計					(38,205)

契約数	コール / プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現純評 価損 (米ドル)	時価 (米ドル)
デリバティブ金融商品							
買建オプション							
5	コール	E-Mini S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 4,150.00	16/12/2022	(16,345)	6,030
合計						(16,345)	6,030

契約数	コール / プット	摘要	取引相手	行使価格	満期日	未実現純評 価益 (米ドル)	時価 (米ドル)
デリバティブ金融商品							
売建オプション							
(5)	コール	E-Mini S&P 500 Index	Exchange Traded	USD 4,350.00	16/12/2022	3,850	(350)
合計						3,850	(350)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現純評価益 / (損) (米ドル)
デリバティブ金融商品						
未決済先渡為替予約						
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	25,918,222	USD	25,982,526	State Street Bank & Trust Company	15/12/2022	954,962
USD	588,950	EUR	575,438	State Street Bank & Trust Company	15/12/2022	(9,119)
						945,843
ヘッジを使用した英ポンド建投資証券クラス						
GBP	272,708	USD	330,366	State Street Bank & Trust Company	15/12/2022	(2,933)
USD	2,831	GBP	2,370	State Street Bank & Trust Company	15/12/2022	(14)
						(2,947)
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	840,286	USD	77,660	State Street Bank & Trust Company	15/12/2022	2,193
USD	661	SEK	6,967	State Street Bank & Trust Company	15/12/2022	(2)
						2,191
合計						945,087

業種別内訳 2022年11月30日現在(未監査)

	純資産比率(%)
政府債	89.60
総合事業	0.92
技術	0.17
金融	0.00
投資有価証券 - 時価	90.69
その他の純資産	9.31
	100.00

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】(2023年7月末現在)

「ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド(為替ヘッジあり)」

資産総額	20,396,154円
負債総額	6,010円
純資産総額(-)	20,390,144円
発行済数量	23,443,839口
1単位当たり純資産額(/)	0.8697円

「ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド(為替ヘッジなし)」

資産総額	762,408,061円
負債総額	223,444円
純資産総額(-)	762,184,617円
発行済数量	614,886,158口
1単位当たり純資産額(/)	1.2396円

(参考情報)

「世界株式絶対収益追求マザーファンド」

資産総額	782,529,581円
負債総額	0円
純資産総額(-)	782,529,581円
発行済数量	512,799,069口
1単位当たり純資産額(/)	1.5260円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

1 受益証券の名義書換え等
該当事項はありません。

2 受益者名簿の閉鎖の時期
受益者名簿は作成していません。

3 投資者に対する特典
該当事項はありません。

4 内国投資信託受益証券の譲渡制限の内容
譲渡制限は設けておりません。

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

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

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

の振替について、委託会社は、当該投資者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

7 受益権の譲渡の対抗要件
受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

8 受益権の再分割
委託会社は、受益権の再分割を行いません。ただし、受託会社と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

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

10 質権口記載または記録の受益権の取り扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額等

資本金 3,120百万円

発行する株式の総数 36,000株

発行済株式の総数 15,000株

直近5カ年における主な資本金の額の増減 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7月末現在、以下の通りです(親投資信託を除きます。)

種類	本数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	196	11,220,168
単位型株式投資信託	73	452,082
合計	269	11,672,250

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)
負債の部		
流動負債		
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
固定負債		
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
純資産の部		
株主資本		
資本金	3,120	3,120
資本剰余金		
資本準備金	3,001	3,001
その他資本剰余金	3,846	3,846
資本剰余金合計	6,847	6,847
利益剰余金		
利益準備金	336	336
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	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
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	3	3
評価・換算差額等合計	3	3
純資産合計	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 (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

【中間財務諸表】

1．中間財務諸表の作成方法について

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

2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、中間会計期間（自2023年1月1日 至2023年6月30日）の中間財務諸表について有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

