

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 2019年3月15日

【発行者名】 ブラックロック・ジャパン株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役会長 井澤 吉幸

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目8番3号

【事務連絡者氏名】 猪浦 純子

【電話番号】 03-6703-7940

【届出の対象とした募集(売出)内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】 サイエнтиフィック・エクイティ・ファンド
(愛称：ザ・アメリカズ・ロングショート)

【届出の対象とした募集(売出)内国投資信託受益証券の金額】 600億円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

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

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

サイエンティフィック・エクイティ・ファンド

（ファンドの愛称を「ザ・アメリカズ・ロングショート」とします。以下「当ファンド」または「ファンド」といいます。）

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

当初元本は、1口当り1円です。

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

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

(3)【発行（売出）価額の総額】

600億円を上限とします。

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

(4)【発行（売出）価格】

購入受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額につきましては、販売会社または下記にお問い合わせください。

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

ホームページアドレス： www.blackrock.com/jp/

(5)【申込手数料】

購入時の申込手数料（以下「購入時手数料」といいます。）は、購入受付日の翌営業日の基準価額に4.32%（税抜4.00%）を上限として、販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

詳細は、販売会社にお問い合わせください。

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

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

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

(6)【申込単位】

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

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

(7)【申込期間】

2019年3月16日から2019年9月20日まで

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

(8)【申込取扱場所】

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

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

ホームページアドレス： www.blackrock.com/jp/

(9)【払込期日】

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

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

(10)【払込取扱場所】

上記「(8)申込取扱場所」でお払込みください。

(11)【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構です。

(12)【その他】

購入代金の利息

購入代金には利息をつけません。

日本以外の地域における発行

行ないません。

購入不可日

販売会社の営業日であっても、ルクセンブルグの銀行の休業日、12月24日、その他実質的な主要投資対象ファンドの受付不可日のいずれかに該当する場合は、購入は受け付けません。

振替受益権について

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

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

(参考)

投資信託振替制度とは、

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

「サイエンティフィック・エクイティ・ファンド」（ファンドの愛称を「ザ・アメリカズ・ロングショート」とします。以下「当ファンド」または「ファンド」といいます。）は、市場動向に左右されない投資収益の達成を目標に運用を行ないます。

当ファンドは、追加型証券投資信託であり、追加型投信／海外／株式／特殊型（ロング・ショート型）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 (ロング・ショート型)

<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	年1回	グローバル	ファミリー	あり	ブル・ベア型
一般	年2回	日本	ファンド	(フルヘッジ)	
大型株	年4回	北米			条件付運用型
中小型株	年6回	欧州	ファンド・	なし	
債券	(隔月)	アジア	オブ・		ロング・ショ-
一般	年12回	オセアニア	ファンズ		ト型 / 絶対収益
公債	(毎月)	中南米			追求型
社債	日々	アフリカ			
その他債券	その他	中近東			その他
クレジット属性		(中東)			
不動産投信		エマージング			
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					

< 各分類および区分の定義 >

．商品分類

単位型投信・追加型投信の区分	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。
投資対象地域による区分	海外	目論見書又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	目論見書又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 (ロング・ショート型)	目論見書又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(ロング・ショート戦略)の記載があるものをいう。

．属性区分

投資対象資産による属性区分	その他資産（投資信託証券）	目論見書又は投資信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいう。
決算頻度による属性区分	年2回	目論見書又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	北米 中南米	目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域および中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
投資形態による属性区分	ファミリーファンド	目論見書又は投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいう。
為替ヘッジによる属性区分	為替ヘッジあり (フルヘッジ)	目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行なう旨の記載があるものをいう。なお、「為替ヘッジ」とは、対円での為替リスクに対するヘッジの有無をいう。
特殊型による属性区分	ロング・ショート型	目論見書又は投資信託約款において、ロング・ショート戦略により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、かつマザーファンドはファンド・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（<http://www.toushin.or.jp/>）をご参照ください。

信託金の限度額は、600億円です。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. アメリカ大陸株式（米国、カナダおよびラテンアメリカ諸国の株式）等を投資対象として、ロングショート（買い建て・売り建て）ポジションを構築することにより、市場動向に左右されない投資収益の達成を目標に運用を行ないます。

アメリカズ・ロングショート・マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として米国、カナダおよびラテンアメリカ諸国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・売り建て）ポジションを構築する投資信託証券を実質的な主要投資対象とします。副次的な投資対象として、米国の短中期国債等に投資する投資信託証券にも投資を行ないます。通常、実質的な主要投資対象ファンドへの投資割合を高位に保ちます。

各投資信託証券への投資割合は、原則として市況動向および各投資信託証券の収益性等を勘案して委託会社が決定します。

実質的な主要投資対象ファンドは、米国、カナダおよびラテンアメリカ諸国の中小型株を含む約4,000の幅広い株式を投資候補銘柄とします。また、投資にあたってはデリバティブ取引（スワップなど）を活用します。

上記の投資候補銘柄数は、今後変更になる可能性があります。

買い建て額と売り建て額の合計であるグロスポジションは、実質的な主要投資対象ファンドの純資産総額の200～600%の範囲内とします。

実質的な主要投資対象ファンドの投資手法およびグロスポジションの割合は将来変更になる場合があります。

実質的な主要投資対象ファンドのロングショート戦略は、ブラックロック独自の計量モデルを活用することで運用を行ないます。

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。

<実質的な主要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、ロングショート戦略によりポートフォリオを構築します。

<イメージ図>



上記の投資候補銘柄数は、今後変更になる可能性があります。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

実質的な主要投資対象ファンドの運用体制等は、変更となる場合があります。

b. ファンドは、アメリカズ・ロングショート・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。

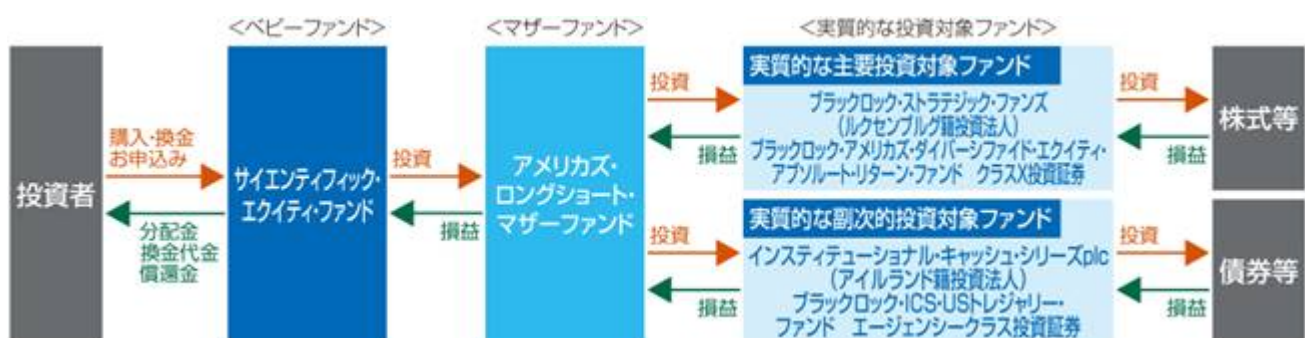
ファンドは、マザーファンドを通じて、投資信託証券を投資対象とするファンド・オブ・ファンズです。

マザーファンドは「BSF ブラックロック・アメリカズ・ダイバーシファイド・エクイティ・アブソルート・リターン・ファンド^{*1}」と「ICSブラックロック・ICS・USTレジャーリー・ファンド^{*2}」に投資します。

*1 正式名称は、「ブラックロック・ストラテジック・ファンズ(ルクセンブルグ籍投資法人) ブラックロック・アメリカズ・ダイバーシファイド・エクイティ・アブソルート・リターン・ファンド クラスX投資証券」です。

*2 正式名称は、「インスティテューショナル・キャッシュ・シリーズplc(アイルランド籍投資法人) ブラックロック・ICS・USTレジャーリー・ファンド エージェンシークラス投資証券」です。

<ファンドの仕組み>



投資対象ファンドは、委託会社の判断により適宜見直しを行なうことがあります。

c. 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。

当ファンドは、マザーファンドが投資する米ドル建て投資信託証券等(実質外貨建資産)に対して対円の為替ヘッジを行いません。

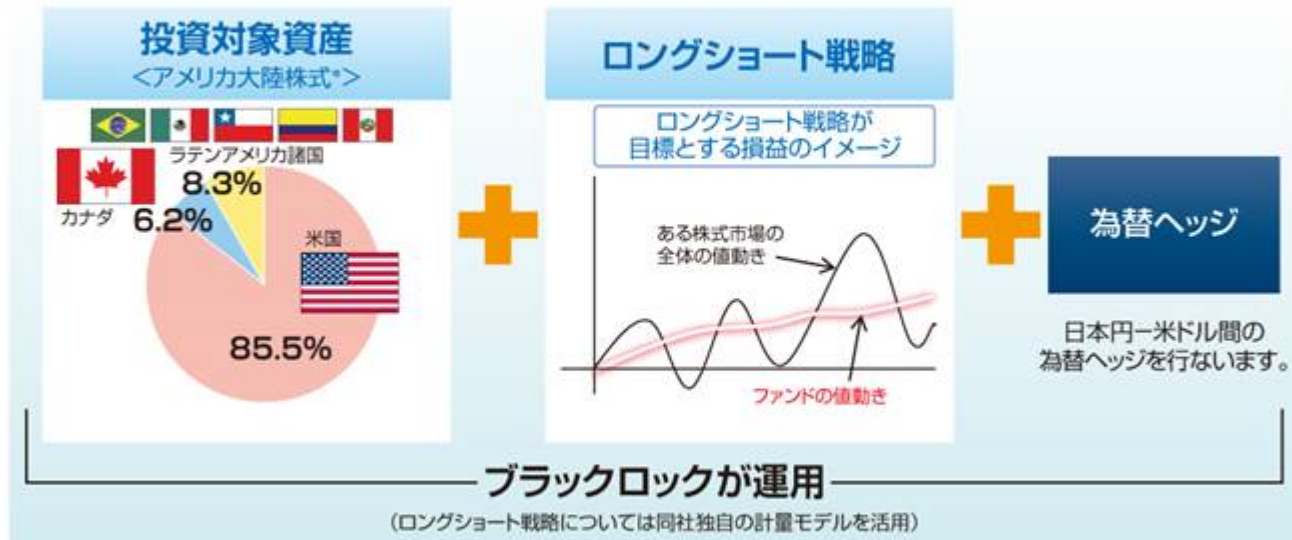
また、実質的な主要投資対象ファンドは現地通貨建てで投資を行なう場合があり、通常は現地通貨にかかる為替変動リスクは、ロングショート戦略において相殺されますが、ロングポジションとショートポジションの割合が一致しない等の場合には米ドルに対する現地通貨の為替レートの変動が、間接的に当ファンドの運用成果に影響を与えます。

(追加的記載事項)

当ファンドの投資戦略のポイント

- アメリカ大陸株式*を投資対象とした、ロングショート戦略を用います。
- 市場動向に左右されない投資収益の達成を目標に運用を行ないます。

[イメージ図]



*アメリカ大陸株式とは米国、カナダおよびラテンアメリカ諸国の株式を指します。

※上記投資対象資産の比率は、実質的な主要投資対象ファンドの2018年12月末の国・地域別投資比率であり、運用状況により変動します。なお、投資比率は実質的な主要投資対象ファンドにおける投資比率であり、当ファンドにおける実質投資比率とは異なります。また、四捨五入の関係で比率の合計が100にならない場合があります。

※上記は、当ファンドをご理解頂くことを目的に作成したイメージ図であり、当ファンドの運用すべてを網羅しているものとは限りません。

投資魅力度の算出について

- 独自の情報分析力と計量運用のノウハウを駆使し、大量の投資情報を迅速に入手、分析します。
- 企業分析や割安度分析などの中長期的な情報に加えて、市場分析による短期的な投資家動向等の情報を踏まえて、投資魅力度を算出します。さらに米国市場においては、短中期的な投資戦略として、株価の歪みや、コーポレートアクション等のイベントに対する短期的なモメンタムにも着目します。

投資魅力度算出の主な着眼点



※投資魅力度の算出に際しては、上記以外の項目に着眼する場合があります。

※資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。運用プロセスは変更がある場合があります。

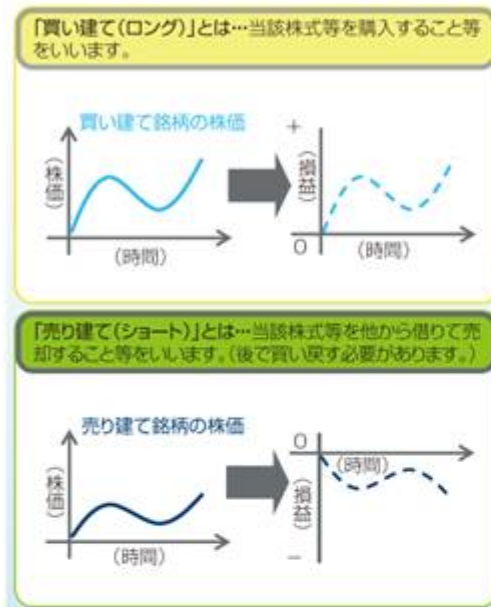
ロングショート戦略とは

■ ロングショート戦略とは、相対的に投資魅力度の高い資産を買い建て（ロング）、相対的に投資魅力度が低い資産を売り建て（ショート）する投資手法をいいます。

「買い建て」銘柄の方が「売り建て」銘柄よりも良いパフォーマンスの場合にロングショート戦略全体としての損益はプラスになります（逆の場合には、損益はマイナスになります）。

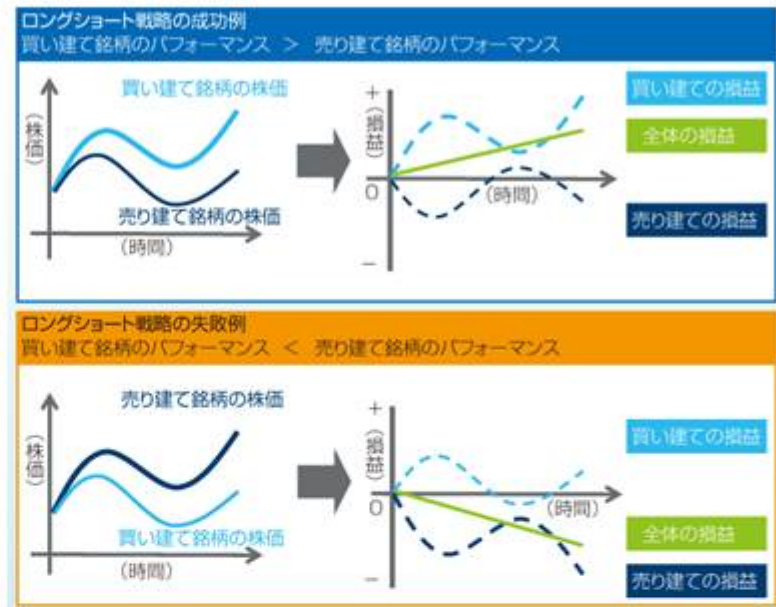
「買い建て」と「売り建て」について

[イメージ図]



ロングショート戦略による損益①

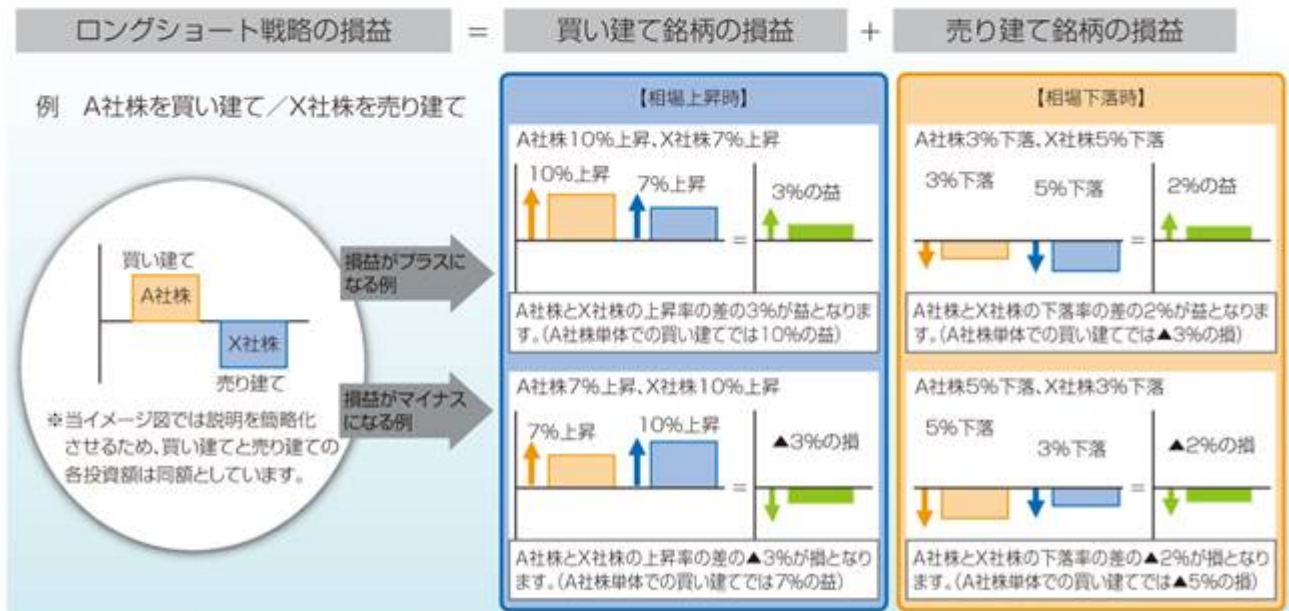
[イメージ図]



ロングショート戦略による損益②

■ 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]



実質的な主要投資対象ファンドの概要

ファンド名	ブラックロック・ストラテジック・ファンズ ブラックロック・アメリカス・ダイバーシファイド・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アブソルート・リターンの追求を目指します。 ファンドの純資産の少なくとも70%を米国、カナダおよびラテンアメリカ諸国の株式もしくは株式関連の派生商品等へ投資を行ないます。 ファンドは、投資対象とする株式市場へのネットエクスポージャーを最小限にすることを旨として、広く分散投資を行ないます。
設定日	2012年2月17日
管理会社	ブラックロック(ルクセンブルグ)エス・エー
投資顧問会社	ブラックロック・インスティテューショナル・トラスト・カンパニー、エヌ・エイ、

ブラックロック・グループについて

- ブラックロック・グループは、運用資産残高約5.97兆ドル*(約655兆円)を持つ世界最大級の独立系資産運用グループであり、ブラックロック・ジャパン株式会社はその日本法人です。
- 当グループは、世界各国の機関投資家および個人投資家のため、株式、債券、キャッシュ・マネジメントおよびオルタナティブ商品といった様々な資産クラスの運用を行なっております。また、機関投資家向けに、リスクマネジメント、投資システム・アウトソーシングおよびファイナンシャル・アドバイザー・サービスの提供を行なっております。

*2018年12月末現在(円換算レートは1ドル=109.715円を使用)。



【ニューヨークのグループ本社】

(2) 【ファンドの沿革】

2012年11月30日

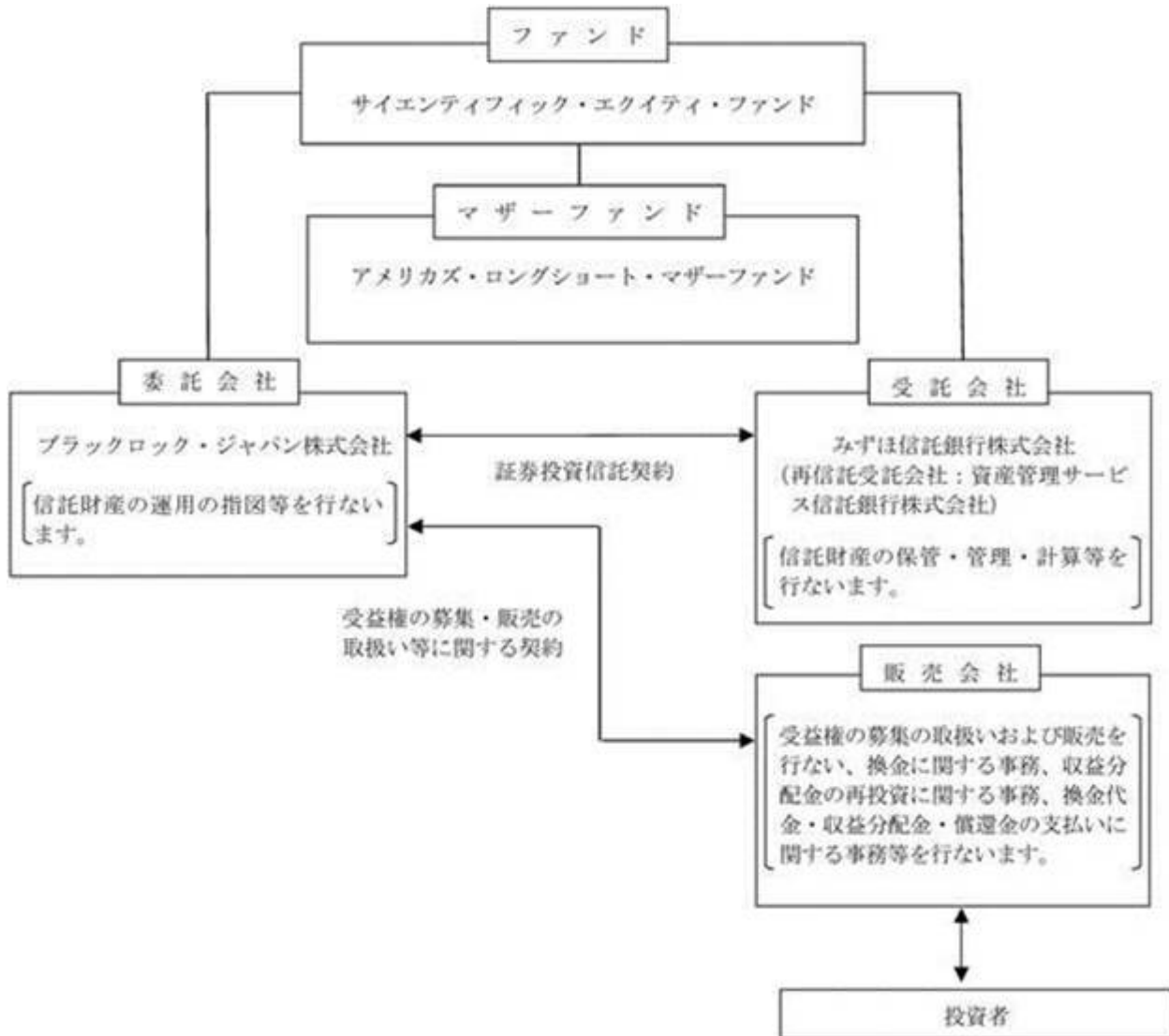
信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

2017年3月18日

マザーファンド名称を「ブラックロック・アメリカズ・ロングショート・マザーファンド」から「アメリカズ・ロングショート・マザーファンド」に変更

(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 >

2018年12月末現在の委託会社の概況は、以下のとおりです。

a . 資本金 3,120百万円

b . 沿革

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

c . 大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

アメリカズ・ロングショート・マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として米国、カナダおよびラテンアメリカ諸国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（売建および買建）ポジションを構築することにより市場動向に左右されない投資収益を追求する投資信託証券に投資を行いません。副次的な投資対象として、短期債券等に投資する投資信託証券にも投資を行いません。投資対象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。

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。

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

<参考> マザーファンドの運用の基本方針

アメリカズ・ロングショート・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ない投資収益の達成を目標に運用を行いません。

2. 運用方法

(1)投資対象

主として米国、カナダおよびラテンアメリカ諸国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（売建および買建）ポジションを構築することにより市場動向に左右されない投資収益を追求する投資信託証券に投資を行いません。副次的な投資対象として、短期債券等に投資する投資信託証券にも投資を行いません。投資信託証券には、国内投資信託または外国投資信託の受益証券、投資証券、または外国投資証券が含まれません。

(2)投資態度

主として米国、カナダおよびラテンアメリカ諸国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（売建および買建）ポジションを構築することにより市場動向に左右されない投資収益を追求する投資信託証券（以下、「主要投資対象ファンド」といいます。）に投資を行いません。副次的な投資対象として、短期債券等に投資する投資信託証券にも投資を行いません。投資対象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。

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

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、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。

資金動向、市場動向、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せん。

(2)【投資対象】**投資対象とする資産の種類**

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

- a．有価証券
- b．金銭債権
- c．約束手形（手形割引市場において売買される手形に限ります。）

投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主としてアメリカズ・ロングショート・マザーファンド受益証券のほか、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）に限り行なうことができるものとします。

投資対象とする金融商品

このファンドの設定、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) B S F ブラックロック・アメリカズ・ダイバーシファイド・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アブソルート・リターンの追求を目指します。ファンドの純資産の少なくとも70%を米国、カナダおよびラテンアメリカ諸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せん。ファンドは、投資対象とする株式市場へのネットエクスポージャーを最小限にすることを旨として、広く分散投資を行いません。
設定日	2012年2月17日
存続期間	無期限
主な投資対象	米国、カナダおよびラテンアメリカ諸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	ありません。(注)
その他費用	管理業務会社、保管会社および名義書換事務代行会社への報酬等および事務諸費に要する費用についてはファンドから差し引かれます。
決算日	年1回（原則として5月末日）に決算を行いません。
収益分配方針	原則として、分配を行いません。
申込手数料	ありません。
管理会社	ブラックロック（ルクセンブルグ）エス・エー
投資顧問会社	ブラックロック・イン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・ルクセンブルグ・エス・シー・エー

(注) 投資対象ファンドにかかる報酬相当額は、委託会社の信託報酬より支払われます。

(b) ICS ブラックロック・ICS・USTレジャーリー・ファンド

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

(3) 【運用体制】

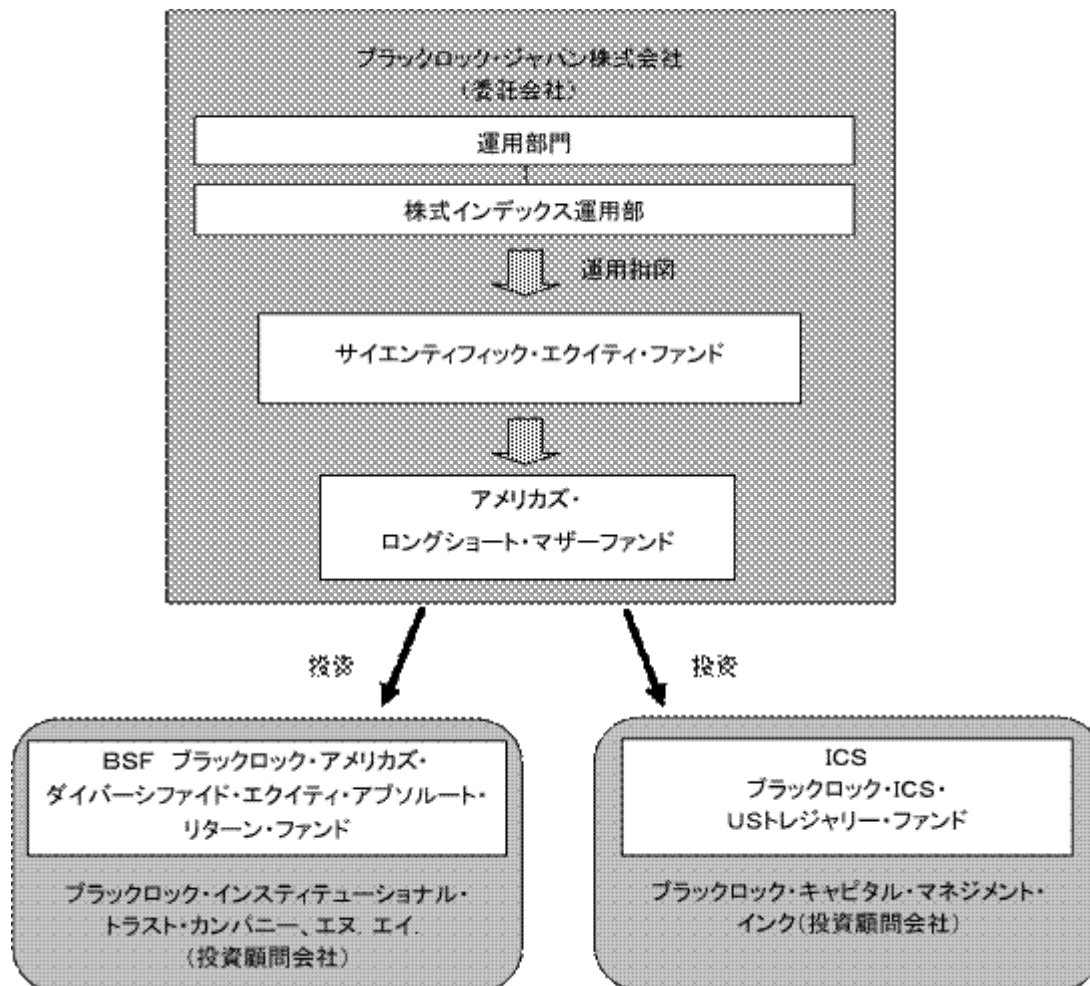
ファンドの運用・管理の各業務の役割分担を社内規程により定めております。

ファンドの運用については委託会社の運用部門が統括しています。

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

当ファンドの運用は、株式インデックス運用部（当ファンド担当：9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5.97兆ドル^{*}（約655兆円）を持つ世界最大級の独立系資産運用グループであり、当社はその日本法人です。

当グループは、世界各国の機関投資家および個人投資家のため、株式、債券、キャッシュ・マネジメントおよびオルタナティブ商品といった様々な資産クラスの運用を行なっております。また、機関投資家向けに、リスク管理、投資システム・アウトソーシングおよびファイナンシャル・アドバイザー・サービスの提供を行なっております。

^{*} 2018年12月末現在。(円換算レートは1ドル=109.715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6月20日および12月20日。休業日の場合は翌営業日。)に、原則として以下の方針に基づき、分配を行ないます。

a. 分配対象額の範囲

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

b. 分配対象収益についての分配方針

分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。基準価額水準、市況動向等によっては分配を行なわないことがあります。将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

c. 留保益の運用方針

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

収益の分配

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

(a) 利子、配当金およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額(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ないます。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なわない場合はその権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は委託会社に帰属します。

(5)【投資制限】

以下は当ファンドの約款で定める投資制限です。

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

投資信託証券への投資制限

投資信託証券への実質投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資制限

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

公社債の借入れ

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

外国為替予約の指図および範囲

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

信用リスク集中回避のための投資制限

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

資金の借入れ

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

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様に帰属します。したがって、当ファンドは元金および元金からの収益の確保が保証されているものではなく、基準価額の下落により投資者は損失を被り、元金を割り込むことがあります。また、投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドにかかる主なリスクは以下の通りです。

基準価額の変動要因

a．ロングショート戦略によるリスク

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

b．株式の価格変動リスク

当ファンドの実質的な主要投資対象ファンドは、米国、カナダおよびラテンアメリカ諸国の発行体が発行する株式および株式関連の派生商品に投資を行ないます。したがって、米国、カナダおよびラテンアメリカ諸国の経済・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。

（中小型株式投資のリスク）

当ファンドの実質的な主要投資対象ファンドは、株式市場平均に比べ時価総額の小さな企業の株式および株式関連の派生商品にも投資を行ないます。これらの企業への投資は、株式市場全体の平均に比べて結果としてより大きな値上がりもしくは値下がりとなる可能性があります。これは比較的小規模の企業は大規模の企業に比べ収益の変動が大きくなる傾向があることに加え、株式市場における需給関係の変動の影響を受けやすいためです。

（カントリー・リスク）

当ファンドの実質的な主要投資対象ファンドはラテンアメリカ諸国の株式市場にも投資をします。ラテンアメリカ諸国のような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、主とし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。

c．デリバティブ取引のリスク

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

（レバレッジ・リスク）

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

（デリバティブ取引の取引先に関するリスク）

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

d．為替変動リスク

当ファンドのマザーファンドは、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ないますが、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も高い場合、ヘッジ・コストがかかります。

なお、実質的な主要投資対象ファンドは現地通貨建てで投資を行なう場合があります。通常は現地通貨にかかる為替変動リスクは、ロングショート戦略において相殺されますが、ロングポジションとショートポジションの割合が一致しない等の場合には米ドルに対する現地通貨の為替レートの変動が、当ファンドの運用成果に影響を与えます。

e．債券投資のリスク

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

ファンド運営上のリスク

a．購入および換金の受付の中止・取消

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、受益権の購入および換金の受付を中止する場合があります。また、この場合、既に受付けた受益権の購入および換金の受付についても取り消す場合があります。

b．ファンドの繰上償還

当ファンドは換金により受益権の口数が20億口を下回ることとなった場合、または投資者のため有利と認められる場合、その他やむを得ない事情が発生したとき等は、ファンドを償還させる場合があります。

c．法令・税制・会計等の変更

法令・税制・会計方法等は今後変更される可能性があります。

d．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

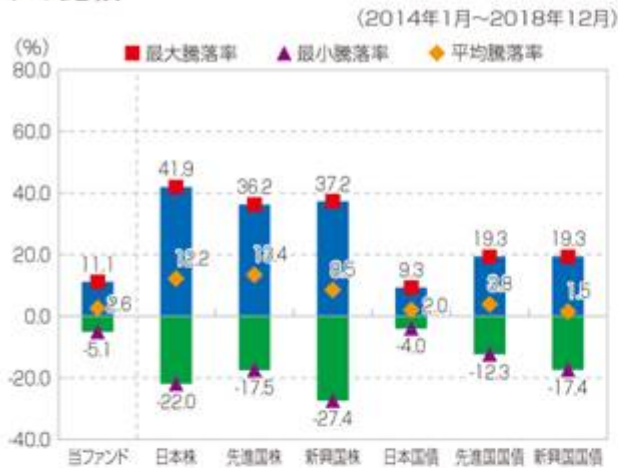
委託会社ではリスク管理を重視しており、独自開発のシステムを用いてリスク管理を行なっております。具体的には、運用担当部門とは異なる部門においてファンドの投資リスクの計測・分析、投資制限のモニタリングなどを行なうことにより、ファンドの投資リスクが運用方針に合致していることを確認し、その結果を運用担当部門にフィードバックするほか、社内関係者で共有しております。また、委託会社の業務に関するリスクについて社内規程を定めて管理を行なっております。

その他、デリバティブ取引のリスク管理として、実質的な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なっています。

リスクの管理体制は、変更となる場合があります。

(参考情報)

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※上記グラフは、2014年1月～2018年12月の5年間の各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドについては、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算しており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※各資産クラスの指数

- 日本株…………… 東証株価指数(配当込み)
- 先進国株……… MSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)
- 新興国株……… MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
- 日本国債……… NOMURA-BPI国債
- 先進国国債… FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
- 新興国国債… J.P.モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバースィファイド(円ベース)

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

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



※上記グラフは、2014年1月～2018年12月の5年間の各月末における分配金再投資基準価額の1年間の騰落率および分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算しており、実際の基準価額と異なる場合があります。

<各指数について>

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

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

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

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

購入時の申込手数料（以下「購入時手数料」といいます。）は、購入受付日の翌営業日の基準価額に4.32%（税抜4.00%）を上限として、販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

詳細は、販売会社にお問い合わせください。

販売会社につきましては、下記にお問い合わせください。

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

ホームページアドレス： www.blackrock.com/jp/

なお、購入時手数料には消費税等相当額が含まれています（以下同じ。）。

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

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

(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

計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年2.56824%（税抜2.378%）の率を乗じて得た金額とします。

信託報酬に係る委託会社、販売会社、受託会社間の配分および当該報酬を対価とする役務の内容は次の通りとします。

	信託報酬の配分	役務の内容
委託会社	年1.728% (税抜1.60%)	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0.810% (税抜0.75%)	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0.03024% (税抜0.028%)	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行等

実質的な投資対象ファンドにかかる報酬相当額は、委託会社の信託報酬より支払われます。

信託報酬の支払時期と支払方法等

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

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

(4)【その他の手数料等】

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

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」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0.108%（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

実質的な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なうつど当該投資者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- c．同一ファンドを複数の販売会社で購入する場合には各販売会社毎に、個別元本の算出が行なわれます。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なわれる場合があります。
- d．投資者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該投資者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記「収益分配金の課税について」を参照。）

換金時および償還時の課税について

a．個人の投資者の場合

換金時および償還時の差益（譲渡益）が課税対象となります。

b．法人の投資者の場合

換金時および償還時の個別元本超過額が課税対象となります。

収益分配金の課税について

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

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

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

個人、法人の課税の取扱いについて

a．個人の投資者に対する課税

(a) 収益分配金の課税について

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

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

(b) 換金時および償還時の差益の課税について

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

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

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

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

b．法人の投資者に対する課税

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

上記は2018年12月末現在のもので、税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

以下の運用状況は2018年12月末現在のものです。

「サイエンティフィック・エクイティ・ファンド」

(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	750,262,283	100.06
内 日本	750,262,283	100.06
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	440,538	0.06
純資産総額	749,821,745	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	アメリカズ・ロング ショート・マザーファン ド	日本	親投資信託 受益証券	600,834,695	1.2490	750,442,543	1.2487	750,262,283	100.06

(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	100.06

(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】

2018年12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(2013年6月20日)	19,281,511,354	(同左)	0.9695	(同左)
第2期(2013年12月20日)	10,642,361,015	(同左)	0.9931	(同左)
第3期(2014年6月20日)	6,030,840,222	(同左)	1.0008	(同左)
第4期(2014年12月22日)	4,341,179,952	(同左)	1.0073	(同左)
第5期(2015年6月22日)	3,128,612,293	(同左)	1.0488	(同左)
第6期(2015年12月21日)	2,114,595,908	(同左)	1.0986	(同左)
第7期(2016年6月20日)	1,597,368,206	(同左)	1.0809	(同左)
第8期(2016年12月20日)	1,311,997,374	(同左)	1.0550	(同左)
第9期(2017年6月20日)	1,061,399,437	(同左)	1.0647	(同左)
第10期(2017年12月20日)	952,031,889	(同左)	1.0795	(同左)
第11期(2018年6月20日)	913,434,003	(同左)	1.1225	(同左)
第12期(2018年12月20日)	751,568,197	(同左)	1.0690	(同左)
2017年12月末現在	952,349,617		1.0810	
2018年1月末現在	948,613,938		1.0895	
2018年2月末現在	957,051,918		1.1078	
2018年3月末現在	945,177,285		1.1055	
2018年4月末現在	933,477,859		1.1100	
2018年5月末現在	933,353,026		1.1297	
2018年6月末現在	915,009,123		1.1275	
2018年7月末現在	873,947,911		1.1181	
2018年8月末現在	862,343,783		1.1348	
2018年9月末現在	851,527,005		1.1439	
2018年10月末現在	781,773,856		1.0995	
2018年11月末現在	748,416,186		1.0613	
2018年12月末現在	749,821,745		1.0681	

【分配の推移】

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

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1期	3.1
第2期	2.4
第3期	0.8
第4期	0.6
第5期	4.1
第6期	4.7
第7期	1.6
第8期	2.4
第9期	0.9
第10期	1.4
第11期	4.0
第12期	4.8

(注) 収益率とは、計算期間末の基準価額(分配付の額)から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額(分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。)を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た額です。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	25,254,364,735	5,367,125,645	19,887,239,090
第2期	37,904,492	9,209,170,324	10,715,973,258
第3期	133,227,514	4,823,073,585	6,026,127,187
第4期	55,009,637	1,771,432,913	4,309,703,911
第5期	177,376,670	1,504,138,299	2,982,942,282
第6期	28,338,828	1,086,518,688	1,924,762,422
第7期	1,023,297	447,975,605	1,477,810,114
第8期	389,663	234,605,730	1,243,594,047
第9期	18,190,212	264,860,176	996,924,083
第10期	29,454	115,006,523	881,947,014
第11期	286,750	68,470,123	813,763,641
第12期	44,747	110,750,374	703,058,014

(参考情報)

「アメリカズ・ロングショート・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	1,227,121,947	95.03
内 ルクセンブルグ	1,112,594,126	86.16
内 アイルランド	114,527,821	8.87
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	64,239,069	4.97
純資産総額	1,291,361,016	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・アメリカズ・ダイバーシファイド・エクイティ・アブソルート・リターン・ファンド クラスX投資証券	ルクセンブルグ	投資証券	66,459	17,230.53	1,145,126,653	16,741.01	1,112,594,126	86.16
2	インスティテューショナル・キャッシュ・シリーズplc インスティテューショナル・USトレジャー・ファンド エージェンシークラス投資証券	アイルランド	投資証券	9,992	11,340.30	113,313,203	11,461.85	114,527,821	8.87

(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	95.03

(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。

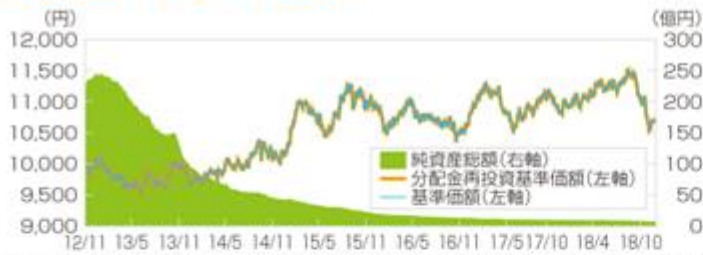
その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考情報)

運用実績（2018年12月28日現在）

基準価額・純資産の推移



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

分配の推移

設定来累計	0円
第8期 2016年12月	0円
第9期 2017年6月	0円
第10期 2017年12月	0円
第11期 2018年6月	0円
第12期 2018年12月	0円

※分配金は税引前、1万口当たり

主要な資産の状況

※ポジション数、ポジション構成比率、業種別グロスポジション上位10、市場別戦略配分比率は、当ファンドの実質的な主要投資対象である「BSFブラックロック・アメリカス・ダイバーシファイド・エクイティ・アブソルート・リターン・ファンド」の運用状況です。(2018年12月末時点)

資産構成比率(%)



※比率は対純資産総額、マザーファンドベース。四捨五入の関係で合計が100にならない場合があります。

ポジション数*

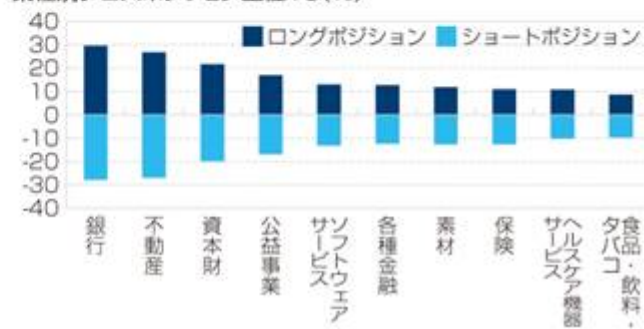
ロングポジション	1,685
ショートポジション	1,692
合計	3,377

ポジション構成比率(%)*

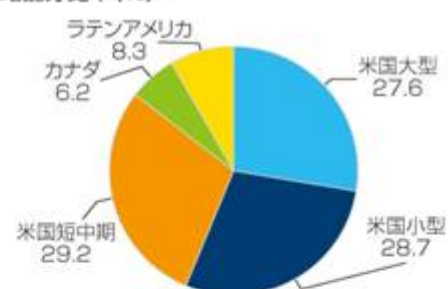
グロスポジション	479.5
ロングポジション	239.6
ショートポジション	-240.0
ネットポジション	-0.4

※実質的な主要投資対象ファンドの運用状況です。比率は実質的な主要投資対象ファンドの純資産総額に対する割合です。

業種別グロスポジション上位10(%)*



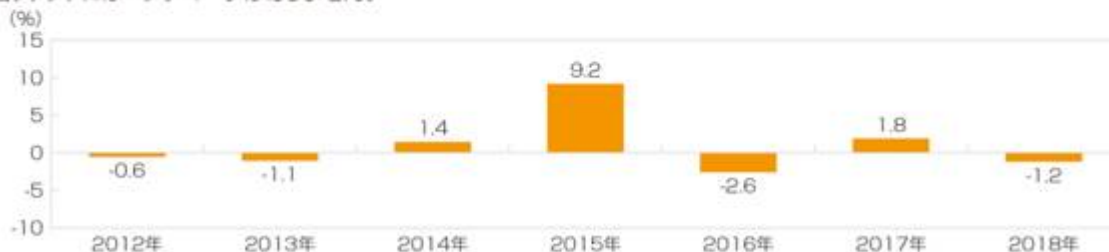
市場別戦略配分比率(%)*



※比率は四捨五入の関係で合計が100にならない場合があります。

年間収益率の推移

※2012年は設定日(11月30日)から年末までの収益率を表示しています。
 ※ファンドの収益率は、決算時の分配金を非課税で再投資したものととして算出しています。
 ※当ファンドにはベンチマークはありません。



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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

(1) 申込方法

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

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

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

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

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

(2) 申込期間

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

(3) 受付時間

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

販売会社につきましては、下記にお問い合わせください。

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

ホームページアドレス： www.blackrock.com/jp/

(4) 購入不可日

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

(5) 購入単位

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

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

(6) 購入価額

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

(7) 購入時手数料

a . 購入受付日の翌営業日の基準価額に4.32% (税抜4.00%) を上限として、販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。詳細は、販売会社にお問い合わせください。

なお、購入時手数料には消費税等相当額が含まれています。

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

(8) 購入代金のお支払い

ファンドの受益権の投資者は、購入の販売会社が定める日までに当ファンドの購入代金を販売会社に支払うものとします。

(9) 購入の受付の中止、既に受付けた購入の受付の取消

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

2【換金（解約）手続等】

(1) 換金の申込と受付

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

(2) 換金単位

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

(3) 換金不可日

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

(4) 換金価額

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

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

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

(5) 換金受付の制限

信託財産の資金管理を円滑に行なうため、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7営業日目から販売会社においてお支払いします。

(7) 換金の申込の受付中止および取消

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に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「ザアメリオン」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、2012年11月30日から2022年11月29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6月21日から12月20日まで、および12月21日から翌年の6月20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、このファンドを償還することが投資者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、このファンドを償還させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、償還しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

b．委託会社は換金により、受益権の口数が20億口を下回ることとなった場合には、受託会社と合意のうえ、このファンドを償還させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、償還しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

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

信託約款の変更

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

- c . b . の書面決議において、投資者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る投資者としての受託会社を除きます。以下 c . において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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行使することができる投資者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行ないます。
- e . 書面決議の効力は、この信託のすべての投資者に対してその効力を生じます。
- f . b . ~ e . までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての投資者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- g . a . ~ f . までの規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行なうことはできません。
- h . 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは a . ~ f . の規定にしたがいます。

信託事務の委託

受託会社は、当ファンドにかかる信託事務の処理の一部について資産管理サービス信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託にかかる契約書類に基づいて所定の事務を行ないます。

運用報告書の作成

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

関係法人との契約の更改等に関する手続

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

公告

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

www.blackrock.com/jp/

但し、当該公告方法に支障がある場合には、日本経済新聞による公告を行ないます。

4【受益者の権利等】

ファンドの受益者（投資者）の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金受領権

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

<一般コース>

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

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

<累積投資コース>

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

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

(2) 償還金受領権

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

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

償還金の支払いは、販売会社において行ないます。

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

(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7営業日目から投資者に支払います。

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

(4) 反対受益者の買取請求の不適用

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

(5) 帳簿書類の閲覧または謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第12期計算期間(2018年6月21日から2018年12月20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「アメリカズ・ロングショート・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】

【サイエンティフィック・エクイティ・ファンド】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第11期 (2018年6月20日現在)	第12期 (2018年12月20日現在)
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	926,038,271	762,838,526
未収入金	2,911,959	318,554
流動資産合計	928,950,230	763,157,080
資産合計	928,950,230	763,157,080
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,911,959	318,554
未払受託者報酬	142,360	127,294
未払委託者報酬	11,953,318	10,688,276
その他未払費用	508,590	454,759
流動負債合計	15,516,227	11,588,883
負債合計	15,516,227	11,588,883
純資産の部		
元本等		
元本	813,763,641	703,058,014
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	99,670,362	48,510,183
(分配準備積立金)	96,044,770	82,973,708
元本等合計	913,434,003	751,568,197
純資産合計	913,434,003	751,568,197
負債純資産合計	928,950,230	763,157,080