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

(1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

		中間会計期間末 (2023年6月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	2	14,894
立替金		83
前払費用		208
未収入金		21
未収委託者報酬		1,869
未収運用受託報酬		1,940
未収収益		1,823
流動資産計		20,840
固定資産		
有形固定資産		
建物附属設備	1	610
器具備品	1	517
有形固定資産計		1,127
無形固定資産		
ソフトウェア		14
無形固定資産計		14
投資その他の資産		
投資有価証券		49
長期差入保証金		1,122
前払年金費用		1,115
長期前払費用		10
繰延税金資産		257
投資その他の資産計		2,554
固定資産計		3,697
資産合計		24,537

(単位：百万円)

中間会計期間末
(2023年6月30日)

負債の部	
流動負債	
預り金	186
未払金	
未払収益分配金	5
未払償還金	70
未払手数料	424
その他未払金	105
未払費用	669
未払消費税等	148
未払法人税等	786
前受金	383
賞与引当金	814
役員賞与引当金	62
早期退職慰労引当金	43
為替予約	2
流動負債計	3,703
固定負債	
退職給付引当金	93
資産除去債務	962
固定負債計	1,055
負債合計	4,759
純資産の部	
株主資本	
資本金	3,120
資本剰余金	
資本準備金	3,001
その他資本剰余金	3,846
資本剰余金合計	6,847
利益剰余金	
利益準備金	336
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	9,474
利益剰余金合計	9,810
株主資本合計	19,777
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	0
評価・換算差額等合計	0
純資産合計	19,777
負債・純資産合計	24,537

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

	中間会計期間 (自 2023年1月1日 至 2023年6月30日)
営業収益	
委託者報酬	3,194
運用受託報酬	4,085
その他営業収益	8,884
営業収益計	16,164
営業費用	
支払手数料	758
広告宣伝費	35
調査費	
調査費	174
委託調査費	2,363
調査費計	2,537
委託計算費	55
営業雑経費	
通信費	37
印刷費	37
諸会費	27
営業雑経費計	102
営業費用計	3,490
一般管理費	
給料	
役員報酬	558
給料・手当	2,975
賞与	1,408
給料計	4,941
退職給付費用	241
福利厚生費	603
事務委託費	1,943
交際費	23
旅費交通費	82
租税公課	138
不動産賃借料	453
水道光熱費	41
固定資産減価償却費	242
資産除去債務利息費用	1
諸経費	196
一般管理費計	8,909
営業利益	3,764

(単位：百万円)

	中間会計期間 (自 2023年1月1日 至 2023年6月30日)
営業外収益	
受取配当金	0
受取利息	0
為替差益	107
雑益	0
その他	0
営業外収益計	108
営業外費用	
支払利息	0
営業外費用計	0
経常利益	3,872
特別利益	
特別利益計	-
特別損失	
特別退職金	45
特別損失計	45
税引前中間純利益	3,826
法人税、住民税及び事業税	688
法人税等調整額	639
中間純利益	2,497

(3) 中間株主資本等変動計算書

中間会計期間 (自 2023年1月1日 至 2023年6月30日)

(単位:百万円)

	株主資本							評価・換算差額等		純資産 合計	
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			株主資本 合計	その他有 価証券評 価差額金		評価・換算 差額等合計
		資本 準備金	その他資本 剰余金	資本 剰余金 合計	利益 準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計				
当期首残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	10,276	10,612	20,580	3	3	20,576
当中間期変動額											
剰余金の配当						3,300	3,300	3,300			3,300
中間純利益						2,497	2,497	2,497			2,497
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)									3	3	3
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	802	802	802	3	3	798
当中間期末残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	9,474	9,810	19,778	0	0	19,777

注 記 事 項

(重要な会計方針)