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第11期 (自 2017年12月21日 至 2018年6月20日)	第12期 (自 2018年6月21日 至 2018年12月20日)
営業収益		
有価証券売買等損益	49,649,778	30,179,032
その他収益	-	3,997,902
営業収益合計	49,649,778	26,181,130
営業費用		
受託者報酬	142,360	127,294
委託者報酬	11,953,318	10,688,276
その他費用	508,590	454,759
営業費用合計	12,604,268	11,270,329
営業利益又は営業損失（ ）	37,045,510	37,451,459
経常利益又は経常損失（ ）	37,045,510	37,451,459
当期純利益又は当期純損失（ ）	37,045,510	37,451,459
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（ ）	2,053,988	148,924
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	70,084,875	99,670,362
剰余金増加額又は欠損金減少額	35,045	4,989
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	35,045	4,989
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,441,080	13,564,785
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,441,080	13,564,785
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	99,670,362	48,510,183

(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。

(追加情報)

2016年11月7日から2018年5月3日までの期間（以下、「該当期間」といいます。）において、当ファンドの主要投資対象である「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・アメリカズ・ダイバーシファイド・エクイティ・アブソルート・リターン・ファンド クラスX投資証券」（以下、「投資対象ファンド」といいます。）の基準価額が本来あるべき価額と相違しておりました。そのため、当ファンドの該当期間における有価証券の評価額に影響を与えておりましたが、2018年5月4日以降、投資対象ファンドの基準価額は正しく算出されております。その他収益は、該当期間における当ファンドの信託財産の毀損額の補填であります。

(貸借対照表に関する注記)

項目	第11期 (2018年6月20日現在)	第12期 (2018年12月20日現在)
1 当該計算期間の末日における受益権総数	813,763,641口	703,058,014口
2 1口当たり純資産額	1.1225円	1.0690円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第11期 (自 2017年12月21日 至 2018年6月20日)	第12期 (自 2018年6月21日 至 2018年12月20日)
分配金の計算過程	第11期計算期末における、費用控除後の配当等収益（198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（19,199,727円）、収益調整金（有価証券売買等損益相当額）（1,359,559円）、収益調整金（その他収益調整金）（2,266,033円）、分配準備積立金（76,844,845円）により、分配対象収益は99,670,362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。	第12期計算期末における、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）（1,962,754円）、分配準備積立金（82,973,708円）により、分配対象収益は84,936,462円となりましたが、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、当期は分配を見合わせました。

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

1 金融商品に対する取組方針

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

2 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク

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

当ファンドの主な投資リスクとして、「ロングショート戦略によるリスク」、「株式の価格変動のリスク」、「デリバティブ取引のリスク」、「為替変動リスク」、「債券投資のリスク」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11期 (2018年6月20日現在)	第12期 (2018年12月20日現在)
<p>1 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額は ありません。</p>	<p>1 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p>
<p>2 時価の算定方法 (1) 有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載 しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿 価額と近似していることから、当該帳簿価額によって おります。</p>	<p>2 時価の算定方法 (1) 有価証券 同左 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左</p>
<p>3 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、 市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含 まれております。当該価額の算定においては一定の前 提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によ った場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>3 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 同左</p>
<p>4 金銭債権の計算期間末日後の償還予定額 金銭債権については全て1年以内に償還予定でありま す。</p>	<p>4 金銭債権の計算期間末日後の償還予定額 同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 期中元本変動額

項目	第11期 (2018年6月20日現在)	第12期 (2018年12月20日現在)
期首元本額	881,947,014円	813,763,641円
期中追加設定元本額	286,750円	44,747円
期中一部解約元本額	68,470,123円	110,750,374円

2 有価証券関係

第11期(2018年6月20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	47,027,116
合計	47,027,116

第12期(2018年12月20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	30,748,853
合計	30,748,853

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	アメリカズ・ロングショート・マザーファンド	610,759,429	762,838,526	
親投資信託受益証券 合計		610,759,429	762,838,526	
合計		610,759,429	762,838,526	

(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、「アメリカズ・ロングショート・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2018年12月20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。

「アメリカズ・ロングショート・マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

項目	(2018年12月20日現在)
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	14,260,479
投資証券	1,243,478,625
派生商品評価勘定	9,676,999
未収入金	36,923,116
流動資産合計	1,304,339,219
資産合計	1,304,339,219
負債の部	
流動負債	
未払解約金	318,554
流動負債合計	318,554
負債合計	318,554
純資産の部	
元本等	
元本	1,044,067,116
剰余金	
剰余金又は欠損金()	259,953,549
元本等合計	1,304,020,665
純資産合計	1,304,020,665
負債純資産合計	1,304,339,219

(注)親投資信託の計算期間は、原則として、毎年6月21日から翌年6月20日までであります。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法

投資証券は移動平均法に基づき、原則として以下の通り時価評価しております。

(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券

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

(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券

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

(3) 時価が入手できなかった有価証券

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

2 デリバティブの評価基準及び評価方法

為替予約取引

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

3 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準

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

4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

外貨建資産等の会計処理

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2018年12月20日現在)
1 当該計算日における受益権総数	1,044,067,116口
2 1口当たり純資産額	1.2490円

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

1 金融商品に対する取組方針

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

2 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク

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

当ファンドの主な投資リスクとして、「ロングショ - ト戦略によるリスク」、「株式の価格変動のリスク」、「デリバティブ取引のリスク」、「為替変動リスク」、「債券投資のリスク」等があります。

当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。

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

3 金融商品に係るリスク管理体制

(1) 市場リスクの管理

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

(2) 信用リスクの管理

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

(3) 取引先リスクの管理

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

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

金融商品の時価等に関する事項

(2018年12月20日現在)

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

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

(2018年12月20日現在)	
同計算期間の期首元本額	1,009,703,930円
同計算期間中の追加設定元本額	153,619,204円
同計算期間中の一部解約元本額	119,256,018円
同計算期間末日の元本額	1,044,067,116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。	
サイエンティフィック・エクイティ・ファンド	610,759,429円
ブラックロック・アメリカ大陸ロング・ショート・ファンド（ダイワ投資一任専用）	433,307,687円
合計	1,044,067,116円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	(2018年12月20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	33,100,906
合計	33,100,906

(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	(2018年12月20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	1,318,922,476	-	1,309,250,564	9,671,912
	買建 アメリカドル	32,443,833	-	32,448,920	5,087
合計		1,351,366,309	-	1,341,699,484	9,676,999

(注1) 時価の算定方法

為替予約取引

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

(注2) 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(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・アメリカズ・ダイバーシファ イド・エクイティ・アプソルート・リターン・ ファンド クラスX投資証券	66,459.160	10,012,072.450	
		インスティテューショナル・キャッシュ・シ リーズplc インスティテューショナル・USト レジャーリー・ファンド エージェンシークラス 投資証券	9,992.080	1,031,254.590	
	アメリカドル 小計	76,451.240	11,043,327.040 (1,243,478,625)		
投資証券 合計				1,243,478,625 (1,243,478,625)	
合計				1,243,478,625 (1,243,478,625)	

(注1)投資証券における券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

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

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

3 外貨建有価証券の内訳

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項は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・アメリカズ・ダイバーシファイド・エクイティ・アブソルート・リターン・ファンド クラスX投資証券」及び「インスティテューショナル・キャッシュ・シリーズplc インスティテューショナル・USTレジャーリー・ファンド エージェンシークラス投資証券」(以下、両者を併せて「同ファンド」という。)を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された投資証券は、すべて同ファンドの投資証券であります。同ファンドの状況は以下のとおりであります。

なお、以下に記載した情報は監査意見の対象外です。

同ファンドの状況

(1)「ブラックロック・ストラテジック・ファンズ ブラックロック・アメリカズ・ダイバーシファイド・エクイティ・アブソルート・リターン・ファンド クラスX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、2018年5月31日に終了する計算期間(2017年6月1日から2018年5月31日まで)に係る財務書類であります。

当該財務書類は、当該ファンドを含む「ブラックロック・ストラテジック・ファンズ」の2018年5月31日現在の財務書類のうち、当該ファンドにかかる部分を、委託会社において抜粋し、その原文を翻訳したものです。なお、財務書類に含まれる「投資有価証券明細表」の銘柄については原文通り英語表記で行っております。

(2)「インスティテューショナル・キャッシュ・シリーズplc インスティテューショナル・USTレジャーリー・ファンド エージェンシークラス投資証券」は、アイルランドにおいて設立されたオープンエンド型投資法人が発行するファンドであり、当該ファンドの現時点で日本語に翻訳された直近の情報は、2018年3月31日に終了する中間計算期間(2017年10月1日から2018年3月31日まで)に係る中間財務書類であります。

当該中間財務書類は、当該ファンドを含む「インスティテューショナル・キャッシュ・シリーズplc」の2018年3月31日現在の中間財務書類のうち、当該ファンドにかかる部分を、委託会社において抜粋し、その原文を翻訳したものです。なお、中間財務書類に含まれる「投資有価証券明細表」の銘柄については原文通り英語表記で行っております。なお、アイルランドにおける独立監査人の監査を受けておりません。

純資産計算書 2018年5月31日現在

ブラックロック・アメリカ
ズ・ダイバーシファイド・
エクイティ・アブソルー
ト・リターン・ファンド

	注記	米ドル
資産		
投資有価証券 - 取得原価		941,348,805
未実現評価益		63,847
投資有価証券 - 時価	2 (a)	941,412,652
未収利息および未収配当金	2 (a) 、 2 (d)	57,320
売却投資有価証券未収金	2 (a) 、 2 (d)	343,528,650
販売投資証券未収金	2 (a)	21,281,880
以下に係る未実現純評価益：		
差金決済契約	2 (d)	2,513,869
スワップの時価	2 (d)	1,046,123
資産合計		1,309,840,494
負債		
銀行からの借入金	2 (a)	12,236,074
ブローカーに対する債務	15	27,170,393
未払利息および未払配当金	2 (a) 、 2 (d)	3,237,457
購入投資有価証券未払金	2 (a) 、 2 (d)	305,154,671
買戻し投資証券未払金	2 (a)	7,772,963
以下に係る未実現純評価損：		
未決済先渡為替予約	2 (d)	9,819,472
未払費用およびその他の負債	4、5、6、 7、8	9,844,712
負債合計		375,235,742
純資産合計		934,604,752

取締役会を代表して署名

Paul Freeman

Robert Hayes

取締役

2018年9月26日

取締役

2018年9月26日

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 2018年5月31日現在

ブラックロック・アメリカズ・ダイバーシファイド・
エクイティ・アブソルート・リターン・ファンド

	通貨	2018年	2017年	2016年
		5月31日現在	5月31日現在	5月31日現在
純資産合計	米ドル	934,604,752	664,750,490	620,900,487
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	134.30	125.91	124.09
クラスA無分配投資証券(豪ドル)	豪ドル	178.46	170.57	172.06
クラスAユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	128.43	122.99	123.05
クラスAスウェーデン・クローネ・ヘッジ無分配投資証券	スウェーデン・クローネ	129.93	124.73	125.06
クラスA無分配英国報告型投資証券(英ポンド)	英ポンド	160.17	155.06	134.72
クラスD無分配投資証券	米ドル	113.90	106.35	104.46
クラスDスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	スイス・フラン	107.08	102.39	102.32
クラスD英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	英ポンド	113.49	107.32	105.96
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	131.30	125.28	124.57
クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	104.40	100.37	101.01
クラスI無分配投資証券 ⁽¹⁾	米ドル	107.42	-	-
クラスIユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	106.44	101.34	101.01
クラスI日本円・ヘッジ無分配投資証券 ⁽¹⁾	日本円	10,209.24	-	-
クラスX無分配投資証券	米ドル	155.83	141.86	137.11

⁽¹⁾ 新規投資証券クラスの設定、詳細についてはアペンディックスIを参照のこと。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

損益および純資産変動計算書 2018年5月31日に終了した会計年度

ブラックロック・アメリカズ・
ダイバーシファイド・エクイ
ティ・アブソルート・リター
ン・ファンド

	注記	米ドル
期首純資産		664,750,490
収益		
預金利息	2 (c)	9,855,283
債券利息	2 (c)	7,191,920
スワップに係る受取利息および受取配当金	2 (c)	170,503
差金決済契約に係る受取配当金、源泉徴収税控除後	2 (d)	42,688,564
収益合計		59,906,270
費用		
差金決済契約に係る支払利息	2 (d)	26,082,818
金融資産のネガティブ・イールド	2 (c)	15,749
差金決済契約に係る支払配当金、源泉徴収税控除後	2 (d)	53,965,458
管理事務代行報酬	5	2,007,754
預託報酬	2 (i)、6	784,572
税金	8	353,120
パフォーマンス・フィー	7	8,114,721
販売報酬	4	42,218
ローン・コミットメント・フィー	14	7,271
投資運用報酬および外部の副投資顧問会社に対する報酬	4	9,192,153
費用合計		100,565,834
投資純損失		(40,659,564)
以下に係る実現純利益 / (損失) :		
投資有価証券	2 (a)、2 (b)	756,877
差金決済契約	2 (d)	94,936,373
先物取引	2 (d)	(78,778)
外貨および先渡為替予約	2 (d)、 2 (e)、2 (j)	20,524,506
スワップ取引	2 (d)	(3,943,665)
当期実現純利益		112,195,313
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)	(146,887)
差金決済契約	2 (d)	(644,051)
外貨および先渡為替予約	2 (d)、 2 (e)、2 (j)	(24,004,036)
スワップ取引	2 (d)	1,802,735
当期末実現評価益 / (損) の純変動		(22,992,239)
運用成績による純資産の増加		48,543,510
資本の変動		
投資証券発行による正味受取額		641,321,265
投資証券買戻しによる正味支払額		(420,010,513)
資本の変動による純資産の増加		221,310,752
期末純資産		934,604,752

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 2018年5月31日に終了した会計年度

ブラックロック・アメリカズ・ダイバーシファイド・エクイティ・
アブソルート・リターン・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	207,154	195,930	209,118	193,966
クラスA無分配投資証券(豪ドル)	452	203	303	352
クラスAユーロ・ヘッジ無分配投資証券	1,310,497	672,723	650,963	1,332,257
クラスAスウェーデン・クローネ・ヘッジ無 分配投資証券	10,361,602	1,916,190	2,315,740	9,962,052
クラスA無分配英国報告型投資証券(英ポ ンド)	113	1	20	94
クラスD無分配投資証券	836,980	753,704	488,721	1,101,963
クラスDスイス・フラン・ヘッジ無分配投資 証券	27,808	20,883	6,728	41,963
クラスD英ポンド・ヘッジ無分配投資証券	17,445	213	15,953	1,705
クラスDユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投 資証券	1,172,009	986,231	964,829	1,193,411
クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券	43,066	143,911	17,777	169,200
クラスI無分配投資証券 ⁽¹⁾	-	386,755	72,771	313,984
クラスIユーロ・ヘッジ無分配投資証券	258,533	635,872	297,854	596,551
クラスI日本円・ヘッジ無分配投資証券 ⁽¹⁾	-	1,143,554	-	1,143,554
クラスX無分配投資証券	107,233	29,769	35,967	101,035

⁽¹⁾ 新規投資証券クラスの設定、詳細についてはアペンディックスIを参照のこと。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ブラックロック・アメリカズ・ダイバーシファイド・エクイティ・アブソルート・リターン・ファンド

投資有価証券明細表 2018年5月31日現在

公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
普通株式			
	米国		
18,085	GreenSky Inc	483,412	0.05
		483,412	0.05
普通株式合計		483,412	0.05
債券			
	米国		
USD 2,500,000	Federal Home Loan Banks 1.375% 18/3/2019	2,482,665	0.27
USD 111,450,000	United States Treasury Bill 5/7/2018 (Zero Coupon)	111,267,208	11.90
USD 27,000,000	United States Treasury Bill 29/11/2018 (Zero Coupon)	26,724,767	2.86
USD 4,000,000	United States Treasury Note 0.75% 31/8/2018	3,988,309	0.43
		144,462,949	15.46
債券合計		144,462,949	15.46
譲渡性預金証書			
	米国		
USD 2,000,000	Bank of Nova Scotia/Houston 1.66% 21/9/2018	2,000,000	0.21
USD 15,300,000	Canadian Imperial Bank of Commerce 2.178% 13/11/2018	15,300,000	1.64
USD 3,000,000	Credit Industriel et Commercial/New York 2.103% 6/8/2018	3,000,000	0.32
USD 15,625,000	DNB ASA 6/8/2018 (Zero Coupon)	15,625,000	1.67
USD 10,000,000	HSBC Bank USA NA 2.30% 4/9/2018	10,000,000	1.07
USD 16,000,000	Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co Ltd 2.258% 31/8/2018	16,000,000	1.71
USD 1,300,000	Natixis SA 5/6/2018 (Zero Coupon)	1,300,000	0.14
USD 15,000,000	Royal Bank of Canada/New York 2.138% 9/8/2018	15,000,000	1.60
USD 15,450,000	Royal Bank of Canada/New York 2.173% 6/11/2018	15,450,000	1.65
USD 20,000,000	Standard Chartered Bank 2.154% 16/8/2018	20,000,000	2.14
USD 2,400,000	Sumitomo Mitsui Trust and Banking Ltd/New York 2.168% 21/6/2018	2,400,000	0.26
USD 1,000,000	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc 2.30% 20/6/2018	1,000,000	0.11
USD 10,050,000	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc 2.248% 21/8/2018	10,050,000	1.07
USD 10,000,000	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc 3.364% 12/10/2018	10,000,000	1.07
USD 13,000,000	Svenska Handelsbanken AB 'A' 2.077% 4/9/2018	13,000,000	1.39
USD 10,000,000	The Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ 22/6/2018 (Zero Coupon)	10,000,000	1.07
USD 23,000,000	UBS AG/Stamford 1/6/2018 (Zero Coupon)	23,000,000	2.46
USD 9,500,000	Wells Fargo Bank NA 2.154% 15/11/2018	9,500,000	1.02
USD 13,700,000	Wells Fargo Bank NA 2.185% 19/11/2018	13,700,000	1.47
USD 4,000,000	Wells Fargo Bank NA 2.575% 5/4/2019	4,000,000	0.43
		210,325,000	22.50
譲渡性預金証書合計		210,325,000	22.50

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(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
コマーシャル・ペーパー			
カナダ			
USD 8,200,000	Total Capital Canada Ltd 27/6/2018 (Zero Coupon)	8,188,925	0.88
		8,188,925	0.88
フランス			
USD 665,000	BPCE SA 5/7/2018 (Zero Coupon)	663,568	0.07
USD 20,000,000	BPCE SA 1/10/2018 (Zero Coupon)	19,835,300	2.13
USD 1,500,000	Societe Generale SA 3/7/2018 (Zero Coupon)	1,496,973	0.16
		21,995,841	2.36
日本			
USD 1,500,000	Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co Ltd 20/7/2018 (Zero Coupon)	1,495,263	0.16
USD 7,000,000	Mizuho Bank Ltd/New York 30/11/2018 (Zero Coupon)	6,915,244	0.74
		8,410,507	0.90
英国			
USD 4,710,000	Standard Chartered Bank 22/6/2018 (Zero Coupon)	4,704,368	0.50
		4,704,368	0.50
米国			
USD 17,900,000	American Honda Motor Co 7/6/2018 (Zero Coupon)	17,894,093	1.91
USD 500,000	Antalis SA 10/7/2018 (Zero Coupon)	498,944	0.05
USD 9,830,000	Antalis SA 12/7/2018 (Zero Coupon)	9,804,139	1.05
USD 10,000,000	ASB Finance Ltd/London 2.178% 21/9/2018	10,000,000	1.07
USD 20,000,000	Banque et Caisse d'Epargne de l'Etat 10/7/2018 (Zero Coupon)	19,960,567	2.14
USD 17,500,000	Barton Capital LLC 25/6/2018 (Zero Coupon)	17,477,250	1.87
USD 2,900,000	Bedford Row Funding Corp FRN 11/6/2018	2,900,000	0.31
USD 5,300,000	Bedford Row Funding Corp 24/7/2018 (Zero Coupon)	5,282,210	0.57
USD 10,000,000	Bennington Stark Capital Co 23/7/2018 (Zero Coupon)	9,966,056	1.07
USD 16,550,000	Canadian Imperial Bank of Commerce 2.143% 22/8/2018	16,550,000	1.77
USD 15,100,000	Chariot Funding LLC 3/7/2018 (Zero Coupon)	15,068,995	1.61
USD 25,400,000	Charta LLC 5/7/2018 (Zero Coupon)	25,344,346	2.71
USD 4,000,000	Charta LLC 16/7/2018 (Zero Coupon)	3,988,400	0.43
USD 10,300,000	Ciesco LLC 16/10/2018 (Zero Coupon)	10,203,183	1.09
USD 13,900,000	Coca-Cola Company/The 8/6/2018 (Zero Coupon)	13,894,973	1.49
USD 23,000,000	Coca-Cola Company/The 20/9/2018 (Zero Coupon)	22,838,310	2.44
USD 22,200,000	CRC Funding LLC 4/6/2018 (Zero Coupon)	22,196,022	2.38
USD 15,000,000	CRC Funding LLC 5/11/2018 (Zero Coupon)	14,839,947	1.59
USD 15,000,000	Crown Point Capital Co LLC 5/7/2018 (Zero Coupon)	14,967,417	1.60
USD 3,500,000	Danske Corp 2/8/2018 (Zero Coupon)	3,486,407	0.37
USD 5,550,000	Fairway Finance Corp 5/7/2018 (Zero Coupon)	5,538,049	0.59
USD 7,950,000	HSBC Bank Plc RegS 2.337% 11/4/2019	7,950,000	0.85
USD 14,650,000	ING US Funding LLC 2.098% 9/7/2018	14,650,000	1.57
USD 9,250,000	JP Morgan Securities 22/2/2019 (Zero Coupon)	9,080,499	0.97
USD 7,800,000	JP Morgan Securities LLC 7/8/2018 (Zero Coupon)	7,775,031	0.83

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(続き)

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
米国(続き)			
USD 363,000	Jupiter Securitization Co LLC 2/7/2018 (Zero Coupon)	362,375	0.04
USD 4,950,000	Kells Funding LLC 23/7/2018 (Zero Coupon)	4,933,912	0.53
USD 10,150,000	Liberty Street Funding LLC 6/9/2018 (Zero Coupon)	10,086,278	1.08
USD 9,000,000	Macquarie Bank Ltd 12/7/2018 (Zero Coupon)	8,976,527	0.96
USD 2,000,000	Macquarie Bank Ltd 2.148% 9/8/2018	2,000,000	0.21
USD 17,300,000	Manhattan Asset Funding Co LLC 18/6/2018 (Zero Coupon)	17,284,233	1.85
USD 5,000,000	Manhattan Asset Funding Co LLC 21/6/2018 (Zero Coupon)	4,994,667	0.53
USD 5,000,000	Manhattan Asset Funding Co LLC 28/6/2018 (Zero Coupon)	4,992,725	0.53
USD 10,100,000	Mizuho Corporate Bank 11/6/2018 (Zero Coupon)	10,094,305	1.08
USD 1,000,000	Mont Blanc Capital Corp 15/6/2018 (Zero Coupon)	999,109	0.11
USD 20,400,000	Nederlandse Waterschapsbank NV RegS 7/6/2018 (Zero Coupon)	20,393,058	2.18
USD 6,750,000	Nieuw Amsterdam Receivables Corp 13/6/2018 (Zero Coupon)	6,745,500	0.72
USD 15,150,000	NRW. Bank 16/7/2018 (Zero Coupon)	15,111,178	1.62
USD 13,100,000	Old Line Funding LLC 30/7/2018 (Zero Coupon)	13,051,479	1.40
USD 10,250,000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd 8/6/2018 (Zero Coupon)	10,245,675	1.10
USD 7,000,000	PFIZER Inc 1/8/2018 (Zero Coupon)	6,976,634	0.75
USD 9,500,000	Prudential Plc 27/6/2018 (Zero Coupon)	9,485,317	1.01
USD 8,000,000	Standard Chartered Bank 20/6/2018 (Zero Coupon)	7,990,204	0.85
USD 10,750,000	Starbird Funding Corp 24/9/2018 (Zero Coupon)	10,663,119	1.14
USD 7,000,000	UBS AG/London 4/4/2019 (Zero Coupon)	7,000,000	0.75
USD 11,230,000	United Overseas Bank Ltd 14/6/2018 (Zero Coupon)	11,222,417	1.20
USD 7,600,000	United Overseas Bank Ltd 21/11/2018 (Zero Coupon)	7,510,703	0.80
USD 26,300,000	Versailles Commercial Paper LLC 31/8/2018 (Zero Coupon)	26,150,419	2.80
USD 19,600,000	Victory Receivables Corp 5/6/2018 (Zero Coupon)	19,595,252	2.10
USD 3,823,000	Victory Receivables Corp 7/6/2018 (Zero Coupon)	3,821,726	0.41
		542,841,650	58.08
コマーシャル・ペーパー合計		586,141,291	62.72
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		941,412,652	100.73
投資有価証券(時価)合計		941,412,652	100.73
その他の純負債		(6,807,900)	(0.73)
純資産合計(米ドル)		934,604,752	100.00

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

差金決済契約 2018年5月31日現在

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益 / (損) (米ドル)
	ブラジル		
188,874	AES Tiete Energia SA (Unit)	Goldman Sachs	(26,597)
504,688	AES Tiete Energia SA (Unit)	Morgan Stanley	(107,349)
13,100	Agrenco Ltd BDR*	Morgan Stanley	(574)
(194,845)	Aliansce Shopping Centers SA	Goldman Sachs	40,569
(210,500)	Aliansce Shopping Centers SA	Morgan Stanley	34,539
(155,566)	Alliar Medicos A Frente SA	Goldman Sachs	63,689
(406,917)	Alliar Medicos A Frente SA	Morgan Stanley	68,231
(38,300)	Alpargatas SA (Pref)	Goldman Sachs	9,579
(50,900)	Alpargatas SA (Pref)	Morgan Stanley	14,916
(85,279)	Alupar Investimento SA (Unit)	Goldman Sachs	25,183
(706,061)	Alupar Investimento SA (Unit)	Morgan Stanley	181,390
164,100	Ambev SA	Goldman Sachs	(95,843)
119,500	Ambev SA	Morgan Stanley	(195,328)
(53,714)	Anima Holding SA	Goldman Sachs	1,564
(89,850)	Anima Holding SA	Morgan Stanley	6,610
(1,000)	Arezzo Industria e Comercio SA	Goldman Sachs	799
(23,700)	Arezzo Industria e Comercio SA	Morgan Stanley	25,385
(87,500)	Atacadao Distribuicao Comercio e Industria Ltda	Goldman Sachs	(3,177)
(190,800)	Atacadao Distribuicao Comercio e Industria Ltda	Morgan Stanley	(17,019)
(15,500)	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	Goldman Sachs	5,306
(296,200)	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	Morgan Stanley	311,486
27,800	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	Morgan Stanley	(53,782)
70,413	Banco ABC Brasil SA (Pref)	Morgan Stanley	(13,178)
110,961	Banco ABC Brasil SA (Pref)	Goldman Sachs	(22,884)
(199,900)	Banco Bradesco SA (Pref)	Goldman Sachs	192,101
(6,000)	Banco Bradesco SA (Pref)	Morgan Stanley	5,481
56,100	Banco BTG Pactual SA (Unit)	Goldman Sachs	(28,798)
135,000	Banco BTG Pactual SA (Unit)	Morgan Stanley	(62,250)
221,500	Banco do Brasil SA	Morgan Stanley	(159,487)
35,700	Banco do Brasil SA	Goldman Sachs	(40,657)
143,800	Banco do Estado do Rio Grande do Sul SA ' B ' (Pref)	Goldman Sachs	(49,722)
165,699	Banco do Estado do Rio Grande do Sul SA ' B ' (Pref)	Morgan Stanley	(25,120)
(781,200)	BB Seguridade Participacoes SA	Morgan Stanley	460,855
(168,500)	BB Seguridade Participacoes SA	Goldman Sachs	73,648
(212,669)	BK Brasil Operacao e Assessoria a Restaurantes SA	Morgan Stanley	18,945
(121,743)	BK Brasil Operacao e Assessoria a Restaurantes SA	Goldman Sachs	(5,739)
(718,911)	BR Malls Participacoes SA	Goldman Sachs	70,879
(1,135,760)	BR Malls Participacoes SA	Morgan Stanley	112,937
(75,743)	BR Properties SA	Goldman Sachs	3,144

* 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。

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	ブラジル(続き)		
(288,168)	BR Properties SA	Morgan Stanley	(36,249)
(83,400)	BRF SA	Goldman Sachs	43,287
(213,700)	BRF SA	Morgan Stanley	66,275
69,100	Camil Alimentos SA	Goldman Sachs	2,331
196,200	Camil Alimentos SA	Morgan Stanley	(12,689)
(10,500)	CCR SA	Goldman Sachs	5,030
(290,622)	CCR SA	Morgan Stanley	102,138
(4,000)	Centrais Eletricas Brasileiras SA	Goldman Sachs	1,972
(255,700)	Centrais Eletricas Brasileiras SA	Morgan Stanley	259,041
8,700	Cia Brasileira de Distribuicao (Pref)	Morgan Stanley	(7,976)
13,209	Cia de Gas de Sao Paulo - COMGAS 'A' (Pref)	Goldman Sachs	(8,247)
5,600	Cia de Gas de Sao Paulo - COMGAS 'A' (Pref)	Morgan Stanley	(3,988)
201	Cia de Gas de Sao Paulo - COMGAS (Right)	Goldman Sachs	(34)
73,300	Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo	Goldman Sachs	(41,200)
177,100	Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo	Morgan Stanley	(338,839)
81,700	Cia de Saneamento de Minas Gerais-COPASA	Morgan Stanley	(182,960)
73,922	Cia de Saneamento de Minas Gerais-COPASA	Goldman Sachs	(73,623)
55,469	Cia de Saneamento do Parana (Pref)	Goldman Sachs	(14,811)
90,027	Cia de Saneamento do Parana (Pref)	Morgan Stanley	(21,342)
43,500	Cia de Saneamento do Parana (Unit)	Goldman Sachs	(57,694)
44,300	Cia de Saneamento do Parana (Unit)	Morgan Stanley	(102,509)
233,575	Cia Ferro Ligas da Bahia - FERBASA (Pref)	Morgan Stanley	(146,165)
195,474	Cia Ferro Ligas da Bahia - FERBASA (Pref)	Goldman Sachs	(33,263)
291,100	Cia Hering	Goldman Sachs	(18,681)
135,719	Cia Hering	Morgan Stanley	(70,809)
(486,300)	Cia Siderurgica Nacional SA	Goldman Sachs	238,174
(197,100)	Cia Siderurgica Nacional SA	Morgan Stanley	88,640
(380,952)	Cielo SA	Morgan Stanley	695,675
(89,800)	Cielo SA	Goldman Sachs	26,878
247,100	Construtora Tenda SA	Goldman Sachs	(43,932)
136,139	Construtora Tenda SA	Morgan Stanley	(49,261)
(272,585)	Cosan Logistica SA	Morgan Stanley	78,990
(234,546)	Cosan Logistica SA	Goldman Sachs	42,938
(121,479)	Cosan SA Industria e Comercio	Morgan Stanley	76,692
12,100	CVC Brasil Operadora e Agencia de Viagens SA	Goldman Sachs	183
90,035	CVC Brasil Operadora e Agencia de Viagens SA	Morgan Stanley	(82,502)
(94,200)	Cyrela Brazil Realty SA Empreendimentos e Participacoes	Morgan Stanley	49,553
(312,400)	Cyrela Brazil Realty SA Empreendimentos e Participacoes	Goldman Sachs	92,014
(826,693)	Direcional Engenharia SA	Goldman Sachs	(22,278)
(1,081,873)	Direcional Engenharia SA	Morgan Stanley	75,441

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	ブラジル(続き)		
(243,100)	Duratex SA	Morgan Stanley	24,783
422,500	EcoRodovias Infraestrutura e Logistica SA	Morgan Stanley	(66,628)
344,300	EcoRodovias Infraestrutura e Logistica SA	Goldman Sachs	(107,042)
4,300	Eletropaulo Metropolitana Eletricidade de Sao Paulo SA	Goldman Sachs	202
134,500	Energisa SA (Unit)	Goldman Sachs	(55,956)
266,200	Energisa SA (Unit)	Morgan Stanley	(143,201)
(35,769)	Engie Brasil Energia SA	Goldman Sachs	6,510
(190,900)	Engie Brasil Energia SA	Morgan Stanley	102,443
(47,500)	Equatorial Energia SA	Goldman Sachs	24,339
(43,738)	Equatorial Energia SA	Morgan Stanley	28,972
91,600	Estacio Participacoes SA	Morgan Stanley	(118,439)
170,800	Estacio Participacoes SA	Goldman Sachs	(65,698)
(268,800)	Even Construtora e Incorporadora SA	Goldman Sachs	35,861
(227,090)	Even Construtora e Incorporadora SA	Morgan Stanley	36,240
(40,100)	Ez Tec Empreendimentos e Participacoes SA	Goldman Sachs	16,602
(65,600)	Ez Tec Empreendimentos e Participacoes SA	Morgan Stanley	50,576
(10,200)	Fibria Celulose SA	Morgan Stanley	1,914
(36,100)	Fibria Celulose SA	Goldman Sachs	13,708
264,500	Fleury SA	Morgan Stanley	(101,757)
(21,700)	Gerdau SA (Pref)	Goldman Sachs	13,184
16,200	Gol Linhas Aereas Inteligentes SA (Pref)	Morgan Stanley	(34,472)
61,257	Grendene SA	Goldman Sachs	(27,361)
236,728	Grendene SA	Morgan Stanley	(135,541)
(4,900)	Guararapes Confecoes SA	Morgan Stanley	14,674
(251,500)	Helbor Empreendimentos SA	Goldman Sachs	23,383
(399,600)	Helbor Empreendimentos SA	Morgan Stanley	17,633
270,000	Hypera SA	Goldman Sachs	(61,490)
105,600	Hypera SA	Morgan Stanley	(17,524)
(82,300)	Iguatemi Empresa de Shopping Centers SA	Goldman Sachs	32,470
(118,600)	Iguatemi Empresa de Shopping Centers SA	Morgan Stanley	177,629
(108,700)	Instituto Hermes Pardini SA	Goldman Sachs	52,336
(140,200)	Instituto Hermes Pardini SA	Morgan Stanley	38,836
186,671	International Meal Co Alimentacao SA	Goldman Sachs	(47,811)
169,108	International Meal Co Alimentacao SA	Morgan Stanley	(24,776)
114,587	Ioche Maxion SA	Goldman Sachs	(89,507)
90,814	Ioche Maxion SA	Morgan Stanley	(63,655)
199,018	IRB Brasil Resseguros S/A	Goldman Sachs	(166,079)
70,800	IRB Brasil Resseguros S/A	Morgan Stanley	(35,498)
60,030	Itau Unibanco Holding SA (Pref)	Goldman Sachs	(79,120)
50,810	Itau Unibanco Holding SA (Pref)	Morgan Stanley	(48,534)
214,200	Itausa - Investimentos Itau SA (Pref)	Morgan Stanley	(59,927)
377,300	Itausa - Investimentos Itau SA (Pref)	Goldman Sachs	(109,204)
1,021,200	JBS SA	Goldman Sachs	(167,463)
690,100	JBS SA	Morgan Stanley	(146,692)
122,878	JSL SA	Goldman Sachs	(49,371)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	ブラジル(続き)		
87,830	JSL SA	Morgan Stanley	(24,657)
(239,700)	Klabin SA (Unit)	Goldman Sachs	88,457
(600,512)	Klabin SA (Unit)	Morgan Stanley	176,619
523,600	Kroton Educacional SA	Goldman Sachs	(97,166)
429,000	Kroton Educacional SA	Morgan Stanley	(95,546)
13,700	Laep Investments Ltd BDR*	Goldman Sachs	(1,050)
24,300	Laep Investments Ltd BDR*	Morgan Stanley	(1,864)
(110,500)	Linx SA	Goldman Sachs	62,901
(103,000)	Linx SA	Morgan Stanley	42,166
17,425	Localiza Rent a Car SA	Goldman Sachs	(7,047)
209,700	Localiza Rent a Car SA	Morgan Stanley	185,405
(55,900)	Lojas Americanas SA (Pref)	Goldman Sachs	17,576
(1,162,000)	Lojas Americanas SA (Pref)	Morgan Stanley	439,330
39,800	Lojas Renner SA	Goldman Sachs	(16,112)
250,600	Lojas Renner SA	Morgan Stanley	(180,179)
7,900	M Dias Branco SA	Goldman Sachs	(4,751)
134,286	M Dias Branco SA	Morgan Stanley	(77,534)
(800)	Magazine Luiza SA	Goldman Sachs	13
(14,400)	Magazine Luiza SA	Morgan Stanley	30,439
41,243	Magnesita Refratarios SA	Morgan Stanley	(31,839)
81,300	Magnesita Refratarios SA	Goldman Sachs	(52,458)
(142,100)	Mahle-Metal Leve SA	Goldman Sachs	58,323
(127,100)	Mahle-Metal Leve SA	Morgan Stanley	60,307
(595,000)	Marcopolo SA (Pref)	Goldman Sachs	100,267
(1,332,100)	Marcopolo SA (Pref)	Morgan Stanley	186,229
(122,800)	Marisa Lojas SA	Goldman Sachs	22,760
(109,354)	Marisa Lojas SA	Morgan Stanley	7,280
29,800	Metalurgica Gerdau SA (Pref)	Morgan Stanley	(8,850)
884,700	Metalurgica Gerdau SA (Pref)	Goldman Sachs	(303,610)
(368,466)	Mills Estruturas e Servicos de Engenharia SA	Goldman Sachs	81,471
(236,300)	Mills Estruturas e Servicos de Engenharia SA	Morgan Stanley	31,150
166,900	Minerva SA/Brazil	Goldman Sachs	(4,162)
83,900	Minerva SA/Brazil	Morgan Stanley	(145,978)
(188,100)	Movida Participacoes SA	Goldman Sachs	52,794
(198,900)	Movida Participacoes SA	Morgan Stanley	60,825
582,000	MRV Engenharia e Participacoes SA	Goldman Sachs	(135,272)
444,613	MRV Engenharia e Participacoes SA	Morgan Stanley	(157,778)
(138,480)	Multiplan Empreendimentos Imobiliarios SA	Morgan Stanley	128,076
(40,303)	Multiplan Empreendimentos Imobiliarios SA	Goldman Sachs	37,566
(77,700)	Natura Cosméticos SA	Morgan Stanley	49,902
(37,700)	Natura Cosméticos SA	Goldman Sachs	35,989
(36,800)	Odontoprev SA	Goldman Sachs	7,336
(386,200)	Oi SA (Pref)	Morgan Stanley	101,547

* 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。

未実現評価益/
(損)
(米ドル)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	ブラジル(続き)		
(351,200)	Oi SA (Pref)	Goldman Sachs	40,714
(186,715)	Omega Geracao SA	Goldman Sachs	57,512
(69,273)	Omega Geracao SA	Morgan Stanley	14,560
(178,007)	Paranapanema SA	Morgan Stanley	38,295
(166)	Paranapanema SA	Goldman Sachs	11
(1,900)	Petro Rio SA	Morgan Stanley	290
8,700	Petrobras Distribuidora SA	Goldman Sachs	(8,062)
70,200	Petrobras Distribuidora SA	Morgan Stanley	(38,242)
(130,200)	Petroleo Brasileiro SA (Pref)	Morgan Stanley	217,702
(82,200)	Petroleo Brasileiro SA (Pref)	Goldman Sachs	183,549
66,700	Porto Seguro SA	Goldman Sachs	(70,072)
103,000	Porto Seguro SA	Morgan Stanley	(106,589)
121,500	QGEP Participacoes SA	Goldman Sachs	(24,525)
73,500	QGEP Participacoes SA	Morgan Stanley	(21,145)
1,600	Qualicorp SA	Goldman Sachs	(833)
107,600	Qualicorp SA	Morgan Stanley	(81,215)
(153,200)	Raia Drogasil SA	Goldman Sachs	368,158
(204,500)	Raia Drogasil SA	Morgan Stanley	311,867
(8,700)	Randon SA Implementos e Participacoes (Pref)	Goldman Sachs	2,330
(18,683)	Randon SA Implementos e Participacoes (Pref)	Morgan Stanley	5,047
(1,000,041)	Rumo SA	Morgan Stanley	373,152
(220,738)	Rumo SA	Goldman Sachs	47,959
(85,400)	Santos Brasil Participacoes SA	Goldman Sachs	9,134
(389,925)	Santos Brasil Participacoes SA	Morgan Stanley	12,198
40,337	Sao Martinho SA	Goldman Sachs	13,524
90,717	Sao Martinho SA	Morgan Stanley	6,577
(55,200)	Ser Educacional SA ' 144A '	Goldman Sachs	4,988
(169,400)	Ser Educacional SA ' 144A '	Morgan Stanley	66,392
30,900	SLC Agricola SA	Morgan Stanley	(5,770)
54,900	SLC Agricola SA	Goldman Sachs	7,522
42,488	Smiles Fidelidade SA	Goldman Sachs	(34,412)
61,100	Smiles Fidelidade SA	Morgan Stanley	(65,750)
(92,523)	Somos Educacao SA	Goldman Sachs	13,968
23,921	Sonae Sierra Brasil SA	Goldman Sachs	(7,332)
5,300	Sonae Sierra Brasil SA	Morgan Stanley	(1,953)
951,224	Sul America SA (Unit)	Morgan Stanley	(673,443)
81,900	Suzano Papel e Celulose SA	Goldman Sachs	(82,648)
210,700	Suzano Papel e Celulose SA	Morgan Stanley	(42,103)
(800,160)	Tecnisa SA	Goldman Sachs	46,826
(951,433)	Tecnisa SA	Morgan Stanley	45,719
169,432	Tegma Gestao Logistica SA	Goldman Sachs	(54,657)
99,200	Tegma Gestao Logistica SA	Morgan Stanley	(15,611)
6,400	Telefonica Brasil SA (Pref)	Goldman Sachs	(4,050)
42,200	Telefonica Brasil SA (Pref)	Morgan Stanley	(50,600)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	ブラジル(続き)		
29,200	TIM Participacoes SA	Goldman Sachs	(5,020)
451,900	TIM Participacoes SA	Morgan Stanley	186,499
(13,600)	TOTVS SA	Morgan Stanley	5,561
(30,800)	TOTVS SA	Goldman Sachs	15,670
415,909	Transmissora Alianca de Energia Eletrica SA (Unit)	Morgan Stanley	(67,128)
407,600	Transmissora Alianca de Energia Eletrica SA (Unit)	Goldman Sachs	(13,436)
(29,500)	Tupy SA	Goldman Sachs	17,050
(11,200)	Tupy SA	Morgan Stanley	6,454
(92,100)	Ultrapar Participacoes SA	Morgan Stanley	83,897
(33,500)	Ultrapar Participacoes SA	Goldman Sachs	39,818
(25,100)	Unipar Carbocloro SA (Pref)	Morgan Stanley	(36,884)
(765,800)	Usinas Siderurgicas de Minas Gerais SA 'A' (Pref)	Goldman Sachs	461,378
(179,000)	Usinas Siderurgicas de Minas Gerais SA 'A' (Pref)	Morgan Stanley	105,057
36,600	Vale SA	Goldman Sachs	(25,532)
49,500	Vale SA	Morgan Stanley	(36,717)
(63,560)	Valid Solucoes e Servicos de Seguranca em Meios de Pagamento e Identificacao SA	Goldman Sachs	21,855
(145,223)	Valid Solucoes e Servicos de Seguranca em Meios de Pagamento e Identificacao SA	Morgan Stanley	423,467
53,500	Via Varejo SA (Unit)	Goldman Sachs	(35,167)
88,100	Via Varejo SA (Unit)	Morgan Stanley	(61,061)
(5,200)	WEG SA	Goldman Sachs	1,955
(465,679)	WEG SA	Morgan Stanley	(656,866)
(86,100)	Wiz Solucoes e Corretagem de Seguros SA	Goldman Sachs	5,672
(259,800)	Wiz Solucoes e Corretagem de Seguros SA	Morgan Stanley	61,188
			1,801,048
	カナダ		
423,018	Advantage Oil & Gas Ltd	Morgan Stanley	(81,213)
95,808	Aecon Group Inc	Morgan Stanley	(177,019)
(21,622)	Ag Growth International Inc	Morgan Stanley	18,502
(50,772)	AGF Management Ltd 'B'	Morgan Stanley	11,225
(231,065)	Aimia Inc	Morgan Stanley	(10,589)
(27,543)	Air Canada	Morgan Stanley	21,832
(55,384)	AirBoss of America Corp	Morgan Stanley	29,734
(26,899)	Alacer Gold Corp	Morgan Stanley	1,240
163,686	Alamos Gold Inc 'A'	Morgan Stanley	(144,313)
66,138	Alaris Royalty Corp	Morgan Stanley	(31,534)
47,841	Alcanna Inc	Morgan Stanley	(3,620)
(236,514)	Algonquin Power & Utilities Corp	Morgan Stanley	(30,368)
4,186	Alimentation Couche-Tard Inc 'B'	Morgan Stanley	4,607
(22,183)	Allied Properties Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	4,226
(88,688)	AltaGas Ltd	Morgan Stanley	52,989
82,303	Altius Minerals Corp	Morgan Stanley	1,988

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	カナダ(続き)		
(86,360)	Altus Group Ltd/Canada	Morgan Stanley	(21,377)
1,525	Angico Eagle Mines Ltd	Morgan Stanley	3,201
(6,939)	Aphria Inc	Morgan Stanley	7,342
(2,991)	ARC Resources Ltd	Morgan Stanley	2,212
72,118	Argonaut Gold Inc	Morgan Stanley	(2,952)
27,928	Aritzia Inc	Morgan Stanley	(590)
(61,485)	Arizona Mining Inc	Morgan Stanley	(2,737)
(95,304)	Artis Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	13,966
(50,935)	Atco Ltd/Canada 'I'	Morgan Stanley	13,900
194,084	Atlantic Power Corp	Morgan Stanley	(2,835)
14,632	ATS Automation Tooling Systems Inc	Morgan Stanley	36,394
(31,888)	Aurora Cannabis Inc	Morgan Stanley	9,053
27,871	AutoCanada Inc	Morgan Stanley	(20,061)
(42,738)	B2Gold Corp	Morgan Stanley	(5,701)
13,710	Badger Daylighting Ltd	Morgan Stanley	383
(343)	Bank of Montreal	Morgan Stanley	882
1,546	Bank of Nova Scotia/The	Morgan Stanley	(4,522)
(2,795)	Barrick Gold Corp	Morgan Stanley	(310)
45,800	Baytex Energy Corp	Morgan Stanley	65,753
7,761	BCE Inc	Morgan Stanley	(6,677)
22,299	Bellatrix Exploration Ltd	Morgan Stanley	(1,587)
(61,363)	Birchcliff Energy Ltd	Morgan Stanley	12,609
(214,864)	Bird Construction Inc	Morgan Stanley	2,226
7,416	BlackBerry Ltd	Morgan Stanley	2,126
191,461	BlackPearl Resources Inc	Morgan Stanley	(17,916)
(5,697)	Boardwalk Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	(1,858)
(11,890)	Bombardier Inc	Morgan Stanley	(5,785)
240,475	Bonavista Energy Corp	Morgan Stanley	(17,377)
36,677	Bonterra Energy Corp	Morgan Stanley	(21,486)
(148,494)	Boralex Inc 'A'	Morgan Stanley	(38,454)
12,614	Boyd Group Income Fund (Unit)	Morgan Stanley	(10,471)
919	Brookfield Asset Management Inc 'A'	Morgan Stanley	(852)
3,489	Brookfield Business Partners LP	Morgan Stanley	1,065
49,194	Brookfield Infrastructure Partners LP	Morgan Stanley	(35,695)
105,311	Brookfield Property Partners LP	Morgan Stanley	91,587
79,585	Brookfield Renewable Partners LP	Morgan Stanley	(34,643)
(11,557)	BRP Inc/CA	Morgan Stanley	(45,844)
167,418	CAE Inc	Morgan Stanley	273,660
(110,063)	Calfrac Well Services Ltd	Morgan Stanley	33,355
(3,513)	Cameco Corp	Morgan Stanley	276
51,439	Canaccord Genuity Group Inc	Morgan Stanley	(18,011)
(386,592)	Canacol Energy Ltd	Morgan Stanley	61,169
(19,621)	Canada Goose Holdings Inc	Morgan Stanley	(17,975)
108,681	Canadian Apartment Properties (Reit)	Morgan Stanley	8,997
463	Canadian Imperial Bank of Commerce	Morgan Stanley	(2,074)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	カナダ(続き)		
(2,342)	Canadian National Railway Co	Morgan Stanley	(1,362)
17,774	Canadian Natural Resources Ltd	Morgan Stanley	(41,906)
2,657	Canadian Pacific Railway Ltd	Morgan Stanley	22,190
(1,692)	Canadian Tire Corp Ltd 'A'	Morgan Stanley	7,716
(90,918)	Canadian Utilities Ltd 'A'	Morgan Stanley	300,338
(68,538)	Canadian Western Bank	Morgan Stanley	114,117
(52,934)	Canfor Corp	Morgan Stanley	(77,763)
87,615	Canfor Pulp Products Inc	Morgan Stanley	4,518
(3,744)	Cannttrustholdings Inc	Morgan Stanley	1,928
(3,843)	Canopy Growth Corp	Morgan Stanley	(862)
117,125	CanWel Building Materials Group Ltd	Morgan Stanley	(2,767)
130,009	Capital Power Corp	Morgan Stanley	(35,284)
25,112	Cardinal Energy Ltd	Morgan Stanley	(8,925)
(5,523)	Cargojet Inc	Morgan Stanley	(2,185)
(81,444)	Cascades Inc	Morgan Stanley	(4,373)
(635)	CCL Industries Inc 'B'	Morgan Stanley	500
(71,948)	Celestica Inc	Morgan Stanley	3,656
(16,043)	Cenovus Energy Inc	Morgan Stanley	11,786
11,050	Centerra Gold Inc	Morgan Stanley	(4,366)
(190,177)	CES Energy Solutions Corp	Morgan Stanley	58,531
2,380	CGI Group Inc 'A'	Morgan Stanley	1,111
98,460	Chartwell Retirement Residences (Unit)	Morgan Stanley	(12,595)
(84,597)	Chemtrade Logistics Income Fund (Unit)	Morgan Stanley	(8,579)
(62,159)	Chesswood Group Ltd	Morgan Stanley	21,542
(27,464)	China Gold International Resources Corp Ltd	Morgan Stanley	539
120,612	Choice Properties Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	(4,777)
(33,152)	CI Financial Corp	Morgan Stanley	10,741
(66,364)	Cineplex Inc	Morgan Stanley	253,987
(111,016)	Clearwater Seafoods Inc	Morgan Stanley	25,020
29,801	Cogeco Communications Inc	Morgan Stanley	(122,857)
20,114	Cogeco Inc	Morgan Stanley	(28,770)
16,497	Colliers International Group Inc	Morgan Stanley	(61,516)
(250,305)	Cominar Real Estate Investment Trust (Reit) 'U'	Morgan Stanley	29,124
(112,587)	Computer Modelling Group Ltd	Morgan Stanley	75,168
18	Constellation Software Inc/Canada	Morgan Stanley	285
(30,780)	Continental Gold Inc	Morgan Stanley	(1,273)
11,140	Corby Spirit and Wine Ltd	Morgan Stanley	(4,701)
(40,889)	Corus Entertainment Inc 'B'	Morgan Stanley	73,581
14,370	Cott Corp	Morgan Stanley	(613)
596	Crescent Point Energy Corp	Morgan Stanley	(300)
138,377	Crew Energy Inc	Morgan Stanley	(22,077)
(60,042)	CRH Medical Corp	Morgan Stanley	(48,993)
61,278	Crius Energy Trust (Unit)	Morgan Stanley	(12,807)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	カナダ(続き)		
348,338	Crombie Real Estate Investment Trust (Reit)**	Morgan Stanley	(19,618)
55,035	CT Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	(10,399)
29,379	Descartes Systems Group Inc/The	Morgan Stanley	115,309
31,935	Detour Gold Corp	Morgan Stanley	(1,479)
(3,916)	DHX Media Ltd	Morgan Stanley	295
(68,600)	DHX Media Ltd	Morgan Stanley	8,877
(218,965)	DIRTT Environmental Solutions	Morgan Stanley	11,986
1,035	Dollarama Inc	Morgan Stanley	(2,408)
3,032	Domtar Corp	Morgan Stanley	5,575
(31,962)	Dorel Industries Inc 'B'	Morgan Stanley	14,153
100,992	Dream Global Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	323
344,762	Dream Industrial Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	452,473
(67,065)	Dream Office Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	(161,870)
28,872	Dundee Corp 'A'	Morgan Stanley	(1,945)
143,145	Dundee Precious Metals Inc	Morgan Stanley	1,522
(1,406)	Echelon Financial Holdings Inc	Morgan Stanley	778
(41,388)	ECN Capital Corp	Morgan Stanley	1,319
(34,746)	Eldorado Gold Corp	Morgan Stanley	(1,524)
(16,791)	Emera Inc	Morgan Stanley	3,406
23,880	Empire Co Ltd 'A'	Morgan Stanley	12,874
8,450	Enbridge Inc	Morgan Stanley	(5,668)
124,233	Enbridge Income Fund Holdings Inc	Morgan Stanley	(39,927)
(2,873)	Encana Corp	Morgan Stanley	1,508
(14,474)	Endeavour Mining Corp	Morgan Stanley	(7,570)
(20,561)	Endeavour Silver Corp	Morgan Stanley	816
(95,682)	Enercare Inc	Morgan Stanley	32,749
52,227	Enerflex Ltd	Morgan Stanley	(30,871)
(25,651)	Enerplus Corp	Morgan Stanley	10,822
32,962	Enghouse Systems Ltd	Morgan Stanley	7,986
(37,698)	Ensign Energy Services Inc	Morgan Stanley	9,536
67,346	Essential Energy Services Trust	Morgan Stanley	609
(88,662)	Extendicare Inc	Morgan Stanley	25,201
1,562	Fairfax Financial Holdings Ltd	Morgan Stanley	(42,393)
(45,896)	Fairfax India Holdings Corp '144A'	Morgan Stanley	(50,631)
135,073	Fiera Capital Corp	Morgan Stanley	(55,559)
48,250	Finning International Inc	Morgan Stanley	(732)
(104,653)	First Capital Realty Inc	Morgan Stanley	7,659
(18,888)	First Majestic Silver Corp	Morgan Stanley	2,938
41,932	First National Financial Corp	Morgan Stanley	(43,067)
(1,837)	First Quantum Minerals Ltd	Morgan Stanley	3,173
22,850	FirstService Corp	Morgan Stanley	(24,219)
6,174	Fortis Inc/Canada	Morgan Stanley	(4,267)

** 当該有価証券には市場流動性がない。

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	カナダ(続き)		
53,463	Fortuna Silver Mines Inc	Morgan Stanley	422
1,700	Franco-Nevada Corp	Morgan Stanley	(990)
(26,056)	Freehold Royalties Ltd	Morgan Stanley	25,547
(8,519)	Frontera Energy Corp	Morgan Stanley	34,904
(30,312)	Genworth MI Canada Inc	Morgan Stanley	22,719
80	George Weston Ltd	Morgan Stanley	5
(69,984)	Gibson Energy Inc	Morgan Stanley	(52,631)
4,985	Gildan Activewear Inc	Morgan Stanley	72
(46,638)	Gluskin Sheff + Associates Inc	Morgan Stanley	47,376
22,747	goeasy Ltd	Morgan Stanley	(21,094)
6,028	Goldcorp Inc	Morgan Stanley	4,729
(271,507)	Gran Tierra Energy Inc	Morgan Stanley	45,357
(38,491)	Granite Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	50,738
(11,755)	Great Canadian Gaming Corp	Morgan Stanley	(151,902)
(63,095)	Great-West Lifeco Inc	Morgan Stanley	63,862
64,788	Guyana Goldfields Inc	Morgan Stanley	(4,465)
(157,675)	H&R Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	47,045
48,788	High Arctic Energy Services Inc	Morgan Stanley	(5,146)
(76,049)	High Liner Foods Inc	Morgan Stanley	36,567
9,136	Home Capital Group Inc	Morgan Stanley	2,226
(248,931)	Horizon North Logistics Inc	Morgan Stanley	(31,629)
79,486	Hudbay Minerals Inc	Morgan Stanley	(55,749)
3,122	Husky Energy Inc	Morgan Stanley	(2,949)
(155,011)	Hydro One Ltd '144A'	Morgan Stanley	20,122
25,729	IAMGOLD Corp	Morgan Stanley	8,800
40,287	IGM Financial Inc	Morgan Stanley	(44,651)
3,028	Imperial Oil Ltd	Morgan Stanley	(1,239)
28,204	Industrial Alliance Insurance & Financial Services Inc	Morgan Stanley	(42,988)
(169,129)	Innergex Renewable Energy Inc	Morgan Stanley	(2,743)
(35,086)	Intact Financial Corp	Morgan Stanley	30,051
2,309	Inter Pipeline Ltd	Morgan Stanley	(899)
61,104	Interfor Corp	Morgan Stanley	(6,783)
(47,616)	InterRent Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	7,846
(28,209)	Intertape Polymer Group Inc	Morgan Stanley	4,360
(88,476)	Ivanhoe Mines Ltd 'A'	Morgan Stanley	14,287
41,704	Jamieson Wellness Inc	Morgan Stanley	60,231
65,797	Just Energy Group Inc	Morgan Stanley	8,080
(198,284)	Kelt Exploration Ltd	Morgan Stanley	26,830
(38,379)	Keyera Corp	Morgan Stanley	(35,515)
269,353	Killam Apartment Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	11,848
(16,176)	Kinaxis Inc	Morgan Stanley	(13,545)
(61,891)	Kinder Morgan Canada Ltd '144A'	Morgan Stanley	41,170
5,691	Kinross Gold Corp	Morgan Stanley	288

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	カナダ(続き)		
(7,039)	Kirkland Lake Gold Ltd	Morgan Stanley	102
68,351	Knight Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(4,400)
16,196	Labrador Iron Ore Royalty Corp	Morgan Stanley	30,100
(41,911)	Laurentian Bank of Canada	Morgan Stanley	147,786
(15,358)	Linamar Corp	Morgan Stanley	56,805
11,704	Lithium Americas Corp	Morgan Stanley	(6,673)
2,571	Loblaw Cos Ltd	Morgan Stanley	495
735,404	Lucara Diamond Corp	Morgan Stanley	(44,233)
122,537	Lundin Mining Corp	Morgan Stanley	(22,641)
(15,860)	MAG Silver Corp	Morgan Stanley	(2,215)
3,900	Magna International Inc	Morgan Stanley	(9,769)
(65,889)	Major Drilling Group International Inc	Morgan Stanley	(18,432)
20,758	Manulife Financial Corp	Morgan Stanley	(18,792)
136,119	Maple Leaf Foods Inc	Morgan Stanley	40,949
37,518	Martinrea International Inc	Morgan Stanley	(46,948)
(18,938)	Maxar Technologies Ltd	Morgan Stanley	15,616
19,197	McCoy Global Inc	Morgan Stanley	(292)
(44,759)	McEwen Mining Inc	Morgan Stanley	(2,792)
(15,273)	Medical Facilities Corp	Morgan Stanley	(851)
51,208	MEG Energy Corp	Morgan Stanley	(6,555)
4,471	Methanex Corp	Morgan Stanley	53,776
3,002	Metro Inc	Morgan Stanley	(1,429)
(23,753)	Morguard Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	818
145,841	Morneau Shepell Inc	Morgan Stanley	(1,745)
(30,161)	MTY Food Group Inc	Morgan Stanley	28,306
(128,078)	Mullen Group Ltd	Morgan Stanley	(3,084)
(8,390)	National Bank of Canada	Morgan Stanley	16,568
(51,287)	New Gold Inc	Morgan Stanley	(4,529)
(21,058)	Nexa Resources SA	Morgan Stanley	17,151
5,278	NexGen Energy Ltd	Morgan Stanley	(265)
6,288	NFI Group Inc	Morgan Stanley	(14,590)
170,411	Noranda Income Fund (Unit)	Morgan Stanley	(1,272)
21,061	Norbord Inc	Morgan Stanley	11,586
17,265	North American Construction Group Ltd	Morgan Stanley	(3,788)
(100,209)	North West Co Inc/The	Morgan Stanley	15,333
125,303	Northland Power Inc	Morgan Stanley	165,213
(71,303)	Northview Apartment Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	(2,755)
145,350	NorthWest Healthcare Properties Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	(34,836)
(58,493)	Novagold Resources Inc	Morgan Stanley	(16,608)
375	Nutrien Ltd	Morgan Stanley	(179)
134,693	NuVista Energy Ltd	Morgan Stanley	(52,220)
(16,234)	OceanaGold Corp	Morgan Stanley	744
10,181	Onex Corp	Morgan Stanley	(22,596)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	カナダ(続き)		
(13,391)	Open Text Corp	Morgan Stanley	(3,557)
(28,367)	Osisko Gold Royalties Ltd	Morgan Stanley	(2,369)
80,821	Osisko Mining Inc	Morgan Stanley	2,386
(42,038)	Painted Pony Energy Ltd	Morgan Stanley	5,788
22,203	Pan American Silver Corp	Morgan Stanley	(3,835)
(55,500)	Paramount Resources Ltd 'A'	Morgan Stanley	(7,534)
74,175	Parex Resources Inc	Morgan Stanley	(51,257)
48,274	Parkland Fuel Corp	Morgan Stanley	2,888
127,534	Pason Systems Inc	Morgan Stanley	(62,541)
6,136	Pattern Energy Group Inc 'A'	Morgan Stanley	3,923
15,852	Pembina Pipeline Corp	Morgan Stanley	(2,624)
(2,810)	Peyto Exploration & Development Corp	Morgan Stanley	1,109
(26,058)	Poseidon Concepts Corp**	Morgan Stanley	76
(500)	Power Corp of Canada	Morgan Stanley	335
93,165	Power Financial Corp	Morgan Stanley	(91,259)
(80,780)	PrairieSky Royalty Ltd	Morgan Stanley	141,260
52,179	Premier Gold Mines Ltd	Morgan Stanley	1,303
(21,349)	Premium Brands Holdings Corp	Morgan Stanley	39,352
(13,510)	Pretium Resources Inc	Morgan Stanley	(4,013)
(52,913)	ProMetic Life Sciences Inc	Morgan Stanley	28,363
136,515	Quebecor Inc 'B'	Morgan Stanley	(15,806)
(80,702)	Raging River Exploration Inc	Morgan Stanley	6,047
67,038	Real Matters Inc	Morgan Stanley	(59,088)
(4,168)	Recipe Unlimited Corp	Morgan Stanley	3,769
(46,610)	Resolute Forest Products Inc	Morgan Stanley	(11,256)
380	Restaurant Brands International Inc	Morgan Stanley	714
22,893	Richelieu Hardware Ltd	Morgan Stanley	(4,561)
(139,450)	RioCan Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	44,719
(51,955)	Ritchie Bros Auctioneers Inc	Morgan Stanley	(45,698)
6,195	Rogers Communications Inc 'B'	Morgan Stanley	(15,421)
(378,162)	Rogers Sugar Inc	Morgan Stanley	(7,426)
60,662	Roots Corp	Morgan Stanley	42,710
1,128	Royal Bank of Canada	Morgan Stanley	(5,625)
(46,900)	Russel Metals Inc	Morgan Stanley	53,415
20,819	Sandstorm Gold Ltd	Morgan Stanley	(355)
(5,165)	Saputo Inc	Morgan Stanley	(6,066)
(60,389)	Savaria Corp	Morgan Stanley	(13,029)
(10,128)	Seabridge Gold Inc	Morgan Stanley	(5,754)
12,100	Sears Canada Inc	Morgan Stanley	(5,839)
144,320	Secure Energy Services Inc	Morgan Stanley	(61,935)
(143,899)	SEMAFO Inc	Morgan Stanley	(678)
49,121	Seven Generations Energy Ltd 'A'	Morgan Stanley	73,413
(18,048)	Shaw Communications Inc 'B'	Morgan Stanley	5,543
44,752	ShawCor Ltd	Morgan Stanley	(33,083)

** 当該有価証券には市場流動性がない。

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	カナダ(続き)		
(4,046)	Shopify Inc 'A'	Morgan Stanley	(71,582)
14,709	Sienna Senior Living Inc	Morgan Stanley	(7,473)
(6,828)	Sierra Wireless Inc	Morgan Stanley	1,825
91,899	Silvercorp Metals Inc	Morgan Stanley	(3,769)
(136,399)	Slate Office REIT (Reit)	Morgan Stanley	7,003
49,531	Slate Retail REIT (Unit)	Morgan Stanley	(11,864)
21,670	Sleep Country Canada Holdings Inc '144A'	Morgan Stanley	(9,659)
(71,544)	SmartCentres Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	(9,574)
(449)	SNC-Lavalin Group Inc	Morgan Stanley	(18)
(24,215)	Spartan Energy Corp	Morgan Stanley	6,841
13,352	Spin Master Corp '144A'	Morgan Stanley	(8,531)
(55,618)	Sprott Inc	Morgan Stanley	5,371
12,649	SSR Mining Inc	Morgan Stanley	928
(99,345)	Stantec Inc	Morgan Stanley	30,583
(6,128)	Stars Group Inc/The	Morgan Stanley	12,671
7,159	Stelco Holdings Inc	Morgan Stanley	(1,407)
(8,775)	Stella-Jones Inc	Morgan Stanley	963
155,407	Summit Industrial Income (Reit)	Morgan Stanley	(2,568)
670	Sun Life Financial Inc	Morgan Stanley	(1,569)
3,850	Suncor Energy Inc	Morgan Stanley	(5,377)
(82,256)	SunOpta Inc	Morgan Stanley	(40,803)
(50,384)	Superior Plus Corp	Morgan Stanley	30,064
25,086	Supremex Inc	Morgan Stanley	(2,362)
(187,938)	Surge Energy Inc	Morgan Stanley	31,537
(47,060)	Tahoe Resources Inc	Morgan Stanley	(6,608)
(2,204)	Teck Resources Ltd 'B'	Morgan Stanley	3,359
315	TELUS Corp	Morgan Stanley	(158)
44,376	Teranga Gold Corp	Morgan Stanley	59,425
(11,029)	TFI International Inc	Morgan Stanley	(1,778)
(5,658)	Theratechnologies Inc	Morgan Stanley	208
(3,800)	Thomson Reuters Corp	Morgan Stanley	(952)
146,163	Timbercreek Financial Corp	Morgan Stanley	(17,908)
(12,164)	TMAC Resources Inc	Morgan Stanley	(1,338)
(28,732)	TMX Group Ltd	Morgan Stanley	(86,006)
200,771	TORC Oil & Gas Ltd	Morgan Stanley	(43,898)
(4,172)	Torex Gold Resources Inc	Morgan Stanley	1,557
36,509	Toromont Industries Ltd	Morgan Stanley	(11,195)
5,749	Toronto-Dominion Bank/The	Morgan Stanley	(5,840)
(21,662)	Torstar Corp 'B'	Morgan Stanley	2,710
63,564	Tourmaline Oil Corp	Morgan Stanley	9,282
(103,389)	TransAlta Corp	Morgan Stanley	10,718
275,917	TransAlta Renewables Inc	Morgan Stanley	3,926
22,223	Transat AT Inc	Morgan Stanley	(2,711)
(7,310)	TransCanada Corp	Morgan Stanley	10,519
(22,219)	Transcontinental Inc 'A'	Morgan Stanley	(5,000)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
カナダ(続き)			
(192,835)	Trican Well Service Ltd	Morgan Stanley	16,621
(311,860)	Tricon Capital Group Inc	Morgan Stanley	(64,545)
110,562	Trinidad Drilling Ltd	Morgan Stanley	(19,456)
(4,870)	Tucows Inc 'A'	Morgan Stanley	1,326
(817,839)	Turquoise Hill Resources Ltd	Morgan Stanley	153,488
27,742	Uni-Select Inc	Morgan Stanley	(24,076)
(162,197)	Uranium Participation Corp	Morgan Stanley	883
(2,341)	Valeant Pharmaceuticals International Inc	Morgan Stanley	121
(48,815)	Valener Inc	Morgan Stanley	9,714
6,445	Valeura Energy Inc	Morgan Stanley	479
(31,766)	Vermilion Energy Inc	Morgan Stanley	68,483
24,065	Wajax Corp	Morgan Stanley	(12,410)
5,227	Waste Connections Inc	Morgan Stanley	6,117
67,237	Wesdome Gold Mines Ltd	Morgan Stanley	10,472
(11,974)	West Fraser Timber Co Ltd	Morgan Stanley	(17,308)
407,777	Western Forest Products Inc	Morgan Stanley	(53,971)
(102,079)	WestJet Airlines Ltd	Morgan Stanley	29,415
58,582	Westport Fuel Systems Inc	Morgan Stanley	(11,943)
(61,471)	Westshore Terminals Investment Corp	Morgan Stanley	23,186
445	Wheaton Precious Metals Corp	Morgan Stanley	27
211,145	Whitecap Resources Inc	Morgan Stanley	(109,314)
(27,890)	Winpak Ltd	Morgan Stanley	25,726
96,956	WPT Industrial Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	16,483
40,453	WSP Global Inc	Morgan Stanley	(13,619)
117,801	Xtreme Drilling Corp	Morgan Stanley	(7,166)
(68,385)	Yamana Gold Inc	Morgan Stanley	(6,839)
13,548	ZCL Composites Inc	Morgan Stanley	(6,158)
			923,725
チリ			
1,125,081	AES Gener SA	Morgan Stanley	(13,985)
446,367	Aguas Andinas SA 'A'	Morgan Stanley	(13,491)
9,006,416	Banco de Chile	Morgan Stanley	404,447
4,766	Banco de Credito e Inversiones SA	Morgan Stanley	143,243
643	Bupa Chile SA**	Morgan Stanley	45
26,744	CAP SA	Morgan Stanley	(22,826)
50,229	Cia Cervecerias Unidas SA	Morgan Stanley	(52,331)
1,001,331	Colbun SA	Morgan Stanley	(12,856)
298,091	Embotelladora Andina SA 'B' (Pref)	Morgan Stanley	(78,615)
607,761	Empresas CMPC SA	Morgan Stanley	435,033
3,190	Empresas COPEC SA	Morgan Stanley	(970)
8,408,515	Enel Chile SA	Morgan Stanley	(44,613)
94,931	Inversiones Aguas Metropolitanas SA	Morgan Stanley	(22,137)
90,764	Inversiones La Construccion SA	Morgan Stanley	(98,323)
1,010,678	Parque Arauco SA	Morgan Stanley	(134,282)

** 当該有価証券には市場流動性がない。

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	チリ(続き)		
2,335,816	Ripley Corp SA	Morgan Stanley	948,325
788,046	Salfacorp SA	Morgan Stanley	(125,202)
463,032	Sociedad Matriz del Banco de Chile SA ' B '	Morgan Stanley	(1,316)
1,196,584	SONDA SA	Morgan Stanley	(110,132)
			<u>1,200,014</u>
	コロンビア		
499,610	Avianca Holdings SA (Pref)	Morgan Stanley	(12,481)
3,463,389	Ecopetrol SA	Morgan Stanley	(50,735)
			<u>(63,216)</u>
	ドイツ		
(652)	Alphabet Inc ' A '	Morgan Stanley	8,931
(222)	Tesla Inc	Goldman Sachs	6,003
(14,266)	Walt Disney Co/The	Morgan Stanley	164,204
			<u>179,138</u>
	イタリア		
(1,170)	Rizzoli Corriere Della Sera Mediagroup SpA	Bank of America Merrill Lynch	(515)
1,170	Rizzoli Corriere Della Sera Mediagroup SpA	Bank of America Merrill Lynch	342
			<u>(173)</u>
	メキシコ		
1,357,047	Alfa SAB de CV ' A '	Goldman Sachs	(94,677)
2,997,435	Alfa SAB de CV ' A '	Morgan Stanley	(128,254)
645,239	Alpek SAB de CV	Goldman Sachs	64,572
1,003,033	Alpek SAB de CV	Morgan Stanley	34,348
(88,400)	Alsea SAB de CV	Goldman Sachs	21,857
(475,652)	Alsea SAB de CV	Morgan Stanley	43,799
1,355,460	America Movil SAB de CV ' L '	Goldman Sachs	(101,966)
812,239	America Movil SAB de CV ' L '	Morgan Stanley	(65,639)
(337,137)	Arca Continental SAB de CV	Goldman Sachs	22,555
(557,904)	Arca Continental SAB de CV	Morgan Stanley	318,370
(3,211,328)	Axtel SAB de CV (Unit)	Morgan Stanley	9,348
(1,495,723)	Axtel SAB de CV (Unit)	Goldman Sachs	9,217
(88,000)	Banco del Bajio SA ' 144A '	Goldman Sachs	7,907
(335,186)	Banco del Bajio SA ' 144A '	Morgan Stanley	37,574
283,700	Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand ' B	Goldman Sachs	(64,856)
110,200	Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand ' B	Morgan Stanley	(24,169)
9,200	Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand ' B	Goldman Sachs	(842)
43,500	Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand ' B	Morgan Stanley	(7,539)
(3,303,933)	Becle SAB de CV	Morgan Stanley	420,866
(56,551)	Becle SAB de CV	Goldman Sachs	(1,439)

未実現評価益/
(損)
(米ドル)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	メキシコ(続き)		
(459,842)	Bolsa Mexicana de Valores SAB de CV	Goldman Sachs	39,611
(22,907)	Bolsa Mexicana de Valores SAB de CV	Morgan Stanley	561
815,547	Cemex SAB de CV (Unit)	Goldman Sachs	2,867
937,949	Cemex SAB de CV (Unit)	Morgan Stanley	(11,012)
(59,272)	Coca-Cola Femsa SAB de CV 'L'	Goldman Sachs	13,305
(21,339)	Coca-Cola Femsa SAB de CV 'L'	Morgan Stanley	8,325
192,013	Concentradora Fibra Danhos SA de CV (Reit)	Goldman Sachs	(5,352)
127,089	Concentradora Fibra Danhos SA de CV (Reit)	Morgan Stanley	(17,037)
(293,252)	Concentradora Fibra Hotelera Mexicana SA de CV (Reit) '144A'	Goldman Sachs	4,063
(340,449)	Concentradora Fibra Hotelera Mexicana SA de CV (Reit) '144A'	Morgan Stanley	5,962
(331,879)	Concentradora Hipotecaria SAPI de CV (Reit)	Morgan Stanley	25,874
1,129,471	Consortio ARA SAB de CV	Goldman Sachs	(9,987)
1,050,288	Consortio ARA SAB de CV	Morgan Stanley	(35,460)
(169,600)	Controladora Vuela Cia de Aviacion SAB de CV 'A'	Goldman Sachs	8,101
(603,900)	Controladora Vuela Cia de Aviacion SAB de CV 'A'	Morgan Stanley	443,473
(45,928)	Corp Inmobiliaria Vesta SAB de CV	Morgan Stanley	1,571
242,400	Credito Real SAB de CV SOFOM ER	Goldman Sachs	(9,863)
490,960	Credito Real SAB de CV SOFOM ER	Morgan Stanley	(13,028)
(27,000)	Fibra Uno Administracion SA de CV (Reit)	Morgan Stanley	516
(661,534)	Fibra Uno Administracion SA de CV (Reit)	Goldman Sachs	69,089
56,000	Fomento Economico Mexicano SAB de CV (Unit)	Morgan Stanley	(6,017)
54,500	Fomento Economico Mexicano SAB de CV (Unit)	Goldman Sachs	(10,936)
(295,562)	Genomma Lab Internacional SAB de CV 'B'	Goldman Sachs	(5,328)
(554,199)	Genomma Lab Internacional SAB de CV 'B'	Morgan Stanley	(9,546)
(244,502)	Gentera SAB de CV	Goldman Sachs	(7,951)
(1,271,820)	Gentera SAB de CV	Morgan Stanley	(34,759)
(81,700)	GMexico Transportes SAB de CV '144A'	Goldman Sachs	988
(743,991)	GMexico Transportes SAB de CV '144A'	Morgan Stanley	229,653
124,434	Gruma SAB de CV 'B'	Goldman Sachs	(74,846)
138,402	Gruma SAB de CV 'B'	Morgan Stanley	(36,682)
172,203	Grupo Aeromexico SAB de CV	Goldman Sachs	1,590
194,395	Grupo Aeromexico SAB de CV	Morgan Stanley	618
194,315	Grupo Aeroportuario del Centro Norte SAB de CV	Goldman Sachs	(49,121)
173,115	Grupo Aeroportuario del Centro Norte SAB de CV	Morgan Stanley	(21,358)
148,134	Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV 'B'	Morgan Stanley	(164,346)
66,833	Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV 'B'	Goldman Sachs	(56,593)
(8,435)	Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV 'B'	Goldman Sachs	10,233
(44,060)	Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV 'B'	Morgan Stanley	93,782
(1,537,265)	Grupo Bimbo SAB de CV 'A'	Morgan Stanley	701,200

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	メキシコ(続き)		
(290,796)	Grupo Bimbo SAB de CV 'A'	Goldman Sachs	43,718
207,568	Grupo Carso SAB de CV 'A1'	Goldman Sachs	(15,096)
87,445	Grupo Carso SAB de CV 'A1'	Morgan Stanley	1,222
(3,100)	Grupo Cementos de Chihuahua SAB de CV	Goldman Sachs	1
(15,300)	Grupo Cementos de Chihuahua SAB de CV	Morgan Stanley	69
417,710	Grupo Comercial Chedraui SA de CV	Goldman Sachs	(14,874)
692,873	Grupo Comercial Chedraui SA de CV	Morgan Stanley	(20,845)
(9,432)	Grupo Elektra SAB DE CV	Goldman Sachs	4,536
(53,347)	Grupo Elektra SAB DE CV	Morgan Stanley	20,064
74,900	Grupo Financiero Banorte SAB de CV '0'	Goldman Sachs	(20,692)
758,517	Grupo Financiero Banorte SAB de CV '0'	Morgan Stanley	(64,680)
(2,035,836)	Grupo Financiero Inbursa SAB de CV '0'	Goldman Sachs	230,626
(842,892)	Grupo Financiero Inbursa SAB de CV '0'	Morgan Stanley	52,500
460,378	Grupo Financiero Interacciones SA de CV '0'	Goldman Sachs	(53,755)
489,314	Grupo Financiero Interacciones SA de CV '0'	Morgan Stanley	(18,984)
(124,157)	Grupo GICSA SA de CV	Goldman Sachs	4,096
(330,808)	Grupo GICSA SA de CV	Morgan Stanley	2,521
(869,370)	Grupo Herdez SAB de CV	Goldman Sachs	103,848
(4,098)	Grupo Herdez SAB de CV	Morgan Stanley	233
(1,995,312)	Grupo Lala SAB de CV	Goldman Sachs	(199,433)
(809,842)	Grupo Lala SAB de CV	Morgan Stanley	(75,634)
(74,800)	Grupo Mexico SAB de CV 'B'	Goldman Sachs	20,193
(319,500)	Grupo Mexico SAB de CV 'B'	Morgan Stanley	198,534
(282,192)	Grupo Rotoplas SAB de CV	Morgan Stanley	15,714
(259,136)	Grupo Rotoplas SAB de CV	Goldman Sachs	13,846
66,317	Grupo Simec SAB de CV 'B'	Morgan Stanley	(27,537)
(497,182)	Grupo Televisa SAB (Unit)	Morgan Stanley	319,664
(10,400)	Grupo Televisa SAB (Unit)	Goldman Sachs	2,648
(180,465)	Hoteles City Express SAB de CV	Goldman Sachs	4,874
(1,415,871)	Hoteles City Express SAB de CV	Morgan Stanley	114,769
219,579	Industrias Bachoco SAB de CV 'B'	Goldman Sachs	(45,223)
463,503	Industrias Bachoco SAB de CV 'B'	Morgan Stanley	8,312
34,983	Industrias Penoles SAB de CV	Morgan Stanley	(32,376)
48,533	Industrias Penoles SAB de CV	Goldman Sachs	(51,059)
(29,400)	Infraestructura Energetica Nova SAB de CV	Goldman Sachs	5,790
(1,617,084)	Infraestructura Energetica Nova SAB de CV	Morgan Stanley	1,154,342
(890,400)	Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV 'A'	Morgan Stanley	48,223
(226,407)	La Comer SAB de CV	Goldman Sachs	(9,859)
(1,653,140)	La Comer SAB de CV	Morgan Stanley	(31,922)
2,152,022	Macquarie Mexico Real Estate Management SA de CV (Reit)	Goldman Sachs	(41,202)
927,095	Macquarie Mexico Real Estate Management SA de CV (Reit)	Morgan Stanley	31,111
303,356	Megacable Holdings SAB de CV (Unit)	Goldman Sachs	(35,202)
457,817	Megacable Holdings SAB de CV (Unit)	Morgan Stanley	(73,804)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	メキシコ(続き)		
(294,454)	Mexichem SAB de CV	Goldman Sachs	32,427
(835,548)	Nemak SAB de CV '144A'	Morgan Stanley	177,939
(57,600)	Nemak SAB de CV '144A'	Goldman Sachs	1,161
228,300	PLA Administradora Industrial S de RL de CV (Reit)	Goldman Sachs	(16,304)
861,016	PLA Administradora Industrial S de RL de CV (Reit)	Morgan Stanley	(27,638)
1,086,740	Prologis Property Mexico SA de CV (Reit)	Morgan Stanley	147,642
797,257	Prologis Property Mexico SA de CV (Reit)	Goldman Sachs	(19,601)
89,892	Promotora y Operadora de Infraestructura SAB de CV	Goldman Sachs	(37,759)
209,447	Promotora y Operadora de Infraestructura SAB de CV	Morgan Stanley	(27,469)
(100,075)	Qualitas Controladora SAB de CV	Goldman Sachs	146
(322,668)	Qualitas Controladora SAB de CV	Morgan Stanley	19,287
101,945	Rassini SAB de CV	Goldman Sachs	(12,172)
23,693	Rassini SAB de CV	Morgan Stanley	(2,423)
(666,783)	Regional SAB de CV	Morgan Stanley	321,059
(268,301)	Regional SAB de CV	Goldman Sachs	58,564
(1,375,258)	Telesites SAB de CV	Goldman Sachs	12,687
(3,458,831)	Telesites SAB de CV	Morgan Stanley	(114,233)
(984,519)	TV Azteca SAB de CV (Unit)	Goldman Sachs	10,835
(2,968,077)	TV Azteca SAB de CV (Unit)	Morgan Stanley	302,924
(55,688)	Unifin Financiera SAB de CV SOFOM ENR	Morgan Stanley	8,904
513,500	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	Goldman Sachs	(2,363)
2,378,414	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	Morgan Stanley	49,057
			4,035,139
	ペルー		
447	Credicorp Ltd	Morgan Stanley	(939)
(238)	Credicorp Ltd	Goldman Sachs	(25,734)
7,452	Tahoe Resources Inc**	Morgan Stanley	(149)
537,685	Volcan Cia Minera SAA	Morgan Stanley	(18,352)
			(45,174)
	英国		
51,691	Rhythmone Plc	Bank of America Merrill Lynch	(159,751)
23,480	Rhythmone Plc	Goldman Sachs	(10,387)
19,978	Rhythmone Plc	Morgan Stanley	(68,605)
(23,480)	Rhythmone Plc	Goldman Sachs	4,150
(19,978)	Rhythmone Plc	Morgan Stanley	(9,815)
			(244,408)
	米国		
(125,944)	1-800-Flowers.com Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(56,675)
(9,854)	2U Inc	Goldman Sachs	(13,401)
593	2U Inc	Morgan Stanley	1,228
(46,242)	2U Inc	Bank of America Merrill Lynch	(62,889)
(25,163)	3D Systems Corp	Bank of America Merrill Lynch	4,189

** 当該有価証券には市場流動性がない。

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
8,559	3M Co	Bank of America Merrill Lynch	(37,403)
66,814	8x8 Inc	Morgan Stanley	(240,530)
(20,293)	8x8 Inc	Bank of America Merrill Lynch	58,850
(71,717)	A Schulman Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,091)
(4,058)	A-Mark Precious Metals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,583)
433,499	A10 Networks Inc	Bank of America Merrill Lynch	169,065
218,946	A10 Networks Inc	Goldman Sachs	85,389
84,382	A10 Networks Inc	Morgan Stanley	20,252
(143,915)	AAON Inc	Bank of America Merrill Lynch	(158,307)
(10,205)	AAR Corp	Bank of America Merrill Lynch	12,756
(56,730)	AAR Corp	Morgan Stanley	(72,047)
16,929	Aaron's Inc	Morgan Stanley	5,687
22,506	Aaron's Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,223
69,611	Abbott Laboratories	Bank of America Merrill Lynch	105,809
202	Abbott Laboratories	Morgan Stanley	135
12,932	AbbVie Inc	Bank of America Merrill Lynch	(42,805)
551	AbbVie Inc	Goldman Sachs	(1,824)
(28,145)	Abeona Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(56,994)
(1,506)	Abeona Therapeutics Inc	Goldman Sachs	2,937
(1,653)	Abercrombie & Fitch Co 'A'	Morgan Stanley	1,636
(3,285)	Abiomed Inc	Bank of America Merrill Lynch	(25,163)
926	Abiomed Inc	Morgan Stanley	4,109
89,280	ABM Industries Inc	Morgan Stanley	(81,481)
(10,673)	ABM Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	15,796
7,404	Abraxas Petroleum Corp	Goldman Sachs	(444)
(7,913)	Acacia Communications Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,356
(26,664)	Acacia Communications Inc	Morgan Stanley	(38,365)
(11,877)	Acacia Communications Inc	Goldman Sachs	2,850
(37,756)	Acacia Research Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,888)
(2,401)	Acacia Research Corp	Goldman Sachs	(120)
(9,042)	Acacia Research Corp	Morgan Stanley	452
1,336	Acadia Healthcare Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,714)
6,155	Acadia Healthcare Co Inc	Morgan Stanley	(7,275)
(8,081)	Acadia Healthcare Co Inc	Goldman Sachs	6,788
(4,279)	ACADIA Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	1,498
19,373	Acadia Realty Trust (Reit)	Morgan Stanley	20,729
1,636	Accelerate Diagnostics Inc	Morgan Stanley	8
(37,290)	Acceleron Pharma Inc	Bank of America Merrill Lynch	(43,629)
26,940	Accenture Plc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	61,962
57,511	Accenture Plc 'A'	Morgan Stanley	91,097
988	Accenture Plc 'A'	Goldman Sachs	2,272
(52,391)	Access National Corp	Bank of America Merrill Lynch	(72,633)
(11,311)	Access National Corp	Goldman Sachs	(15,949)
(15,247)	Access National Corp	Morgan Stanley	(3,812)
117,467	ACCO Brands Corp	Morgan Stanley	52,860

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
86,097	ACCO Brands Corp	Bank of America Merrill Lynch	99,012
34,448	ACCO Brands Corp	Goldman Sachs	39,615
200,195	Accuray Inc	Bank of America Merrill Lynch	(35,034)
219,266	Accuray Inc	Goldman Sachs	(38,372)
76,958	Accuray Inc	Morgan Stanley	(28,859)
(71,625)	Aceto Corp	Bank of America Merrill Lynch	8,871
(3,717)	ACI Worldwide Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,211)
(2,765)	ACI Worldwide Inc	Morgan Stanley	(1,714)
(2,442)	Aclaris Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,614
(15,565)	Aclaris Therapeutics Inc	Morgan Stanley	15,876
(1,389)	ACM Research Inc 'A'	Morgan Stanley	(1,861)
19,278	Acorda Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	30,845
7,862	Acorda Therapeutics Inc	Goldman Sachs	12,579
4,360	Acorda Therapeutics Inc	Morgan Stanley	12,862
23,431	Activision Blizzard Inc	Morgan Stanley	3,749
19,364	Activision Blizzard Inc	Bank of America Merrill Lynch	25,948
1,323	Actua Corp	Bank of America Merrill Lynch	-
(232,463)	Actuant Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	168,768
(128,511)	Actuant Corp 'A'	Morgan Stanley	(47,669)
1,305	Acuity Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	6,838
20,646	Acuity Brands Inc	Morgan Stanley	132,275
(1,801)	Acuity Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9,437)
20,565	Acushnet Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	17,480
1,844	Acushnet Holdings Corp	Morgan Stanley	92
1,427	Acxiom Corp	Bank of America Merrill Lynch	3,168
20,150	Acxiom Corp	Morgan Stanley	25,196
2,059	Adamas Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(264)
1,136	Adamas Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(2,851)
2,819	Adamas Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(1,006)
(1,187)	Adams Resources & Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	154
(2,275)	Adams Resources & Energy Inc	Goldman Sachs	296
360	Addus HomeCare Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,638
88,674	Adecoagro SA	Morgan Stanley	(13,301)
(49,948)	Adient Plc	Goldman Sachs	164,329
(1,066)	Adient Plc	Morgan Stanley	3,646
13,322	Adobe Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	159,198
(165,530)	Adtalem Global Education Inc	Bank of America Merrill Lynch	(309,242)
(78,298)	Adtalem Global Education Inc	Morgan Stanley	(100,127)
3,133	ADTRAN Inc	Bank of America Merrill Lynch	(940)
(15,972)	Advance Auto Parts Inc	Bank of America Merrill Lynch	(102,221)
13,601	Advanced Drainage Systems Inc	Morgan Stanley	73,527
7,906	Advanced Drainage Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	37,203
(213,168)	Advanced Emissions Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	85,267
2,711	Advanced Energy Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,988
2,790	Advanced Energy Industries Inc	Goldman Sachs	5,134

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(19,448)	Advanced Micro Devices Inc	Bank of America Merrill Lynch	(27,811)
(10,233)	Advanced Micro Devices Inc	Goldman Sachs	(14,633)
18,272	AdvanSix Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,644
1,915	AdvanSix Inc	Morgan Stanley	(2,470)
(48,912)	Adverum Biotechnologies Inc	Morgan Stanley	(22,010)
(6,313)	Adverum Biotechnologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,525)
65,689	AECOM	Bank of America Merrill Lynch	(4,986)
10,691	AECOM	Morgan Stanley	353
25,717	Aegon NV Reg	Bank of America Merrill Lynch	1,330
94,515	Aegon NV Reg	Morgan Stanley	(40,779)
(102,295)	AerCap Holdings NV	Morgan Stanley	(169,102)
(16,782)	AerCap Holdings NV	Goldman Sachs	8,450
(26,039)	Aerie Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10,416)
873	Aerie Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	609
1,164	Aerie Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	622
286,061	Aerohive Networks Inc	Bank of America Merrill Lynch	11,442
34,795	Aerohive Networks Inc	Goldman Sachs	1,392
63,621	Aerohive Networks Inc	Morgan Stanley	(7,635)
(32,484)	Aerovironment Inc	Bank of America Merrill Lynch	(121,576)
(24,724)	Aerovironment Inc	Morgan Stanley	(47,223)
(811,267)	AES Corp/VA	Morgan Stanley	(385,352)
(94,140)	AES Corp/VA	Bank of America Merrill Lynch	(35,303)
13,795	Affiliated Managers Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(97,117)
3,176	Affiliated Managers Group Inc	Morgan Stanley	(25,122)
398	Affiliated Managers Group Inc	Goldman Sachs	(2,802)
(51,162)	Aflac Inc	Bank of America Merrill Lynch	14,570
(68,416)	Aflac Inc	Morgan Stanley	25,774
(44,475)	AGCO Corp	Morgan Stanley	108,074
55,134	AGCO Corp	Bank of America Merrill Lynch	25,362
591	AGCO Corp	Goldman Sachs	272
54,977	Agenus Inc	Bank of America Merrill Lynch	6,215
16,853	Agenus Inc	Goldman Sachs	2,107
27,470	Agenus Inc	Morgan Stanley	(1,236)
28,787	Agilent Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	5,182
(53,546)	Agilysys Inc	Bank of America Merrill Lynch	(128,510)
(37,575)	Agilysys Inc	Morgan Stanley	(69,138)
(1,100)	Agilysys Inc	Goldman Sachs	(2,640)
(13,900)	Agios Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(88,543)
(11,602)	Agios Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(72,380)
(190,894)	AGNC Investment Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(45,324)
(16,957)	AGNC Investment Corp (Reit)	Morgan Stanley	(85)
9,752	AH Belo Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	975
1,507	AH Belo Corp 'A'	Morgan Stanley	75
18,691	Aimmune Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	57,755
1,121	Aimmune Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(146)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
32,825	Air Lease Corp	Bank of America Merrill Lynch	(10,504)
(64,604)	Air Lease Corp	Morgan Stanley	(15,506)
2,579	Air Lease Corp	Goldman Sachs	(825)
44,889	Air Products & Chemicals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(148,583)
1,541	Air Products & Chemicals Inc	Goldman Sachs	(5,101)
44,006	Air Products & Chemicals Inc	Morgan Stanley	(215,376)
80,748	Air Transport Services Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(13,770)
112,160	Air Transport Services Group Inc	Morgan Stanley	48,229
(15,334)	Aircastle Ltd	Goldman Sachs	23,154
(1,459)	AK Steel Holding Corp	Goldman Sachs	(452)
(55,099)	AK Steel Holding Corp	Morgan Stanley	(10,469)
(94,251)	AK Steel Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	(29,218)
(36,619)	Akamai Technologies Inc	Morgan Stanley	(35,708)
(9,711)	Akamai Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	6,798
(11,804)	Akcea Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(12,108)
(1,675)	Akcea Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(3,819)
92,095	Akebia Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(29,757)
23,314	Akebia Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(8,036)
35,238	Akebia Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(24,314)
6,147	Alamo Group Inc	Goldman Sachs	(5,471)
42,636	Alamo Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(37,946)
6,140	Alamo Group Inc	Morgan Stanley	(24,621)
(111,122)	Alamos Gold Inc 'A'	Morgan Stanley	307,792
(20,643)	Alarm.com Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(77,927)
(17,849)	Alarm.com Holdings Inc	Goldman Sachs	(67,380)
(22,106)	Alarm.com Holdings Inc	Morgan Stanley	(48,191)
28,349	Alaska Air Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	45,642
(114,235)	Albany International Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(194,200)
(27,742)	Albany International Corp 'A'	Morgan Stanley	24,968
2,138	Albemarle Corp	Bank of America Merrill Lynch	(15,094)
2,781	Albemarle Corp	Goldman Sachs	(19,634)
(29,016)	Alcoa Corp	Morgan Stanley	12,767
(233)	Alcoa Corp	Bank of America Merrill Lynch	301
(266)	Alcoa Corp	Goldman Sachs	343
24,710	Alder Biopharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	45,096
(6,950)	Aldeyra Therapeutics Inc	Morgan Stanley	1,738
2,469	Alexander & Baldwin Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,543
38,522	Alexander & Baldwin Inc	Morgan Stanley	27,736
50,917	Alexandria Real Estate Equities Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	48,257
64,159	Alexandria Real Estate Equities Inc (Reit)	Morgan Stanley	54,061
4,765	Alexandria Real Estate Equities Inc (Reit)	Goldman Sachs	4,384
1,265	Alexion Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(3,150)
4,100	Alexion Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(20,623)
(17,898)	Alico Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,685
(2,495)	Alico Inc	Goldman Sachs	374