項 目	中間会計期間 自 2023年1月 1日 至 2023年6月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>その他有価証券 時価のあるもの 決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定）を採用しております。</p>
2. デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	<p>時価法を採用しております。</p>
3. 固定資産の減価償却方法	<p>(1) 有形固定資産 定額法により償却しております。 なお、主な耐用年数は建物附属設備6～18年、器具備品3～15年であります。</p> <p>(2) 無形固定資産 自社利用のソフトウェアの減価償却方法については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
4. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金の計上方法 債権の貸倒損失に備えるため、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 退職給付引当金の計上方法 旧退職金制度 適格退職年金制度移行日現在在籍していた従業員については、旧退職制度に基づく給付額を保証しているため、中間会計期間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）については拠出額を費用計上しております。 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。 過去勤務費用は、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の翌事業年度から費用処理または費用から控除することとしております。</p> <p>(3) 賞与引当金の計上方法 従業員の賞与の支払に備えて、賞与支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。</p>

	<p>(4) 役員賞与引当金の計上方法 役員の賞与の支払に備えて、賞与支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(5) 早期退職慰労引当金の計上方法 早期退職慰労金の支払に備えて、早期退職慰労金支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。</p>
<p>5. 外貨建の資産又は負債の本邦通貨への換算基準</p>	<p>外貨建金銭債権債務は、中間会計期間末の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。</p>
<p>6. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬、その他営業収益および成功報酬を稼得しております。当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主要な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点(収益を認識する通常の時点)は以下のとおりであります。</p> <p>委託者報酬：当社は投資信託の信託約款に基づき、投資信託の運用について履行義務を負っております。委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産価額に対する一定割合として計算され、投資信託の運用期間にわたり収益認識しております。</p> <p>運用受託報酬：当社は顧客との投資一任契約及び投資助言契約に基づき運用及び助言について履行義務を負っております。運用受託報酬は、対象顧客との投資一任契約等に基づき純資産価額に対する一定割合として計算され、対象口座の運用期間にわたり収益認識しております。</p> <p>その他営業収益：当社はグループ会社との契約に基づき委託された業務について履行義務を負っております。グループ会社から受領する収益は、当社のグループ会社との契約で定められた算式に基づき、当社がグループ会社にオフショアファンド関連のサービス等を提供する期間にわたり月次で収益認識しております。</p> <p>成功報酬：成功報酬は対象となるファンドまたは口座の運用益に対する一定割合、もしくは特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として計算されます。当該報酬は契約上支払われることが確定した時点で収益認識しております。</p>
<p>7. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>グループ通算制度の適用 当社は、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通算親会社とするグループ通算制度を適用しております。</p>

(中間株主資本等変動計算書関係)

中間会計期間					
自 2023年1月 1日					
至 2023年6月30日					
1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項					
	前事業年度末 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計 期間末株式数	
発行済株式					
普通株式	15,000	-	-	15,000	
合計	15,000	-	-	15,000	
2. 自己株式の種類及び株式数に関する事項					
該当事項はありません。					
3. 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項					
該当事項はありません。					
4. 配当に関する事項					
(1) 配当金支払額					
	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
2023年3月31日 株主総会決議	普通株式	3,300	220,000	2022年12月31日	2023年3月31日
(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの					
該当事項はありません。					

(リース取引関係)

中間会計期間	
自 2023年1月 1日	
至 2023年6月30日	
オペレーティング・リース取引	
オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料	
1年以内	487百万円
1年超	1,782百万円
合計	2,270百万円

(金融商品関係)

中間会計期間
自 2023年1月 1日
至 2023年6月30日

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金等に限定し、また、資金調達については関連当事者からの長期借入に限定しています。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

営業債務である未払手数料はその全てが1年以内の支払期日となっております。

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

2023年6月30日（中間期の決算日）における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりです。なお、金額的重要性が低いと判断するものは含めておりません。

（単位：百万円）

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
長期差入保証金	1,122	1,103	19

（注1）

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

（注2）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

レベル3の時価：重要な観察できないインプットを使用して算定した時価

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

（単位：百万円）

	レベル1	レベル2	レベル3	合計
長期差入保証金	-	1,103	-	1,103

（注）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

長期差入保証金

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

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

(資産除去債務関係)