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(25,760)	Alico Inc	Morgan Stanley	(25,760)
(1,330)	Align Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(71,022)
(4,469)	Align Technology Inc	Morgan Stanley	(175,810)
(21,553)	Alkermes Plc	Goldman Sachs	(26,726)
(291)	Alleghany Corp	Bank of America Merrill Lynch	4,173
(24,059)	Allegheny Technologies Inc	Goldman Sachs	(5,774)
(25,776)	Allegheny Technologies Inc	Morgan Stanley	(3,093)
(16,330)	Allegiance Bancshares Inc	Morgan Stanley	(11,431)
(1,500)	Allegiance Bancshares Inc	Goldman Sachs	(2,250)
(54,022)	Allegiance Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	(71,719)
(24,212)	Allegiant Travel Co	Bank of America Merrill Lynch	90,795
(3,576)	Allegiant Travel Co	Morgan Stanley	(1,788)
14,265	Allegion Plc	Morgan Stanley	(2,425)
21,666	Allegion Plc	Bank of America Merrill Lynch	44,199
(7,060)	Allergan Plc	Goldman Sachs	6,636
3,440	ALLETE Inc	Bank of America Merrill Lynch	10,086
647	Alliance Data Systems Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,879
(2,630)	Alliance Data Systems Corp	Morgan Stanley	1,131
(1,360)	Alliance One International Inc	Goldman Sachs	(4,080)
(3,721)	Alliance One International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11,163)
54,934	Alliant Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	37,410
1,873	Alliant Energy Corp	Goldman Sachs	1,506
(10,278)	Allied Motion Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(19,323)
(7,668)	Allied Motion Technologies Inc	Morgan Stanley	(13,956)
(1,010)	Allied Motion Technologies Inc	Goldman Sachs	(1,899)
(77,731)	Allison Transmission Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	88,613
(46,444)	Allison Transmission Holdings Inc	Morgan Stanley	109,143
2,572	Allscripts Healthcare Solutions Inc	Morgan Stanley	3,620
(14,780)	Allstate Corp/The	Morgan Stanley	38,633
12,385	Allstate Corp/The	Bank of America Merrill Lynch	(29,972)
870	Ally Financial Inc	Morgan Stanley	(1,305)
29,295	Ally Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(17,415)
3,264	Ally Financial Inc	Goldman Sachs	(2,089)
(10,438)	Alnylam Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	939
129,200	Alpha & Omega Semiconductor Ltd	Bank of America Merrill Lynch	153,748
(447)	Alphabet Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(4,488)
236	Alphabet Inc 'A'	Morgan Stanley	4,049
27,106	Alta Mesa Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,584)
23,328	Alta Mesa Resources Inc	Morgan Stanley	(12,364)
1,203	Altair Engineering Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	596
5,259	Altair Engineering Inc 'A'	Morgan Stanley	2,093
(4,125)	Alteryx Inc 'A'	Morgan Stanley	(8,333)
23,188	Altice USA Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(31,903)
1,355	Altice USA Inc 'A'	Goldman Sachs	(718)
48,621	Altice USA Inc 'A'	Morgan Stanley	(1,945)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(7,672)	Altisource Portfolio Solutions SA	Morgan Stanley	(2,378)
(19,872)	Altisource Portfolio Solutions SA	Bank of America Merrill Lynch	4,430
10,429	Altra Industrial Motion Corp	Morgan Stanley	(11,424)
21,804	Altra Industrial Motion Corp	Bank of America Merrill Lynch	(17,443)
10,806	Altra Industrial Motion Corp	Goldman Sachs	(8,645)
(123,959)	Altria Group Inc	Morgan Stanley	(64,088)
(3,266)	Altria Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,344)
16,531	AMAG Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	20,250
1,070	AMAG Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	1,311
(71,631)	Ambac Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	30,085
16,032	Ambarella Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,168)
(6,801)	Ambarella Inc	Morgan Stanley	(21,055)
2,239	Ambarella Inc	Goldman Sachs	(582)
320	Ambarella Inc	Morgan Stanley	(122)
124,851	Ambev SA ADR	Goldman Sachs	(55,658)
201,491	Ambev SA ADR	Morgan Stanley	(52,388)
13,819	AMC Entertainment Holdings Inc 'A'	Morgan Stanley	(11,746)
8,913	AMC Entertainment Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(11,807)
1,656	AMC Networks Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	2,252
(29,430)	Amdocs Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(67,100)
(1,244)	Amdocs Ltd	Morgan Stanley	(2,961)
(11,140)	Amedisys Inc	Bank of America Merrill Lynch	(39,213)
(4,919)	AMERCO	Bank of America Merrill Lynch	117,367
(3,865)	AMERCO	Morgan Stanley	56,025
77,598	Ameren Corp	Morgan Stanley	128,718
19,774	Ameresco Inc 'A'	Goldman Sachs	18,431
10,752	Ameresco Inc 'A'	Morgan Stanley	9,139
40,491	Ameresco Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	34,480
30,136	America Movil SAB de CV ADR 'L'	Goldman Sachs	(40,265)
80,719	America Movil SAB de CV ADR 'L'	Morgan Stanley	(71,033)
22,096	America's Car-Mart Inc/TX	Bank of America Merrill Lynch	206,598
2,053	America's Car-Mart Inc/TX	Goldman Sachs	19,196
(39,156)	American Airlines Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,175
1,991	American Airlines Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(725)
661	American Assets Trust Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	1,144
46,964	American Assets Trust Inc (Reit)	Morgan Stanley	61,992
(9,394)	American Axle & Manufacturing Holdings Inc	Morgan Stanley	4,885
4,578	American Campus Communities Inc (Reit)	Goldman Sachs	8,195
67,862	American Campus Communities Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	120,853
987	American Campus Communities Inc (Reit)	Morgan Stanley	2,458
10,166	American Eagle Outfitters Inc	Goldman Sachs	9,251
113,589	American Eagle Outfitters Inc	Bank of America Merrill Lynch	51,651
1,590	American Eagle Outfitters Inc	Morgan Stanley	620
(3,224)	American Equity Investment Life Holding Co	Morgan Stanley	2,060
5,600	American Express Co	Bank of America Merrill Lynch	(11,816)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
38,466	American Financial Group Inc/OH	Bank of America Merrill Lynch	2,989
25,146	American Financial Group Inc/OH	Morgan Stanley	(31,775)
1,090	American Financial Group Inc/OH	Goldman Sachs	458
(74,227)	American International Group Inc	Morgan Stanley	192,248
(98,976)	American International Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	75,751
(2,948)	American National Bankshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,717)
12,378	American National Insurance Co	Bank of America Merrill Lynch	(7,951)
2,445	American National Insurance Co	Goldman Sachs	(1,171)
460	American National Insurance Co	Morgan Stanley	(1,058)
(13,226)	American Public Education Inc	Bank of America Merrill Lynch	(52,243)
(90,361)	American Railcar Industries Inc	Morgan Stanley	7,229
(84,919)	American Railcar Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(72,181)
27,755	American Renal Associates Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(15,543)
7,913	American Renal Associates Holdings Inc	Morgan Stanley	(3,165)
2,320	American Renal Associates Holdings Inc	Goldman Sachs	(1,299)
85,795	American Software Inc/GA 'A'	Bank of America Merrill Lynch	47,187
56,763	American Software Inc/GA 'A'	Goldman Sachs	31,220
38,542	American Software Inc/GA 'A'	Morgan Stanley	18,500
(63,947)	American States Water Co	Bank of America Merrill Lynch	(166,262)
(70,163)	American States Water Co	Morgan Stanley	(161,375)
(12,270)	American Tower Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(9,571)
(2,141)	American Tower Corp (Reit)	Goldman Sachs	(1,670)
37,052	American Water Works Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	101,937
15,229	American Water Works Co Inc	Morgan Stanley	51,131
611	American Water Works Co Inc	Goldman Sachs	2,134
(50,910)	American Woodmark Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,122,566)
10,169	American Woodmark Corp	Morgan Stanley	209,622
810	American Woodmark Corp	Bank of America Merrill Lynch	13,161
(149,785)	Americold Realty Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(62,940)
(90,964)	Americold Realty Trust (Reit)	Morgan Stanley	(10,006)
(1,218)	AmeriGas Partners LP	Morgan Stanley	390
76,070	Ameriprise Financial Inc	Morgan Stanley	(430,556)
(48,150)	Ameris Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	(13,104)
(14,473)	Ameris Bancorp	Morgan Stanley	10,211
(3,258)	AMERISAFE Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,258)
18,565	AmerisourceBergen Corp	Bank of America Merrill Lynch	(42,885)
404	AmerisourceBergen Corp	Goldman Sachs	(933)
5,224	AMETEK Inc	Goldman Sachs	811
87,697	AMETEK Inc	Bank of America Merrill Lynch	8,124
42,236	AMETEK Inc	Morgan Stanley	1,015
1,686	Amgen Inc	Bank of America Merrill Lynch	13,134
(16,267)	Amicus Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(38,553)
13,876	Amkor Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	8,464
(724)	AMN Healthcare Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11)
(120,354)	Amneal Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(541,759)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(37,945)	Ampco-Pittsburgh Corp	Morgan Stanley	(1,897)
(28,274)	Ampco-Pittsburgh Corp	Bank of America Merrill Lynch	(19,792)
94,650	Amphenol Corp 'A'	Morgan Stanley	(89,292)
6,969	Amphenol Corp 'A'	Goldman Sachs	(2,021)
31,686	Anadarko Petroleum Corp	Bank of America Merrill Lynch	21,863
24,366	Analog Devices Inc	Morgan Stanley	41,383
(15,284)	AnaptysBio Inc	Bank of America Merrill Lynch	180,963
(16,909)	AnaptysBio Inc	Morgan Stanley	147,446
(5,484)	Anika Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,312)
(4,610)	Anixter International Inc	Morgan Stanley	(4,759)
(131,221)	Annaly Capital Management Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(18,063)
(28,318)	Ansys Inc	Bank of America Merrill Lynch	44,229
(5,096)	Ansys Inc	Morgan Stanley	7,492
(235,675)	Antares Pharma Inc	Bank of America Merrill Lynch	(35,351)
(131,838)	Antares Pharma Inc	Goldman Sachs	(19,776)
97,043	Antero Resources Corp	Bank of America Merrill Lynch	970
10,182	Antero Resources Corp	Goldman Sachs	102
4,220	Antero Resources Corp	Morgan Stanley	(422)
83,869	Anworth Mortgage Asset Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	23,483
37,455	Anworth Mortgage Asset Corp (Reit)	Goldman Sachs	10,487
49,260	Anworth Mortgage Asset Corp (Reit)	Morgan Stanley	8,867
(44,929)	Aon Plc	Morgan Stanley	83,452
(11,647)	Aon Plc	Goldman Sachs	12,695
(12,552)	Apache Corp	Bank of America Merrill Lynch	29,623
4,136	Apache Corp	Morgan Stanley	(1,670)
2,867	Apartment Investment & Management Co 'A' (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	2,638
(10,842)	Apellis Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(13,444)
1,692	Apergy Corp	Goldman Sachs	(738)
37,330	Apergy Corp	Bank of America Merrill Lynch	63,939
44,667	Apogee Enterprises Inc	Bank of America Merrill Lynch	90,335
4,567	Apogee Enterprises Inc	Goldman Sachs	11,829
5,044	Apogee Enterprises Inc	Morgan Stanley	4,457
(459,335)	Apollo Commercial Real Estate Finance Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(156,174)
(58,573)	Apollo Commercial Real Estate Finance Inc (Reit)	Morgan Stanley	(5,121)
(5,332)	Appian Corp	Bank of America Merrill Lynch	(861)
(2,530)	Appian Corp	Morgan Stanley	(4,073)
175,897	Apple Hospitality Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	167,102
(13,422)	Apple Hospitality Inc (Reit)	Morgan Stanley	(7,382)
20,340	Apple Hospitality Inc (Reit)	Goldman Sachs	19,323
(8,294)	Apple Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,543)
(6,792)	Apple Inc	Morgan Stanley	2,536
45,096	Applied Genetic Technologies Corp/DE	Bank of America Merrill Lynch	(45,096)
39,078	Applied Genetic Technologies Corp/DE	Morgan Stanley	(37,124)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
10,444	Applied Industrial Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	-
80,922	Applied Materials Inc	Bank of America Merrill Lynch	(201,137)
154,488	Applied Materials Inc	Morgan Stanley	(212,324)
4,785	Applied Optoelectronics Inc	Goldman Sachs	46,319
709	Applied Optoelectronics Inc	Morgan Stanley	6,253
10,279	Applied Optoelectronics Inc	Bank of America Merrill Lynch	99,501
150,507	Approach Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	57,945
42,631	Approach Resources Inc	Goldman Sachs	16,413
100,532	Approach Resources Inc	Morgan Stanley	5,529
(13,646)	Apptio Inc 'A'	Morgan Stanley	(17,194)
(9,464)	AptarGroup Inc	Bank of America Merrill Lynch	(12,065)
(54,611)	AptarGroup Inc	Morgan Stanley	(14,366)
8,774	Aptiv Plc	Morgan Stanley	809
(705)	Aptiv Plc	Goldman Sachs	(804)
46,795	Aqua America Inc	Morgan Stanley	80,487
(50,949)	Aramark	Bank of America Merrill Lynch	(43,307)
(106,818)	Aramark	Morgan Stanley	(5,341)
(22,961)	Aratana Therapeutics Inc	Morgan Stanley	6,659
(2,713)	Aratana Therapeutics Inc	Goldman Sachs	1,085
385,464	Arbor Realty Trust Inc (Reit)	Morgan Stanley	11,949
460,281	Arbor Realty Trust Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	79,172
4,899	Arbor Realty Trust Inc (Reit)	Goldman Sachs	740
347,516	ARC Document Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	(104,255)
72,287	ARC Document Solutions Inc	Goldman Sachs	(21,686)
158,139	ARC Document Solutions Inc	Morgan Stanley	-
(21,216)	ArcBest Corp	Bank of America Merrill Lynch	6,640
(50,259)	Arch Capital Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(8,841)
(13,897)	Arch Capital Group Ltd	Morgan Stanley	17,927
7,358	Archer-Daniels-Midland Co	Morgan Stanley	(5,663)
53,714	Archer-Daniels-Midland Co	Bank of America Merrill Lynch	(19,874)
(83,661)	Arconic Inc	Bank of America Merrill Lynch	9,203
(21,742)	Arconic Inc	Morgan Stanley	15,219
(12,877)	Ardagh Group SA	Goldman Sachs	5,923
(9,785)	Ardagh Group SA	Morgan Stanley	1,370
83,282	Ardelyx Inc	Morgan Stanley	(34,252)
82,944	Ardelyx Inc	Bank of America Merrill Lynch	(134,784)
91,548	Ardelyx Inc	Goldman Sachs	(148,766)
(21,643)	Arena Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	28,785
133,075	Ares Commercial Real Estate Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	37,261
31,276	Argan Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,564)
15,208	Argo Group International Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	7,604
581	Arista Networks Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,812
(39,182)	Armstrong World Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(105,791)
66,099	Array BioPharma Inc	Bank of America Merrill Lynch	70,065
20,408	Array BioPharma Inc	Goldman Sachs	21,632

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
16,255	Array BioPharma Inc	Morgan Stanley	12,029
(13,925)	ARRIS International PLC	Morgan Stanley	3,735
(63,898)	ARRIS International Plc	Goldman Sachs	52,396
33,172	Arrow Electronics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(17,913)
1,893	Arrow Electronics Inc	Morgan Stanley	379
(132,190)	Arrow Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(152,019)
(1,864)	Arrow Financial Corp	Morgan Stanley	280
79,202	Arthur J Gallagher & Co	Bank of America Merrill Lynch	(53,065)
30,130	Arthur J Gallagher & Co	Morgan Stanley	(93,103)
(123,840)	Artisan Partners Asset Management Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	43,344
(4,262)	Artisan Partners Asset Management Inc 'A'	Morgan Stanley	2,958
50,595	Asbury Automotive Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11,443)
(251,380)	Ascena Retail Group Inc	Goldman Sachs	(90,853)
(1,525)	Ascent Capital Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	656
(4,255)	Ascent Capital Group Inc 'A'	Goldman Sachs	1,830
40,809	ASGN Inc	Bank of America Merrill Lynch	(195,067)
3,369	ASGN Inc	Goldman Sachs	(16,104)
(132,043)	Ashford Hospitality Trust Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(77,905)
(43,091)	Ashland Global Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(115,903)
(941)	Ashland Global Holdings Inc	Morgan Stanley	(536)
(2,013)	Ashland Global Holdings Inc	Goldman Sachs	(6,019)
196	ASML Holding NV	Bank of America Merrill Lynch	(724)
4,373	ASML Holding NV	Morgan Stanley	(9,704)
5,442	Aspen Aerogels Inc	Bank of America Merrill Lynch	218
98,517	Aspen Aerogels Inc	Morgan Stanley	7,881
(39,970)	Aspen Insurance Holdings Ltd	Morgan Stanley	(35,907)
(17,133)	Aspen Insurance Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(5,997)
(59,420)	Aspen Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(77,712)
(26,176)	Aspen Technology Inc	Morgan Stanley	(26,618)
(2,419)	Assembly Biosciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	(847)
(2,347)	Assembly Biosciences Inc	Goldman Sachs	(821)
(56,478)	Associated Banc-Corp	Morgan Stanley	11,398
3,725	Associated Banc-Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,049
(23,124)	Associated Capital Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(42,779)
(934)	Associated Capital Group Inc 'A'	Goldman Sachs	(1,728)
(8,678)	Assurant Inc	Bank of America Merrill Lynch	(42,296)
(22,329)	Assurant Inc	Morgan Stanley	(95,272)
24,439	Assured Guaranty Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(5,132)
(22,368)	Astec Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(67,328)
(18,267)	Astec Industries Inc	Morgan Stanley	(11,143)
(5,842)	Astronics Corp	Bank of America Merrill Lynch	35,870
(1,839)	Astronics Corp 'B'	Morgan Stanley	166
(3,169)	Astronics Corp 'B'	Bank of America Merrill Lynch	12,729
(98,064)	Asure Software Inc	Bank of America Merrill Lynch	(39,226)
9,717	At Home Group Inc	Goldman Sachs	(4,081)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
16,434	At Home Group Inc	Morgan Stanley	(12,024)
9,129	At Home Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,242)
(24,713)	AT&T Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,819)
13,406	AT&T Inc	Morgan Stanley	(1,944)
6,888	Atara Biotherapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	31,168
5,889	athenahealth Inc	Bank of America Merrill Lynch	15,482
1,412	athenahealth Inc	Goldman Sachs	3,728
3,921	athenahealth Inc	Morgan Stanley	5,267
13,364	Athene Holding Ltd 'A'	Goldman Sachs	(23,654)
(14,075)	Athene Holding Ltd 'A'	Morgan Stanley	17,296
32,909	Athene Holding Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(58,249)
799	Athene Holding Ltd 'A'	Morgan Stanley	(1,694)
170,962	Atkore International Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	163,496
7,947	Atkore International Group Inc	Goldman Sachs	10,570
34,904	Atkore International Group Inc	Morgan Stanley	48,168
84,187	Atlantic Power Corp	Morgan Stanley	-
65,920	Atlantic Power Corp	Bank of America Merrill Lynch	(6,592)
68,306	Atlantic Power Corp	Goldman Sachs	(6,831)
6,125	Atlantica Yield Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2,882)
52,875	Atlantica Yield Plc	Morgan Stanley	(112,805)
2,346	Atlas Air Worldwide Holdings Inc	Morgan Stanley	1,414
755	Atlas Air Worldwide Holdings Inc	Goldman Sachs	1,050
14,196	Atlassian Corp Plc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	29,244
(26,842)	Atlassian Corp Plc 'A'	Morgan Stanley	(58,553)
30,410	Atmos Energy Corp	Morgan Stanley	99,370
(54,847)	ATN International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(106,403)
74,281	AtriCure Inc	Bank of America Merrill Lynch	97,308
39,930	aTyr Pharma Inc	Bank of America Merrill Lynch	(18,663)
(14,158)	Autodesk Inc	Bank of America Merrill Lynch	73,055
(2,545)	Autodesk Inc	Morgan Stanley	(3,475)
(14,653)	Autoliv Inc	Bank of America Merrill Lynch	(28,427)
(13,800)	Autoliv Inc	Morgan Stanley	14,628
10,741	Automatic Data Processing Inc	Bank of America Merrill Lynch	36,842
45,806	Automatic Data Processing Inc	Morgan Stanley	318,397
(6,835)	AutoNation Inc	Morgan Stanley	9,865
24,036	AutoNation Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,442)
345	AutoNation Inc	Morgan Stanley	90
1,445	AutoNation Inc	Goldman Sachs	(87)
685	AutoZone Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,062)
(32,762)	AV Homes Inc	Goldman Sachs	(54,057)
(31,265)	AV Homes Inc	Bank of America Merrill Lynch	(51,587)
(143,245)	Avangrid Inc	Bank of America Merrill Lynch	(167,597)
(12,617)	Avangrid Inc	Goldman Sachs	(14,762)
(38,903)	AVEO Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	2,140
16,537	Avery Dennison Corp	Bank of America Merrill Lynch	8,765

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
39,411	Avery Dennison Corp	Morgan Stanley	(131,633)
(6,943)	Avid Bioservices Inc	Goldman Sachs	1,805
(34,740)	Avid Bioservices Inc	Morgan Stanley	8,685
(11,226)	Avis Budget Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	41,985
(165,137)	Avnet Inc	Morgan Stanley	52,844
(33,074)	Avnet Inc	Bank of America Merrill Lynch	47,957
69,265	Avon Products Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,922)
175,818	Avon Products Inc	Morgan Stanley	(12,974)
1,374	Avon Products Inc	Goldman Sachs	(131)
48,703	AVX Corp	Goldman Sachs	(5,357)
28,933	AVX Corp	Morgan Stanley	(4,629)
101,086	AVX Corp	Bank of America Merrill Lynch	(11,119)
446	Axalta Coating Systems Ltd	Goldman Sachs	(58)
(36,667)	Axcelis Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	14,667
(15,133)	Axis Capital Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	13,771
(18,557)	Axis Capital Holdings Ltd	Morgan Stanley	10,577
(2,773)	AxoGen Inc	Bank of America Merrill Lynch	(12,201)
(10,643)	AxoGen Inc	Morgan Stanley	(50,554)
(177,652)	AZZ Inc	Bank of America Merrill Lynch	(648,642)
(6,325)	B&G Foods Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,142)
(327,506)	B. Riley Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(180,128)
(12,785)	B. Riley Financial Inc	Morgan Stanley	(4,475)
(2,022)	B. Riley Financial Inc	Goldman Sachs	(1,112)
(95,425)	Babcock & Wilcox Enterprises Inc	Bank of America Merrill Lynch	(47,352)
(339,722)	Babcock & Wilcox Enterprises Inc	Goldman Sachs	98,519
(49,397)	Badger Meter Inc	Bank of America Merrill Lynch	(71,626)
9,171	Baker Hughes a GE Co	Bank of America Merrill Lynch	(10,638)
(6,504)	Balchem Corp	Morgan Stanley	(8,267)
79,189	Baldwin & Lyons Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(3,844)
25,069	Baldwin & Lyons Inc 'B'	Morgan Stanley	4,191
15,293	Baldwin & Lyons Inc 'B'	Goldman Sachs	(765)
(185,706)	Ball Corp	Morgan Stanley	430,709
(78,019)	Banc of California Inc	Bank of America Merrill Lynch	(66,316)
(30,996)	Banc of California Inc	Goldman Sachs	(26,347)
(2,262)	Banc of California Inc	Morgan Stanley	(234)
539	BancFirst Corp	Morgan Stanley	270
1,555	BancFirst Corp	Goldman Sachs	2,799
(57,104)	Banco Bradesco SA ADR	Goldman Sachs	49,515
(149,501)	Banco Bradesco SA ADR	Morgan Stanley	128,571
1,579	Banco de Chile ADR	Goldman Sachs	(1,358)
4,512	Banco de Chile ADR	Morgan Stanley	(9,114)
22,493	Banco Santander Brasil SA ADR	Goldman Sachs	(17,320)
163,815	Banco Santander Brasil SA ADR	Morgan Stanley	(275,725)
(6,297)	Banco Santander Chile ADR	Goldman Sachs	(630)
(47,772)	Banco Santander Chile ADR	Morgan Stanley	955

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(20,300)	Banco Santander SA ADR	Morgan Stanley	16,139
(1,023)	Bancolumbia SA ADR	Morgan Stanley	(644)
(38,193)	Bancolumbia SA ADR	Goldman Sachs	47,531
(45,025)	BancorpSouth Bank	Morgan Stanley	(6,434)
(36,047)	Bank of America Corp	Goldman Sachs	82,728
14,100	Bank of Commerce Holdings	Bank of America Merrill Lynch	6,017
6,042	Bank of Commerce Holdings	Goldman Sachs	3,977
4,802	Bank of Commerce Holdings	Morgan Stanley	1,609
68,051	Bank of Hawaii Corp	Bank of America Merrill Lynch	28,792
21,972	Bank of Hawaii Corp	Morgan Stanley	(22,631)
303	Bank of Hawaii Corp	Goldman Sachs	133
1,211	Bank of Marin Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	182
1,000	Bank of Marin Bancorp	Morgan Stanley	750
1,030	Bank of Marin Bancorp	Goldman Sachs	155
(53,616)	Bank of New York Mellon Corp/The	Bank of America Merrill Lynch	123,317
24,523	BankFinancial Corp	Bank of America Merrill Lynch	13,242
6,522	BankFinancial Corp	Goldman Sachs	3,522
27,410	BankFinancial Corp	Morgan Stanley	2,741
(22,688)	BankUnited Inc	Morgan Stanley	(18,810)
2,935	BankUnited Inc	Morgan Stanley	(2,084)
133,024	Banner Corp	Bank of America Merrill Lynch	189,847
(3,476)	Banner Corp	Morgan Stanley	(1,371)
(43,675)	Barnes & Noble Education Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10,482)
(16,628)	Barnes Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(13,469)
5,513	Bassett Furniture Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,654
3,183	Bassett Furniture Industries Inc	Morgan Stanley	(1,910)
17,967	Baxter International Inc	Bank of America Merrill Lynch	29,134
46,659	Baxter International Inc	Morgan Stanley	21,547
5,036	BB&T Corp	Bank of America Merrill Lynch	(14,554)
(8,367)	BB+T Corp	Morgan Stanley	3,984
(3,119)	BCB Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,560)
(16,498)	Beacon Roofing Supply Inc	Bank of America Merrill Lynch	(29,917)
24,266	Beacon Roofing Supply Inc	Bank of America Merrill Lynch	40,646
6,572	Beacon Roofing Supply Inc	Goldman Sachs	11,008
8,663	Beacon Roofing Supply Inc	Morgan Stanley	16,416
(66,827)	Beasley Broadcast Group Inc 'A'	Morgan Stanley	(53,462)
59,423	Beazer Homes USA Inc	Bank of America Merrill Lynch	50,510
(36,502)	Becton Dickinson and Co	Bank of America Merrill Lynch	5,110
(38,634)	Becton Dickinson and Co	Morgan Stanley	218,037
(29,677)	Bed Bath & Beyond Inc	Morgan Stanley	(24,280)
(60,735)	Bed Bath & Beyond Inc	Bank of America Merrill Lynch	(35,226)
2,238	Belden Inc	Morgan Stanley	(4,026)
(54,092)	Belden Inc	Bank of America Merrill Lynch	11,900
6,500	Bellicum Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,365)
5,031	Bellicum Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(1,057)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(87,385)	Belmond Ltd 'A'	Goldman Sachs	(18,373)
(53,333)	Belmond Ltd 'A'	Morgan Stanley	8,000
35,853	Bemis Co Inc	Morgan Stanley	(8,824)
40,141	Bemis Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	26,493
(4,193)	Benchmark Electronics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,774)
(72,944)	Beneficial Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(28,419)
(16,965)	Berkshire Hathaway Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	74,816
(1,982)	Berkshire Hills Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,535)
(53,165)	Berry Global Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(73,368)
(13,489)	Best Buy Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	74,247
(2,683)	Best Buy Co Inc	Morgan Stanley	27,062
(34,107)	BG Staffing Inc	Bank of America Merrill Lynch	64,462
(903)	BG Staffing Inc	Goldman Sachs	1,707
6,375	BGC Partners Inc 'A'	Goldman Sachs	(2,964)
168,632	BGC Partners Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(78,414)
16,346	BGC Partners Inc 'A'	Morgan Stanley	(7,601)
28,533	Big Lots Inc	Morgan Stanley	16,834
1,107	Biglari Holdings Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	14,616
302	Biglari Holdings Inc 'B'	Goldman Sachs	4,053
203	Biglari Holdings Inc 'B'	Morgan Stanley	1,330
1,369	Bio-Rad Laboratories Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	8,228
791	Bio-Rad Laboratories Inc 'A'	Morgan Stanley	546
809	Bio-Rad Laboratories Inc 'A'	Goldman Sachs	3,681
769	Bio-Techne Corp	Bank of America Merrill Lynch	562
805	Bio-Techne Corp	Morgan Stanley	(240)
(14,766)	Bio-Techne Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,363)
(14,291)	BioCryst Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9,516)
(76,714)	BioCryst Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(44,208)
5,161	Biogen Inc	Bank of America Merrill Lynch	117,000
441	Biogen Inc	Goldman Sachs	9,997
189	Biogen Inc	Morgan Stanley	3,599
(16,080)	Biohaven Pharmaceutical Holding Co Ltd	Morgan Stanley	(28,301)
(8,681)	BioMarin Pharmaceutical Inc	Bank of America Merrill Lynch	(21,095)
(107,251)	BioScrip Inc	Morgan Stanley	(15,015)
(7,614)	BioSpecifics Technologies Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,208)
(27,763)	BioTelemetry Inc	Goldman Sachs	(63,855)
(5,545)	BioTelemetry Inc	Morgan Stanley	(9,149)
(19,946)	BioTime Inc	Bank of America Merrill Lynch	-
3,793	BJ's Restaurants Inc	Morgan Stanley	14,413
130,009	BJ's Restaurants Inc	Bank of America Merrill Lynch	514,107
5,342	BJ's Restaurants Inc	Goldman Sachs	21,298
46,676	Black Hills Corp	Bank of America Merrill Lynch	63,634
35,690	Black Hills Corp	Morgan Stanley	45,950
15,239	Black Hills Corp	Goldman Sachs	16,471
1,006	Blackbaud Inc	Bank of America Merrill Lynch	396

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
11,702	Blackbaud Inc	Morgan Stanley	1,148
(65,314)	Blackbaud Inc	Bank of America Merrill Lynch	22,207
(11,302)	Blackline Inc	Morgan Stanley	(1,017)
(41,978)	Blackstone Mortgage Trust Inc 'A' (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(20,989)
159,360	Bloomin' Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,402
11,366	Bloomin' Brands Inc	Goldman Sachs	(1,932)
83,941	Bloomin' Brands Inc	Morgan Stanley	45,328
(47,527)	Blucora Inc	Morgan Stanley	(83,172)
(50,595)	Blucora Inc	Bank of America Merrill Lynch	(263,094)
(16,185)	Bluebird Bio Inc	Bank of America Merrill Lynch	(131,515)
(1,950)	Bluebird Bio Inc	Goldman Sachs	(18,135)
(15,592)	BlueLinx Holdings Inc	Goldman Sachs	(7,640)
(649)	BlueLinx Holdings Inc	Morgan Stanley	(1,629)
(27,251)	Blueprint Medicines Corp	Bank of America Merrill Lynch	(115,846)
(38,898)	Bluerock Residential Growth REIT Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(1,556)
(1,481)	Bluerock Residential Growth REIT Inc (Reit)	Goldman Sachs	(59)
12,517	BMC Stock Holdings Inc	Morgan Stanley	7,510
(155)	Boeing Co/The	Bank of America Merrill Lynch	613
(7,549)	Boeing Co/The	Morgan Stanley	41,835
(66,965)	BofI Holding Inc	Morgan Stanley	(24,107)
(735)	BofI Holding Inc	Goldman Sachs	(243)
38,446	Boingo Wireless Inc	Bank of America Merrill Lynch	66,127
2,191	Boingo Wireless Inc	Goldman Sachs	3,769
4,867	BOK Financial Corp	Morgan Stanley	(13,725)
(23,973)	BOK Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	64,727
(11,230)	BOK Financial Corp	Goldman Sachs	30,321
(703)	Booking Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(27,776)
(1,740)	Booking Holdings Inc	Morgan Stanley	(52,382)
(19,556)	Boot Barn Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(31,297)
(25,503)	Boot Barn Holdings Inc	Goldman Sachs	(51,516)
41,791	Booz Allen Hamilton Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	173,851
1,797	Booz Allen Hamilton Holding Corp	Goldman Sachs	7,476
11,268	Booz Allen Hamilton Holding Corp	Morgan Stanley	36,876
104,960	BorgWarner Inc	Bank of America Merrill Lynch	(181,517)
11,886	BorgWarner Inc	Goldman Sachs	(22,528)
134,425	BorgWarner Inc	Morgan Stanley	(487,040)
(813)	Boston Beer Co Inc/The 'A'	Morgan Stanley	(13,333)
45,872	Boston Private Financial Holdings Inc	Morgan Stanley	(5,734)
194,187	Boston Private Financial Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	53,401
40,180	Boston Properties Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	106,075
37,760	Boston Properties Inc (Reit)	Morgan Stanley	65,020
3,429	Boston Properties Inc (Reit)	Goldman Sachs	9,053
47,629	Bottomline Technologies de Inc	Bank of America Merrill Lynch	178,132
13,954	Box Inc 'A'	Goldman Sachs	(33,350)
34,375	Box Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(82,156)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(3,773)	Boyd Gaming Corp	Bank of America Merrill Lynch	(7,282)
5,236	Boyd Gaming Corp	Bank of America Merrill Lynch	7,470
23,269	Boyd Gaming Corp	Morgan Stanley	33,408
52,396	Brady Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	115,271
(97,156)	Braemar Hotels & Resorts Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(86,469)
9,038	Brandywine Realty Trust (Reit)	Goldman Sachs	4,598
105,623	Brandywine Realty Trust (Reit)	Morgan Stanley	46,474
176,649	Brandywine Realty Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	85,940
(774)	Braskem SA ADR	Morgan Stanley	759
(1,748)	Braskem SA ADR	Goldman Sachs	2,657
(68,682)	BRF SA ADR	Morgan Stanley	27,473
(175,073)	BRF SA ADR	Goldman Sachs	152,314
(64,258)	Bridge Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(19,277)
34,094	Bridgepoint Education Inc	Bank of America Merrill Lynch	37,503
44,105	Bridgepoint Education Inc	Goldman Sachs	48,516
33,368	Bridgepoint Education Inc	Morgan Stanley	7,007
13,422	Bridgewater Bancshares Inc	Morgan Stanley	(2,684)
20,155	Bridgewater Bancshares Inc	Goldman Sachs	(3,873)
68,226	Bridgewater Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	(12,982)
100,593	Briggs & Stratton Corp	Bank of America Merrill Lynch	15,089
29,859	Briggs & Stratton Corp	Goldman Sachs	4,479
43,647	Briggs & Stratton Corp	Morgan Stanley	(20,078)
2,955	Bright Horizons Family Solutions Inc	Merrill Lynch	9,633
3,029	Bright Horizons Family Solutions Inc	Goldman Sachs	9,875
2,404	Brightcove Inc	Bank of America Merrill Lynch	721
3,737	Brightcove Inc	Goldman Sachs	1,121
2,700	Brightcove Inc	Morgan Stanley	1,080
(16,597)	Brighthouse Financial Inc	Morgan Stanley	80,750
(42,213)	Brighthouse Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	59,520
118,708	BrightSphere Investment Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(5,935)
(75,289)	Brink's Co/The	Bank of America Merrill Lynch	(361,827)
2,315	Brinker International Inc	Bank of America Merrill Lynch	787
(2,470)	Brinker International Inc	Goldman Sachs	(840)
3,442	Brinker International Inc	Morgan Stanley	1,471
11,804	Bristol-Myers Squibb Co	Goldman Sachs	8,145
50,271	Bristol-Myers Squibb Co	Bank of America Merrill Lynch	34,557
1,215	Bristol-Myers Squibb Co	Morgan Stanley	790
(11,101)	Bristow Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	70,380
(33,761)	Bristow Group Inc	Goldman Sachs	214,045
134,002	Brixmor Property Group Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	197,491
(21,082)	Brixmor Property Group Inc (Reit)	Morgan Stanley	(19,141)
19,301	Broadcom Inc	Morgan Stanley	241,476
3,482	Broadcom Inc	Bank of America Merrill Lynch	34,437
33,587	Broadridge Financial Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	37,617
14,227	Brookdale Senior Living Inc	Goldman Sachs	6,616

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
19,575	Brookdale Senior Living Inc	Morgan Stanley	7,536
92,996	Brookdale Senior Living Inc	Bank of America Merrill Lynch	43,243
(105,292)	Brookline Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(115,821)
(45,747)	Brooks Automation Inc	Bank of America Merrill Lynch	(88,712)
(32,309)	Brooks Automation Inc	Morgan Stanley	(97,399)
1,146	Brown & Brown Inc	Bank of America Merrill Lynch	516
(5,825)	Brown & Brown Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,621)
140,387	Brown & Brown Inc	Morgan Stanley	(14,263)
12,312	Brown-Forman Corp	Bank of America Merrill Lynch	12,222
7,616	Brown-Forman Corp	Goldman Sachs	7,921
18,545	Brown-Forman Corp ' B '	Bank of America Merrill Lynch	(19,287)
38,030	Brown-Forman Corp ' B '	Morgan Stanley	33,645
10,280	Brown-Forman Corp ' B '	Goldman Sachs	(10,691)
8,259	Bruker Corp	Bank of America Merrill Lynch	6,503
51,015	Bruker Corp	Morgan Stanley	(98,771)
2,610	Bruker Corp	Goldman Sachs	2,558
938	Brunswick Corp/DE	Goldman Sachs	982
7,092	Brunswick Corp/DE	Bank of America Merrill Lynch	20,070
28,281	Brunswick Corp/DE	Morgan Stanley	28,402
(87,944)	Buckle Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	(6,545)
(156,189)	Buckle Inc/The	Morgan Stanley	(39,047)
(6,586)	Build-A-Bear Workshop Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,572
40,881	Bunge Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(51,156)
5,868	Bunge Ltd	Morgan Stanley	(7,796)
4,176	Bunge Ltd	Goldman Sachs	(3,931)
12,078	Burlington Stores Inc	Bank of America Merrill Lynch	102,658
1,243	Burlington Stores Inc	Goldman Sachs	10,491
34,661	Burlington Stores Inc	Morgan Stanley	411,913
(33,789)	BWX Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	22,196
(28,972)	C&J Energy Services Inc	Morgan Stanley	60,262
(131,565)	CA Inc	Bank of America Merrill Lynch	(23,335)
(1,317)	Cable One Inc	Bank of America Merrill Lynch	23,021
857	Cabot Corp	Goldman Sachs	(643)
33,797	Cabot Corp	Morgan Stanley	31,093
19,609	Cabot Corp	Bank of America Merrill Lynch	(14,707)
28,770	Cabot Microelectronics Corp	Bank of America Merrill Lynch	75,953
10,197	Cabot Oil & Gas Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,855)
2,681	Cabot Oil & Gas Corp	Goldman Sachs	(751)
651	CACI International Inc ' A '	Morgan Stanley	2,702
2,944	CACI International Inc ' A '	Bank of America Merrill Lynch	14,426
(1,530)	CACI International Inc ' A '	Morgan Stanley	(4,817)
(19,195)	CACI International Inc ' A '	Bank of America Merrill Lynch	(94,056)
1,959	CACI International Inc ' A '	Goldman Sachs	9,599
30,417	Cactus Inc ' A '	Bank of America Merrill Lynch	(33,155)
25,214	Cactus Inc ' A '	Goldman Sachs	(28,867)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
8,939	Cactus Inc 'A'	Morgan Stanley	(26,370)
172,007	Cadence BanCorp	Bank of America Merrill Lynch	(8,600)
3,914	Cadence BanCorp	Goldman Sachs	(196)
18,711	Cadence BanCorp	Morgan Stanley	3,368
(2,343)	Cadence BanCorp	Morgan Stanley	(426)
35,903	Cadence Design Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	46,431
10,105	Cadence Design Systems Inc	Goldman Sachs	15,032
(67,523)	Caesars Entertainment Corp	Bank of America Merrill Lynch	23,633
(5,395)	CAI International Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,874
(3,717)	Cal-Maine Foods Inc	Goldman Sachs	(2,974)
(1,162)	Cal-Maine Foods Inc	Morgan Stanley	(1,046)
21,827	Cal-Maine Foods Inc	Bank of America Merrill Lynch	17,462
7,863	Cal-Maine Foods Inc	Goldman Sachs	6,290
(106,697)	CalAmp Corp	Bank of America Merrill Lynch	(76,822)
233	Calavo Growers Inc	Bank of America Merrill Lynch	(243)
9,200	Calavo Growers Inc	Morgan Stanley	(37,542)
18,025	Caleres Inc	Morgan Stanley	9,373
10,540	Caleres Inc	Bank of America Merrill Lynch	6,017
4,775	Caleres Inc	Goldman Sachs	2,499
9,547	California Resources Corp	Morgan Stanley	(17,355)
1,551	California Resources Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,235)
3,075	California Water Service Group	Bank of America Merrill Lynch	2,836
2,404	California Water Service Group	Morgan Stanley	3,956
33,372	Calithera Biosciences Inc	Morgan Stanley	5,006
53,895	Calithera Biosciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	(20,211)
50,441	Calithera Biosciences Inc	Goldman Sachs	(18,915)
(176,860)	Calix Inc	Bank of America Merrill Lynch	(88,430)
(9,953)	Calix Inc	Goldman Sachs	(4,977)
17,360	Callaway Golf Co	Bank of America Merrill Lynch	18,914
(351,331)	Callon Petroleum Co	Bank of America Merrill Lynch	600,776
(543)	Cambrex Corp	Morgan Stanley	(61)
(35,953)	Cambrex Corp	Bank of America Merrill Lynch	46,677
57,962	Camden Property Trust (Reit)	Morgan Stanley	122,151
(75,350)	Campbell Soup Co	Bank of America Merrill Lynch	302,977
(62,377)	Campbell Soup Co	Morgan Stanley	251,482
(13,131)	Campbell Soup Co	Goldman Sachs	69,857
6,935	Camping World Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(19,973)
5,393	Camping World Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	(15,532)
21,735	Camping World Holdings Inc 'A'	Morgan Stanley	(61,293)
819	Canada Goose Holdings Inc	Morgan Stanley	1,228
2,017	Cannae Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	81
25,550	Cantel Medical Corp	Bank of America Merrill Lynch	(89,775)
5,327	Cantel Medical Corp	Morgan Stanley	(25,061)
8,335	Cantel Medical Corp	Goldman Sachs	(30,429)
4,121	Capella Education Co	Goldman Sachs	29,259

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
770	Capella Education Co	Morgan Stanley	3,889
13,514	Capella Education Co	Bank of America Merrill Lynch	95,949
15,638	Capital City Bank Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10,634)
1,888	Capital City Bank Group Inc	Goldman Sachs	(1,284)
6,199	Capital City Bank Group Inc	Morgan Stanley	(5,703)
32,682	Capital One Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(69,281)
118,732	Capital One Financial Corp	Morgan Stanley	(62,466)
5,485	Capital One Financial Corp	Goldman Sachs	(8,611)
(53,039)	Capital Senior Living Corp	Bank of America Merrill Lynch	(15,381)
(8,278)	Capital Senior Living Corp	Goldman Sachs	(2,401)
(1,113)	Capstar Financial Holdings Inc	Goldman Sachs	(1,191)
(24,025)	Capstar Financial Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(25,707)
(4,305)	Capstar Financial Holdings Inc	Morgan Stanley	(1,205)
(201,708)	Capstead Mortgage Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(74,632)
(4,063)	Capstead Mortgage Corp (Reit)	Morgan Stanley	(366)
(14,721)	Carbonite Inc	Bank of America Merrill Lynch	(61,092)
12,535	Cardinal Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	(19,148)
419	Cardinal Health Inc	Goldman Sachs	(662)
30,401	Cardinal Health Inc	Morgan Stanley	(78,416)
(6,205)	Cardtronics Plc 'A'	Morgan Stanley	22,867
(30,047)	Cardtronics Plc 'A'	Goldman Sachs	95,624
16,095	Care.com Inc	Goldman Sachs	39,111
27,791	Care.com Inc	Bank of America Merrill Lynch	67,532
8,857	Care.com Inc	Morgan Stanley	16,917
(97,435)	Career Education Corp	Bank of America Merrill Lynch	(136,409)
208,407	CareTrust Inc (Reit)	Morgan Stanley	212,575
666,835	CareTrust Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	1,000,252
20,346	CareTrust Inc (Reit)	Goldman Sachs	30,519
523	Carlisle Cos Inc	Goldman Sachs	1,757
2,227	Carlisle Cos Inc	Morgan Stanley	1,743
(16,527)	CarMax Inc	Bank of America Merrill Lynch	(62,968)
(3,367)	CarMax Inc	Morgan Stanley	(20,487)
114,797	Carnival Corp	Bank of America Merrill Lynch	(254,849)
594	Carnival Corp	Goldman Sachs	(1,319)
201,556	Carnival Corp	Morgan Stanley	(414,830)
42,074	Carolina Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	136,587
9,683	Carolina Financial Corp	Goldman Sachs	30,693
3,100	Carolina Financial Corp	Morgan Stanley	1,705
4,154	Carpenter Technology Corp	Bank of America Merrill Lynch	8,848
7,785	Carpenter Technology Corp	Goldman Sachs	16,582
116,837	Carriage Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,168)
14,792	Carriage Services Inc	Goldman Sachs	(148)
5,451	Carrizo Oil & Gas Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,868)
(3,575)	Carrizo Oil & Gas Inc	Morgan Stanley	4,969
58,613	Carrols Restaurant Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	48,356

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
13,755	Carrols Restaurant Group Inc	Goldman Sachs	11,348
9,451	Carrols Restaurant Group Inc	Morgan Stanley	10,632
2,991	Cars.com Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,277
25,143	Cars.com Inc	Morgan Stanley	53,296
(4,308)	Carter's Inc	Morgan Stanley	5,444
(5,064)	Carter's Inc	Bank of America Merrill Lynch	5,215
(13,678)	Casa Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	20,654
(6,796)	Casa Systems Inc	Morgan Stanley	6,456
(6,394)	Casella Waste Systems Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	3,645
(3,823)	Casey's General Stores Inc	Bank of America Merrill Lynch	9,634
(13,470)	Casey's General Stores Inc	Goldman Sachs	33,944
41,295	Casey's General Stores Inc	Morgan Stanley	(27,444)
(19,615)	Catalent Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,903)
214,622	CatchMark Timber Trust Inc 'A' (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(12,877)
100,285	CatchMark Timber Trust Inc 'A' (Reit)	Goldman Sachs	(6,017)
83,276	CatchMark Timber Trust Inc 'A' (Reit)	Morgan Stanley	(15,822)
(24,073)	Caterpillar Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,971)
(46,588)	Caterpillar Inc	Morgan Stanley	(139,236)
95,085	Cathay General Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	69,412
13,755	Cathay General Bancorp	Morgan Stanley	(5,089)
22,392	Cathay General Bancorp	Goldman Sachs	16,346
91,957	Cato Corp/The 'A'	Bank of America Merrill Lynch	513,120
(1,631)	Cavco Industries Inc	Morgan Stanley	(49,722)
1,042	Cavium Inc	Bank of America Merrill Lynch	6,836
(128,338)	CBIZ Inc	Bank of America Merrill Lynch	(160,423)
(494,729)	CBL & Associates Properties Inc (Reit)	Goldman Sachs	(499,676)
(31,012)	Cboe Global Markets Inc	Bank of America Merrill Lynch	294,614
(58,665)	Cboe Global Markets Inc	Morgan Stanley	301,517
(7,872)	CBRE Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(236)
(28,555)	CBRE Group Inc 'A'	Morgan Stanley	(533)
2,393	CBS Corp 'B non-voting share'	Morgan Stanley	194
5,064	CBS Corp 'B non-voting share'	Goldman Sachs	(20,560)
20,833	CBS Corp 'B non-voting share'	Bank of America Merrill Lynch	(84,582)
6,885	CDK Global Inc	Bank of America Merrill Lynch	5,301
633	CDK Global Inc	Morgan Stanley	872
11,179	CDK Global Inc	Goldman Sachs	8,608
24,054	CDW Corp/DE	Bank of America Merrill Lynch	59,491
43,463	CDW Corp/DE	Morgan Stanley	90,403
198,938	CECO Environmental Corp	Bank of America Merrill Lynch	(55,703)
58,746	CECO Environmental Corp	Goldman Sachs	(16,449)
80,576	CECO Environmental Corp	Morgan Stanley	(23,367)
15,941	Celanese Corp 'A'	Morgan Stanley	210,918
24,333	Celanese Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	164,004
360	Celanese Corp 'A'	Goldman Sachs	2,426
641	Celgene Corp	Goldman Sachs	(2,493)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
40,625	Celgene Corp	Bank of America Merrill Lynch	(110,861)
625	Celgene Corp	Morgan Stanley	925
15,161	Celldex Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,286)
43,571	Celldex Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(3,695)
32,922	Celldex Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(1,452)
(4,125)	Cellular Biomedicine Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,713
221,167	Cemex SAB de CV ADR	Morgan Stanley	(250,397)
73,036	Cemex SAB de CV ADR	Goldman Sachs	6,938
(5,821)	Centene Corp	Bank of America Merrill Lynch	(30,502)
(1,136)	Centene Corp	Morgan Stanley	(1,763)
(1,946)	Centennial Resource Development Inc/DE 'A'	Bank of America Merrill Lynch	2,666
(39,740)	Centennial Resource Development Inc/DE 'A'	Goldman Sachs	54,444
4,615	CenterPoint Energy Inc	Goldman Sachs	-
130,733	CenterPoint Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	-
111,634	CenterPoint Energy Inc	Morgan Stanley	98,486
70,959	Central European Media Enterprises Ltd 'A'	Morgan Stanley	(60,695)
195,694	Central European Media Enterprises Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(19,050)
72,450	Central European Media Enterprises Ltd 'A'	Goldman Sachs	(7,245)
(1,302)	Central European Media Enterprises Ltd (Wts 2/5/2018)*	Morgan Stanley	-
732	Central Garden & Pet Co 'A'	Bank of America Merrill Lynch	666
740	Central Garden & Pet Co 'A'	Goldman Sachs	673
21,389	Central Garden & Pet Co 'A'	Morgan Stanley	1,073
156,086	Central Pacific Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	6,243
118,937	Central Pacific Financial Corp	Morgan Stanley	(59,469)
(6,696)	Century Aluminum Co	Morgan Stanley	(8,058)
92,516	Century Casinos Inc	Bank of America Merrill Lynch	21,279
32,781	Century Casinos Inc	Goldman Sachs	7,540
123,786	Century Casinos Inc	Morgan Stanley	59,417
123,000	Century Communities Inc	Bank of America Merrill Lynch	79,950
4,127	Century Communities Inc	Morgan Stanley	(1,651)
(113,699)	CenturyLink Inc	Morgan Stanley	115,973
(86,309)	CenturyLink Inc	Bank of America Merrill Lynch	93,565
13,484	Ceridian HCM Holding Inc	Morgan Stanley	2,427
52,661	Cerus Corp	Bank of America Merrill Lynch	17,905
51,826	Cerus Corp	Goldman Sachs	17,621
11,617	Cerus Corp	Morgan Stanley	4,182
(13,424)	CEVA Inc	Bank of America Merrill Lynch	(847)
(23,322)	CF Industries Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	10,728
(63,918)	CH Robinson Worldwide Inc	Bank of America Merrill Lynch	(208,373)
(19,856)	CH Robinson Worldwide Inc	Morgan Stanley	87,044
278	ChannelAdvisor Corp	Goldman Sachs	70

* 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。

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
6,874	ChannelAdvisor Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,719
(3,928)	Charles River Laboratories International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(12,255)
3,875	Charles Schwab Corp/The	Bank of America Merrill Lynch	(13,400)
95,614	Charles Schwab Corp/The	Morgan Stanley	(258,070)
(12,774)	Charter Communications Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	60,293
24,671	Charter Financial Corp/MD	Bank of America Merrill Lynch	(1,727)
9,061	Charter Financial Corp/MD	Goldman Sachs	(634)
19,921	Charter Financial Corp/MD	Morgan Stanley	(13,347)
(8,687)	Chase Corp	Bank of America Merrill Lynch	(70,365)
49,863	Chatham Lodging Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	76,290
1,989	Chatham Lodging Trust (Reit)	Goldman Sachs	3,043
13,792	Chatham Lodging Trust (Reit)	Morgan Stanley	8,275
2,498	CHC Group Ltd*	Morgan Stanley	(1,124)
(4,887)	Check Point Software Technologies Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3,274)
(51,262)	Check Point Software Technologies Ltd	Morgan Stanley	(60,489)
6,096	Cheesecake Factory Inc/The	Goldman Sachs	1,402
96,910	Cheesecake Factory Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	23,555
51,229	Cheesecake Factory Inc/The	Morgan Stanley	136,625
(43,229)	Chegg Inc	Morgan Stanley	(96,833)
13,389	Chemed Corp	Bank of America Merrill Lynch	(20,422)
193	CHEMED Corp	Morgan Stanley	106
667	CHEMED Corp	Goldman Sachs	(342)
15,842	Chemical Financial Corp	Morgan Stanley	(24,397)
(112,508)	Chemical Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(42,753)
1,892	ChemoCentryx Inc	Goldman Sachs	1,183
89,602	ChemoCentryx Inc	Bank of America Merrill Lynch	122,755
16,635	ChemoCentryx Inc	Morgan Stanley	55,126
15,022	Chemours Co/The	Morgan Stanley	(32,761)
399	Chemours Co/The	Goldman Sachs	(76)
5,510	Chemours Co/The	Bank of America Merrill Lynch	(8,075)
(7,189)	Chemung Financial Corp	Morgan Stanley	(23,436)
(3,330)	Chemung Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(16,028)
(300)	Chemung Financial Corp	Goldman Sachs	(1,557)
671	Cheniere Energy Inc	Morgan Stanley	3,402
(18,029)	Cheniere Energy Partners LP Holdings LLC	Morgan Stanley	(41,106)
(71,749)	Cheniere Energy Partners LP Holdings LLC	Goldman Sachs	(180,090)
(15,541)	Chesapeake Energy Corp	Goldman Sachs	(11,733)
(114,783)	Chesapeake Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	(9,757)
1,295	Chesapeake Utilities Corp	Bank of America Merrill Lynch	3,216
1,059	Chesapeake Utilities Corp	Goldman Sachs	1,523
337	Chesapeake Utilities Corp	Morgan Stanley	314
(14,243)	Chevron Corp	Bank of America Merrill Lynch	82,467
(9,154)	Chevron Corp	Morgan Stanley	(7,938)
28,213	Chico's FAS Inc	Morgan Stanley	(46,834)

* 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。

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
80,622	Chico's FAS Inc	Bank of America Merrill Lynch	(169,306)
63,490	Chico's FAS Inc	Goldman Sachs	(133,329)
(109,472)	Chimera Investment Corp (Reit)	Morgan Stanley	(10,947)
(8,443)	China Biologic Products Holdings Inc	Morgan Stanley	(53,800)
(1,066)	Chipotle Mexican Grill Inc	Morgan Stanley	(8,291)
738	Chipotle Mexican Grill Inc	Bank of America Merrill Lynch	7,653
76	Chipotle Mexican Grill Inc	Goldman Sachs	788
(44,409)	Choice Hotels International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(77,716)
(85,064)	Choice Hotels International Inc	Morgan Stanley	(106,371)
(4,352)	Chubb Ltd	Bank of America Merrill Lynch	16,668
(2,569)	Chubb Ltd	Morgan Stanley	11,740
13,084	Chubb Ltd	Morgan Stanley	1,719
(18,227)	Chubb Ltd	Goldman Sachs	69,809
148,613	Church & Dwight Co Inc	Morgan Stanley	25,217
53,312	Church & Dwight Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	30,452
8,923	Church & Dwight Co Inc	Goldman Sachs	4,997
(861)	Churchill Downs Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,450)
(2,247)	Churchill Downs Inc	Morgan Stanley	10,112
13,900	Cia Brasileira de Distribuicao ADR	Goldman Sachs	(2,224)
34,974	Cia Cervecerias Unidas SA ADR	Goldman Sachs	(37,422)
32,426	Cia Cervecerias Unidas SA ADR	Morgan Stanley	(73,411)
(114,025)	Cia de Minas Buenaventura SAA ADR	Goldman Sachs	11,693
(332,919)	Cia Siderurgica Nacional SA ADR	Morgan Stanley	153,143
(192,652)	Cia Siderurgica Nacional SA ADR	Goldman Sachs	98,253
40,414	Cidara Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	46,476
94,811	Cidara Therapeutics Inc	Goldman Sachs	109,033
3,054	Cidara Therapeutics Inc	Morgan Stanley	2,291
49,138	Ciena Corp	Bank of America Merrill Lynch	(53,045)
64,099	Ciena Corp	Morgan Stanley	(36,536)
9,858	Ciena Corp	Goldman Sachs	(11,534)
342	Cigna Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,272)
19,126	Cimarex Energy Co	Bank of America Merrill Lynch	(80,903)
8,169	Cimarex Energy Co	Goldman Sachs	(34,555)
243	Cimarex Energy Co	Morgan Stanley	(1,256)
(6,634)	Cimpress NV	Bank of America Merrill Lynch	(4,445)
(10,738)	Cimpress NV	Morgan Stanley	(44,500)
18,985	Cimpress NV	Bank of America Merrill Lynch	12,720
4,882	Cimpress NV	Goldman Sachs	3,271
1,247	Cimpress NV	Morgan Stanley	5,175
(103,401)	Cincinnati Bell Inc	Bank of America Merrill Lynch	511,835
(10,623)	Cincinnati Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	20,396
12,615	Cinemark Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(34,061)
8,005	Cinemark Holdings Inc	Goldman Sachs	(21,614)
833	Cintas Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,120
3,751	Cintas Corp	Morgan Stanley	5,024

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(9,326)	Cintas Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3,917)
(283)	Cintas Corp	Goldman Sachs	(119)
15,650	CIRCOR International Inc	Bank of America Merrill Lynch	12,833
7,955	CIRCOR International Inc	Goldman Sachs	6,523
5,065	CIRCOR International Inc	Morgan Stanley	(9,320)
133,650	Cirrus Logic Inc	Bank of America Merrill Lynch	(72,171)
28,654	Cirrus Logic Inc	Goldman Sachs	(15,473)
15,585	Cirrus Logic Inc	Morgan Stanley	(6,234)
(5,312)	Cision Ltd	Goldman Sachs	(5,843)
(19,051)	Cision Ltd	Morgan Stanley	(11,812)
(12,348)	CIT Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	44,453
29,798	Citi Trends Inc	Morgan Stanley	(12,515)
31,224	Citi Trends Inc	Bank of America Merrill Lynch	9,367
9,573	Citi Trends Inc	Goldman Sachs	2,872
64,826	Citigroup Inc	Bank of America Merrill Lynch	(433,038)
103,521	Citigroup Inc	Morgan Stanley	(438,607)
(70,923)	Citizens & Northern Corp	Bank of America Merrill Lynch	(75,888)
(79,059)	Citizens & Northern Corp	Morgan Stanley	(432,666)
134,346	Citizens Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(267,532)
30,711	Citizens Financial Group Inc	Morgan Stanley	(52,209)
7,249	Citizens Financial Group Inc	Goldman Sachs	(13,471)
(14,249)	Citrix Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,767)
(23,051)	Citrix Systems Inc	Morgan Stanley	(43,520)
(22,750)	City Holding Co	Bank of America Merrill Lynch	(53,235)
(24,450)	Civeo Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4,095)
10,587	Civista Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	7,004
1,104	Civista Bancshares Inc	Goldman Sachs	201
5,114	Civista Bancshares Inc	Morgan Stanley	126
3,514	Civitas Solutions Inc	Morgan Stanley	1,406
31,111	Clarus Corp	Bank of America Merrill Lynch	6,222
32,643	Clarus Corp	Goldman Sachs	6,529
33,329	Clarus Corp	Morgan Stanley	(1,666)
(6,057)	Clean Harbors Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10,600)
(22,750)	Clean Harbors Inc	Morgan Stanley	(27,755)
23,620	Clear Channel Outdoor Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(9,448)
(73,973)	Clear Channel Outdoor Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	29,589
(20,147)	Clear Channel Outdoor Holdings Inc 'A'	Morgan Stanley	4,029
(23,202)	Clearfield Inc	Bank of America Merrill Lynch	16,241
(51,663)	Clearfield Inc	Morgan Stanley	12,916
(3,566)	Clearfield Inc	Goldman Sachs	2,496
(7,346)	Clearwater Paper Corp	Bank of America Merrill Lynch	8,448
36,101	Clorox Co/The	Morgan Stanley	187,899
3,160	Clorox Co/The	Bank of America Merrill Lynch	13,322
11,028	Cloudera Inc	Bank of America Merrill Lynch	6,617
1,979	Cloudera Inc	Goldman Sachs	1,187

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
11,722	Clovis Oncology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(33,642)
16,669	Clovis Oncology Inc	Goldman Sachs	(44,132)
5,786	Clovis Oncology Inc	Morgan Stanley	(10,263)
135,090	CMS Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	189,126
9,927	CNA Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(15,530)
3,246	CNA Financial Corp	Goldman Sachs	(6,395)
58,107	CNA Financial Corp	Morgan Stanley	(111,903)
(38,421)	CNB Financial Corp/PA	Bank of America Merrill Lynch	(44,376)
(14,685)	CNB Financial Corp/PA	Morgan Stanley	1,395
(309,349)	CNH Industrial NV	Morgan Stanley	355,751
13,604	CNO Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,632)
(42,912)	CNX Resources Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,369)
(46,900)	CNX Resources Corp	Morgan Stanley	235
134,306	CoBiz Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	146,394
11,961	CoBiz Financial Inc	Morgan Stanley	4,784
(12,796)	Coca-Cola Bottling Co Consolidated	Bank of America Merrill Lynch	(27,639)
5,537	Coca-Cola Bottling Co Consolidated	Morgan Stanley	4,097
(114,016)	Coca-Cola Co/The	Bank of America Merrill Lynch	(89,467)
(26,090)	Coca-Cola Co/The	Morgan Stanley	(12,001)
59,090	Coca-Cola European Partners Plc	Bank of America Merrill Lynch	(10,045)
9,267	Coca-Cola European Partners Plc	Goldman Sachs	(1,575)
(1,397)	Coca-Cola Femsa SAB de CV ADR	Goldman Sachs	3,395
(4,987)	Coca-Cola Femsa SAB de CV ADR	Morgan Stanley	6,591
109,059	Cogent Communications Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	109,059
14,624	Cogent Communications Holdings Inc	Goldman Sachs	14,624
(15,342)	Cognex Corp	Bank of America Merrill Lynch	18,104
(6,694)	Cognex Corp	Morgan Stanley	16,005
(12,639)	Cognizant Technology Solutions Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(7,331)
(19,928)	Cohbar Inc	Morgan Stanley	(2,391)
(1,925)	Cohen & Steers Inc	Bank of America Merrill Lynch	96
(6,635)	Coherent Inc	Morgan Stanley	15,120
(7,611)	Coherent Inc	Bank of America Merrill Lynch	35,380
41,967	Cohu Inc	Bank of America Merrill Lynch	53,298
3,779	Cohu Inc	Morgan Stanley	1,096
2,211	Cohu Inc	Goldman Sachs	2,808
(11,271)	Colfax Corp	Morgan Stanley	9,130
(24,051)	Colfax Corp	Bank of America Merrill Lynch	6,975
11,011	Colgate-Palmolive Co	Bank of America Merrill Lynch	21,141
(59,882)	Collectors Universe Inc	Bank of America Merrill Lynch	49,702
(10,378)	Collegium Pharmaceutical Inc	Morgan Stanley	23,247
(6,791)	Colony NorthStar Inc 'A' (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	645
(54,496)	Colony NorthStar Inc 'A' (Reit)	Morgan Stanley	15,898
(192,116)	Columbia Banking System Inc	Bank of America Merrill Lynch	(39,719)
(26,339)	Columbia Banking System Inc	Morgan Stanley	9,409
(18,803)	Columbia Property Trust Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(2,498)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(2,178)	Columbia Property Trust Inc (Reit)	Morgan Stanley	(784)
(658)	Columbia Sportswear Co	Morgan Stanley	129
19,244	Comcast Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(18,859)
23,456	Comcast Corp 'A'	Morgan Stanley	(19,110)
69,645	Comcast Corp 'A'	Goldman Sachs	(68,252)
24,422	Comerica Inc	Morgan Stanley	(147,509)
(1,065)	Comerica Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,398
54,044	Comfort Systems USA Inc	Bank of America Merrill Lynch	147,125
13,403	Comfort Systems USA Inc	Goldman Sachs	35,539
58,766	Comfort Systems USA Inc	Morgan Stanley	94,026
(34,938)	Commerce Bancshares Inc/MO	Bank of America Merrill Lynch	13,276
(50,504)	Commercial Metals Co	Morgan Stanley	(18,686)
(142,476)	Commercial Metals Co	Bank of America Merrill Lynch	(150,597)
(116,761)	CommScope Holding Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	5,348
(189,623)	CommScope Holding Co Inc	Morgan Stanley	56,887
(4,878)	Community Bank System Inc	Morgan Stanley	38
(9,088)	Community Health Systems Inc (Right)	Goldman Sachs	20
(133,364)	Community Healthcare Trust Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(241,088)
(47,924)	CommVault Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(21,566)
(1,354)	CommVault Systems Inc	Morgan Stanley	(1,219)
(17,117)	Compass Minerals International Inc	Goldman Sachs	55,630
(14,939)	Compass Minerals International Inc	Morgan Stanley	14,192
288	Conagra Brands Inc	Goldman Sachs	(92)
11,696	Conagra Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,743)
57,990	Conagra Brands Inc	Morgan Stanley	4,336
112,866	Conatus Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	27,484
105,157	Conatus Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	26,735
41,380	Conatus Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	8,795
(13,322)	Concert Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,528)
464	Concho Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,535)
17,187	Concho Resources Inc	Morgan Stanley	(146,759)
(32,852)	Conduent Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,197)
(45,847)	Conduent Inc	Morgan Stanley	7,565
15,612	CONMED Corp	Bank of America Merrill Lynch	13,270
5,483	CONMED Corp	Goldman Sachs	4,661
2,181	CONMED Corp	Morgan Stanley	632
(12,581)	CONMED Corp	Morgan Stanley	(3,648)
(67,989)	Conn's Inc	Goldman Sachs	98,584
(908)	Conn's Inc	Morgan Stanley	(45)
(23,104)	Conn's Inc	Bank of America Merrill Lynch	33,501
(392)	Connecticut Water Service Inc	Morgan Stanley	(721)
(101,183)	Connecticut Water Service Inc	Bank of America Merrill Lynch	(94,100)
(252,586)	ConnectOne Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(126,293)
(34,533)	ConnectOne Bancorp Inc	Morgan Stanley	17,267
46,729	ConocoPhillips	Bank of America Merrill Lynch	(122,430)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
5,012	Consol Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,002
4,017	Consolidated Communications Holdings Inc	Goldman Sachs	522
77,756	Consolidated Communications Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,906
51,068	Consolidated Communications Holdings Inc	Morgan Stanley	(6,228)
15,341	Consolidated Edison Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,870)
9,551	Consolidated Edison Inc	Morgan Stanley	(563)
10,236	Consolidated Water Co Ltd	Morgan Stanley	2,032
8,262	Consolidated Water Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,002
9,227	Consolidated Water Co Ltd	Goldman Sachs	1,074
(7,625)	Consolidated-Tomoka Land Co	Bank of America Merrill Lynch	12,731
(13,263)	Consolidated-Tomoka Land Co	Morgan Stanley	16,711
(19,885)	Consolidated-Tomoka Land Co	Goldman Sachs	34,401
7,811	Constellation Brands Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	4,690
41,521	Constellation Brands Inc 'A'	Morgan Stanley	(70,989)
491	Constellation Brands Inc 'A'	Goldman Sachs	2,343
5,775	Constellium NV 'A'	Bank of America Merrill Lynch	3,465
184,644	Constellium NV 'A'	Morgan Stanley	-
32,183	Consumer Portfolio Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,218
7,210	Consumer Portfolio Services Inc	Goldman Sachs	721
211,273	Consumer Portfolio Services Inc	Morgan Stanley	2,113
39,645	Continental Building Products Inc	Bank of America Merrill Lynch	39,645
14,636	Continental Resources Inc/OK	Bank of America Merrill Lynch	(3,768)
19,140	Continental Resources Inc/OK	Morgan Stanley	33,818
(17,560)	Convergys Corp	Bank of America Merrill Lynch	15,728
(4,535)	Cooper Cos Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	10,570
(38,445)	Cooper Tire & Rubber Co	Bank of America Merrill Lynch	(11,534)
(674)	Cooper Tire & Rubber Co	Goldman Sachs	(202)
(17,362)	Cooper-Standard Holdings Inc	Morgan Stanley	113,584
(1,648)	Copa Holdings SA 'A'	Goldman Sachs	5,933
(2,278)	Copa Holdings SA 'A'	Bank of America Merrill Lynch	8,201
(963)	Copa Holdings SA 'A'	Morgan Stanley	3,293
(48,228)	Copart Inc	Bank of America Merrill Lynch	(26,525)
6,531	Copart Inc	Morgan Stanley	19,201
52,216	Corcept Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	43,339
30,800	Corcept Therapeutics Inc	Goldman Sachs	25,564
(7,433)	Corcept Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(1,086)
(1,682)	Core Laboratories NV	Morgan Stanley	3,835
(7,241)	Core Laboratories NV	Bank of America Merrill Lynch	(5,358)
26,788	Core-Mark Holding Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	15,228
8,530	Core-Mark Holding Co Inc	Goldman Sachs	3,311
55,961	Core-Mark Holding Co Inc	Morgan Stanley	39,173
2,602	CoreCivic Inc (Reit)	Morgan Stanley	1,691
15,427	CoreCivic Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	16,353
(65,589)	CoreLogic Inc/United States	Bank of America Merrill Lynch	(101,663)
(27,160)	CoreLogic Inc/United States	Morgan Stanley	(196,942)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
13,487	CoreSite Realty Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	22,928
41,151	CoreSite Realty Corp (Reit)	Morgan Stanley	201,640
2,362	CoreSite Realty Corp (Reit)	Goldman Sachs	4,015
(40,955)	Corindus Vascular Robotics Inc	Morgan Stanley	950
(1,385)	Corium International Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,981
(6,166)	Corium International Inc	Goldman Sachs	8,817
33,307	Cornerstone OnDemand Inc	Bank of America Merrill Lynch	111,578
6,767	Cornerstone OnDemand Inc	Morgan Stanley	21,200
(162,563)	Corning Inc	Morgan Stanley	50,395
2,252	Corporate Office Properties Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	2,139
50,843	Corvus Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	181,510
19,456	Corvus Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	69,458
9,862	Corvus Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	20,118
134,581	Cosan Ltd 'A'	Goldman Sachs	(123,815)
493,587	Cosan Ltd 'A'	Morgan Stanley	(567,625)
(583)	CoStar Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,953
77	CoStar Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	626
1,146	CoStar Group Inc	Morgan Stanley	8,194
988	Costco Wholesale Corp	Bank of America Merrill Lynch	3,310
1,997	Cotiviti Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,118
2,099	Cotiviti Holdings Inc	Morgan Stanley	2,470
831	Cotiviti Holdings Inc	Goldman Sachs	952
(66,743)	Coty Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	50,166
(410)	County Bancorp Inc	Goldman Sachs	45
(20,505)	Coupa Software Inc	Morgan Stanley	(45,316)
109,281	Cousins Properties Inc (Reit)	Morgan Stanley	56,280
76,569	Cousins Properties Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	37,136
8,189	Cousins Properties Inc (Reit)	Goldman Sachs	3,972
(217,709)	Covanta Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	(201,381)
(26,139)	Covanta Holding Corp	Morgan Stanley	(24,179)
(153,953)	Covanta Holding Corp	Goldman Sachs	(142,407)
7,112	Covenant Transportation Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	569
1,678	Covenant Transportation Group Inc 'A'	Goldman Sachs	134
1,602	Covenant Transportation Group Inc 'A'	Morgan Stanley	336
(50,869)	Cowen Inc	Goldman Sachs	39,423
(66,136)	Cowen Inc	Morgan Stanley	44,642
55,479	CRA International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(18,308)
6,456	CRA International Inc	Goldman Sachs	(2,130)
1,827	CRA International Inc	Morgan Stanley	201
(611)	Cracker Barrel Old Country Store Inc	Goldman Sachs	(2,059)
(35,420)	Cracker Barrel Old Country Store Inc	Morgan Stanley	(79,341)
(45,073)	Craft Brew Alliance Inc	Bank of America Merrill Lynch	(49,580)
812	Crane Co	Goldman Sachs	(690)
24,548	Crane Co	Bank of America Merrill Lynch	(21,475)
30,136	Crane Co	Morgan Stanley	(21,134)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(8,531)	Cray Inc	Morgan Stanley	4,596
978	Credicorp Ltd	Goldman Sachs	(4,661)
6,819	Credicorp Ltd	Morgan Stanley	(3,205)
(3,103)	Credit Acceptance Corp	Bank of America Merrill Lynch	(21,628)
(13,919)	Credit Acceptance Corp	Goldman Sachs	(97,015)
(22,708)	Credit Acceptance Corp	Morgan Stanley	(492,851)
(72,974)	Cree Inc	Bank of America Merrill Lynch	(275,842)
(58,239)	Cree Inc	Morgan Stanley	(125,214)
11,486	Crocs Inc	Bank of America Merrill Lynch	25,958
(57,827)	Cross Country Healthcare Inc	Bank of America Merrill Lynch	(24,287)
(45,576)	Crown Castle International Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(18,230)
27,283	Crown Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,364
(174,148)	Crown Holdings Inc	Morgan Stanley	874,659
(67,660)	CryoLife Inc	Bank of America Merrill Lynch	(118,405)
(5,210)	CryoLife Inc	Morgan Stanley	(4,689)
(12,444)	CSW Industrials Inc	Bank of America Merrill Lynch	(44,176)
(26,502)	CSX Corp	Bank of America Merrill Lynch	(73,146)
(39,168)	CTI BioPharma Corp	Bank of America Merrill Lynch	(15,276)
(82,296)	CTI BioPharma Corp	Goldman Sachs	(32,095)
(42,866)	CTI BioPharma Corp	Morgan Stanley	9,859
(103,736)	CTS Corp	Bank of America Merrill Lynch	(191,912)
6,594	CubeSmart (Reit)	Morgan Stanley	6,066
44,459	CubeSmart (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	28,813
432	CubeSmart (Reit)	Goldman Sachs	276
(13,350)	Cubic Corp	Morgan Stanley	7,343
(23,978)	Cubic Corp	Bank of America Merrill Lynch	(12,942)
18,527	Cullen/Frost Bankers Inc	Morgan Stanley	(78,369)
3,216	Cullen/Frost Bankers Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10,561)
19,963	Culp Inc	Morgan Stanley	11,978
13,894	Culp Inc	Bank of America Merrill Lynch	20,146
17,950	Cumberland Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(696)
12,033	Cummins Inc	Bank of America Merrill Lynch	(20,817)
1,093	Cummins Inc	Goldman Sachs	(1,891)
15,930	Curis Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,791)
14,577	Curis Inc	Goldman Sachs	(5,298)
19,594	Curis Inc	Morgan Stanley	(4,084)
24,130	Curo Group Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	685
7,248	Curo Group Holdings Corp	Goldman Sachs	161
65,522	Curtiss-Wright Corp	Bank of America Merrill Lynch	(66,177)
1,428	Curtiss-Wright Corp	Morgan Stanley	(1,015)
2,649	Curtiss-Wright Corp	Goldman Sachs	(2,215)
(6,506)	Customers Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,026)
(25,337)	Customers Bancorp Inc	Morgan Stanley	(16,976)
4,575	CVB Financial Corp	Morgan Stanley	(760)
(23,969)	CVR Energy Inc	Morgan Stanley	77,002

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(12,884)	CVS Health Corp	Morgan Stanley	11,219
(8,478)	CVS Health Corp	Goldman Sachs	8,817
(2,603)	CyberArk Software Ltd	Morgan Stanley	(4,921)
(10,288)	CyberOptics Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,029
(23,899)	CyberOptics Corp	Morgan Stanley	-
(3,794)	CyberOptics Corp	Goldman Sachs	379
(52,875)	Cymabay Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(78,255)
(65,561)	Cypress Semiconductor Corp	Bank of America Merrill Lynch	(25,241)
(2,167)	Cypress Semiconductor Corp	Morgan Stanley	(704)
13,178	CyrusOne Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	22,016
636	CyrusOne Inc (Reit)	Morgan Stanley	(245)
30,964	Dana Inc	Goldman Sachs	(42,111)
136,033	Dana Inc	Bank of America Merrill Lynch	(185,456)
87,529	Dana Inc	Morgan Stanley	(138,296)
20,071	Danaher Corp	Morgan Stanley	(5,988)
61,557	Danaher Corp	Bank of America Merrill Lynch	36,816
669	Darden Restaurants Inc	Goldman Sachs	749
20,588	Darden Restaurants Inc	Bank of America Merrill Lynch	23,059
54,011	Darden Restaurants Inc	Morgan Stanley	20,821
(45,761)	Darling Ingredients Inc	Morgan Stanley	(13,986)
(8,148)	Darling Ingredients Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,530)
(4,353)	DaVita Inc	Morgan Stanley	(974)
1,264	DaVita Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,124
1,858	DaVita Inc	Goldman Sachs	3,121
534	DaVita Inc	Morgan Stanley	27
179,654	Dawson Geophysical Co	Morgan Stanley	274,785
32,613	DCT Industrial Trust Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	21,851
20,264	DDR Corp	Morgan Stanley	3,327
22,289	Dean Foods Co	Bank of America Merrill Lynch	(9,138)
(2,842)	Dean Foods Co	Morgan Stanley	625
(821)	Deckers Outdoor Corp	Bank of America Merrill Lynch	(6,956)
4,598	Deckers Outdoor Corp	Morgan Stanley	40,348
31,027	Deckers Outdoor Corp	Bank of America Merrill Lynch	382,253
(9,634)	Deere & Co	Bank of America Merrill Lynch	(60,502)
(16,758)	Deere & Co	Morgan Stanley	64,777
182,664	Del Taco Restaurants Inc	Bank of America Merrill Lynch	115,078
20,116	Del Taco Restaurants Inc	Morgan Stanley	14,282
73,395	Del Taco Restaurants Inc	Goldman Sachs	46,239
(17,307)	Delek US Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(128,245)
1,218	Dell Technologies Inc 'V'	Morgan Stanley	200
11,874	Delphi Technologies Plc	Bank of America Merrill Lynch	(7,124)
1,872	Delphi Technologies Plc	Goldman Sachs	(1,123)
350	Delphi Technologies Plc	Morgan Stanley	(1,085)
(17,620)	Delphi Technologies Plc	Morgan Stanley	25,573
(103,847)	Delta Air Lines Inc	Morgan Stanley	(28,977)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
6,627	Delta Air Lines Inc	Bank of America Merrill Lynch	11,995
2,618	Deluxe Corp	Goldman Sachs	(11,912)
68,070	Deluxe Corp	Bank of America Merrill Lynch	(201,602)
14,035	Deluxe Corp	Morgan Stanley	(27,901)
(7,344)	DENTSPLY SIRONA Inc	Morgan Stanley	(805)
(22,587)	Depomed Inc	Bank of America Merrill Lynch	20,780
236,420	Dermira Inc	Bank of America Merrill Lynch	(527,217)
9,606	Dermira Inc	Morgan Stanley	(11,527)
29,900	Dermira Inc	Goldman Sachs	(66,677)
1,619	Despegar.com Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,768)
43,333	Despegar.com Corp	Morgan Stanley	(40,079)
(11,634)	Deutsche Bank AG	Bank of America Merrill Lynch	29,318
(173,799)	Deutsche Bank AG	Morgan Stanley	372,525
893	Devon Energy Corp	Morgan Stanley	(63)
28,618	Devon Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	12,878
10,106	Devon Energy Corp	Goldman Sachs	4,548
(4,193)	DexCom Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,816)
(252)	DexCom Inc	Morgan Stanley	(474)
25,737	DHI Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	18,016
12,266	DHI Group Inc	Goldman Sachs	8,586
8,243	DHI Group Inc	Morgan Stanley	4,946
(26,059)	Diamondback Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	182,413
67,805	DiamondRock Hospitality Co (Reit)	Morgan Stanley	37,632
46,375	DiamondRock Hospitality Co (Reit)	Goldman Sachs	57,273
416,336	DiamondRock Hospitality Co (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	514,175
(33,331)	Dicerna Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(30,331)
5,809	Dick's Sporting Goods Inc	Bank of America Merrill Lynch	41,373
14,148	Dick's Sporting Goods Inc	Morgan Stanley	93,449
(187,181)	Diebold Nixdorf Inc	Bank of America Merrill Lynch	107,629
(115,810)	Diebold Nixdorf Inc	Goldman Sachs	66,591
(424)	Digimarc Corp	Bank of America Merrill Lynch	(191)
(32,437)	Digimarc Corp	Goldman Sachs	(22,527)
(24,136)	Digimarc Corp	Morgan Stanley	(20,516)
3,735	Digital Realty Trust Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	523
214	Digital Realty Trust Inc (Reit)	Morgan Stanley	220
18,915	Dillard's Inc 'A'	Goldman Sachs	171,937
13,235	Dillard's Inc 'A'	Morgan Stanley	98,865
51,543	Dillard's Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	416,715
(90,946)	Dime Community Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	(90,946)
(2,350)	Dine Brands Global Inc	Morgan Stanley	7,802
994	Dine Brands Global Inc	Goldman Sachs	(3,471)
1,827	Dine Brands Global Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10,974)
1,911	Dine Brands Global Inc	Morgan Stanley	(5,631)
23,948	Diodes Inc	Bank of America Merrill Lynch	29,935
19,525	Diodes Inc	Goldman Sachs	24,406

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
44,451	Diodes Inc	Morgan Stanley	32,005
(9,444)	Diplomat Pharmacy Inc	Morgan Stanley	2,246
1,902	Diplomat Pharmacy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,132)
1,028	Discover Financial Services	Bank of America Merrill Lynch	(2,457)
335	Discover Financial Services	Morgan Stanley	(1,441)
(5,366)	Discovery Inc 'A'	Goldman Sachs	10,893
(36,093)	DISH Network Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	108,556
(37,337)	DISH Network Corp 'A'	Morgan Stanley	113,131
(33,190)	DMC Global Inc	Bank of America Merrill Lynch	(104,549)
(40,174)	DMC Global Inc	Morgan Stanley	(50,218)
(529)	DocuSign Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,185)
(1,488)	DocuSign Inc	Morgan Stanley	(5,668)
28,327	Dolby Laboratories Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,416)
14,705	Dollar General Corp	Bank of America Merrill Lynch	(84,683)
12,492	Dollar General Corp	Morgan Stanley	(82,811)
2,028	Dollar General Corp	Goldman Sachs	(10,383)
(27,392)	Dollar Tree Inc	Bank of America Merrill Lynch	301,860
(26,515)	Dollar Tree Inc	Morgan Stanley	270,958
13,977	Dominion Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(14,117)
8,505	Domino's Pizza Inc	Bank of America Merrill Lynch	26,280
3,130	Domino's Pizza Inc	Morgan Stanley	6,197
770	Domino's Pizza Inc	Goldman Sachs	2,379
(21,889)	Domtar Corp	Morgan Stanley	(82,237)
5,764	Domtar Corp	Bank of America Merrill Lynch	5,556
2,580	Domtar Corp	Goldman Sachs	6,373
38,669	Donegal Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	4,640
9,331	Donegal Group Inc 'A'	Morgan Stanley	933
4,903	Donnelley Financial Solutions Inc	Goldman Sachs	(5,687)
(19,377)	Dorman Products Inc	Morgan Stanley	70,303
(49,027)	Dorman Products Inc	Bank of America Merrill Lynch	18,630
(6,995)	Dorman Products Inc	Goldman Sachs	2,658
572	Douglas Dynamics Inc	Bank of America Merrill Lynch	687
412	Douglas Dynamics Inc	Morgan Stanley	433
8,922	Douglas Emmett Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	9,011
(130,197)	DowDuPont Inc	Morgan Stanley	403,611
(170,792)	DowDuPont Inc	Bank of America Merrill Lynch	474,802
5,432	DR Horton Inc	Goldman Sachs	9,995
121,537	DR Horton Inc	Bank of America Merrill Lynch	221,695
17,676	DR Horton Inc	Morgan Stanley	(6,867)
(2,920)	Dream Office Real Estate Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	19,507
(7,482)	Dril-Quip Inc	Morgan Stanley	(6,403)
4,094	Dril-Quip Inc	Bank of America Merrill Lynch	7,165
(8,014)	DSP Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(585)
(51,538)	DSW Inc 'A'	Morgan Stanley	87,615
(116,172)	DSW Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	83,644

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
47,295	DTE Energy Co	Bank of America Merrill Lynch	27,431
2,469	DTE Energy Co	Goldman Sachs	1,432
702	Ducommun Inc	Bank of America Merrill Lynch	(729)
755	Ducommun Inc	Goldman Sachs	(364)
(62,287)	Duke Energy Corp	Morgan Stanley	73,129
8,881	Duke Realty Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	1,332
57,388	Duke Realty Corp (Reit)	Morgan Stanley	35,581
(40,541)	Duluth Holdings Inc 'B'	Goldman Sachs	(12,162)
(41,897)	Duluth Holdings Inc 'B'	Morgan Stanley	(12,150)
5,338	Dun & Bradstreet Corp/The	Bank of America Merrill Lynch	2,829
1,530	Dun & Bradstreet Corp/The	Goldman Sachs	811
13,416	Dun & Bradstreet Corp/The	Morgan Stanley	98,514
(10,489)	Dunkin' Brands Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	7,028
(1,565)	Dunkin' Brands Group Inc	Goldman Sachs	(20)
199,160	Durect Corp	Bank of America Merrill Lynch	21,908
154,580	Durect Corp	Goldman Sachs	17,004
125,351	Durect Corp	Morgan Stanley	10,028
(10,926)	DXC Technology Co	Bank of America Merrill Lynch	91,014
(17,558)	Dycom Industries Inc	Morgan Stanley	(43,544)
(96,063)	Dycom Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,585,487
(34,058)	Dynavax Technologies Corp	Morgan Stanley	23,841
(972)	Dynavax Technologies Corp	Goldman Sachs	2,916
(44,162)	E*TRADE Financial Corp	Morgan Stanley	90,532
(30,384)	E*TRADE Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	17,533
19,225	Eagle Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	16,341
(12,172)	Eagle Materials Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,290)
(20,773)	Eagle Pharmaceuticals Inc/DE	Bank of America Merrill Lynch	(17,242)
(2,480)	Eagle Pharmaceuticals Inc/DE	Morgan Stanley	(744)
(64,293)	East West Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	45,950
330,681	Easterly Government Properties Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	52,909
57,302	Easterly Government Properties Inc (Reit)	Goldman Sachs	9,168
22,641	Easterly Government Properties Inc (Reit)	Morgan Stanley	7,245
(10,649)	Eastern Co/The	Bank of America Merrill Lynch	(9,584)
(874)	Eastern Co/The	Goldman Sachs	(787)
109,332	EastGroup Properties Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	318,307
2,943	EastGroup Properties Inc (Reit)	Morgan Stanley	10,065
11,372	EastGroup Properties Inc (Reit)	Goldman Sachs	32,638
6,072	Eastman Chemical Co	Goldman Sachs	(16,334)
33,295	Eastman Chemical Co	Bank of America Merrill Lynch	(89,564)
14,496	Eaton Corp Plc	Bank of America Merrill Lynch	11,887
(14,894)	Eaton Vance Corp	Bank of America Merrill Lynch	35,746
12,458	eBay Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,852)
(1,064)	Ebix Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,286)
(53,458)	Ebix Inc	Morgan Stanley	32,402
2,957	EBIX Inc	Morgan Stanley	2,311

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
10,905	Echo Global Logistics Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,382
6,589	Echo Global Logistics Inc	Goldman Sachs	446
2,966	Echo Global Logistics Inc	Morgan Stanley	37
(28,036)	EchoStar Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	104,855
(16,536)	EchoStar Corp 'A'	Morgan Stanley	113,029
123,234	Eclipse Resources Corp	Bank of America Merrill Lynch	9,243
90,527	Eclipse Resources Corp	Morgan Stanley	(1,358)
64,367	Eclipse Resources Corp	Goldman Sachs	4,828
2,339	Ecolab Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,298)
7,712	Ecolab Inc	Morgan Stanley	(11,713)
(16,635)	Edgewell Personal Care Co	Bank of America Merrill Lynch	(579)
(78,919)	Edgewell Personal Care Co	Morgan Stanley	(6,871)
(88,953)	Edison International	Bank of America Merrill Lynch	(30,273)
(74,090)	Edison International	Morgan Stanley	102,902
(206,083)	Education Realty Trust Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(548,181)
(17,666)	Education Realty Trust Inc (Reit)	Morgan Stanley	(54,588)
14,839	Edwards Lifesciences Corp	Bank of America Merrill Lynch	39,620
16,165	eGain Corp	Bank of America Merrill Lynch	36,371
1,743	eGain Corp	Morgan Stanley	4,488
(66,767)	eHealth Inc	Bank of America Merrill Lynch	(149,558)
(7,414)	eHealth Inc	Morgan Stanley	(3,410)
13,103	Eiger BioPharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(655)
15,903	Eiger BioPharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	42,938
4,762	Eiger BioPharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	12,857
(16,772)	El Paso Electric Co	Bank of America Merrill Lynch	(16,339)
3,712	El Paso Electric Co	Morgan Stanley	9,094
91,934	El Pollo Loco Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	50,564
36,602	El Pollo Loco Holdings Inc	Goldman Sachs	20,131
29,148	El Pollo Loco Holdings Inc	Morgan Stanley	7,287
897	Eldorado Resorts Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,797
3,262	Eldorado Resorts Inc	Morgan Stanley	1,020
(7,421)	Eldorado Resorts Inc	Goldman Sachs	(20,435)
13,265	Electronic Arts Inc	Bank of America Merrill Lynch	17,848
324	Electronic Arts Inc	Morgan Stanley	(159)
1,468	Electronic Arts Inc	Goldman Sachs	2,319
739	Electronics For Imaging Inc	Bank of America Merrill Lynch	429
2,958	Electronics For Imaging Inc	Goldman Sachs	1,716
(33,090)	Electronics For Imaging Inc	Morgan Stanley	7,942
3,195	Elevate Credit Inc	Goldman Sachs	(3,131)
(15,296)	elf Beauty Inc	Bank of America Merrill Lynch	15,143
2,790	elf Beauty Inc	Morgan Stanley	(2,874)
1,176	Eli Lilly & Co	Goldman Sachs	2,564
1,354	Eli Lilly & Co	Bank of America Merrill Lynch	2,952
(54,783)	Ellie Mae Inc	Bank of America Merrill Lynch	(342,394)
(17,241)	Ellie Mae Inc	Morgan Stanley	(201,773)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(40,004)	Ellington Residential Mortgage (Reit)	Morgan Stanley	(12,401)
(189,537)	Ellington Residential Mortgage (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(77,710)
(1,500)	Ellington Residential Mortgage (Reit)	Goldman Sachs	(615)
(12,367)	Embraer SA ADR	Goldman Sachs	11,920
2,054	EMCOR Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,108
(334)	EMCOR Group Inc	Morgan Stanley	239
(6,347)	EMCORE Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3,174)
(29,421)	Emergent BioSolutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	(55,505)
150,483	Emergent Capital Inc	Morgan Stanley	(9,330)
74,445	Emergent Capital Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,360)
(54,928)	Emerson Electric Co	Bank of America Merrill Lynch	22,294
(9,542)	Emerson Electric Co	Morgan Stanley	180
2,501	Empire State Realty Trust Inc 'A' (Reit)	Morgan Stanley	371
(98,276)	Empire State Realty Trust Inc 'A' (Reit)	Morgan Stanley	(80,095)
72,223	Employers Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	32,500
5,912	Employers Holdings Inc	Goldman Sachs	1,892
5,702	Employers Holdings Inc	Morgan Stanley	(3,261)
(125,125)	Empresas ICA SAB de CV ADR	Morgan Stanley	1,251
13,739	Enanta Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(53,033)
699	Enanta Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(2,698)
(2,382)	Enbridge Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,812
887	Encompass Health Corp	Goldman Sachs	1,567
887	Encompass Health Corp	Morgan Stanley	1,286
3,947	Endo International Plc	Bank of America Merrill Lynch	579
(50,302)	Endo International Plc	Goldman Sachs	(9,306)
(26,174)	Endocyte Inc	Morgan Stanley	3,141
(115,867)	Endocyte Inc	Bank of America Merrill Lynch	(251,431)
(3,191)	Enel Americas SA ADR	Morgan Stanley	1,693
(24,556)	Enel Americas SA ADR	Goldman Sachs	15,716
(6,587)	Energen Corp	Bank of America Merrill Lynch	(10,869)
(13,246)	Energizer Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(67,785)
(47,589)	Energizer Holdings Inc	Morgan Stanley	(109,931)
(124,743)	Energy Recovery Inc	Morgan Stanley	98,547
4,598	Energy XXI Gulf Coast Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,839)
4,532	Energy XXI Gulf Coast Inc	Goldman Sachs	(1,813)
(38,455)	EnerSys	Morgan Stanley	(21,919)
5,396	EnerSys	Bank of America Merrill Lynch	36,315
(14,971)	EnerSys	Bank of America Merrill Lynch	(100,755)
111,817	Enova International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(128,590)
19,959	Enova International Inc	Goldman Sachs	(22,953)
34,392	Enova International Inc	Morgan Stanley	(46,429)
2,990	EnPro Industries Inc	Morgan Stanley	1,475
(38,492)	Ensco Plc 'A'	Morgan Stanley	30,409
(42,479)	Ensco Plc 'A'	Goldman Sachs	20,815
6,189	Ensign Group Inc/The	Morgan Stanley	10,893

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
12,075	Ensign Group Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	39,168
4,563	Ensign Group Inc/The	Goldman Sachs	16,199
(14,269)	Enstar Group Ltd	Morgan Stanley	116,115
(18,092)	Enstar Group Ltd	Goldman Sachs	91,365
120,547	Entegris Inc	Bank of America Merrill Lynch	(18,082)
(26,310)	Entegris Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,947
(57,858)	Entergy Corp	Bank of America Merrill Lynch	(97,834)
(47,498)	Enterprise Financial Services Corp	Bank of America Merrill Lynch	(54,623)
6,516	Entravision Communications Corp 'A'	Goldman Sachs	-
491,662	Entravision Communications Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	-
4,215	Envestnet Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,464)
1,325	Envestnet Inc	Goldman Sachs	(227)
(7,725)	Envision Healthcare Corp	Morgan Stanley	(1,777)
951	Envision Healthcare Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,255
1,054	Envision Healthcare Corp	Morgan Stanley	242
17,953	Enzo Biochem Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,052)
(18,291)	EOG Resources Inc	Morgan Stanley	79,200
84,971	EP Energy Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(5,098)
(620)	EPAM Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	298
11,657	EPAM Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,595)
3,782	EPAM Systems Inc	Goldman Sachs	(1,815)
(6,719)	Epizyme Inc	Goldman Sachs	(13,774)
(11,950)	ePlus Inc	Morgan Stanley	(20,315)
(44,785)	EPR Properties (Reit)	Morgan Stanley	(44,259)
2,573	EQT Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,058)
733	EQT Corp	Goldman Sachs	(586)
332	EQT Corp	Morgan Stanley	(365)
(17,162)	EQT Corp	Morgan Stanley	5,008
(19,205)	Equifax Inc	Bank of America Merrill Lynch	(31,496)
(2,302)	Equinix Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(24,862)
(2,950)	Equinix Inc (Reit)	Morgan Stanley	(38,391)
(461,246)	Equity Commonwealth (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(199,501)
(186,691)	Equity Commonwealth (Reit)	Morgan Stanley	(231,390)
24,535	Equity LifeStyle Properties Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	58,148
3,532	Equity LifeStyle Properties Inc (Reit)	Goldman Sachs	8,371
728	Equity Residential (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	1,561
18,071	Equity Residential (Reit)	Morgan Stanley	52,732
4,286	Erie Indemnity Co 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,329)
2,670	Erie Indemnity Co 'A'	Goldman Sachs	(828)
1,950	Erie Indemnity Co 'A'	Morgan Stanley	(3,413)
13,471	Eros International Plc	Bank of America Merrill Lynch	18,859
76,056	ESCO Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	87,464
(6,115)	Esperion Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	19,996
(11,389)	Esperion Therapeutics Inc	Morgan Stanley	22,892
63,070	Essendant Inc	Bank of America Merrill Lynch	208,762