中間会計期間	
自 2023年1月 1日	
至 2023年6月30日	
資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの	
1. 当該資産除去債務の概要	当社事業所の定期建物賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。
2. 当該資産除去債務の金額の算定方法	使用見込期間を合理的に見積り、割引率は0.16%～0.72%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。
3. 当中間会計期間における当該資産除去債務の総額の増減	
期首残高	961 百万円
有形固定資産の取得に伴う増加額	- 百万円
時の経過による調整額	1 百万円
中間会計期間末残高	<u>962</u> 百万円

(収益認識関係)

中間会計期間	
自 2023年1月 1日	
至 2023年6月30日	
1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報	
委託者報酬	3,194 百万円
運用受託報酬	3,989 百万円
成功報酬（注）	95 百万円
その他営業収益	8,884 百万円
合計	<u>16,164</u> 百万円
（注）成功報酬は、中間損益計算書において運用受託報酬に含めて表示しております。	
2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報 （重要な会計方針）6. 収益及び費用の計上基準に記載のとおりです。	
3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに中間会計期間末において存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報 重要性が乏しいため、記載を省略しています。	

(セグメント情報等)

中間会計期間

自 2023年1月 1日

至 2023年6月30日

1. セグメント情報

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

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスに関する情報

(単位：百万円)

	委託者 報酬	運用受託 報酬	その他	合計
外部顧客 営業収益	3,194	4,085	8,884	16,164

(2) 地域に関する情報

売上高

(単位：百万円)

日本	北米	その他	合計
7,086	7,451	1,626	16,164

(注) 売上高は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客に関する情報

営業収益の10%以上を占める主要な顧客は以下のとおりです。

(単位：百万円)

相手先	営業収益	関連する セグメント名
ブラックロック・ファイナンシャル・ マネジメント・インク	3,625	投資運用業
ブラックロック・ファンド・アドバイ ザーズ	2,477	投資運用業

(1株当たり情報)

中間会計期間	
自	2023年1月1日
至	2023年6月30日
1株当たり純資産額	1,318,516円64銭
1株当たり中間純利益	166,533円13銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。	
1株当たり中間純利益の算定上の基礎	
損益計算書上の中間純利益	2,497百万円
1株当たり中間純利益の算定に 用いられた普通株式に係る中間純利益	2,497百万円
期中平均株式数	15,000株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

変更年月日	変更事項
2007年9月18日	証券業登録に伴う商号変更(「パークレイズ・グローバル・インベスターズ証券投資顧問株式会社」に変更)のため、定款変更を行いました。
2007年9月30日	商号変更(「パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社」に変更)のため、定款変更を行いました。
2007年9月30日	公告の方法を変更するため、定款変更を行いました。
2007年12月27日	事業を営むこと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 : みずほ信託銀行株式会社
- ・資本金の額 : 247,369百万円（2023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（2023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) (2023年3月末現在)	事業の内容
みずほ証券株式会社	125,167	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

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

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【参考情報】

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

2023年4月14日

有価証券報告書

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9月29日

ブラックロック・ジャパン株式会社
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 鶴田 光夫

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド(為替ヘッジあり)の2023年1月17日から2023年7月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド(為替ヘッジあり)の2023年7月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2023年9月29日

ブラックロック・ジャパン株式会社
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 鶴田 光夫

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド（為替ヘッジなし）の2023年1月17日から2023年7月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ブラックロック世界株式絶対収益追求ファンド（為替ヘッジなし）の2023年7月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年8月31日

ブラックロック・ジャパン株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ

東京事務所

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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているブラックロック・ジャパン株式会社の2023年1月1日から2023年12月31日までの第37期事業年度の中間会計期間（2023年1月1日から2023年6月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ブラックロック・ジャパン株式会社の2023年6月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2023年1月1日から2023年6月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査役の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。