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
183,703	Essent Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(141,451)
19,072	Essent Group Ltd	Morgan Stanley	(6,855)
4,732	Essex Property Trust Inc (Reit)	Morgan Stanley	31,285
(3,462)	Essex Property Trust Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(19,076)
10,499	Estee Lauder Cos Inc/The 'A'	Bank of America Merrill Lynch	86,407
29,605	Etsy Inc	Bank of America Merrill Lynch	79,601
2,725	Etsy Inc	Morgan Stanley	7,685
(1,177)	Etsy Inc	Morgan Stanley	(213)
5,832	Etsy Inc	Goldman Sachs	13,792
(16,173)	Euronet Worldwide Inc	Morgan Stanley	(4,043)
12,864	Euronet Worldwide Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,672)
(35,323)	Everbridge Inc	Bank of America Merrill Lynch	(141,645)
(29,530)	Evercore Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	92,304
(36,977)	Evercore Inc 'A'	Morgan Stanley	221,862
1,265	Evercore Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(3,542)
3,460	Everest Re Group Ltd	Morgan Stanley	(13,030)
(2,693)	Everest Re Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	8,618
651	Everest Re Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(549)
9,940	Eversource Energy	Bank of America Merrill Lynch	1,851
9,727	EVERTEC Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,345
14,175	EVERTEC Inc	Morgan Stanley	4,825
19,382	Evolution Petroleum Corp	Bank of America Merrill Lynch	7,753
19,504	Evolution Petroleum Corp	Goldman Sachs	6,789
97,019	Evolution Petroleum Corp	Morgan Stanley	14,553
10,412	EW Scripps Co/The 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,562)
2,394	EW Scripps Co/The 'A'	Goldman Sachs	(359)
79,403	EW Scripps Co/The 'A'	Morgan Stanley	(60,346)
(12,082)	Exact Sciences Corp	Bank of America Merrill Lynch	(128,069)
984	Exact Sciences Corp	Bank of America Merrill Lynch	9,048
(34,123)	Exantas Capital Corp	Bank of America Merrill Lynch	(14,673)
(3,544)	Exantas Capital Corp	Goldman Sachs	(1,524)
(57,369)	Exantas Capital Corp	Morgan Stanley	(18,932)
6,486	Exelixis Inc	Goldman Sachs	1,394
31,886	Exelixis Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,228
(91,046)	Exelon Corp	Bank of America Merrill Lynch	(83,307)
(77,784)	Exelon Corp	Morgan Stanley	(48,197)
(1,611)	Expedia Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,571)
14,790	Expeditors International of Washington Inc	Bank of America Merrill Lynch	51,321
907	Expeditors International of Washington Inc	Morgan Stanley	1,986
(47,579)	Expeditors International of Washington Inc	Morgan Stanley	(102,950)
(5,130)	Exponent Inc	Morgan Stanley	(12,262)
111,031	Extended Stay America Inc (Unit)	Bank of America Merrill Lynch	146,561
23,024	Extended Stay America Inc (Unit)	Morgan Stanley	24,866
30,622	Exterran Corp	Bank of America Merrill Lynch	(29,091)
24,562	Exterran Corp	Goldman Sachs	(23,334)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
25,423	Exterran Corp	Morgan Stanley	(15,762)
(17,288)	Extra Space Storage Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(60,685)
38,239	Extraction Oil & Gas Inc	Bank of America Merrill Lynch	104,775
6,305	Extraction Oil & Gas Inc	Morgan Stanley	4,414
12,268	Extraction Oil & Gas Inc	Goldman Sachs	33,614
(35,986)	Exxon Mobil Corp	Bank of America Merrill Lynch	37,425
(129,860)	Exxon Mobil Corp	Morgan Stanley	(197,176)
34,935	EZCORP Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(20,961)
4,580	EZCORP Inc 'A'	Goldman Sachs	(2,748)
19,016	EZCORP Inc 'A'	Morgan Stanley	(14,262)
(544)	F5 Networks Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,295)
(9,432)	F5 Networks Inc	Morgan Stanley	(1,814)
(9,360)	Fabrinet	Morgan Stanley	1,706
4,792	Facebook Inc 'A'	Goldman Sachs	23,241
2,878	Facebook Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	13,958
(18,848)	Facebook Inc 'A'	Morgan Stanley	(101,214)
7,220	FactSet Research Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	41,443
3,066	FactSet Research Systems Inc	Morgan Stanley	25,207
379	FactSet Research Systems Inc	Goldman Sachs	2,175
396	Fair Isaac Corp	Goldman Sachs	3,057
6,218	Fair Isaac Corp	Bank of America Merrill Lynch	48,003
2,528	Fair Isaac Corp	Morgan Stanley	38,901
(142,349)	Fairmount Santrol Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	74,021
(18,978)	Fairmount Santrol Holdings Inc	Morgan Stanley	7,212
(78,087)	Farmer Brothers Co	Bank of America Merrill Lynch	(429,479)
(61,013)	Fastenal Co	Bank of America Merrill Lynch	8,542
(73,624)	Fastenal Co	Morgan Stanley	25,032
5,583	FBL Financial Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	16,749
1,544	FBL Financial Group Inc 'A'	Goldman Sachs	4,632
17	FBL Financial Group Inc 'A'	Morgan Stanley	22
49,156	FCB Financial Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	25,649
2,910	Federal Agricultural Mortgage Corp 'C'	Morgan Stanley	728
3,787	Federal Agricultural Mortgage Corp 'C'	Goldman Sachs	11,134
9,372	Federal Agricultural Mortgage Corp 'C'	Bank of America Merrill Lynch	27,554
2,617	Federal Realty Investment Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	9,096
20,622	Federal Realty Investment Trust (Reit)	Morgan Stanley	44,750
(17,941)	Federal Realty Investment Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(65,843)
(14,644)	Federal Signal Corp	Bank of America Merrill Lynch	(9,226)
289	FedEx Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,541
16,235	FedEx Corp	Morgan Stanley	42,330
(1,852)	FedEx Corp	Bank of America Merrill Lynch	(9,908)
(1,154)	Fennec Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(1,419)
8,404	Ferrari NV	Morgan Stanley	(20,674)
4,720	Ferro Corp	Morgan Stanley	(2,320)
11,885	Ferroglobe Plc	Morgan Stanley	(15,926)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
3,289	Ferroglobe Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1,749)
(38,788)	Fiat Chrysler Automobiles NV	Morgan Stanley	-
(69,438)	Fibria Celulose SA ADR	Goldman Sachs	32,736
(24,493)	Fibria Celulose SA ADR	Morgan Stanley	8,083
(8,328)	FibroGen Inc	Bank of America Merrill Lynch	(21,265)
75,784	Fidelity National Information Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(112,496)
120,457	Fidelity National Information Services Inc	Morgan Stanley	(63,479)
679	Fidelity National Information Services Inc	Goldman Sachs	(1,202)
(113,693)	Fiesta Restaurant Group Inc	Goldman Sachs	(68,216)
(107,392)	Fiesta Restaurant Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(64,435)
(62,860)	Fifth Third Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	237,611
(66,938)	Finisar Corp	Morgan Stanley	(31,631)
(790)	FireEye Inc	Bank of America Merrill Lynch	837
(2,847)	FireEye Inc	Goldman Sachs	3,018
17,954	First American Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(180)
390	First American Financial Corp	Goldman Sachs	(115)
51,328	First American Financial Corp	Morgan Stanley	(36,358)
(38,551)	First BanCorp/Puerto Rico	Morgan Stanley	6,034
3,308	First Bancorp/Southern Pines NC	Bank of America Merrill Lynch	4,300
904	First Bancorp/Southern Pines NC	Morgan Stanley	271
3,177	First Bank/Hamilton NJ	Bank of America Merrill Lynch	489
3,119	First Bank/Hamilton NJ	Morgan Stanley	281
(1,834)	First Business Financial Services Inc	Goldman Sachs	(459)
(16,622)	First Business Financial Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,156)
(12,554)	First Business Financial Services Inc	Morgan Stanley	628
(2,715)	First Citizens BancShares Inc/NC 'A'	Bank of America Merrill Lynch	26,390
(1,679)	First Citizens BancShares Inc/NC 'A'	Morgan Stanley	7,135
129,120	First Connecticut Bancorp Inc/Farmington CT	Bank of America Merrill Lynch	38,736
6,645	First Connecticut Bancorp Inc/Farmington CT	Goldman Sachs	1,994
27,341	First Connecticut Bancorp Inc/Farmington CT	Morgan Stanley	(8,202)
145,783	First Data Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(86,012)
142,694	First Defiance Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	319,635
7,642	First Defiance Financial Corp	Morgan Stanley	1,146
3,882	First Financial Corp/IN	Bank of America Merrill Lynch	2,954
1,431	First Financial Corp/IN	Morgan Stanley	356
474	First Financial Corp/IN	Goldman Sachs	(126)
92,509	First Financial Northwest Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11,697)
24,596	First Financial Northwest Inc	Goldman Sachs	(3,443)
30,279	First Financial Northwest Inc	Morgan Stanley	(1,211)
(169)	First Guaranty Bancshares Inc	Morgan Stanley	30
166,438	First Hawaiian Inc	Bank of America Merrill Lynch	137,805
5,590	First Hawaiian Inc	Morgan Stanley	2,571
3,475	First Hawaiian Inc	Goldman Sachs	3,301
141,468	First Horizon National Corp	Bank of America Merrill Lynch	(87,710)
9,484	First Horizon National Corp	Morgan Stanley	(9,294)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
13,748	First Horizon National Corp	Goldman Sachs	(8,524)
5,837	First Industrial Realty Trust Inc (Reit)	Morgan Stanley	6,888
90,679	First Industrial Realty Trust Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	124,230
9,824	First Industrial Realty Trust Inc (Reit)	Goldman Sachs	13,459
(1,684)	First Internet Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	(4,968)
119,635	First Majestic Silver Corp	Morgan Stanley	(13,911)
16,393	First Majestic Silver Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,951
(30,327)	First Mid-Illinois Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	(23,130)
(967)	First Mid-Illinois Bancshares Inc	Goldman Sachs	(754)
(3,696)	First Mid-Illinois Bancshares Inc	Morgan Stanley	(2,513)
(55,718)	First Midwest Bancorp Inc/IL	Bank of America Merrill Lynch	(56,832)
(73,580)	First Midwest Bancorp Inc/IL	Morgan Stanley	9,565
47,907	First Republic Bank/CA	Bank of America Merrill Lynch	74,735
(562)	First Republic Bank/CA	Morgan Stanley	312
(12,947)	First Solar Inc	Bank of America Merrill Lynch	53,860
20,486	FirstCash Inc	Morgan Stanley	(33,547)
(201,317)	FirstEnergy Corp	Bank of America Merrill Lynch	(128,843)
(28,089)	FirstEnergy Corp	Morgan Stanley	(19,943)
(32,266)	Fiserv Inc	Bank of America Merrill Lynch	(16,778)
299,533	Fitbit Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	68,893
176,816	Fitbit Inc 'A'	Goldman Sachs	40,668
30,668	Fitbit Inc 'A'	Morgan Stanley	7,974
(5,431)	Five Below Inc	Bank of America Merrill Lynch	15,370
3,476	Five Below Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,962)
78,828	Five Below Inc	Morgan Stanley	(147,960)
(1,648)	Five Point Holdings LLC 'A'	Bank of America Merrill Lynch	2,159
(5,248)	Five Point Holdings LLC 'A'	Morgan Stanley	3,201
(1,235)	Five Point Holdings LLC 'A'	Goldman Sachs	1,618
31,456	Five Prime Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	12,582
1,743	Five9 Inc	Bank of America Merrill Lynch	7,443
17,111	Five9 Inc	Morgan Stanley	30,629
(9,155)	FleetCor Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9,320)
(21,984)	FleetCor Technologies Inc	Morgan Stanley	(23,812)
5,656	Flex Ltd	Bank of America Merrill Lynch	152
(5,914)	FLIR Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,909
6,286	FLIR Systems Inc	Morgan Stanley	417
25,047	Flowers Foods Inc	Morgan Stanley	20,495
(109,386)	Flowserve Corp	Bank of America Merrill Lynch	205,646
(119,818)	Flowserve Corp	Morgan Stanley	353,463
(109,573)	FNB Corp/PA	Bank of America Merrill Lynch	31,776
(29,417)	FNF Group	Morgan Stanley	16,179
3,329	FNF Group	Goldman Sachs	(1,565)
5,871	FNF Group	Morgan Stanley	(3,229)
18,552	Fomento Economico Mexicano SAB de CV ADR	Morgan Stanley	(52,472)
995	Fomento Economico Mexicano SAB de CV ADR	Goldman Sachs	(1,831)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(15,393)	FONAR Corp	Bank of America Merrill Lynch	(5,388)
(8,401)	FONAR Corp	Goldman Sachs	(2,940)
(11,665)	Foot Locker Inc	Bank of America Merrill Lynch	(119,995)
(23,911)	Foot Locker Inc	Morgan Stanley	(1,999)
(88,980)	Ford Motor Co	Bank of America Merrill Lynch	(32,923)
(236,605)	Ford Motor Co	Morgan Stanley	(16,562)
1,007	ForeScout Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(342)
863	ForeScout Technologies Inc	Morgan Stanley	78
89,622	Forest City Realty Trust Inc 'A' (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	53,773
8,384	Forest City Realty Trust Inc 'A' (Reit)	Morgan Stanley	(1,408)
(89,237)	FormFactor Inc	Bank of America Merrill Lynch	(66,928)
(12,676)	FormFactor Inc	Morgan Stanley	(2,903)
25,746	Forrester Research Inc	Bank of America Merrill Lynch	28,321
2,911	Forrester Research Inc	Morgan Stanley	2,474
(19,725)	Forterra Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,156
(5,257)	Fortinet Inc	Morgan Stanley	(15,666)
2,937	Fortive Corp	Bank of America Merrill Lynch	(7,754)
6,020	Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC	Morgan Stanley	4,515
14,090	Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC	Bank of America Merrill Lynch	4,509
1,945	Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC	Goldman Sachs	622
125,041	Fortune Brands Home & Security Inc	Bank of America Merrill Lynch	134,820
8,236	Fortune Brands Home & Security Inc	Goldman Sachs	9,142
94,367	Fortune Brands Home & Security Inc	Morgan Stanley	14,155
(4,951)	Forum Energy Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	5,416
(23,463)	Forum Energy Technologies Inc	Morgan Stanley	21,117
(4,072)	Forward Air Corp	Morgan Stanley	(56)
(5,330)	Fossil Group Inc	Morgan Stanley	(2,654)
1,122	Foundation Building Materials Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,380
3,570	Foundation Building Materials Inc	Goldman Sachs	4,391
(920)	Foundation Medicine Inc	Morgan Stanley	(12,972)
(945)	Foundation Medicine Inc	Goldman Sachs	(20,365)
(4,036)	Foundation Medicine Inc	Bank of America Merrill Lynch	(60,545)
94,812	Four Corners Property Trust Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	74,901
13,594	Four Corners Property Trust Inc (Reit)	Goldman Sachs	10,739
3,638	Four Corners Property Trust Inc (Reit)	Morgan Stanley	1,928
48,035	Fox Factory Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	146,507
4,379	Fox Factory Holding Corp	Goldman Sachs	13,356
48,127	Fox Factory Holding Corp	Morgan Stanley	62,565
(61,140)	Francesca's Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(6,588)
(32,951)	Frank's International NV	Morgan Stanley	(989)
(7,722)	Franklin Electric Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(15,830)
1,427	Franklin Resources Inc	Morgan Stanley	(1,456)
80,301	Franklin Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,833)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(53,519)	Fred's Inc 'A'	Morgan Stanley	4,817
(17,751)	Fred's Inc 'A'	Goldman Sachs	3,461
(38,869)	Freeport-McMoRan Inc	Bank of America Merrill Lynch	(50,918)
(54,114)	FreightCar America Inc	Bank of America Merrill Lynch	(99,029)
2,650	Fresh Del Monte Produce Inc	Morgan Stanley	(722)
(2,641)	Fresh Del Monte Produce Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,912
10,188	Freshpet Inc	Bank of America Merrill Lynch	23,432
912	Freshpet Inc	Goldman Sachs	2,098
(87,876)	Front Yard Residential Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(75,573)
5,333	Frontier Communications Corp	Bank of America Merrill Lynch	(9,333)
(736)	FRP Holdings Inc	Goldman Sachs	(478)
(25,468)	FRP Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(16,554)
10,074	FS Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,687)
1,866	FS Bancorp Inc	Goldman Sachs	455
515	FS Bancorp Inc	Morgan Stanley	(283)
(9,281)	FTI Consulting Inc	Morgan Stanley	(16,978)
44,379	FTS International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,213)
22,652	FTS International Inc	Goldman Sachs	(3,171)
21,491	Fulton Financial Corp	Morgan Stanley	(5,373)
(109,176)	Fulton Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(26,706)
2,106	Funko Inc	Bank of America Merrill Lynch	779
(44,115)	Fusion Connect Inc	Morgan Stanley	17,205
5,529	G-III Apparel Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	23,266
12,621	G-III Apparel Group Ltd	Morgan Stanley	49,348
(19,137)	G-III Apparel Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(83,437)
(3,368)	Gafisa SA ADR	Goldman Sachs	674
(11,535)	Gafisa SA ADR	Morgan Stanley	9,805
(71,910)	GAIN Capital Holdings Inc	Morgan Stanley	2,784
(11,670)	GAMCO Investors Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,734
12,071	GameStop Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(3,863)
10,662	GameStop Corp 'A'	Goldman Sachs	(3,412)
(54,569)	GameStop Corp 'A'	Morgan Stanley	(28,376)
26,979	Gaming and Leisure Properties Inc (Reit)	Morgan Stanley	16,633
(3,849)	Gaming and Leisure Properties Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(3,233)
(39,157)	Gannett Co Inc	Morgan Stanley	9,789
(51,967)	Gap Inc/The	Morgan Stanley	116,573
(76,318)	Gap Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	106,003
6,019	Gardner Denver Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,551)
488	Gardner Denver Holdings Inc	Goldman Sachs	(587)
471	Garmin Ltd	Morgan Stanley	24
48,801	Garmin Ltd	Bank of America Merrill Lynch	62,953
4,269	Garmin Ltd	Goldman Sachs	5,507
(29,017)	Gartner Inc	Bank of America Merrill Lynch	39,825
(14,530)	Gartner Inc	Morgan Stanley	(19,439)
10,325	GasLog Ltd	Bank of America Merrill Lynch	762

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(143,745)	GasLog Ltd	Morgan Stanley	7,187
22,089	GasLog Ltd	Morgan Stanley	(5,511)
147,146	Gates Industrial Corp Plc	Bank of America Merrill Lynch	5,886
7,668	Gates Industrial Corp Plc	Goldman Sachs	307
2,833	Gates Industrial Corp Plc	Morgan Stanley	(1,983)
29,069	GATX Corp	Morgan Stanley	(26,113)
(4,670)	GATX Corp	Goldman Sachs	8,325
5,073	GATX Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,486)
1,621	Gatx Corp	Goldman Sachs	(794)
(14,968)	GCI Liberty Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	22,602
3,264	GCI Liberty Inc 'A'	Morgan Stanley	(2,028)
(22,374)	Genco Shipping & Trading Ltd	Goldman Sachs	(14,767)
22,293	Gencor Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,476
7,798	Gencor Industries Inc	Goldman Sachs	1,950
10,604	Gencor Industries Inc	Morgan Stanley	1,260
4,842	Generac Holdings Inc	Morgan Stanley	1,876
18,106	Generac Holdings Inc	Goldman Sachs	34,220
99,816	Generac Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	186,643
(100,934)	General Electric Co	Bank of America Merrill Lynch	66,112
(91,953)	General Electric Co	Morgan Stanley	113,562
(3,397)	General Mills Inc	Goldman Sachs	611
(50,355)	General Mills Inc	Bank of America Merrill Lynch	9,064
(4,438)	General Motors Co	Bank of America Merrill Lynch	(22,767)
5,216	General Motors Co	Morgan Stanley	19,769
(57,776)	Genesco Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,158)
(43,521)	Genesee & Wyoming Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(71,810)
(82,497)	Genesee & Wyoming Inc 'A'	Morgan Stanley	(660,667)
(107,316)	Genie Energy Ltd 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(66,536)
(16,163)	Genie Energy Ltd 'B'	Morgan Stanley	(8,243)
1,586	Genomic Health Inc	Morgan Stanley	2,783
37,322	Genomic Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	59,398
1,459	Genomic Health Inc	Goldman Sachs	3,071
(65,835)	Genpact Ltd	Bank of America Merrill Lynch	9,875
(233,871)	Gentex Corp	Bank of America Merrill Lynch	(54,438)
(290,550)	Gentex Corp	Morgan Stanley	(131,619)
(129,483)	Gentherm Inc	Bank of America Merrill Lynch	(79,973)
(63,754)	Gentherm Inc	Morgan Stanley	(74,526)
4,947	Genuine Parts Co	Bank of America Merrill Lynch	(4,947)
(2,952)	Genuine Parts Co	Morgan Stanley	1,477
(40,459)	GEO Group Inc/The (Reit)	Morgan Stanley	(36,653)
36,016	GEO Group Inc/The (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	66,990
2,317	GEO Group Inc/The (Reit)	Morgan Stanley	2,294
10,763	GEO Group Inc/The (Reit)	Goldman Sachs	20,019
1,818	Geospace Technologies Corp	Bank of America Merrill Lynch	(131)
(21,185)	Gerdau SA ADR	Goldman Sachs	17,584

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(87,425)	Gerdau SA ADR	Morgan Stanley	9,097
(20,186)	Gibraltar Industries Inc	Morgan Stanley	(33,307)
61,247	Gilead Sciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	46,152
810	Gilead Sciences Inc	Goldman Sachs	536
552	Gilead Sciences Inc	Morgan Stanley	316
109,847	Glacier Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	29,659
60,088	Gladstone Land Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(8,412)
22,959	Gladstone Land Corp (Reit)	Morgan Stanley	6,199
14,163	Gladstone Land Corp (Reit)	Goldman Sachs	(1,983)
(3,802)	Global Blood Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,182
(7,662)	Global Eagle Entertainment Inc	Goldman Sachs	(10,493)
(287,539)	Global Eagle Entertainment Inc	Morgan Stanley	(77,636)
(99)	Global Indemnity Ltd	Bank of America Merrill Lynch	222
(63,407)	Global Indemnity Ltd	Morgan Stanley	159,152
(40,340)	Global Medical REIT Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(10,085)
(700)	Global Medical REIT Inc (Reit)	Goldman Sachs	(175)
(37,155)	Global Payments Inc	Bank of America Merrill Lynch	87,783
3,086	Global Water Resources Inc	Goldman Sachs	432
6,226	Global Water Resources Inc	Morgan Stanley	249
14,405	Global Water Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,017
151	Globant SA	Bank of America Merrill Lynch	261
50,164	Globant SA	Morgan Stanley	109,859
3,888	Globus Medical Inc 'A'	Goldman Sachs	24,144
2,305	Globus Medical Inc 'A'	Morgan Stanley	7,699
818	Globus Medical Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	5,080
38,833	GNC Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	(11,262)
4,422	GNC Holdings Inc 'A'	Morgan Stanley	(619)
37,485	GNC Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(10,871)
8,915	GoDaddy Inc 'A'	Morgan Stanley	17,384
5,523	GoDaddy Inc 'A'	Goldman Sachs	19,054
60,057	GoDaddy Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	207,060
2,713	Golar LNG Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(11,774)
80,241	Golar LNG Ltd	Morgan Stanley	(414,044)
15,256	Gold Resource Corp	Morgan Stanley	9,611
5,592	Gold Resource Corp	Bank of America Merrill Lynch	5,089
3,354	Gold Resource Corp	Goldman Sachs	3,052
(17,249)	Golden Entertainment Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,037)
(2,021)	Golden Entertainment Inc	Goldman Sachs	(707)
12,553	Goldman Sachs Group Inc/The	Morgan Stanley	(151,967)
(791)	Goldman Sachs Group Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	12,094
(21,908)	Goodyear Tire & Rubber Co/The	Bank of America Merrill Lynch	28,480
(64,082)	Goodyear Tire & Rubber Co/The	Morgan Stanley	80,743
6,573	GoPro Inc 'A'	Morgan Stanley	2,103
200,234	GoPro Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(14,016)
58,451	GoPro Inc 'A'	Goldman Sachs	(4,092)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(41,059)	Government Properties Income Trust (Reit)	Morgan Stanley	(20,998)
(10,447)	GP Strategies Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4,179)
24,722	Graco Inc	Bank of America Merrill Lynch	11,619
(18,349)	GrafTech International Ltd	Bank of America Merrill Lynch	12,929
(62,437)	Graham Corp	Bank of America Merrill Lynch	(139,274)
241	Graham Holdings Co ' B '	Bank of America Merrill Lynch	(2,440)
543	Graham Holdings Co ' B '	Morgan Stanley	(3,102)
20,859	Grana y Montero SAA ADR	Goldman Sachs	(7,926)
(11,521)	Grand Canyon Education Inc	Bank of America Merrill Lynch	(28,342)
9,677	Grand Canyon Education Inc	Bank of America Merrill Lynch	2
(210,858)	Graphic Packaging Holding Co	Morgan Stanley	61,149
(160,579)	Graphic Packaging Holding Co	Bank of America Merrill Lynch	(110,800)
24,809	Gray Television Inc	Bank of America Merrill Lynch	(22,634)
51,190	Gray Television Inc	Morgan Stanley	(57,589)
(470,915)	Great Lakes Dredge & Dock Corp	Bank of America Merrill Lynch	-
(107,753)	Great Plains Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(162,707)
1,305	Great Plains Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,357
41,619	Great Plains Energy Inc	Morgan Stanley	72,105
2,140	Great Western Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,397
53,269	Great Western Bancorp Inc	Morgan Stanley	1,065
(33,770)	Great Western Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,538)
(14,004)	Green Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	14,004
(17,124)	Green Brick Partners Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,715)
80,426	Green Dot Corp ' A '	Bank of America Merrill Lynch	23,324
9,526	Green Dot Corp ' A '	Morgan Stanley	17,433
16,618	Green Dot Corp ' A '	Goldman Sachs	4,819
(161,748)	Green Plains Inc	Bank of America Merrill Lynch	(258,563)
5,207	Green Plains Partners LP	Morgan Stanley	1,041
57,877	Green Plains Partners LP	Bank of America Merrill Lynch	46,302
32,393	Greenbrier Cos Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	85,841
47,250	Greenbrier Cos Inc/The	Morgan Stanley	(28,350)
(69,003)	Greenhill & Co Inc	Morgan Stanley	(65,300)
197,169	Greenlight Capital Re Ltd ' A '	Bank of America Merrill Lynch	(195,347)
15,041	Greenlight Capital Re Ltd ' A '	Morgan Stanley	(16,545)
(5,017)	Greif Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10,025)
(784)	Griffon Corp	Bank of America Merrill Lynch	(627)
8,736	Group 1 Automotive Inc	Morgan Stanley	(3,900)
(54,401)	Groupon Inc	Bank of America Merrill Lynch	5,168
(53,275)	Groupon Inc	Morgan Stanley	(8,258)
(69,968)	Groupon Inc	Goldman Sachs	6,647
5,178	GrubHub Inc	Bank of America Merrill Lynch	29,349
256	GrubHub Inc	Goldman Sachs	1,188
29,692	Grupo Aeroportuario del Centro Norte SAB de CV ADR	Goldman Sachs	(64,432)
16,034	Grupo Aeroportuario del Centro Norte SAB de CV ADR	Morgan Stanley	(29,558)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(10,812)	Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV ADR	Goldman Sachs	96,033
(107)	Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV ADR	Morgan Stanley	397
(62,242)	Grupo Televisa SAB ADR	Morgan Stanley	272,341
(39,257)	Grupo Televisa SAB ADR	Goldman Sachs	51,427
(51,803)	GTT Communications Inc	Bank of America Merrill Lynch	183,901
737	GTT Communications Inc	Bank of America Merrill Lynch	(198)
3,795	Guess? Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11,423)
603	Guidewire Software Inc	Goldman Sachs	1,556
(105,992)	Gulf Island Fabrication Inc	Goldman Sachs	(47,696)
(11,154)	Gulf Island Fabrication Inc	Morgan Stanley	-
11,880	Gulfport Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	3,208
11,622	H&E Equipment Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(30,217)
9,686	H&E Equipment Services Inc	Morgan Stanley	(27,896)
773	H&E Equipment Services Inc	Goldman Sachs	(2,010)
3,950	H&R Block Inc	Goldman Sachs	553
73,991	H&R Block Inc	Bank of America Merrill Lynch	10,020
137,406	H&R Block Inc	Morgan Stanley	36,275
94,603	Hackett Group Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	17,975
(4,200)	Haemonetics Corp	Bank of America Merrill Lynch	(15,708)
29,849	Hain Celestial Group Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	(21,491)
106,761	Hain Celestial Group Inc/The	Morgan Stanley	5,338
(85,194)	Halcon Resources Corp	Morgan Stanley	33,226
15,470	Halliburton Co	Bank of America Merrill Lynch	(40,569)
56,185	Halliburton Co	Morgan Stanley	(131,263)
121,040	Hallmark Financial Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,052)
30,306	Hallmark Financial Services Inc	Morgan Stanley	-
25,842	Halozyne Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(21,449)
(60,569)	Halyard Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	(119,321)
(9,650)	Halyard Health Inc	Morgan Stanley	(9,361)
(35,757)	Hamilton Beach Brands Holding Co 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(54,552)
(31,383)	Hamilton Lane Inc 'A'	Morgan Stanley	(3,307)
(246,792)	Hancock Holding Co	Bank of America Merrill Lynch	184,196
(24,513)	Hanesbrands Inc	Morgan Stanley	(5,148)
(71,317)	Hanesbrands Inc	Goldman Sachs	(83,441)
53,205	Hanesbrands Inc	Morgan Stanley	11,173
1,062	Hanmi Financial Corp	Goldman Sachs	2,177
19,348	Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital Inc (Reit)	Morgan Stanley	-
25,590	Hanover Insurance Group Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	54,605
26,582	Hanover Insurance Group Inc/The	Morgan Stanley	48,820
5,503	Hanover Insurance Group Inc/The	Goldman Sachs	14,473
(16,149)	Harley-Davidson Inc	Goldman Sachs	(3,391)
4,067	Harris Corp	Bank of America Merrill Lynch	(14,194)
10,022	Harris Corp	Morgan Stanley	6,615

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
1,379	Harris Corp	Goldman Sachs	(4,813)
(34,677)	Harsco Corp	Bank of America Merrill Lynch	(10,780)
17,373	Harte-Hanks Inc	Morgan Stanley	(3,127)
56,436	Hartford Financial Services Group Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	(5,644)
18,915	Hartford Financial Services Group Inc/The	Morgan Stanley	(21,185)
8,451	Hartford Financial Services Group Inc/The	Goldman Sachs	(845)
141,393	Harvard Bioscience Inc	Bank of America Merrill Lynch	(70,697)
21,049	Harvard Bioscience Inc	Goldman Sachs	(10,525)
27,728	Harvard Bioscience Inc	Morgan Stanley	(4,159)
(52,252)	Hasbro Inc	Morgan Stanley	20,283
(7,011)	Hasbro Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,006
(50,610)	Hawaiian Electric Industries Inc	Morgan Stanley	19,447
(221,763)	Hawaiian Electric Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(139,711)
12,402	Hawaiian Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,721
6,472	Hawaiian Holdings Inc	Morgan Stanley	7,564
(39,744)	Haynes International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(124,399)
34,264	HB Fuller Co	Bank of America Merrill Lynch	29,124
17,967	HB Fuller Co	Morgan Stanley	20,268
(16,041)	HCA Healthcare Inc	Bank of America Merrill Lynch	(54,058)
(40,646)	HCA Healthcare Inc	Morgan Stanley	(236,765)
(112,707)	HCP Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(51,845)
300,735	HD Supply Holdings Inc	Morgan Stanley	362,376
39,543	HD Supply Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,523
7,476	HD Supply Holdings Inc	Goldman Sachs	1,518
(1,575)	Health Insurance Innovations Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(4,489)
(20,062)	Health Insurance Innovations Inc 'A'	Morgan Stanley	14,043
(12,911)	Health Insurance Innovations Inc 'A'	Goldman Sachs	(26,375)
(112,373)	Healthcare Realty Trust Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(80,909)
3,216	Healthcare Services Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	116
13,170	Healthcare Services Group Inc	Morgan Stanley	2,847
(157,685)	Healthcare Services Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	96,255
(19,273)	Healthcare Trust of America Inc 'A' (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(5,011)
(22,312)	HealthEquity Inc	Bank of America Merrill Lynch	(129,543)
496	HealthEquity Inc	Morgan Stanley	(340)
(959)	Heartland Express Inc	Morgan Stanley	(249)
(12,046)	Heartland Express Inc	Goldman Sachs	(12,528)
(65,158)	Heartland Express Inc	Bank of America Merrill Lynch	(67,764)
401,041	Hecla Mining Co	Morgan Stanley	(20,052)
59,022	Hecla Mining Co	Bank of America Merrill Lynch	(1,771)
9,872	HEICO Corp	Bank of America Merrill Lynch	15,438
49,277	HEICO Corp	Morgan Stanley	144,342
475	HEICO Corp	Goldman Sachs	1,259
2,352	HEICO Corp 'A'	Goldman Sachs	1,627
67,441	HEICO Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	53,383
(45,421)	Heidrick & Struggles International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9,308)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(109,925)	Helix Energy Solutions Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	45,069
(301)	Helmerich & Payne Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,418
(3,119)	Helmerich & Payne Inc	Goldman Sachs	14,690
27,728	Helmerich & Payne Inc	Morgan Stanley	(110,080)
(23,341)	Hemisphere Media Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,002)
(1,469)	Hemisphere Media Group Inc	Goldman Sachs	(441)
1,336	Hennessy Advisors Inc	Morgan Stanley	(788)
24,078	Hennessy Advisors Inc	Bank of America Merrill Lynch	(12,521)
(45,894)	Henry Schein Inc	Morgan Stanley	23,884
(38,634)	Henry Schein Inc	Bank of America Merrill Lynch	29,047
5,324	Herbalife Nutrition Ltd	Morgan Stanley	2,468
4,096	Herc Holdings Inc	Morgan Stanley	(5,322)
13,642	Heritage Commerce Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,183
242,108	Heritage Commerce Corp	Morgan Stanley	(58,106)
(13,873)	Heritage-Crystal Clean Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,939)
(28,604)	Herman Miller Inc	Morgan Stanley	39,450
(12,635)	Herman Miller Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,563)
47,188	Hersha Hospitality Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	86,826
9,334	Hersha Hospitality Trust (Reit)	Goldman Sachs	17,175
11,981	Hersha Hospitality Trust (Reit)	Morgan Stanley	9,106
16,338	Hershey Co/The	Bank of America Merrill Lynch	(28,592)
58,104	Hershey Co/The	Morgan Stanley	(89,751)
6,806	Hertz Global Holdings Inc	Morgan Stanley	(10,209)
(12,197)	Heska Corp	Bank of America Merrill Lynch	(140,509)
(45,690)	Hess Corp	Bank of America Merrill Lynch	135,242
(28,804)	Hess Corp	Morgan Stanley	95,629
17,214	Hewlett Packard Enterprise Co	Bank of America Merrill Lynch	(26,160)
758	Hewlett Packard Enterprise Co	Goldman Sachs	(1,433)
48,411	Hewlett Packard Enterprise Co	Morgan Stanley	(91,981)
6,994	Hexcel Corp	Morgan Stanley	43,879
(726)	Hexcel Corp	Bank of America Merrill Lynch	(506)
(59,962)	HFF Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(98,234)
(11,607)	HFF Inc 'A'	Morgan Stanley	(7,857)
8,038	Hibbett Sports Inc	Goldman Sachs	(10,248)
20,068	Hibbett Sports Inc	Morgan Stanley	(18,061)
28,581	Hibbett Sports Inc	Bank of America Merrill Lynch	(30,630)
127,003	HighPoint Resources Corp	Bank of America Merrill Lynch	114,207
29,250	HighPoint Resources Corp	Goldman Sachs	26,910
13,975	HighPoint Resources Corp	Morgan Stanley	(559)
19,846	Highwoods Properties Inc (Reit)	Goldman Sachs	51,203
1,092	Highwoods Properties Inc (Reit)	Morgan Stanley	1,627
183,571	Highwoods Properties Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	477,095
(171,759)	Hill International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,588)
(41,500)	Hill International Inc	Morgan Stanley	(2,075)
46,863	Hill-Rom Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	235,721

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
49,860	Hill-Rom Holdings Inc	Morgan Stanley	402,145
3,254	Hill-Rom Holdings Inc	Goldman Sachs	16,368
3,328	Hilltop Holdings Inc	Morgan Stanley	732
7,367	Hilton Grand Vacations Inc	Bank of America Merrill Lynch	9,430
593	Hilton Grand Vacations Inc	Goldman Sachs	759
1,140	Hilton Grand Vacations Inc	Morgan Stanley	(34)
(49,520)	Hilton Grand Vacations Inc	Morgan Stanley	181,567
(2,820)	Hilton Worldwide Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,568
(179,274)	HMS Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(168,518)
2,041	HNI Corp	Morgan Stanley	2,713
(14,500)	HollyFrontier Corp	Bank of America Merrill Lynch	(154,570)
1,249	Hollysys Automation Technologies Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(837)
35,723	Hollysys Automation Technologies Ltd	Morgan Stanley	(38,224)
(46,799)	Hologic Inc	Bank of America Merrill Lynch	(21,524)
(62,926)	Hologic Inc	Morgan Stanley	(63,894)
59,366	Home BancShares Inc/AR	Bank of America Merrill Lynch	(21,965)
(5,921)	Home BancShares Inc/AR	Bank of America Merrill Lynch	2,191
5,373	Home BancShares Inc/AR	Goldman Sachs	(1,988)
(12,097)	Home Depot Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	16,573
(54,888)	Home Depot Inc/The	Morgan Stanley	(98,551)
(22,507)	HomeStreet Inc	Bank of America Merrill Lynch	22,326
(22,021)	Homology Medicines Inc	Morgan Stanley	(2,643)
5,490	Honeywell International Inc	Bank of America Merrill Lynch	11,858
4,960	Hope Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	694
4,124	Hope Bancorp Inc	Goldman Sachs	577
(2,174)	Horizon Bancorp Inc/IN	Bank of America Merrill Lynch	(3,413)
(2,351)	Horizon Bancorp Inc/IN	Morgan Stanley	(611)
(150)	Horizon Bancorp Inc/IN	Goldman Sachs	(236)
(14,005)	Horizon Global Corp	Bank of America Merrill Lynch	(9,804)
(2,765)	Horizon Pharma Plc	Morgan Stanley	(3,622)
18,187	Hormel Foods Corp	Morgan Stanley	5,232
1,597	Hormel Foods Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,278
(42,464)	Hormel Foods Corp	Bank of America Merrill Lynch	(33,971)
57,165	Hortonworks Inc	Bank of America Merrill Lynch	17,764
42,626	Hortonworks Inc	Morgan Stanley	2,558
11,149	Hortonworks Inc	Goldman Sachs	3,679
(2,148)	Hospitality Properties Trust (Reit)	Morgan Stanley	(1,761)
43,289	Host Hotels & Resorts Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	36,109
4,649	Host Hotels & Resorts Inc (Reit)	Goldman Sachs	1,466
3,077	Hostess Brands Inc	Morgan Stanley	(157)
19,660	Houghton Mifflin Harcourt Co	Bank of America Merrill Lynch	4,424
56,561	Houghton Mifflin Harcourt Co	Morgan Stanley	35,351
(43,605)	Houlihan Lokey Inc	Bank of America Merrill Lynch	23,767
(10)	Houston Wire & Cable Co	Bank of America Merrill Lynch	(2)
(777,150)	Hovnanian Enterprises Inc	Bank of America Merrill Lynch	(89,372)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(22,414)	Howard Hughes Corp/The	Morgan Stanley	104,001
9,882	HP Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,223
28,337	HP Inc	Morgan Stanley	5,526
(50,866)	HRG Group Inc	Morgan Stanley	(3,737)
(38,710)	HRG Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(27,017)
(8,597)	Hub Group Inc 'A'	Morgan Stanley	(23,322)
14,869	Hubbell Inc	Bank of America Merrill Lynch	58,138
1,161	HubSpot Inc	Bank of America Merrill Lynch	12,597
19,532	Hudson Ltd 'A'	Morgan Stanley	1,563
37,043	Hudson Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1,482
7,503	Hudson Ltd 'A'	Goldman Sachs	300
(4,646)	Hudson Ltd 'A'	Morgan Stanley	1,239
(18,893)	Hudson Pacific Properties Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(24,493)
(8,510)	Hudson Technologies Inc	Goldman Sachs	2,213
18,774	Humana Inc	Bank of America Merrill Lynch	79,414
(21,113)	Huntington Bancshares Inc/OH	Bank of America Merrill Lynch	8,023
(48,972)	Huntington Bancshares Inc/OH	Morgan Stanley	6,116
(6,160)	Huntington Ingalls Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(29,014)
42,369	Huntsman Corp	Bank of America Merrill Lynch	8,050
(59,139)	Huntsman Corp	Morgan Stanley	(26,146)
1,864	Hurco Cos Inc	Morgan Stanley	4,846
4,891	Hurco Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	16,385
4,183	Hurco Cos Inc	Goldman Sachs	14,013
(59,351)	Huron Consulting Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(234,436)
(15,060)	Huttig Building Products Inc	Goldman Sachs	(452)
(227,574)	Huttig Building Products Inc	Morgan Stanley	(20,482)
26,011	Hyatt Hotels Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	41,357
(9,077)	Hyatt Hotels Corp 'A'	Morgan Stanley	(5,778)
(18,594)	IAC/InterActiveCorp	Bank of America Merrill Lynch	(190,031)
(4,644)	IAC/InterActiveCorp	Morgan Stanley	(18,091)
532	IBERIABANK Corp	Morgan Stanley	(399)
30,990	IBERIABANK Corp	Bank of America Merrill Lynch	61,980
(4,279)	IBERIABANK Corp	Morgan Stanley	1,371
(60,985)	Ichor Holdings Ltd	Goldman Sachs	28,850
(19,506)	Ichor Holdings Ltd	Morgan Stanley	(21,262)
2,780	Icon Plc	Morgan Stanley	(83)
(17,636)	ICU Medical Inc	Bank of America Merrill Lynch	(450,600)
92,447	IDACORP Inc	Morgan Stanley	285,230
239,368	IDACORP Inc	Bank of America Merrill Lynch	754,009
(7,215)	Idera Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,587)
(191,576)	Idera Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(42,147)
18,376	IDEX Corp	Morgan Stanley	4,046
173	IDEXX Laboratories Inc	Goldman Sachs	1,388
17,572	IDEXX Laboratories Inc	Morgan Stanley	189,075
13,381	IDEXX Laboratories Inc	Bank of America Merrill Lynch	24,487

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(139,961)	IES Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(34,990)
(27,971)	IHS Markit Ltd	Goldman Sachs	64,333
(99,302)	II-VI Inc	Bank of America Merrill Lynch	26,131
(38,951)	II-VI Inc	Morgan Stanley	33,108
(18,117)	ILG Inc	Bank of America Merrill Lynch	(14,494)
(22,700)	ILG Inc	Morgan Stanley	(11,123)
23,754	Illinois Tool Works Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,789)
754	Illinois Tool Works Inc	Goldman Sachs	(279)
17,444	Illinois Tool Works Inc	Morgan Stanley	(29,131)
(4,811)	Illumina Inc	Bank of America Merrill Lynch	(41,711)
29,208	IMAX Corp	Goldman Sachs	(80,322)
12,856	IMAX Corp	Morgan Stanley	(17,998)
39,151	IMAX Corp	Bank of America Merrill Lynch	(107,665)
(23,098)	IMAX Corp	Morgan Stanley	48,585
(18,935)	Immersion Corp	Morgan Stanley	(44,876)
(27,538)	ImmunoGen Inc	Bank of America Merrill Lynch	(15,972)
(15,603)	ImmunoGen Inc	Goldman Sachs	(9,050)
(84,829)	Immunomedics Inc	Goldman Sachs	(225,595)
(872)	Immunomedics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,965)
(7,972)	Impac Mortgage Holdings Inc	Morgan Stanley	-
7,814	Imperva Inc	Morgan Stanley	12,893
9,288	Incyte Corp	Bank of America Merrill Lynch	13,549
3,853	Incyte Corp	Goldman Sachs	5,165
617	Incyte Corp	Morgan Stanley	684
10,896	Independence Contract Drilling Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,756)
5,620	Independence Contract Drilling Inc	Goldman Sachs	(3,484)
24,377	Independence Contract Drilling Inc	Morgan Stanley	(12,540)
(14,176)	Independence Holding Co	Morgan Stanley	9,923
(22,461)	Independence Holding Co	Bank of America Merrill Lynch	(55,029)
61,972	Independent Bank Corp/MI	Bank of America Merrill Lynch	74,366
13,578	Independent Bank Corp/MI	Goldman Sachs	16,294
18,226	Independent Bank Corp/MI	Morgan Stanley	4,557
(22,583)	Independent Bank Corp/Rockland MA	Bank of America Merrill Lynch	(65,523)
(14,482)	Independent Bank Corp/Rockland MA	Morgan Stanley	(57,277)
(5,823)	Independent Bank Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	8,456
16,721	Infinera Corp	Morgan Stanley	(11,577)
147,945	Infinera Corp	Bank of America Merrill Lynch	(149,468)
(45,047)	Infinera Corp	Morgan Stanley	16,310
(23,217)	Information Services Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	770
6,920	Infrastructure and Energy Alternatives Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,548)
3,368	Infrastructure and Energy Alternatives Inc	Goldman Sachs	(432)
4,594	Infrastructure and Energy Alternatives Inc	Morgan Stanley	(1,194)
46,759	Ingersoll-Rand Plc	Bank of America Merrill Lynch	(19,171)
622	Ingersoll-Rand Plc	Goldman Sachs	(255)
21,248	Ingersoll-Rand Plc	Morgan Stanley	(35,469)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(5,732)	Ingevity Corp	Bank of America Merrill Lynch	9,916
2,021	Ingles Markets Inc 'A'	Goldman Sachs	1,617
48,341	Ingles Markets Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	3,232
155,556	InnerWorkings Inc	Bank of America Merrill Lynch	18,667
(1,029)	Innophos Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,406)
91,407	Innospec Inc	Bank of America Merrill Lynch	297,073
6,034	Innospec Inc	Goldman Sachs	19,611
11,555	Innospec Inc	Morgan Stanley	26,660
26,308	Innoviva Inc	Goldman Sachs	4,272
15,656	Innoviva Inc	Morgan Stanley	(7,012)
103,615	Innoviva Inc	Bank of America Merrill Lynch	15,972
(1,974)	Inogen Inc	Morgan Stanley	(10,556)
17,808	Inovalon Holdings Inc 'A'	Morgan Stanley	3,562
(35,031)	Inovalon Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(21,019)
(33,745)	Inphi Corp	Bank of America Merrill Lynch	(51,336)
(17,647)	Insight Enterprises Inc	Bank of America Merrill Lynch	(43,235)
16,385	Insight Enterprises Inc	Morgan Stanley	224,311
(41,475)	Insmid Inc	Bank of America Merrill Lynch	(45,208)
75,104	Insp erityy Inc	Bank of America Merrill Lynch	292,906
23,465	Insp erityy Inc	Morgan Stanley	77,435
1,038	Insp erityy Inc	Goldman Sachs	4,048
(121,160)	Installed Building Products Inc	Bank of America Merrill Lynch	(489,666)
(587)	Installed Building Products Inc	Morgan Stanley	(37)
(32,325)	Insteel Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(56,005)
668	Instructure Inc	Morgan Stanley	1,536
2,094	Insulet Corp	Bank of America Merrill Lynch	16,459
(13,326)	Insulet Corp	Bank of America Merrill Lynch	(104,742)
15,954	Integer Holdings Corp	Morgan Stanley	2,742
710	Integer Holdings Corp	Goldman Sachs	426
4,943	Integer Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,966
(98,838)	Integra LifeSciences Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(145,292)
(47,073)	Integrated Device Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(128,980)
(26,130)	Integrated Device Technology Inc	Morgan Stanley	(35,164)
(17,979)	Intel Corp	Bank of America Merrill Lynch	(30,744)
(20,474)	Intellia Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(32,554)
(105,810)	Intelsat SA	Morgan Stanley	(938,570)
102,702	Inter Parfums Inc	Bank of America Merrill Lynch	477,564
3,024	Inter Parfums Inc	Goldman Sachs	14,062
47	Inter Parfums Inc	Morgan Stanley	85
(10,991)	Interactive Brokers Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	48,470
(8,517)	Intercept Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	9,624
66,873	Intercontinental Exchange Inc	Bank of America Merrill Lynch	(24,074)
49,515	Intercontinental Exchange Inc	Morgan Stanley	(10,398)
5,207	Intercontinental Exchange Inc	Goldman Sachs	(1,875)
15,912	InterDigital Inc/PA	Bank of America Merrill Lynch	17,503

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
34,839	Interface Inc	Goldman Sachs	5,226
135,036	Interface Inc	Bank of America Merrill Lynch	20,255
12,032	Interface Inc	Morgan Stanley	(2,406)
(2,773)	Internap Corp	Morgan Stanley	22,194
(6,949)	Internap Corp	Bank of America Merrill Lynch	5,283
(892)	International Business Machines Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,383
(46,308)	International Business Machines Corp	Morgan Stanley	92,290
897	International Flavors & Fragrances Inc	Goldman Sachs	63
15,439	International Flavors & Fragrances Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,089)
13,983	International Flavors & Fragrances Inc	Morgan Stanley	(12,504)
16,192	International Game Technology Plc	Bank of America Merrill Lynch	(66,630)
10,446	International Game Technology Plc	Goldman Sachs	(42,985)
133,728	International Game Technology Plc	Morgan Stanley	(328,302)
(20,129)	International Paper Co	Bank of America Merrill Lynch	8,308
(116,828)	International Seaways Inc	Goldman Sachs	(155,196)
(16,595)	International Speedway Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(8,298)
78,164	Interpublic Group of Cos Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	(132,879)
11,997	Interpublic Group of Cos Inc/The	Goldman Sachs	(20,395)
18,154	Intersect ENT Inc	Bank of America Merrill Lynch	13,470
12,042	Intersect ENT Inc	Morgan Stanley	7,903
5,123	Intersect ENT Inc	Goldman Sachs	5,733
431	INTL. FCStone Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,336
939	INTL. FCStone Inc	Goldman Sachs	2,911
(13,256)	Intra-Cellular Therapies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(31,019)
(21,290)	Intra-Cellular Therapies Inc	Morgan Stanley	(33,638)
(5,078)	Intrexon Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,219)
(24,045)	Intrexon Corp	Morgan Stanley	(22,362)
(10,718)	IntriCon Corp	Goldman Sachs	(17,115)
(1,722)	IntriCon Corp	Morgan Stanley	(3,530)
(6,338)	IntriCon Corp	Bank of America Merrill Lynch	(11,092)
(3,632)	Intuit Inc	Bank of America Merrill Lynch	(43,003)
177	Intuitive Surgical Inc	Bank of America Merrill Lynch	810
3,534	Intuitive Surgical Inc	Morgan Stanley	9,948
(5,019)	Intuitive Surgical Inc	Bank of America Merrill Lynch	(30,164)
(111,844)	Invacare Corp	Bank of America Merrill Lynch	39,145
38,056	Invesco Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(40,720)
122,198	Invesco Ltd	Morgan Stanley	(178,409)
2,919	Invesco Ltd	Goldman Sachs	(3,123)
348,629	Invesco Mortgage Capital Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	94,982
208,436	Invesco Mortgage Capital Inc (Reit)	Morgan Stanley	40,645
30,163	Invesco Mortgage Capital Inc (Reit)	Goldman Sachs	8,596
(10,890)	Investment Technology Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,856
33,334	Investors Bancorp Inc	Morgan Stanley	(2,623)
(218,669)	Investors Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	32,800
(378,516)	Investors Real Estate Trust (Reit)	Goldman Sachs	(113,555)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(253,928)	Investors Real Estate Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(75,753)
86,612	Invitae Corp	Bank of America Merrill Lynch	46,337
14,654	Invitae Corp	Morgan Stanley	513
109,990	Invitae Corp	Goldman Sachs	58,845
(73,764)	Invitation Homes Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	24,342
(32,950)	Invitation Homes Inc (Reit)	Morgan Stanley	(7,249)
(12,482)	ION Geophysical Corp	Goldman Sachs	39,318
(12,951)	ION Geophysical Corp	Morgan Stanley	19,427
(1,044)	Ionis Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,984)
(85,438)	Iovance Biotherapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	21,360
(5,464)	Iovance Biotherapeutics Inc	Goldman Sachs	1,366
(1,834)	IQVIA Holdings Inc	Morgan Stanley	3,467
(14,741)	IQVIA Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	31,841
3,172	iRadimed Corp	Bank of America Merrill Lynch	481
3,340	iRadimed Corp	Goldman Sachs	424
2,762	iRadimed Corp	Morgan Stanley	312
(6,817)	iRhythm Technologies Inc	Morgan Stanley	(49,628)
14,683	Iridium Communications Inc	Goldman Sachs	51,391
15,174	Iridium Communications Inc	Bank of America Merrill Lynch	53,109
64,823	Iridium Communications Inc	Morgan Stanley	218,656
6,002	iRobot Corp	Morgan Stanley	10,624
39,459	iRobot Corp	Bank of America Merrill Lynch	144,815
18,524	Iron Mountain Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	12,011
26,366	Iron Mountain Inc (Reit)	Morgan Stanley	22,411
5,342	Iron Mountain Inc (Reit)	Goldman Sachs	3,896
28,881	Ironwood Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	5,776
82,391	Itau Unibanco Holding SA ADR	Goldman Sachs	(116,171)
61,830	Itau Unibanco Holding SA ADR	Morgan Stanley	(140,201)
(76,549)	Iteris Inc	Goldman Sachs	36,744
(27,991)	Iteris Inc	Bank of America Merrill Lynch	13,436
(56,677)	Iteris Inc	Morgan Stanley	15,846
(4,195)	Itron Inc	Morgan Stanley	49,482
(4,183)	Itron Inc	Bank of America Merrill Lynch	17,046
37,779	ITT Inc	Bank of America Merrill Lynch	(28,327)
42,791	ITT Inc	Morgan Stanley	(54,927)
74,218	J Alexander 's Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,422)
10,600	J. Jill Inc	Bank of America Merrill Lynch	21,942
41,413	J. Jill Inc	Goldman Sachs	85,725
3,440	J. Jill Inc	Morgan Stanley	5,401
(4,881)	j2 Global Inc	Morgan Stanley	(1,866)
(92,568)	j2 Global Inc	Bank of America Merrill Lynch	(70,375)
2,007	Jabil Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,967
135,826	Jabil Inc	Morgan Stanley	63,920
(28,173)	Jack Henry & Associates Inc	Bank of America Merrill Lynch	(81,138)
(43,948)	Jack in the Box Inc	Bank of America Merrill Lynch	381,469

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
2,138	Jacobs Engineering Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,233
1,952	Jacobs Engineering Group Inc	Goldman Sachs	3,865
1,619	Jacobs Engineering Group Inc	Morgan Stanley	1,570
135,931	Jagged Peak Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(108,282)
36,569	Jagged Peak Energy Inc	Goldman Sachs	(39,845)
8,293	Jagged Peak Energy Inc	Morgan Stanley	(7,878)
(86,773)	Jamba Inc	Morgan Stanley	(19,958)
(3,610)	Jamba Inc	Bank of America Merrill Lynch	939
43,069	James River Group Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	28,856
13,678	James River Group Holdings Ltd	Goldman Sachs	9,164
(168,908)	Janus Henderson Group Plc	Goldman Sachs	380,043
12,859	Jason Industries Inc	Morgan Stanley	(2,186)
774	Jazz Pharmaceuticals Plc	Bank of America Merrill Lynch	3,480
8,193	Jazz Pharmaceuticals Plc	Morgan Stanley	18,813
(11,544)	JB Hunt Transport Services Inc	Morgan Stanley	(52,525)
4,246	JBG SMITH Properties (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	9,638
1,728	JBG SMITH Properties (Reit)	Goldman Sachs	3,923
1,210	JBG SMITH Properties (Reit)	Morgan Stanley	1,234
(88,692)	JC Penney Co Inc	Morgan Stanley	(8,426)
76,500	Jefferies Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(131,580)
14,562	Jefferies Financial Group Inc	Goldman Sachs	(25,047)
(53,346)	JELD-WEN Holding Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,616)
(111,203)	JELD-WEN Holding Inc	Morgan Stanley	45,593
(242)	Jernigan Capital Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(290)
(26,790)	Jernigan Capital Inc (Reit)	Morgan Stanley	(24,111)
2,648	JM Smucker Co/The	Bank of America Merrill Lynch	(3,350)
30,465	JM Smucker Co/The	Morgan Stanley	(159,338)
71,554	JMP Group LLC	Morgan Stanley	2,147
2,541	John B Sanfilippo & Son Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,529
379	John B Sanfilippo & Son Inc	Morgan Stanley	370
2,829	John B Sanfilippo & Son Inc	Goldman Sachs	5,470
(67,700)	John Bean Technologies Corp	Bank of America Merrill Lynch	(209,102)
(23,862)	John Bean Technologies Corp	Morgan Stanley	(34,504)
31,174	John Wiley & Sons Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	60,789
7,918	John Wiley & Sons Inc 'A'	Goldman Sachs	15,440
69,799	John Wiley & Sons Inc 'A'	Morgan Stanley	92,190
231	Johnson & Johnson	Goldman Sachs	(954)
72,510	Johnson & Johnson	Morgan Stanley	(376,459)
20,429	Johnson & Johnson	Bank of America Merrill Lynch	(84,372)
(157,547)	Johnson Controls International Plc	Morgan Stanley	163,282
(66,411)	Johnson Controls International Plc	Goldman Sachs	154,108
11,692	Jones Lang LaSalle Inc	Bank of America Merrill Lynch	(30,867)
2,030	Jones Lang LaSalle Inc	Goldman Sachs	(5,359)
2,781	Jounce Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,143)
7,880	Jounce Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(27,918)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
6,804	Jounce Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(282)
10,772	Juniper Networks Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,831
(46,910)	Juniper Networks Inc	Morgan Stanley	(34,390)
2,564	Juniper Networks Inc	Goldman Sachs	436
4,209	Juniper Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(421)
8,631	Kadant Inc	Goldman Sachs	28,482
14,361	Kadant Inc	Morgan Stanley	(17,951)
21,128	Kadant Inc	Bank of America Merrill Lynch	69,722
2,675	Kaiser Aluminum Corp	Morgan Stanley	6,331
728	Kaiser Aluminum Corp	Bank of America Merrill Lynch	4,899
(27,218)	Kaman Corp	Bank of America Merrill Lynch	(55,797)
(35,906)	Kaman Corp	Morgan Stanley	6,104
(266)	Kansas City Southern	Bank of America Merrill Lynch	(106)
(25,518)	KAR Auction Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	596
(3,776)	KAR Auction Services Inc	Morgan Stanley	2,667
(130,643)	KBR Inc	Bank of America Merrill Lynch	(198,719)
15,902	Keane Group Inc	Morgan Stanley	(21,627)
7,511	Keane Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(12,193)
(123,736)	Kearny Financial Corp/MD	Bank of America Merrill Lynch	(55,681)
(348,672)	Kearny Financial Corp/MD	Morgan Stanley	(34,867)
12,419	Kearny Financial Corp/MD	Bank of America Merrill Lynch	5,589
59,602	Kearny Financial Corp/MD	Morgan Stanley	5,960
(3,543)	Kellogg Co	Morgan Stanley	(130)
80,719	Kellogg Co	Bank of America Merrill Lynch	259,915
2,207	Kellogg Co	Goldman Sachs	7,107
1,237	Kellogg Co	Morgan Stanley	3,649
(26,219)	Kemet Corp	Morgan Stanley	(30,414)
(7,638)	Kemet Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,798)
(11,011)	Kemper Corp	Morgan Stanley	(235,745)
(2,771)	Kemper Corp	Bank of America Merrill Lynch	(13,994)
4,288	Kennametal Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,288)
(50,835)	Kennametal Inc	Bank of America Merrill Lynch	62,213
31,729	Kennametal Inc	Morgan Stanley	(55,208)
(33,949)	Kennedy-Wilson Holdings Inc	Goldman Sachs	(10,390)
17,310	Key Energy Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,250)
9,972	Key Energy Services Inc	Morgan Stanley	(9,773)
64,497	Key Tronic Corp	Bank of America Merrill Lynch	16,769
11,081	Key Tronic Corp	Morgan Stanley	3,657
(66,037)	KeyCorp	Bank of America Merrill Lynch	62,951
87,836	KeyCorp	Morgan Stanley	(99,779)
60	Keysight Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	419
(8,115)	Keysight Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(52,666)
6,692	Keysight Technologies Inc	Morgan Stanley	49,126
(198,002)	KeyW Holding Corp/The	Morgan Stanley	(239,582)
(20,431)	KeyW Holding Corp/The	Bank of America Merrill Lynch	(23,700)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
2,022	Kforce Inc	Bank of America Merrill Lynch	(279)
1,121	Kforce Inc	Morgan Stanley	827
(2,208)	Kilroy Realty Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(7,772)
(24,850)	Kimball Electronics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(27,335)
45,502	Kimball International Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	28,666
23,094	Kimball International Inc 'B'	Morgan Stanley	11,316
6,118	Kimball International Inc 'B'	Goldman Sachs	3,854
338	Kimberly-Clark Corp	Goldman Sachs	(463)
12,581	Kimberly-Clark Corp	Bank of America Merrill Lynch	(17,236)
74,635	Kimco Realty Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	99,234
115,239	Kimco Realty Corp (Reit)	Morgan Stanley	24,200
25,763	Kimco Realty Corp (Reit)	Goldman Sachs	34,265
194,943	Kinder Morgan Inc/DE	Morgan Stanley	115,016
11,435	Kinsale Capital Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	29,274
4,265	Kinsale Capital Group Inc	Morgan Stanley	1,493
2,800	Kinsale Capital Group Inc	Goldman Sachs	7,168
(9,311)	Kirby Corp	Bank of America Merrill Lynch	(33,985)
11,403	Kirkland's Inc	Bank of America Merrill Lynch	27,367
10,674	Kirkland's Inc	Goldman Sachs	25,618
85,125	Kite Realty Group Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	97,042
5,498	Kite Realty Group Trust (Reit)	Morgan Stanley	3,079
83,351	KKR Real Estate Finance Trust Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,131)
1,286	KKR Real Estate Finance Trust Inc	Goldman Sachs	(309)
6,440	KKR Real Estate Finance Trust Inc	Morgan Stanley	(44)
(20,747)	KLA-Tencor Corp	Bank of America Merrill Lynch	(70,955)
(35,591)	KLA-Tencor Corp	Morgan Stanley	(40,218)
5,569	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	Morgan Stanley	3,694
(72,533)	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(90,666)
(30,971)	Knoll Inc	Bank of America Merrill Lynch	(14,556)
(30,975)	Knowles Corp	Morgan Stanley	(4,956)
6,252	Knowles Corp	Bank of America Merrill Lynch	3,251
2,629	Knowles Corp	Goldman Sachs	1,367
40,353	Kohl's Corp	Bank of America Merrill Lynch	174,728
2,362	Kohl's Corp	Goldman Sachs	10,227
49,334	Kohl's Corp	Morgan Stanley	323,151
104,400	Koninklijke Philips NV	Morgan Stanley	(153,311)
4,539	Kopin Corp	Morgan Stanley	999
12,665	Kopin Corp	Bank of America Merrill Lynch	3,800
59,907	Kopin Corp	Goldman Sachs	17,972
6,301	Koppers Holdings Inc	Goldman Sachs	8,611
3,048	Koppers Holdings Inc	Morgan Stanley	(650)
13,671	Koppers Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	21,190
3,477	Korn/Ferry International	Goldman Sachs	4,937
87,208	Korn/Ferry International	Bank of America Merrill Lynch	123,835
894	Korn/Ferry International	Morgan Stanley	948

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(84,607)	Kosmos Energy Ltd	Morgan Stanley	(32,302)
(116,569)	Kosmos Energy Ltd	Goldman Sachs	(51,107)
(40,576)	Kraft Heinz Co/The	Bank of America Merrill Lynch	43,416
(78,577)	Kraft Heinz Co/The	Morgan Stanley	(36,709)
(41,666)	Kratos Defense & Security Solutions Inc	Goldman Sachs	(5,417)
(146,257)	Kratos Defense & Security Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	(19,013)
49,783	Kroger Co/The	Bank of America Merrill Lynch	10,454
96,670	Kroger Co/The	Morgan Stanley	32,098
(3,713)	Kronos Worldwide Inc	Bank of America Merrill Lynch	692
(11,098)	Kronos Worldwide Inc	Morgan Stanley	1,657
(14,741)	Kulicke & Soffa Industries Inc	Morgan Stanley	(33,260)
(38,651)	KVH Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,933
(5,428)	KVH Industries Inc	Goldman Sachs	271
(17,865)	L Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	(23,046)
(10,411)	L3 Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(73,085)
6,484	La Quinta Holdings Inc	Morgan Stanley	5,641
3,528	La-Z-Boy Inc	Morgan Stanley	9,095
7,150	Laboratory Corp of America Holdings	Morgan Stanley	39,969
(15,396)	Laboratory Corp of America Holdings	Bank of America Merrill Lynch	(98,377)
320,249	Ladder Capital Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	173,539
38,061	Ladder Capital Corp (Reit)	Goldman Sachs	21,695
101,506	Ladder Capital Corp (Reit)	Morgan Stanley	17,194
89,814	Ladenburg Thalmann Financial Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,389)
64,380	Ladenburg Thalmann Financial Services Inc	Goldman Sachs	(3,863)
29,974	Ladenburg Thalmann Financial Services Inc	Morgan Stanley	(1,798)
(4,737)	Lakeland Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,895)
75,591	Lakeland Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	37,796
25,525	Lakeland Financial Corp	Goldman Sachs	12,763
15,742	Lakeland Financial Corp	Morgan Stanley	(6,454)
(5,142)	Lam Research Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,160
3,677	Lam Research Corp	Morgan Stanley	2,120
1,001	Lamar Advertising Co 'A' (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	1,832
1,180	Lamar Advertising Co 'A' (Reit)	Morgan Stanley	1,215
1,059	Lamar Advertising Co 'A' (Reit)	Goldman Sachs	1,938
7,331	Lamb Weston Holdings Inc	Morgan Stanley	(4,487)
(2,658)	Lancaster Colony Corp	Morgan Stanley	(17,913)
(5,231)	Lancaster Colony Corp	Bank of America Merrill Lynch	(9,363)
32,299	Landstar System Inc	Bank of America Merrill Lynch	171,185
1,143	Landstar System Inc	Goldman Sachs	6,058
(45,083)	Lannett Co Inc	Morgan Stanley	(23,891)
(29,840)	Lantheus Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(12,213)
(15,334)	Laredo Petroleum Inc	Bank of America Merrill Lynch	10,044
46,940	Las Vegas Sands Corp	Bank of America Merrill Lynch	97,454
553	Las Vegas Sands Corp	Morgan Stanley	818
289	Las Vegas Sands Corp	Goldman Sachs	751

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(76,662)	Latam Airlines Group SA ADR	Morgan Stanley	85,861
(3,722)	Latam Airlines Group SA ADR	Goldman Sachs	3,601
(79,098)	Laureate Education Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(144,749)
(11,644)	Laureate Education Inc 'A'	Morgan Stanley	(12,925)
(7,643)	Layne Christensen Co	Bank of America Merrill Lynch	1,452
(89,511)	Layne Christensen Co	Morgan Stanley	27,748
399	LCI Industries	Bank of America Merrill Lynch	1,057
11,408	LCI Industries	Morgan Stanley	(37,076)
(13,128)	LCI Industries	Bank of America Merrill Lynch	(34,789)
16,045	LCNB Corp	Bank of America Merrill Lynch	14,477
5,505	LCNB Corp	Morgan Stanley	4,256
900	LCNB Corp	Goldman Sachs	855
21,143	Leaf Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3,171
2,376	Leaf Group Ltd	Goldman Sachs	356
511	Lear Corp	Bank of America Merrill Lynch	669
(288,443)	LegacyTexas Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	349,016
(19,986)	LegacyTexas Financial Group Inc	Morgan Stanley	32,577
22,856	Legg Mason Inc	Bank of America Merrill Lynch	(36,570)
10,968	Legg Mason Inc	Goldman Sachs	(17,549)
63,585	Leggett & Platt Inc	Morgan Stanley	36,879
(9,564)	Leidos Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(302)
(1,767)	Leidos Holdings Inc	Morgan Stanley	(1,396)
31,578	LeMaitre Vascular Inc	Bank of America Merrill Lynch	9,473
525	LendingTree Inc	Morgan Stanley	832
678	LendingTree Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,311
(96,752)	Lennar Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(94,817)
(22,762)	Lennar Corp 'A'	Morgan Stanley	84,605
(14,531)	Lennar Corp 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(14,676)
2,531	Lennox International Inc	Morgan Stanley	5,340
3,800	Lexicon Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	6,329
3,947	Lexicon Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	4,717
7,656	Lexington Realty Trust (Reit)	Morgan Stanley	2,450
(4,823)	LGI Homes Inc	Morgan Stanley	49,466
28,420	LHC Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	74,176
10,378	LHC Group Inc	Morgan Stanley	31,757
2,388	LHC Group Inc	Goldman Sachs	6,233
(29,443)	Liberty Broadband Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	60,538
(513)	Liberty Broadband Corp 'A'	Morgan Stanley	194
(15,184)	Liberty Broadband Corp 'C'	Bank of America Merrill Lynch	35,682
(13,590)	Liberty Expedia Holdings 'A'	Morgan Stanley	(20,929)
1,928	Liberty Expedia Holdings Inc 'A'	Goldman Sachs	4,434
2,861	Liberty Expedia Holdings Inc 'A'	Morgan Stanley	4,406
21,436	Liberty Expedia Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	49,303
7,771	Liberty Global Plc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(10,646)
12,052	Liberty Global Plc 'A'	Morgan Stanley	(7,713)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(2,263)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'A'	Goldman Sachs	(2,648)
(9,262)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'A'	Morgan Stanley	3,705
(8,646)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	Bank of America Merrill Lynch	(5,214)
(1,496)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	Goldman Sachs	(1,825)
2,513	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'A'	Goldman Sachs	3,493
8,845	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'A'	Bank of America Merrill Lynch	12,295
20,578	Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C'	Bank of America Merrill Lynch	28,192
40,468	Liberty Oilfield Services 'A'	Bank of America Merrill Lynch	40,525
9,577	Liberty Oilfield Services 'A'	Goldman Sachs	5,020
16,577	Liberty Oilfield Services 'A'	Morgan Stanley	(7,522)
(5,585)	Liberty Property Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(5,791)
(9,581)	Liberty Tax Inc	Bank of America Merrill Lynch	(958)
(12,703)	Liberty Tax Inc	Goldman Sachs	(1,270)
27,245	Liberty TripAdvisor Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	55,852
4,323	Life Storage Inc (Reit)	Morgan Stanley	13,099
(11,350)	LifePoint Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	18,401
(20,487)	LifePoint Health Inc	Morgan Stanley	(31,328)
(6,680)	Ligand Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(64,328)
(3,195)	Ligand Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(30,768)
(10,169)	Lilis Energy Inc	Morgan Stanley	(9,966)
289	Limelight Networks Inc	Morgan Stanley	(14)
(421)	Lincoln Electric Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,082)
(33,214)	Lincoln Electric Holdings Inc	Morgan Stanley	(113,368)
37,886	Lincoln National Corp	Bank of America Merrill Lynch	(67,423)
95,998	Lincoln National Corp	Morgan Stanley	(376,029)
323	Lincoln National Corp	Goldman Sachs	(123)
28,911	Lions Gate Entertainment Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(5,782)
28,973	Lions Gate Entertainment Corp 'A'	Goldman Sachs	(5,795)
391	Lions Gate Entertainment Corp 'A'	Morgan Stanley	20
58,254	Lions Gate Entertainment Corp 'B'	Bank of America Merrill Lynch	16,341
24,375	Lions Gate Entertainment Corp 'B'	Goldman Sachs	7,800
67,024	Lions Gate Entertainment Corp 'B'	Morgan Stanley	7,373
44,111	Lithia Motors Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	5,293
5,178	Lithia Motors Inc 'A'	Goldman Sachs	621
89,398	Lithia Motors Inc 'A'	Morgan Stanley	(41,920)
(10,123)	Littelfuse Inc	Bank of America Merrill Lynch	(61,447)
(2,689)	Littelfuse Inc	Morgan Stanley	(22,507)
23,575	Live Nation Entertainment Inc	Bank of America Merrill Lynch	(21,453)
(39,189)	Live Oak Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	(45,067)
30,877	LivePerson Inc	Bank of America Merrill Lynch	44,000
7,606	LivePerson Inc	Goldman Sachs	10,839
4,397	LivePerson Inc	Morgan Stanley	4,067
(84,204)	LKQ Corp	Bank of America Merrill Lynch	(70,083)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(23,723)	LKQ Corp	Morgan Stanley	(23,486)
2,576	Loews Corp	Bank of America Merrill Lynch	(7,857)
(27,087)	Loews Corp	Bank of America Merrill Lynch	82,615
160,490	Loews Corp	Morgan Stanley	(481,470)
246	LogMeIn Inc	Bank of America Merrill Lynch	(357)
1,499	LogMeIn Inc	Morgan Stanley	(4,450)
(5,514)	Loral Space & Communications Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,930
(55,937)	Louisiana-Pacific Corp	Bank of America Merrill Lynch	(128,096)
(30,014)	Louisiana-Pacific Corp	Morgan Stanley	(30,014)
(33,291)	Lowe's Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	(390,171)
(1,610)	Lowe's Cos Inc	Morgan Stanley	173
(430)	Loxo Oncology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(18,426)
(144)	Loxo Oncology Inc	Goldman Sachs	(6,170)
(23,712)	LPL Financial Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	37,228
(2,127)	LPL Financial Holdings Inc	Morgan Stanley	6,306
(11,231)	LSB Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,032
(15,653)	LSB Industries Inc	Goldman Sachs	4,226
(37,483)	LSB Industries Inc	Morgan Stanley	15,368
18,877	LSC Communications Inc	Bank of America Merrill Lynch	21,520
1,971	LSC Communications Inc	Goldman Sachs	2,247
3,195	LSI Industries Inc	Goldman Sachs	(64)
(8,285)	LTC Properties Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(17,813)
14,904	Lululemon Athletica Inc	Bank of America Merrill Lynch	50,682
45,899	Lululemon Athletica Inc	Morgan Stanley	183,809
584	Lululemon Athletica Inc	Goldman Sachs	3,194
(2,337)	Lumentum Holdings Inc	Morgan Stanley	6,163
(14,917)	Lumentum Holdings Inc	Goldman Sachs	45,732
16,369	Luminex Corp	Bank of America Merrill Lynch	39,286
1,327	Luminex Corp	Goldman Sachs	3,185
(3,330)	Luxoft Holding Inc	Morgan Stanley	16,613
14,035	Lydall Inc	Bank of America Merrill Lynch	21,053
1,070	Lydall Inc	Goldman Sachs	1,605
825	Lydall Inc	Morgan Stanley	(165)
(25,726)	LyondellBasell Industries NV 'A'	Morgan Stanley	(227,840)
14,051	M&T Bank Corp	Morgan Stanley	(116,730)
(79,758)	M&T Bank Corp	Bank of America Merrill Lynch	999,368
24,135	M/I Homes Inc	Bank of America Merrill Lynch	11,102
9,632	M/I Homes Inc	Goldman Sachs	4,431
66,942	Macatawa Bank Corp	Bank of America Merrill Lynch	87,694
32,528	Macatawa Bank Corp	Goldman Sachs	42,612
46,302	Macatawa Bank Corp	Morgan Stanley	40,746
(3,514)	Macerich Co/The (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(5,060)
6,598	Macerich Co/The (Reit)	Morgan Stanley	3,365
(54,624)	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(13,656)
(39,451)	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	Goldman Sachs	(9,863)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(1,552)	MACOM Technology Solutions Holdings Inc	Morgan Stanley	(1,614)
3,416	Macquarie Infrastructure Corp	Bank of America Merrill Lynch	3,518
(33,695)	Macquarie Infrastructure Corp	Morgan Stanley	(25,945)
1,090	MacroGenics Inc	Morgan Stanley	1,657
(5,853)	Macy's Inc	Bank of America Merrill Lynch	(32,074)
1,085	Madison Square Garden Co/The 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(2,420)
120	Madison Square Garden Co/The 'A'	Goldman Sachs	(268)
(1,682)	Madrigal Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(171,362)
(4,059)	Madrigal Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(386,904)
(758)	Madrigal Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(72,253)
(2,711)	Magellan Health Inc	Morgan Stanley	(5,286)
(12,669)	MakeMyTrip Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(15,203)
(6,219)	MakeMyTrip Ltd	Morgan Stanley	(2,799)
(8,956)	Mallinckrodt Plc	Goldman Sachs	(13,255)
(41,134)	Mallinckrodt Plc	Morgan Stanley	(41,134)
(14,388)	Mammoth Energy Services Inc	Morgan Stanley	(40,544)
(1,302)	Manhattan Associates Inc	Morgan Stanley	690
(23,010)	Manhattan Associates Inc	Bank of America Merrill Lynch	21,325
32,051	Manitowoc Co Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	(23,864)
4,863	Manitowoc Co Inc/The	Goldman Sachs	(2,918)
19,092	Manitowoc Co Inc/The	Morgan Stanley	(35,950)
20,836	ManpowerGroup Inc	Bank of America Merrill Lynch	(51,419)
84,571	Marathon Oil Corp	Bank of America Merrill Lynch	15,223
134,457	Marathon Oil Corp	Morgan Stanley	591,836
5,408	Marathon Petroleum Corp	Goldman Sachs	21,416
41,058	Marcus & Millichap Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9,337)
2,564	Marcus & Millichap Inc	Goldman Sachs	(333)
79,430	Marcus Corp/The	Bank of America Merrill Lynch	(19,858)
4,033	Marcus Corp/The	Goldman Sachs	(1,008)
5,209	Marcus Corp/The	Morgan Stanley	(2,605)
3,192	Marin Software Inc	Bank of America Merrill Lynch	(479)
4,734	Marin Software Inc	Goldman Sachs	(710)
2,918	Marin Software Inc	Morgan Stanley	(584)
30,460	Marine Products Corp	Morgan Stanley	20,408
5,801	Marine Products Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,726
(14,670)	Marinus Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(20,685)
(8,340)	Marinus Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(10,425)
583	Markel Corp	Bank of America Merrill Lynch	(10,885)
(4,292)	Markel Corp	Morgan Stanley	135,671
(212)	MarketAxess Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,235)
(1,382)	MarketAxess Holdings Inc	Morgan Stanley	(11,547)
(5,677)	Marlin Business Services Corp	Bank of America Merrill Lynch	(5,677)
25,768	Marriott International Inc/MD 'A'	Morgan Stanley	(44,836)
638	Marriott Vacations Worldwide Corp	Goldman Sachs	2,001
(9,722)	Marriott Vacations Worldwide Corp	Bank of America Merrill Lynch	(40,467)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(6,059)	Marriott Vacations Worldwide Corp	Morgan Stanley	(17,663)
4,645	Marriott Vacations Worldwide Corp	Bank of America Merrill Lynch	12,892
8,008	Marsh & McLennan Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,565)
165,499	Marten Transport Ltd	Bank of America Merrill Lynch	372,373
24,801	Marten Transport Ltd	Goldman Sachs	55,802
(24,186)	Marvell Technology Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,451)
81,914	Marvell Technology Group Ltd	Morgan Stanley	(34,908)
2,420	Masco Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,936
5,502	Masimo Corp	Goldman Sachs	21,358
101,392	Masimo Corp	Bank of America Merrill Lynch	408,182
4,059	Masimo Corp	Morgan Stanley	9,457
824	Masonite International Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,060
3,875	Masonite International Corp	Morgan Stanley	4,263
(23,578)	MasTec Inc	Morgan Stanley	24,757
(7,052)	MasTec Inc	Bank of America Merrill Lynch	(648)
42,265	MasTec Inc	Bank of America Merrill Lynch	(54,945)
24,530	Mastercard Inc 'A'	Goldman Sachs	4,661
8,370	Mastercard Inc 'A'	Morgan Stanley	4,771
33,354	Matador Resources Co	Bank of America Merrill Lynch	(128,661)
52,920	Matador Resources Co	Morgan Stanley	(137,374)
(6,359)	Match Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(17,360)
2,278	Materion Corp	Morgan Stanley	(2,506)
1,843	Materion Corp	Bank of America Merrill Lynch	(737)
3,009	Materion Corp	Goldman Sachs	(1,204)
(12,678)	Matrix Service Co	Bank of America Merrill Lynch	(23,452)
(1,217)	Mattel Inc	Bank of America Merrill Lynch	(499)
(56,001)	Mattel Inc	Goldman Sachs	(22,960)
5,875	Matthews International Corp 'A'	Goldman Sachs	17,625
46,838	Matthews International Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	140,514
(4,826)	Mau Land & Pineapple Co Inc	Goldman Sachs	(8,446)
(27,940)	Mau Land & Pineapple Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	(42,016)
62,615	Maxim Integrated Products Inc	Bank of America Merrill Lynch	76,539
(117,112)	MAXIMUS Inc	Bank of America Merrill Lynch	32,428
(49,873)	MaxLinear Inc	Morgan Stanley	3,990
2,403	MaxLinear Inc	Goldman Sachs	60
2,124	MaxLinear Inc	Bank of America Merrill Lynch	(408)
(112,431)	Maxwell Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,249
(19,306)	Maxwell Technologies Inc	Goldman Sachs	386
(24,417)	Maxwell Technologies Inc	Morgan Stanley	488
(10,928)	MBIA Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,192
(100,532)	MBIA Inc	Morgan Stanley	40,185
(20,756)	MBIA Inc	Goldman Sachs	9,133
69,608	MBT Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	31,324
1,804	MBT Financial Corp	Morgan Stanley	(90)
85,311	MCBC Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	91,283

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
2,218	MCBC Holdings Inc	Morgan Stanley	(466)
2,404	McCormick & Co Inc/MD 'non-voting share'	Morgan Stanley	(3,928)
30,866	McCormick & Co Inc/MD 'non-voting share'	Bank of America Merrill Lynch	(113,587)
4,630	McCormick & Co Inc/MD 'non-voting share'	Goldman Sachs	(17,038)
(40,720)	McDermott International Inc	Goldman Sachs	666
(118,985)	McDermott International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(437,068)
(73,166)	McDermott International Inc	Morgan Stanley	(13,288)
30,680	McDonald's Corp	Bank of America Merrill Lynch	(63,201)
3,020	McDonald's Corp	Goldman Sachs	(6,221)
106,144	McGrath RentCorp	Bank of America Merrill Lynch	72,419
10,096	McGrath RentCorp	Goldman Sachs	8,380
2,511	McGrath RentCorp	Morgan Stanley	1,758
11,974	McKesson Corp	Bank of America Merrill Lynch	(82,381)
205	McKesson Corp	Morgan Stanley	(381)
365	McKesson Corp	Goldman Sachs	(2,511)
159,042	MDC Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	405,817
17,777	MDC Holdings Inc	Goldman Sachs	49,598
16,535	MDC Partners Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	827
(18,983)	MDU Resources Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,519
3,046	MDU Resources Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	388
23,407	MDU Resources Group Inc	Morgan Stanley	2,215
1,432	MedCath Corp*,**	Morgan Stanley	(11,112)
1,716	Media General Inc-CVR*,**	Bank of America Merrill Lynch	232
1,127	Media General Inc-CVR*,**	Morgan Stanley	152
28,270	Medical Properties Trust Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	12,156
(10,810)	Medicines Co/The	Morgan Stanley	(25,295)
(3,474)	Medidata Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,705)
5,344	Medifast Inc	Morgan Stanley	45,078
(20,809)	Medifast Inc	Bank of America Merrill Lynch	(343,140)
(5,216)	MEDNAX Inc	Morgan Stanley	5,425
2,107	MEDNAX Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,339)
20,674	Medpace Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	12,395
350	Medpace Holdings Inc	Morgan Stanley	(60)
18,297	Medpace Holdings Inc	Goldman Sachs	15,004
42,504	Medtronic Plc	Bank of America Merrill Lynch	76,720
7,811	Medtronic Plc	Morgan Stanley	6,609
927	Medtronic Plc	Goldman Sachs	1,673
(14,322)	Meet Group Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	(5,729)
(21,527)	Melinta Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(6,026)
(4,178)	Melinta Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,342
17,596	Mellanox Technologies Ltd	Morgan Stanley	28,154
(2,250)	MercadoLibre Inc	Bank of America Merrill Lynch	(24,087)
(4,024)	MercadoLibre Inc	Morgan Stanley	8,607

* 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。

** 当該有価証券には市場流動性がない。

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
37,921	Mercantile Bank Corp	Bank of America Merrill Lynch	33,721
11,834	Mercantile Bank Corp	Goldman Sachs	9,414
14,267	Mercantile Bank Corp	Morgan Stanley	(3,187)
6,757	Merchants Bancorp/IN	Bank of America Merrill Lynch	16,487
6,374	Merchants Bancorp/IN	Goldman Sachs	15,553
16,560	Merck & Co Inc	Morgan Stanley	14,699
76,334	Merck & Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	42,747
(20,052)	Mercury General Corp	Morgan Stanley	12,432
13,681	Mercury General Corp	Bank of America Merrill Lynch	13,407
315	Mercury General Corp	Goldman Sachs	309
(104,608)	Mercury Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(309,640)
(7,359)	Mercury Systems Inc	Morgan Stanley	(15,895)
26,647	Meredith Corp	Bank of America Merrill Lynch	30,607
43,729	Meredith Corp	Morgan Stanley	12,368
2,941	Meredith Corp	Goldman Sachs	690
(9,128)	Meredith Corp	Goldman Sachs	(8,672)
131,470	Meridian Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	46,015
58,820	Meridian Bancorp Inc	Goldman Sachs	20,587
12,060	Meridian Bancorp Inc	Morgan Stanley	603
3,215	Merit Medical Systems Inc	Morgan Stanley	(8,841)
27,790	Meritage Homes Corp	Bank of America Merrill Lynch	93,925
97,747	Meritage Homes Corp	Morgan Stanley	180,832
2,081	Meritage Homes Corp	Goldman Sachs	1,643
7,524	Meritor Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,213)
29,324	Meritor Inc	Morgan Stanley	(35,189)
(7,586)	Merrimack Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	303
(7,287)	Mesa Laboratories Inc	Bank of America Merrill Lynch	83,582
(2,013)	Mesa Laboratories Inc	Morgan Stanley	12,239
(1,050)	Mesa Laboratories Inc	Goldman Sachs	1,677
(36,465)	Meta Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(224,097)
(15,946)	Methode Electronics Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,144
(8,815)	Methode Electronics Inc	Morgan Stanley	18,512
(127,446)	MetLife Inc	Bank of America Merrill Lynch	235,775
(2,198)	Mettler-Toledo International Inc	Bank of America Merrill Lynch	7,407
(2,044)	Mettler-Toledo International Inc	Morgan Stanley	42,985
(40,532)	MFA Financial Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(5,067)
(91,068)	MGE Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(282,311)
21,253	MGIC Investment Corp	Goldman Sachs	(1,807)
60,840	MGIC Investment Corp	Bank of America Merrill Lynch	(5,171)
1,299	MGIC Investment Corp	Morgan Stanley	(305)
(105,004)	MGIC Investment Corp	Morgan Stanley	23,122
89,640	MGM Growth Properties LLC 'A' (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	129,978
(183,058)	MGM Growth Properties LLC 'A' (Reit)	Morgan Stanley	(303,123)
(73,356)	MGM Resorts International	Bank of America Merrill Lynch	(8,803)
(53,782)	MGM Resorts International	Morgan Stanley	114,783

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(4,361)	MGP Ingredients Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,105)
57,674	Michael Kors Holdings Ltd	Morgan Stanley	(401,349)
25,070	Michael Kors Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(159,660)
6,914	Michaels Cos Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	559
(36,645)	Michaels Cos Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	(5,497)
21,706	Michaels Cos Inc/The	Morgan Stanley	4,341
(52,867)	Microchip Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(243,188)
(17,320)	Microchip Technology Inc	Goldman Sachs	(79,672)
(39,391)	Microchip Technology Inc	Morgan Stanley	(228,517)
(29,360)	Micron Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(149,807)
(3,297)	Micron Technology Inc	Morgan Stanley	11,424
(22,630)	Microsoft Corp	Morgan Stanley	(61,865)
6,253	MicroStrategy Inc 'A'	Goldman Sachs	29,889
4,086	MicroStrategy Inc 'A'	Morgan Stanley	10,174
62,267	MicroStrategy Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	297,636
(4,435)	MicroStrategy Inc 'A'	Morgan Stanley	(5,768)
(4,167)	Mid-America Apartment Communities Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(16,668)
(38,778)	Middleby Corp/The	Bank of America Merrill Lynch	160,541
(22,411)	Middleby Corp/The	Morgan Stanley	565,318
(97,076)	Middlesex Water Co	Bank of America Merrill Lynch	(286,374)
(49,466)	Midland States Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(33,637)
(22,682)	MidSouth Bancorp Inc	Morgan Stanley	3,402
(27,685)	MidSouth Bancorp Inc	Goldman Sachs	1,384
25,363	Milacron Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	254
7,470	Milacron Holdings Corp	Goldman Sachs	75
23,731	Milacron Holdings Corp	Morgan Stanley	(14,314)
59,486	Miller Industries Inc/TN	Bank of America Merrill Lynch	47,589
6,186	Miller Industries Inc/TN	Goldman Sachs	4,949
24,865	Miller Industries Inc/TN	Morgan Stanley	6,216
941	MINDBODY Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1,529
(4,326)	MINDBODY Inc 'A'	Morgan Stanley	(6,165)
(1,126)	Minerals Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,048)
(3,967)	Minerals Technologies Inc	Morgan Stanley	(4,583)
(70,589)	Minerva Neurosciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	(63,331)
(12,193)	Minerva Neurosciences Inc	Goldman Sachs	(23,509)
16,950	Miragen Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,051)
25,231	Miragen Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(4,542)
6,048	Miragen Therapeutics Inc	Morgan Stanley	423
(30,648)	Mirati Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(205,342)
(16,240)	Mistras Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,761)
(9,116)	Mitek Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,646)
665	MKS Instruments Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,245
1,194	MKS Instruments Inc	Morgan Stanley	3,350
4,515	Mobile Mini Inc	Goldman Sachs	6,058
5,735	Mobile Mini Inc	Morgan Stanley	7,417

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(3,763)	Mobile Mini Inc	Morgan Stanley	(2,666)
41,547	Mobile Mini Inc	Bank of America Merrill Lynch	62,397
51,012	MobileIron Inc	Bank of America Merrill Lynch	7,652
55,468	MobileIron Inc	Goldman Sachs	8,320
43,437	MobileIron Inc	Morgan Stanley	10,859
56,040	Model N Inc	Bank of America Merrill Lynch	8,611
1,095	Model N Inc	Goldman Sachs	493
3,057	Model N Inc	Morgan Stanley	459
164,269	Modine Manufacturing Co	Bank of America Merrill Lynch	(14,732)
29,433	Modine Manufacturing Co	Morgan Stanley	(37,131)
21,241	Modine Manufacturing Co	Goldman Sachs	(2,124)
5,549	Moelis & Co 'A'	Goldman Sachs	9,184
813	Moelis & Co 'A'	Morgan Stanley	244
199,493	Moelis & Co 'A'	Bank of America Merrill Lynch	403,900
(8,314)	Mohawk Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	24,194
(49,971)	Molina Healthcare Inc	Bank of America Merrill Lynch	(92,446)
2,498	Molina Healthcare Inc	Morgan Stanley	(2,644)
(31,318)	Molson Coors Brewing Co 'B'	Morgan Stanley	5,775
34,134	Molson Coors Brewing Co 'B'	Bank of America Merrill Lynch	48,129
6,211	Molson Coors Brewing Co 'B'	Goldman Sachs	8,758
(4,383)	Momenta Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(775)
(19,080)	Mondelez International Inc 'A'	Morgan Stanley	7,404
(14,643)	Mondelez International Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	2,196
19,336	MoneyGram International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,061)
(9,585)	MongoDB Inc	Morgan Stanley	(64,313)
(63,897)	Monmouth Real Estate Investment Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(10,765)
5,618	Monolithic Power Systems Inc	Goldman Sachs	42,247
2,080	Monolithic Power Systems Inc	Morgan Stanley	8,757
41,465	Monolithic Power Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	311,817
(2,484)	Monotype Imaging Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,221)
(40,015)	Monro Inc	Bank of America Merrill Lynch	(38,014)
(66,702)	Monro Inc	Goldman Sachs	(63,367)
(5,904)	Monsanto Co	Bank of America Merrill Lynch	(13,402)
(2,568)	Monsanto Co	Goldman Sachs	(5,829)
(48,025)	Monster Beverage Corp	Morgan Stanley	(83,512)
(48,979)	Monster Beverage Corp	Bank of America Merrill Lynch	(159,427)
(1,883)	Moody's Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3,126)
(573)	Moody's Corp	Morgan Stanley	1,037
(27,076)	Moog Inc 'A'	Morgan Stanley	28,159
509	Morgan Stanley	Goldman Sachs	(1,775)
167,973	Morgan Stanley	Bank of America Merrill Lynch	(659,589)
7,795	Morningstar Inc	Bank of America Merrill Lynch	55,422
254	Morningstar Inc	Morgan Stanley	1,077
3,427	Morningstar Inc	Goldman Sachs	24,366
(102,258)	Mosaic Co/The	Morgan Stanley	(188,453)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(60,486)	Motorcar Parts of America Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,234)
3,876	Motorola Solutions Inc	Goldman Sachs	5,000
18,412	Motorola Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	23,751
29,512	Motorola Solutions Inc	Morgan Stanley	(1,180)
(11,142)	Movado Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(103,281)
11,166	MRC Global Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,434)
54,889	MRC Global Inc	Morgan Stanley	(5,308)
2,626	MRC Global Inc	Goldman Sachs	(1,156)
36,906	MSA Safety Inc	Bank of America Merrill Lynch	148,731
1,503	MSA Safety Inc	Morgan Stanley	5,155
11,268	MSC Industrial Direct Co Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(20,733)
705	MSC Industrial Direct Co Inc 'A'	Morgan Stanley	(2,045)
(265)	MSCI Inc	Bank of America Merrill Lynch	(292)
(42,490)	MSCI Inc	Morgan Stanley	(221,857)
(757)	MTS Systems Corp	Bank of America Merrill Lynch	(409)
(2,089)	Mueller Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(230)
10,000	Mueller Industries Inc	Goldman Sachs	9,875
(16,086)	Mueller Water Products Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(3,217)
(82,364)	Multi-Color Corp	Bank of America Merrill Lynch	(420,056)
87,847	Murphy Oil Corp	Morgan Stanley	(95,753)
3,091	Murphy Oil Corp	Goldman Sachs	(835)
2,657	Murphy USA Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,809)
705	Murphy USA Inc	Morgan Stanley	1,036
(1,656)	Murphy USA Inc	Morgan Stanley	(975)
2,257	Murphy USA Inc	Goldman Sachs	(4,085)
4,150	MutualFirst Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	11,413
2,138	MutualFirst Financial Inc	Goldman Sachs	5,880
1,664	MutualFirst Financial Inc	Morgan Stanley	1,498
(31,919)	Mylan NV	Morgan Stanley	11,390
(8,650)	MyoKardia Inc	Morgan Stanley	23,355
(3,647)	MyoKardia Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,553)
979	Myriad Genetics Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,839
1,828	Myriad Genetics Inc	Goldman Sachs	5,301
1,902	Myriad Genetics Inc	Morgan Stanley	2,530
9,661	Nabors Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(5,314)
(4,135)	NACCO Industries Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(8,890)
35,546	Nanometrics Inc	Bank of America Merrill Lynch	75,825
626	Nanometrics Inc	Goldman Sachs	1,670
40,673	NanoString Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	79,719
14,993	NanoString Technologies Inc	Morgan Stanley	(2,999)
73,315	NanoString Technologies Inc	Goldman Sachs	143,697
(9,813)	Napco Security Technologies Inc	Goldman Sachs	(1,472)
(56,419)	Napco Security Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,463)
(59,523)	Nasdaq Inc	Bank of America Merrill Lynch	(158,666)
3,170	Natera Inc	Bank of America Merrill Lynch	507

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
3,229	National Bank Holdings Corp 'A'	Goldman Sachs	6,329
6,078	National Bank Holdings Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	11,913
491	National Bank Holdings Corp 'A'	Morgan Stanley	241
(50,420)	National Bankshares Inc	Morgan Stanley	5,042
886	National Beverage Corp	Morgan Stanley	5,219
(1,027)	National Beverage Corp	Bank of America Merrill Lynch	(6,696)
(4,220)	National Beverage Corp	Goldman Sachs	(27,514)
(1,119)	National Commerce Corp	Morgan Stanley	(364)
(31,584)	National Fuel Gas Co	Bank of America Merrill Lynch	(41,691)
3,872	National General Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	4,022
21,658	National General Holdings Corp	Morgan Stanley	8,952
(17,972)	National Health Investors Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(76,201)
3,060	National HealthCare Corp	Bank of America Merrill Lynch	9,547
1,105	National HealthCare Corp	Goldman Sachs	3,448
395	National HealthCare Corp	Morgan Stanley	589
13,122	National Instruments Corp	Bank of America Merrill Lynch	7,604
978	National Instruments Corp	Morgan Stanley	116
5,657	National Instruments Corp	Goldman Sachs	3,200
(55,090)	National Oilwell Varco Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,371
(64,919)	National Oilwell Varco Inc	Morgan Stanley	(143,735)
3,527	National Research Corp	Goldman Sachs	1,411
10,434	National Research Corp	Morgan Stanley	8,347
1,847	National Research Corp	Bank of America Merrill Lynch	739
19,655	National Retail Properties Inc (Reit)	Goldman Sachs	44,224
88,113	National Retail Properties Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	198,254
6,399	National Retail Properties Inc (Reit)	Morgan Stanley	9,215
292,994	National Storage Affiliates Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	533,249
8,755	National Storage Affiliates Trust (Reit)	Goldman Sachs	15,934
8,482	National Storage Affiliates Trust (Reit)	Morgan Stanley	16,116
(4,912)	National Vision Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(19,844)
(34,179)	National Vision Holdings Inc	Morgan Stanley	(99,183)
83,339	Nationstar Mortgage Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,501)
(7,171)	Natural Gas Services Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,434
20,284	Natural Grocers by Vitamin Cottage Inc	Morgan Stanley	(2,434)
18,055	Natural Grocers by Vitamin Cottage Inc	Bank of America Merrill Lynch	-
17,753	Natural Grocers by Vitamin Cottage Inc	Goldman Sachs	-
6,581	Natural Health Trends Corp	Bank of America Merrill Lynch	11,912
11,560	Natural Health Trends Corp	Goldman Sachs	20,924
2,829	Natural Health Trends Corp	Morgan Stanley	4,272
(75,480)	Nature's Sunshine Products Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,774)
(9,741)	Nature's Sunshine Products Inc	Morgan Stanley	3,409
(1,266)	Natus Medical Inc	Bank of America Merrill Lynch	(275)
(15,100)	Natus Medical Inc	Morgan Stanley	(16,853)
(133,581)	Navient Corp	Bank of America Merrill Lynch	8,015
(330,551)	Navigant Consulting Inc	Bank of America Merrill Lynch	(343,773)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(26,612)	Navios Maritime Acquisition Corp	Morgan Stanley	(40)
17,157	Navistar International Corp	Morgan Stanley	(27,623)
(5,392)	Navistar International Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,887
7,760	Navistar International Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4,407)
(1,016)	NBT Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	102
(19,439)	NCR Corp	Bank of America Merrill Lynch	10,108
(6,625)	NCR Corp	Morgan Stanley	5,267
(30,278)	Nektar Therapeutics	Bank of America Merrill Lynch	5,923
4,553	Nektar Therapeutics	Morgan Stanley	5,915
(51,035)	Nelnet Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(58,305)
(10,396)	Neogen Corp	Bank of America Merrill Lynch	(36,386)
(23,989)	NeoGenomics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10,795)
(28,688)	Neos Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	15,778
(21,409)	Neos Therapeutics Inc	Morgan Stanley	5,352
1,932	NetApp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,297)
67,616	NetApp Inc	Morgan Stanley	451
(16,674)	NetApp Inc	Bank of America Merrill Lynch	9,715
(7,806)	Netflix Inc	Morgan Stanley	(180,475)
28,683	NETGEAR Inc	Bank of America Merrill Lynch	94,654
882	NETGEAR Inc	Goldman Sachs	2,911
2,167	NETGEAR Inc	Morgan Stanley	(2,492)
(37,635)	NetScout Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,999
(10,879)	NetScout Systems Inc	Morgan Stanley	3,828
(1,931)	Neurocrine Biosciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,917)
4,392	Nevro Corp	Bank of America Merrill Lynch	19,717
(4,309)	Nevro Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4,395)
(8,238)	Nevro Corp	Morgan Stanley	(56,760)
630	Nevro Corp	Morgan Stanley	4,341
(33,554)	New Jersey Resources Corp	Morgan Stanley	(18,129)
10,321	New Jersey Resources Corp	Bank of America Merrill Lynch	15,482
48,013	New Media Investment Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	11,523
4,981	New Media Investment Group Inc	Goldman Sachs	1,195
1,809	New Media Investment Group Inc	Morgan Stanley	109
49,132	New Relic Inc	Bank of America Merrill Lynch	742,876
11,306	New Relic Inc	Morgan Stanley	316,388
5,373	New Relic Inc	Goldman Sachs	81,240
(118,533)	New Senior Investment Group Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(16,180)
(77,941)	New York Community Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	29,618
(105,108)	New York Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(58,860)
(83,400)	New York Inc (Reit)	Goldman Sachs	(46,704)
(135,629)	New York Inc (Reit)	Morgan Stanley	(39,332)
(365,848)	New York Mortgage Trust Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(20,122)
(57,990)	New York Mortgage Trust Inc (Reit)	Goldman Sachs	(3,189)
(103,275)	New York Mortgage Trust Inc (Reit)	Morgan Stanley	4,647
(347,899)	New York Times Co/The 'A'	Bank of America Merrill Lynch	34,874

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(9,425)	New York Times Co/The 'A'	Morgan Stanley	1,908
(54,124)	Newell Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	120,711
1,656	Newfield Exploration Co	Bank of America Merrill Lynch	397
69,777	Newmark Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(52,333)
1,320	Newmark Group Inc 'A'	Goldman Sachs	(990)
2,875	Newmark Group Inc 'A'	Morgan Stanley	(633)
1,627	NewMarket Corp	Bank of America Merrill Lynch	36,786
(5,693)	NewMarket Corp	Morgan Stanley	(73,116)
20,191	Newmont Mining Corp	Goldman Sachs	(9,288)
196,261	Newmont Mining Corp	Morgan Stanley	176,855
137,918	Newmont Mining Corp	Bank of America Merrill Lynch	(63,379)
(53,368)	Newpark Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10,674)
(7,145)	News Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	3,715
(143,818)	News Corp 'A'	Morgan Stanley	88,905
(121,167)	News Corp 'A'	Goldman Sachs	63,189
(110,451)	News Corp 'B'	Bank of America Merrill Lynch	55,226
(35,138)	Newtek Business Services Corp	Bank of America Merrill Lynch	(46,031)
108,368	Nexa Resources SA	Goldman Sachs	(110,269)
46,622	Nexa Resources SA	Morgan Stanley	(38,230)
118,679	Nexeo Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	32,043
17,410	Nexeo Solutions Inc	Goldman Sachs	4,701
14,142	Nexeo Solutions Inc	Morgan Stanley	(2,828)
4,761	Nexstar Media Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(3,095)
14,726	Nexstar Media Group Inc 'A'	Morgan Stanley	55,514
(5,041)	Nexstar Media Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	3,277
1,691	Nexstar Media Group Inc 'A'	Goldman Sachs	(1,099)
(15,500)	NextEra Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(91,140)
66,824	NIC Inc	Bank of America Merrill Lynch	(13,365)
49,332	NIC Inc	Goldman Sachs	(9,866)
30,304	Nicholas Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,636)
(13,191)	Nicolet Bankshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	(27,437)
10,059	Nielsen Holdings Plc	Bank of America Merrill Lynch	(7,242)
(73,931)	Nielsen Holdings Plc	Morgan Stanley	84,281
(84,916)	NIKE Inc 'B'	Morgan Stanley	(407,776)
5,134	Nine Energy Service Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,414)
635	Nine Energy Service Inc	Morgan Stanley	(940)
1,863	Nine Energy Service Inc	Goldman Sachs	(1,397)
(13,521)	NiSource Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,858)
(74,284)	NiSource Inc	Morgan Stanley	(54,970)
(25,535)	NL Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(33,719)
(8,386)	NL Industries Inc	Goldman Sachs	(17,611)
1,700	nLight Inc	Bank of America Merrill Lynch	13,107
(14,511)	NMI Holdings Inc 'A'	Morgan Stanley	1,746
(99,611)	NN Inc	Bank of America Merrill Lynch	79,689
85,428	Noble Corp Plc	Bank of America Merrill Lynch	8,543

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
84,379	Noble Corp Plc	Morgan Stanley	(16,876)
2,772	Noble Corp Plc	Goldman Sachs	277
1,964	Nomad Foods Ltd	Bank of America Merrill Lynch	118
4,531	Nomad Foods Ltd	Morgan Stanley	362
246,268	Nordic American Tankers Ltd	Bank of America Merrill Lynch	107,127
95,100	Nordic American Tankers Ltd	Goldman Sachs	41,369
34,970	Nordic American Tankers Ltd	Morgan Stanley	8,917
(18,454)	Nordson Corp	Bank of America Merrill Lynch	74,370
20,085	Nordstrom Inc	Morgan Stanley	63,669
7,540	Nordstrom Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,937)
2,861	Nordstrom Inc	Goldman Sachs	(2,632)
16,692	Norfolk Southern Corp	Bank of America Merrill Lynch	45,903
13,990	Norfolk Southern Corp	Morgan Stanley	220,864
1,706	Norfolk Southern Corp	Goldman Sachs	4,692
(86,090)	Northeast Bancorp	Goldman Sachs	4,305
(2,038)	Northeast Bancorp	Morgan Stanley	1,019
(48,563)	Northeast Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	2,887
169,224	Northern Oil and Gas Inc	Bank of America Merrill Lynch	98,150
15,108	Northern Oil and Gas Inc	Morgan Stanley	2,417
17,093	Northern Trust Corp	Bank of America Merrill Lynch	(90,935)
22,365	Northern Trust Corp	Morgan Stanley	(125,649)
(109,709)	Northfield Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(50,466)
(16,502)	Northrim BanCorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(27,103)
17,013	Northrop Grumman Corp	Morgan Stanley	85,065
733	Northrop Grumman Corp	Bank of America Merrill Lynch	6,985
162	Northrop Grumman Corp	Goldman Sachs	1,544
(199,787)	NorthStar Realty Europe Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(6,794)
(10,164)	Northwest Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,387)
(22,418)	Northwest Pipe Co	Bank of America Merrill Lynch	(20,400)
70,165	NorthWestern Corp	Bank of America Merrill Lynch	79,988
22,094	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	19,443
1,817	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	Morgan Stanley	(1,072)
1,670	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	Goldman Sachs	1,470
304	Novanta Inc	Morgan Stanley	578
(20,328)	Novanta Inc	Morgan Stanley	(38,623)
11,552	Novanta Inc	Bank of America Merrill Lynch	(347)
4,920	Novocure Ltd	Bank of America Merrill Lynch	13,284
(8,382)	NOW Inc	Bank of America Merrill Lynch	9,440
4,434	NOW Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,862)
7,896	NOW Inc	Morgan Stanley	(4,896)
70,184	NRG Yield Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	4,913
31,481	NRG Yield Inc 'A'	Goldman Sachs	2,204
23,913	NRG Yield Inc 'A'	Morgan Stanley	3,826
24,427	NRG Yield Inc 'C'	Bank of America Merrill Lynch	(2,123)
23,375	NRG Yield Inc 'C'	Morgan Stanley	(1,169)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
2,332	NRG Yield Inc 'C'	Goldman Sachs	(181)
1,863	Nuance Communications Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,621
(18,604)	Nucor Corp	Morgan Stanley	(80,317)
(43,634)	Nucor Corp	Bank of America Merrill Lynch	(96,867)
5,260	Nutanix Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(12,045)
(13,008)	Nutanix Inc 'A'	Morgan Stanley	(23,705)
1,340	Nutanix Inc 'A'	Goldman Sachs	(3,069)
14,649	Nutrisystem Inc	Bank of America Merrill Lynch	55,343
46,187	Nutrisystem Inc	Morgan Stanley	114,616
(29,783)	NuVasive Inc	Bank of America Merrill Lynch	(64,033)
(700)	Nuverra Environmental Solutions Inc	Morgan Stanley	2,247
(27,636)	NV5 Global Inc	Bank of America Merrill Lynch	(158,216)
(12,126)	NVE Corp	Bank of America Merrill Lynch	(83,843)
19,091	nVent Electric PLC	Bank of America Merrill Lynch	26,545
2,578	nVent Electric PLC	Morgan Stanley	1,521
(6,020)	nVent Electric PLC	Morgan Stanley	446
957	NVIDIA Corp	Morgan Stanley	4,614
(18)	NVR Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,574)
(97)	NVR Inc	Morgan Stanley	(8,721)
31,176	NxStage Medical Inc	Bank of America Merrill Lynch	45,582
11,165	NxStage Medical Inc	Goldman Sachs	15,375
5,766	NxStage Medical Inc	Morgan Stanley	3,950
3,800	Nymox Pharmaceutical Corp	Morgan Stanley	(315)
(4,361)	O'Reilly Automotive Inc	Bank of America Merrill Lynch	11,469
(1,331)	O'Reilly Automotive Inc	Morgan Stanley	3,698
11,485	Oasis Midstream Partners LP	Morgan Stanley	(3,905)
54,275	Oasis Midstream Partners LP	Bank of America Merrill Lynch	22,796
39,638	Oasis Midstream Partners LP	Goldman Sachs	16,648
83,761	Oasis Petroleum Inc	Bank of America Merrill Lynch	86,274
28,827	Oasis Petroleum Inc	Morgan Stanley	12,972
705	Oasis Petroleum Inc	Goldman Sachs	726
8,776	Occidental Petroleum Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,457)
925	Occidental Petroleum Corp	Goldman Sachs	(259)
27,788	Occidental Petroleum Corp	Morgan Stanley	17,061
4,949	Oceaneering International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,373)
(15,854)	Oceaneering International Inc	Morgan Stanley	5,707
7,495	Oceaneering International Inc	Goldman Sachs	(3,709)
(449,439)	OceanFirst Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(925,844)
(6,305)	Ocular Therapeutix Inc	Goldman Sachs	504
(22,295)	Ocular Therapeutix Inc	Morgan Stanley	1,338
(24,066)	Ocwen Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	5,656
(186,624)	Ocwen Financial Corp	Morgan Stanley	41,990
(516,406)	Office Depot Inc	Bank of America Merrill Lynch	(28,402)
(138,505)	Office Depot Inc	Morgan Stanley	(9,214)
11,996	OFG Bancorp	Morgan Stanley	(2,444)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
2,000	OFG Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	-
16,388	OGE Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	22,732
1,766	OGE Energy Corp	Goldman Sachs	2,495
(4,320)	Ohio Valley Banc Corp	Bank of America Merrill Lynch	(9,504)
(2,605)	Ohio Valley Banc Corp	Goldman Sachs	(5,731)
(1,333)	Ohio Valley Banc Corp	Morgan Stanley	(1,000)
40,531	Okta Inc	Bank of America Merrill Lynch	327,490
10,325	Okta Inc	Goldman Sachs	83,426
5,652	Okta Inc	Morgan Stanley	45,725
(3,778)	Okta Inc	Morgan Stanley	(30,564)
(3,974)	Old Dominion Freight Line Inc	Bank of America Merrill Lynch	(52,695)
(1,112)	Old Line Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	678
(161,611)	Old Republic International Corp	Bank of America Merrill Lynch	(63,028)
(9,470)	Old Republic International Corp	Morgan Stanley	1,799
(23,302)	Olin Corp	Bank of America Merrill Lynch	699
(8,809)	Olin Corp	Morgan Stanley	7,089
(52,889)	Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(70,426)
(20,257)	Ollie's Bargain Outlet Holdings Inc	Morgan Stanley	(34,437)
(670)	Omega Flex Inc	Morgan Stanley	(771)
(91)	Omega Flex Inc	Goldman Sachs	(29)
(20,358)	Omega Flex Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,515)
(30,837)	Omega Healthcare Investors Inc (Reit)	Morgan Stanley	(41,322)
(416)	Omega Healthcare Investors Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(969)
(52,058)	Omega Healthcare Investors Inc (Reit)	Goldman Sachs	(121,295)
9,243	Omnicell Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,986
1,010	Omnicell Inc	Goldman Sachs	531
1,847	Omnicell Inc	Morgan Stanley	1,900
(3,988)	Omnicom Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	15,501
(56,688)	Omnicom Group Inc	Morgan Stanley	253,395
13,949	ON Semiconductor Corp	Morgan Stanley	21,678
62,921	ONE Gas Inc	Morgan Stanley	183,729
19,431	One Liberty Properties Inc (Reit)	Morgan Stanley	19,820
79,346	One Liberty Properties Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	122,193
22,035	One Liberty Properties Inc (Reit)	Goldman Sachs	33,934
22,126	OneMain Holdings Inc	Morgan Stanley	(40,491)
15,243	OneMain Holdings Inc	Goldman Sachs	(20,273)
30,121	OneMain Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(41,219)
(4,460)	ONEOK Inc	Morgan Stanley	(8,764)
(29,148)	Ontario Hydro Generic Resid	Bank of America Merrill Lynch	(816,144)
27,571	Ooma Inc	Bank of America Merrill Lynch	37,221
20,157	Ooma Inc	Goldman Sachs	27,212
11,714	Ooma Inc	Morgan Stanley	(1,171)
1,676	OP Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	225
2,184	OP Bancorp	Morgan Stanley	(262)
(59,655)	OPKO Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	54,286

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(42,399)	Oppenheimer Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	8,480
(41,918)	Opus Bank	Bank of America Merrill Lynch	(39,822)
(193,868)	Oracle Corp	Morgan Stanley	(118,259)
(32,999)	Oracle Corp	Bank of America Merrill Lynch	(5,283)
(92,056)	OraSure Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(105,819)
(20,772)	OraSure Technologies Inc	Morgan Stanley	(18,695)
(97,740)	ORBCOMM Inc	Bank of America Merrill Lynch	(28,767)
(2,234)	Orchid Island Capital Inc (Reit)	Goldman Sachs	(514)
47,971	Orion Engineered Carbons SA	Morgan Stanley	43,614
(42,147)	Ormat Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	29,498
(77,485)	Ormat Technologies Inc	Morgan Stanley	172,090
(13,915)	Orthofix International NV	Bank of America Merrill Lynch	(7,596)
(2,726)	Orthofix International NV	Goldman Sachs	(1,579)
27,264	Oshkosh Corp	Bank of America Merrill Lynch	(27,809)
19,851	Oshkosh Corp	Morgan Stanley	(70,029)
837	Oshkosh Corp	Goldman Sachs	(854)
116,875	OSI Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	222,062
4,184	OSI Systems Inc	Morgan Stanley	7,991
9,074	OSI Systems Inc	Goldman Sachs	17,241
21,024	Otonomy Inc	Goldman Sachs	(3,154)
7,807	Otonomy Inc	Morgan Stanley	(586)
(23,693)	Otter Tail Corp	Bank of America Merrill Lynch	(63,971)
159,660	Outfront Media Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(35,125)
878	Outfront Media Inc (Reit)	Goldman Sachs	(193)
85,791	Outfront Media Inc (Reit)	Morgan Stanley	6,392
1,553	Overstock.com Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9,551)
11,103	Overstock.com Inc	Morgan Stanley	(35,538)
14,897	Owens & Minor Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,830)
60,881	Owens & Minor Inc	Morgan Stanley	(15,829)
28,538	Owens Corning	Bank of America Merrill Lynch	(19,828)
3,049	Owens Corning	Goldman Sachs	(2,866)
16,432	Owens Corning	Morgan Stanley	(11,650)
(25,051)	Owens Realty Mortgage Inc (Reit)	Morgan Stanley	(22,546)
(4,427)	Owens Realty Mortgage Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(5,003)
(800)	Owens Realty Mortgage Inc (Reit)	Goldman Sachs	(904)
(8,723)	Owens-Illinois Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,321)
(66,217)	Owens-Illinois Inc	Morgan Stanley	15,892
46,255	Oxford Immunotec Global Plc	Bank of America Merrill Lynch	66,145
6,602	Oxford Immunotec Global Plc	Goldman Sachs	9,441
5,178	Oxford Immunotec Global Plc	Morgan Stanley	3,987
145,570	PACCAR Inc	Morgan Stanley	(395,950)
80,550	PACCAR Inc	Bank of America Merrill Lynch	(40,275)
7,052	PACCAR Inc	Goldman Sachs	(3,526)
56,895	Pacific Biosciences of California Inc	Bank of America Merrill Lynch	6,258
227,939	Pacific Ethanol Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11,397)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
84,710	Pacific Ethanol Inc	Goldman Sachs	(4,236)
43,139	Pacific Ethanol Inc	Morgan Stanley	(4,314)
8,338	Pacific Mercantile Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	2,501
10,250	Pacific Mercantile Bancorp	Goldman Sachs	3,075
1,619	Pacific Mercantile Bancorp	Morgan Stanley	243
(30,594)	Pacific Premier Bancorp Inc	Morgan Stanley	41,302
(53,994)	Pacira Pharmaceuticals Inc/DE	Bank of America Merrill Lynch	(78,291)
(8,976)	Pacira Pharmaceuticals Inc/DE	Morgan Stanley	(39,356)
27,254	Packaging Corp of America	Bank of America Merrill Lynch	(31,260)
104,683	Packaging Corp of America	Morgan Stanley	(453,568)
1,381	Packaging Corp of America	Goldman Sachs	(3,655)
(5,980)	PacWest Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	1,615
20,437	Pagseguro Digital Ltd 'A'	Goldman Sachs	51,093
141,736	Pagseguro Digital Ltd 'A'	Morgan Stanley	217,377
6,048	Palo Alto Networks Inc	Bank of America Merrill Lynch	51,798
2,345	Palo Alto Networks Inc	Morgan Stanley	3,899
708	Palo Alto Networks Inc	Goldman Sachs	6,562
(12,741)	Pandora Media Inc	Morgan Stanley	(2,470)
82,136	Pandora Media Inc	Bank of America Merrill Lynch	-
(2,898)	Panhandle Oil and Gas Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	580
(53,744)	Papa John's International Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,855
(102,300)	Papa John's International Inc	Goldman Sachs	(23,529)
(42,782)	Papa John's International Inc	Morgan Stanley	136,787
(22,772)	PAR Technology Corp	Bank of America Merrill Lynch	6,604
(3,852)	PAR Technology Corp	Goldman Sachs	1,117
136,163	Paramount Group Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	61,273
2,001	Paramount Group Inc (Reit)	Goldman Sachs	900
(18,000)	Paratek Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	25,200
(13,919)	Paratek Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	19,487
(8)	Pareteum Corp**	Morgan Stanley	-
24,474	Park Hotels & Resorts Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	45,522
1,785	Park Hotels & Resorts Inc (Reit)	Morgan Stanley	1,660
(13,539)	Park National Corp	Bank of America Merrill Lynch	(29,380)
(4,948)	Park National Corp	Morgan Stanley	(247)
(676)	Park National Corp	Goldman Sachs	(1,467)
(12,104)	Parker-Hannifin Corp	Bank of America Merrill Lynch	38,612
(1,615)	Parker-Hannifin Corp	Morgan Stanley	4,652
17,411	Parsley Energy Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(13,354)
73,654	Parsley Energy Inc 'A'	Morgan Stanley	(26,856)
2,566	Party City Holdco Inc	Bank of America Merrill Lynch	239
76,927	Party City Holdco Inc	Morgan Stanley	11,996
1,476	Patrick Industries Inc	Morgan Stanley	(517)
2,219	Patrick Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,559
4,403	Pattern Energy Group Inc	Goldman Sachs	1,805

** 0.5米ドル未満の投資は端数切捨てにより0と表示されている。

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
107,893	Pattern Energy Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	44,041
81,147	Pattern Energy Group Inc 'A'	Morgan Stanley	57,215
(1,347)	Patterson Cos Inc	Morgan Stanley	543
(7,355)	Patterson Cos Inc	Goldman Sachs	2,926
(5,285)	Patterson-UTI Energy Inc	Morgan Stanley	1,709
1,982	Patterson-UTI Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,649)
4,689	Patterson-UTI Energy Inc	Goldman Sachs	(8,392)
(11,361)	Paychex Inc	Bank of America Merrill Lynch	(15,678)
22,440	Paychex Inc	Morgan Stanley	3,565
(219)	Paycom Software Inc	Morgan Stanley	(1,198)
908	Paycom Software Inc	Morgan Stanley	990
(14,014)	Paycom Software Inc	Goldman Sachs	(67,688)
539	Paylocity Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,151
5,774	Paylocity Holding Corp	Morgan Stanley	12,356
(14,187)	PayPal Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(64,409)
(28,801)	PayPal Holdings Inc	Morgan Stanley	(49,250)
(6,385)	PBF Energy Inc 'A'	Morgan Stanley	(22,517)
4,347	PC Connection Inc	Morgan Stanley	(782)
47,572	PC Connection Inc	Bank of America Merrill Lynch	30,446
16,074	PC Connection Inc	Goldman Sachs	10,287
91,810	PC-Tel Inc	Morgan Stanley	(19,280)
(2,700)	PCM Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,215)
(3,401)	PCSB Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,632)
(24,603)	PDC Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(50,313)
(1,066)	PDC Energy Inc	Morgan Stanley	1,173
38,514	PDL BioPharma Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,926
61,366	PDL BioPharma Inc	Goldman Sachs	3,068
(52,899)	pdvWireless Inc	Bank of America Merrill Lynch	55,544
(6,327)	pdvWireless Inc	Morgan Stanley	11,389
(49,109)	Peabody Energy Corp	Morgan Stanley	(123,264)
14,719	Peabody Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	49,750
1,913	Peabody Energy Corp	Goldman Sachs	6,466
(10,238)	Peapack Gladstone Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(24,366)
(11,234)	Pebblebrook Hotel Trust (Reit)	Morgan Stanley	(15,615)
9,071	Pegasystems Inc	Morgan Stanley	25,852
(28,279)	Pegasystems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(39,502)
196	Pendrell Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,940)
155	Pendrell Corp	Goldman Sachs	(2,325)
82	Pendrell Corp	Morgan Stanley	(1,394)
(10,378)	Penn Virginia Corp	Morgan Stanley	(22,832)
(474)	Penn Virginia Corp	Goldman Sachs	(2,910)
(20,019)	Penns Woods Bancorp Inc	Morgan Stanley	(11,010)
65,265	Penske Automotive Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	28,359
64,223	Penske Automotive Group Inc	Morgan Stanley	18,625
12,798	Penske Automotive Group Inc	Goldman Sachs	4,609

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(35,897)	Pentair Plc	Morgan Stanley	755,541
(38,643)	Pentair Plc	Goldman Sachs	28,596
(2,684)	Penumbra Inc	Morgan Stanley	(14,418)
11,966	Penumbra Inc	Bank of America Merrill Lynch	132,823
(30,370)	People's United Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	9,415
103,914	People's United Financial Inc	Morgan Stanley	(22,431)
3,024	People's United Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,012)
6,442	People's Utah Bancorp	Goldman Sachs	22,869
8,530	People's Utah Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	29,773
545	People's Utah Bancorp	Morgan Stanley	954
7,509	Peoples Bancorp Inc/OH	Bank of America Merrill Lynch	1,045
761	Peoples Bancorp Inc/OH	Goldman Sachs	20
3,446	Peoples Bancorp Inc/OH	Morgan Stanley	1,472
(24,763)	Peoples Financial Services Corp	Morgan Stanley	(40,364)
47,230	PepsiCo Inc	Morgan Stanley	(7,557)
10,565	PepsiCo Inc	Bank of America Merrill Lynch	31,378
180,101	Performance Food Group Co	Bank of America Merrill Lynch	162,091
12,042	Performance Food Group Co	Morgan Stanley	9,032
(17,011)	Performance Food Group Co	Morgan Stanley	(12,758)
12,465	PerkinElmer Inc	Morgan Stanley	4,850
10,553	Perrigo Co Plc	Bank of America Merrill Lynch	(7,071)
22,102	Perrigo Co Plc	Morgan Stanley	(24,091)
2,572	Perrigo Co Plc	Goldman Sachs	(1,793)
25,703	Perry Ellis International Inc	Bank of America Merrill Lynch	40,097
4,989	Perry Ellis International Inc	Goldman Sachs	7,783
40,149	PetIQ Inc	Bank of America Merrill Lynch	5,621
35,272	PetIQ Inc	Goldman Sachs	4,938
(59,741)	Petroleo Brasileiro SA ADR	Goldman Sachs	255,990
(22,149)	Petroleo Brasileiro SA ADR	Morgan Stanley	72,981
28,659	Pfenex Inc	Goldman Sachs	(71,648)
96,867	Pfenex Inc	Bank of America Merrill Lynch	(242,168)
(280,520)	Pfizer Inc	Bank of America Merrill Lynch	(109,403)
(227,442)	Pfizer Inc	Morgan Stanley	(78,891)
(95,174)	PG&E Corp	Bank of America Merrill Lynch	9,517
186,785	PGT Innovations Inc	Bank of America Merrill Lynch	261,397
23,843	PGT Innovations Inc	Goldman Sachs	53,647
11,885	PGT Innovations Inc	Morgan Stanley	5,411
8,531	PH Glatfelter Co	Bank of America Merrill Lynch	8,275
9,824	PHI Inc 'non-voting share'	Bank of America Merrill Lynch	(7,270)
2,838	Phibro Animal Health Corp 'A'	Morgan Stanley	993
30,967	Phibro Animal Health Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	69,676
3,471	Phibro Animal Health Corp 'A'	Goldman Sachs	7,810
(39,854)	Philip Morris International Inc	Bank of America Merrill Lynch	26,304
(21,896)	Phillips 66	Bank of America Merrill Lynch	(36,785)
9,051	Physicians Realty Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	3,892

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
8,443	Physicians Realty Trust (Reit)	Morgan Stanley	5,235
(117,315)	Piedmont Office Realty Trust Inc 'A' (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(102,064)
(81,398)	Pier 1 Imports Inc	Bank of America Merrill Lynch	(21,163)
64,614	Pilgrim's Pride Corp	Bank of America Merrill Lynch	(65,826)
24,654	Pilgrim's Pride Corp	Morgan Stanley	(20,868)
4,039	Pilgrim's Pride Corp	Goldman Sachs	(4,051)
(4,417)	Pinnacle Foods Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,039)
153,976	Pinnacle West Capital Corp	Bank of America Merrill Lynch	331,048
129	Pinnacle West Capital Corp	Goldman Sachs	277
108,743	Pinnacle West Capital Corp	Morgan Stanley	292,519
179,844	Pioneer Energy Services Corp	Bank of America Merrill Lynch	53,953
76,981	Pioneer Energy Services Corp	Goldman Sachs	23,094
58,786	Pioneer Energy Services Corp	Morgan Stanley	-
(1,939)	Pioneer Natural Resources Co	Bank of America Merrill Lynch	13,302
(15,168)	Piper Jaffray Cos	Morgan Stanley	23,510
(8,659)	Piper Jaffray Cos	Bank of America Merrill Lynch	9,998
9,416	Pivotal Software Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	3,057
9,678	Pivotal Software Inc 'A'	Morgan Stanley	5,344
(26,458)	PJT Partners Inc	Bank of America Merrill Lynch	(35,983)
31,249	Plains GP Holdings LP 'A'	Morgan Stanley	6,434
42,459	Plains GP Holdings LP 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(10,419)
(1,684)	Planet Fitness Inc 'A'	Morgan Stanley	984
2,724	Planet Fitness Inc 'A'	Goldman Sachs	(1,171)
20,059	Planet Fitness Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(8,625)
(10,102)	Plantronics Inc	Morgan Stanley	(30,508)
(21,374)	Platform Specialty Products Corp	Morgan Stanley	(4,028)
56,039	Platform Specialty Products Corp	Bank of America Merrill Lynch	51,556
10,164	PlayAGS Inc	Bank of America Merrill Lynch	19,312
6,090	PlayAGS Inc	Goldman Sachs	11,571
1,083	Plexus Corp	Bank of America Merrill Lynch	667
(37,998)	Plexus Corp	Morgan Stanley	(35,583)
402	Plexus Corp	Morgan Stanley	157
601	Plexus Corp	Goldman Sachs	(234)
36,134	PNM Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	66,848
(739)	Polaris Industries Inc	Goldman Sachs	(3,540)
(2,478)	Polaris Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11,870)
(36,558)	PolarityTE Inc	Morgan Stanley	(125,736)
(9,514)	PolarityTE Inc	Bank of America Merrill Lynch	19,350
4,743	PolyOne Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,717)
3,678	PolyOne Corp	Goldman Sachs	(1,578)
1,572	PolyOne Corp	Morgan Stanley	(365)
(8,129)	Pool Corp	Morgan Stanley	33,639
(11,370)	Pool Corp	Bank of America Merrill Lynch	35,438
(8,368)	Popular Inc	Bank of America Merrill Lynch	8,870
(61,634)	Popular Inc	Morgan Stanley	97,998

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
108,621	Portland General Electric Co	Morgan Stanley	(165,546)
235,768	Portland General Electric Co	Bank of America Merrill Lynch	425,463
16,122	Portland General Electric Co	Goldman Sachs	29,720
(20,716)	Portola Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	6,629
11,330	Portola Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,626)
10,783	Portola Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(3,451)
3,473	Portola Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	278
(44,846)	Post Holdings Inc	Morgan Stanley	52,699
(228,732)	Potbelly Corp	Bank of America Merrill Lynch	(160,112)
(5,006)	Potbelly Corp	Goldman Sachs	(3,504)
69,819	Potlatch Corp (Reit)	Morgan Stanley	20,946
(86,562)	Potlatch Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(324,608)
(10,298)	Powell Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	13,698
20,961	Power Integrations Inc	Bank of America Merrill Lynch	106,901
(2,284)	Power Integrations Inc	Morgan Stanley	(3,122)
(13,869)	PPG Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	25,103
62,428	PPL Corp	Morgan Stanley	(8,116)
110,514	PPL Corp	Bank of America Merrill Lynch	(5,526)
7,171	PPL Corp	Goldman Sachs	(359)
(914)	PRA Group Inc	Goldman Sachs	(686)
(5,726)	PRA Group Inc	Morgan Stanley	2,863
(5,034)	PRA Health Sciences Inc	Morgan Stanley	(5,550)
(101,161)	Precision Drilling Corp	Morgan Stanley	43,807
8,363	Preferred Bank/ Los Angeles CA	Bank of America Merrill Lynch	4,037
3,224	Preferred Bank/ Los Angeles CA	Goldman Sachs	3,031
9,464	Preferred Bank/ Los Angeles CA	Morgan Stanley	(320)
(79,133)	Premier Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(50,645)
(94,930)	Presidio Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,797)
(55,645)	Presidio Inc	Morgan Stanley	(2,782)
3,580	Prestige Brands Holdings Inc	Morgan Stanley	3,795
7,086	Prestige Brands Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,551)
113,683	PRGX Global Inc	Morgan Stanley	39,789
(77,770)	PriceSmart Inc	Bank of America Merrill Lynch	(384,962)
(38,144)	PriceSmart Inc	Morgan Stanley	(129,690)
(20,757)	Primerica Inc	Bank of America Merrill Lynch	(77,839)
(402)	Primerica Inc	Goldman Sachs	(1,508)
(6,984)	Primerica Inc	Morgan Stanley	2,485
83,717	Primo Water Corp	Morgan Stanley	161,574
17,494	Principal Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(60,879)
4,860	Principal Financial Group Inc	Goldman Sachs	(16,913)
72,252	Principal Financial Group Inc	Morgan Stanley	(173,783)
(97,728)	ProAssurance Corp	Bank of America Merrill Lynch	111,920
(156,460)	Procter & Gamble Co/The	Bank of America Merrill Lynch	(126,733)
(33,773)	Procter & Gamble Co/The	Morgan Stanley	9,288
34,153	Progress Software Corp	Bank of America Merrill Lynch	18,443

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
17,563	Progress Software Corp	Goldman Sachs	9,484
92,945	Progress Software Corp	Morgan Stanley	(350,696)
11,326	Progressive Corp/The	Bank of America Merrill Lynch	6,796
310	Progressive Corp/The	Goldman Sachs	186
139,528	Prologis Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	55,490
137,623	Prologis Inc (Reit)	Morgan Stanley	98,915
8,687	Prologis Inc (Reit)	Goldman Sachs	3,627
1,292	Proofpoint Inc	Morgan Stanley	(478)
(21,636)	Proofpoint Inc	Bank of America Merrill Lynch	101,906
147,729	ProPetro Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	(242,276)
(7,851)	ProPetro Holding Corp	Morgan Stanley	15,928
(18,150)	PROS Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(44,480)
6,217	Prosperity Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,952)
7,259	Prosperity Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,811
3,923	Prosperity Bancshares Inc	Goldman Sachs	2,872
5,248	Prosperity Bancshares Inc	Morgan Stanley	5,038
(41,606)	Proteostasis Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(2,496)
(5,275)	Proto Labs Inc	Bank of America Merrill Lynch	(29,013)
(3,135)	Providence Service Corp/The	Bank of America Merrill Lynch	(1,129)
21,726	Prudential Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(83,211)
63,870	Prudential Financial Inc	Morgan Stanley	(335,318)
76,965	PS Business Parks Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	404,066
(9,064)	PS Business Parks Inc (Reit)	Morgan Stanley	(52,220)
(24,742)	PTC Inc	Bank of America Merrill Lynch	(41,319)
(424)	PTC Inc	Morgan Stanley	(655)
(76,018)	Public Service Enterprise Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(151,727)
(6,922)	Public Service Enterprise Group Inc	Morgan Stanley	(250)
(14,990)	Public Storage (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(91,589)
(77,164)	PulteGroup Inc	Bank of America Merrill Lynch	(69,448)
(3,110)	PulteGroup Inc	Goldman Sachs	(2,799)
4,250	Puma Biotechnology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,265)
2,387	Puma Biotechnology Inc	Morgan Stanley	2,387
844	Puma Biotechnology Inc	Goldman Sachs	(1,730)
148,734	Pure Storage Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(237,974)
9,062	Pure Storage Inc 'A'	Goldman Sachs	(14,499)
3,554	PVH Corp	Bank of America Merrill Lynch	16,064
9,926	PVH Corp	Morgan Stanley	56,382
(5,100)	Q2 Holdings Inc	Morgan Stanley	(2,805)
1,206	QAD Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	2,894
632	QAD Inc 'A'	Goldman Sachs	1,517
417	QAD Inc 'A'	Morgan Stanley	1,376
63,557	QCR Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	57,201
12,242	QCR Holdings Inc	Goldman Sachs	11,018
9,999	QCR Holdings Inc	Morgan Stanley	(2,000)
(79,721)	QEP Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	48,630

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(116,788)	QEP Resources Inc	Morgan Stanley	92,263
(19,994)	QIAGEN NV	Morgan Stanley	(58,908)
(29,101)	Qorvo Inc	Bank of America Merrill Lynch	(22,600)
(24,981)	Qorvo Inc	Morgan Stanley	(129,234)
(7,189)	QTS Realty Trust Inc 'A'(Reit)	Morgan Stanley	1,457
8,092	QTS Realty Trust Inc 'A'(Reit)	Bank of America Merrill Lynch	22,577
(2,280)	Quaker Chemical Corp	Bank of America Merrill Lynch	559
(10,220)	Quaker Chemical Corp	Morgan Stanley	4,701
(4,590)	Qualcomm Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10,787)
(15,663)	Qualys Inc	Bank of America Merrill Lynch	(33,062)
(273,391)	Quanex Building Products Corp	Bank of America Merrill Lynch	(13,670)
11,152	Quanta Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,134)
5,043	Quanta Services Inc	Goldman Sachs	(2,675)
38,713	Quest Diagnostics Inc	Bank of America Merrill Lynch	222,600
30,736	Quest Diagnostics Inc	Morgan Stanley	185,645
3,632	Quidel Corp	Morgan Stanley	2,445
62,905	QuinStreet Inc	Morgan Stanley	50,953
(5,919)	Quorum Health Corp	Bank of America Merrill Lynch	3,078
(2,893)	Quotient Ltd	Goldman Sachs	4
9,353	Quotient Technology Inc	Goldman Sachs	(701)
1,300	Quotient Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(98)
(14,981)	Quotient Technology Inc	Morgan Stanley	1,124
(12,255)	Qurate Retail Inc	Morgan Stanley	17,280
(14,875)	Qurate Retail Inc	Bank of America Merrill Lynch	20,310
(104,819)	R1 RCM Inc	Bank of America Merrill Lynch	31,446
(132,322)	R1 RCM Inc	Morgan Stanley	1,323
(51,291)	R1 RCM Inc	Goldman Sachs	15,387
17,530	Ra Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	8,590
23,530	Ra Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	17,191
32,849	Ra Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	16,096
14,171	Radian Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,559
18,010	Radian Group Inc	Goldman Sachs	(1,228)
293,076	Radiant Logistics Inc	Bank of America Merrill Lynch	111,369
56,921	Radiant Logistics Inc	Morgan Stanley	2,277
8,526	Radiant Logistics Inc	Goldman Sachs	3,240
20,851	Radiant Logistics Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,625
1,354	Radiant Logistics Inc	Goldman Sachs	101
17,533	Rafael Holdings Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	11,572
2,465	Rafael Holdings Inc 'B'	Goldman Sachs	1,627
(8,979)	Ralph Lauren Corp	Bank of America Merrill Lynch	(126,397)
(824)	Ralph Lauren Corp	Morgan Stanley	(838)
5,901	Rambus Inc	Morgan Stanley	1,593
(91,558)	Rambus Inc	Morgan Stanley	(24,721)
17,843	Rambus Inc	Bank of America Merrill Lynch	6,186
(12,540)	Ramco-Gershenson Properties Trust (Reit)	Morgan Stanley	(6,270)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
40,608	Range Resources Corp	Bank of America Merrill Lynch	40,608
2,409	Range Resources Corp	Goldman Sachs	2,409
(71,842)	Range Resources Corp	Morgan Stanley	(92,464)
21,458	Rapid7 Inc	Bank of America Merrill Lynch	31,114
1,779	Rapid7 Inc	Goldman Sachs	2,580
47,758	Raymond James Financial Inc	Morgan Stanley	204,480
16,323	Raymond James Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	44,235
1,149	Raymond James Financial Inc	Goldman Sachs	3,114
22,133	Rayonier Advanced Materials Inc	Bank of America Merrill Lynch	(26,117)
817	Rayonier Advanced Materials Inc	Goldman Sachs	(964)
(95,062)	Rayonier Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(172,062)
12,413	Raytheon Co	Morgan Stanley	20,625
21,783	Raytheon Co	Bank of America Merrill Lynch	50,126
1,072	RBB Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	751
(22,803)	RBC Bearings Inc	Morgan Stanley	(74,794)
(24,529)	RCI Hospitality Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(35,567)
(4,426)	RCI Hospitality Holdings Inc	Morgan Stanley	(3,142)
(28,293)	Reading International Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,208
19,603	Real Industry Inc	Bank of America Merrill Lynch	-
17,468	Real Industry Inc	Morgan Stanley	-
38,856	RealNetworks Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,166
13,241	RealNetworks Inc	Goldman Sachs	397
14,680	RealNetworks Inc	Morgan Stanley	147
(24,532)	Realogy Holdings Corp	Morgan Stanley	8,965
(26,694)	Realogy Holdings Corp	Goldman Sachs	7,683
(24,541)	RealPage Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,135)
5,499	RealPage Inc	Morgan Stanley	(1,077)
1,595	Realty Income Corp (Reit)	Morgan Stanley	1,436
2,355	Realty Income Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	3,438
2,355	Realty Income Corp (Reit)	Goldman Sachs	3,438
2,545	Reata Pharmaceuticals Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	10,689
2,633	Reata Pharmaceuticals Inc 'A'	Goldman Sachs	11,059
(10,614)	Red Lion Hotels Corp	Morgan Stanley	(7,961)
(136,612)	Red Lion Hotels Corp	Bank of America Merrill Lynch	(136,612)
(51,890)	Red Rock Resorts Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(16,086)
(18,475)	Redfin Corp	Bank of America Merrill Lynch	(18,622)
(2,924)	Redfin Corp	Morgan Stanley	(1,023)
(8,338)	Redfin Corp	Goldman Sachs	(4,147)
6,975	Regal Beloit Corp	Bank of America Merrill Lynch	8,370
454	Regal Beloit Corp	Morgan Stanley	74
(11,876)	Regency Centers Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(20,427)
59,876	Regency Centers Corp (Reit)	Morgan Stanley	65,063
1,259	Regency Centers Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	304
8,468	Regeneron Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	28,430
513	Regeneron Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	2,125

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
82	Regeneron Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	785
2,764	REGENXBIO Inc	Bank of America Merrill Lynch	9,536
2,859	REGENXBIO Inc	Goldman Sachs	9,864
596	REGENXBIO Inc	Morgan Stanley	4,470
34,230	Regions Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(39,365)
(104,897)	Regis Corp	Bank of America Merrill Lynch	(123,778)
(19,034)	Reis Inc	Bank of America Merrill Lynch	(30,454)
32,733	Reliance Steel & Aluminum Co	Bank of America Merrill Lynch	86,511
8,900	Reliance Steel & Aluminum Co	Goldman Sachs	24,436
38,638	Reliance Steel & Aluminum Co	Morgan Stanley	31,297
(21,799)	Renasant Corp	Bank of America Merrill Lynch	(28,993)
(11,314)	Rent-A-Center Inc/TX	Bank of America Merrill Lynch	6,449
(35,466)	Rent-A-Center Inc/TX	Morgan Stanley	21,989
(29,185)	Rent-A-Center Inc/TX	Goldman Sachs	16,635
(18,799)	Rentech Inc	Morgan Stanley	-
(38,242)	Repligen Corp	Bank of America Merrill Lynch	(65,030)
88,700	Republic Bancorp Inc/KY 'A'	Bank of America Merrill Lynch	49,294
6,886	Republic Bancorp Inc/KY 'A'	Goldman Sachs	3,448
12,153	Republic Bancorp Inc/KY 'A'	Morgan Stanley	(4,010)
11,757	Republic First Bancorp Inc	Goldman Sachs	(4,115)
1,801	Republic Services Inc	Goldman Sachs	1,603
74,450	Republic Services Inc	Morgan Stanley	55,045
104,238	Republic Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	92,772
(30,022)	Research Frontiers Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,453
(129,742)	Research Frontiers Inc	Morgan Stanley	5,190
(5,099)	ResMed Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9,994)
(17,570)	ResMed Inc	Morgan Stanley	(19,327)
(9,480)	Resolute Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	(16,685)
(11,704)	Resolute Energy Corp	Goldman Sachs	(20,599)
169,975	Retail Opportunity Investments Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	178,687
45,231	Retail Opportunity Investments Corp (Reit)	Morgan Stanley	17,188
(163,808)	Retail Properties of America Inc 'A' (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(144,550)
(389,061)	Retail Properties of America Inc 'A' (Reit)	Morgan Stanley	(198,421)
48,696	Retrophin Inc	Bank of America Merrill Lynch	92,522
3,235	Retrophin Inc	Morgan Stanley	388
(19,335)	REV Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	7,541
8,733	REV Group Inc	Morgan Stanley	(2,606)
39,859	Revance Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(68,885)
5,870	Revance Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(11,976)
16,326	Revance Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(43,264)
(10,321)	Revlon Inc 'A'	Goldman Sachs	10,357
(51,758)	Revolution Lighting Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(39,854)
6,074	REX American Resources Corp	Bank of America Merrill Lynch	13,737
402	REX American Resources Corp	Goldman Sachs	357

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
2,250	REX American Resources Corp	Morgan Stanley	704
16,136	Rexford Industrial Realty Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	5,246
3,397	Rexford Industrial Realty Inc (Reit)	Morgan Stanley	2,208
1,558	Rexford Industrial Realty Inc (Reit)	Goldman Sachs	318
16,181	Rexnord Corp	Morgan Stanley	3,398
(58,424)	Rexnord Corp	Morgan Stanley	(12,440)
249,948	Rexnord Corp	Bank of America Merrill Lynch	124,974
9,824	Rexnord Corp	Goldman Sachs	4,912
9,484	RH	Bank of America Merrill Lynch	(6,849)
3,687	RH	Morgan Stanley	(4,787)
(51,691)	Rhythmone Plc	Bank of America Merrill Lynch	5,753
67,061	Ribbon Communications Inc	Bank of America Merrill Lynch	31,519
35,612	Ribbon Communications Inc	Goldman Sachs	17,219
24,397	Ribbon Communications Inc	Morgan Stanley	13,697
(9,019)	RigNet Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,960
5,948	RingCentral Inc 'A'	Goldman Sachs	11,618
25,768	RingCentral Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	39,132
20,861	RingCentral Inc 'A'	Morgan Stanley	61,941
217,444	Riverview Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	67,635
38,996	Riverview Bancorp Inc	Goldman Sachs	13,259
91,883	Riverview Bancorp Inc	Morgan Stanley	96,481
1,025	RLI Corp/DE	Bank of America Merrill Lynch	(730)
30,110	RLI Corp/DE	Morgan Stanley	(36,867)
(266,591)	RLJ Lodging Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(597,164)
(98,589)	RLJ Lodging Trust (Reit)	Morgan Stanley	(113,377)
(58,905)	RMR Group Inc/The 'A'	Bank of America Merrill Lynch	46,403
20,363	Robert Half International Inc	Bank of America Merrill Lynch	24,639
831	Robert Half International Inc	Morgan Stanley	(382)
8,873	Rockwell Automation Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,372)
1,171	Rocky Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	228
(35,529)	Rogers Corp	Bank of America Merrill Lynch	31,096
(7,962)	Rogers Corp	Morgan Stanley	(2,294)
5,198	Roku Inc	Bank of America Merrill Lynch	18,713
3,849	Roku Inc	Morgan Stanley	14,010
1,750	Roper Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,535)
602	Roper Technologies Inc	Goldman Sachs	(1,216)
13,054	Ross Stores Inc	Bank of America Merrill Lynch	(43,209)
(53,123)	Rowan Cos Plc 'A'	Goldman Sachs	65,873
17,399	Rowan Cos Plc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(21,575)
1,761	Royal Caribbean Cruises Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,008)
84,367	Royal Caribbean Cruises Ltd	Morgan Stanley	(164,568)
(2,064)	Royal Gold Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,539)
(16,499)	Royal Gold Inc	Morgan Stanley	(104,311)
8,638	RPC Inc	Bank of America Merrill Lynch	(20,731)
43,317	RPC Inc	Morgan Stanley	(81,003)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
24,970	RPM International Inc	Bank of America Merrill Lynch	5,244
2,166	RPM International Inc	Goldman Sachs	(687)
81,525	RPX Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,853
63,791	RR Donnelley & Sons Co	Bank of America Merrill Lynch	2,233
27,749	RTI Surgical Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,775
56,789	RTI Surgical Inc	Morgan Stanley	8,518
11,685	Rubicon Project Inc/The	Morgan Stanley	467
29,968	Rubicon Project Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	7,192
15,096	Rubicon Project Inc/The	Goldman Sachs	3,623
(15,293)	Rubicon Technology Inc	Morgan Stanley	(3,517)
(7,815)	Rush Enterprises Inc 'A'	Morgan Stanley	11,371
39,844	Rush Enterprises Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,395)
17,648	Rush Enterprises Inc 'A'	Goldman Sachs	(618)
14,743	Rush Enterprises Inc 'A'	Morgan Stanley	(21,451)
54,059	Ruth's Hospitality Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,109)
30,703	Ryder System Inc	Bank of America Merrill Lynch	7,369
1,414	Ryder System Inc	Goldman Sachs	339
3,713	Ryerson Holding Corp	Morgan Stanley	2,042
(3,807)	Ryman Hospitality Properties Inc (Reit)	Morgan Stanley	(16,998)
24,033	Ryman Hospitality Properties Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	69,455
14,402	S&P Global Inc	Bank of America Merrill Lynch	7,777
5,033	S&P Global Inc	Morgan Stanley	48,857
(102,606)	S&T Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(137,521)
(158,920)	Sabra Health Care Inc (Reit)	Morgan Stanley	(177,990)
(313,937)	Sabra Health Care Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(266,846)
(354)	Sabra Health Care Inc (Reit)	Goldman Sachs	(301)
(50,899)	Sabre Corp	Bank of America Merrill Lynch	(25,450)
(73,885)	Safeguard Scientifics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(881)
(27,799)	Saga Communications Inc 'A'	Morgan Stanley	(13,900)
(3,929)	Sage Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	64,396
(6,464)	Saia Inc	Bank of America Merrill Lynch	(56,237)
(2,201)	SailPoint Technologies Holding Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,163)
(70,622)	Sally Beauty Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	11,425
(56,467)	Sally Beauty Holdings Inc	Morgan Stanley	3,309
(21,294)	Sanchez Energy Corp	Morgan Stanley	(219)
(6,691)	Sanderson Farms Inc	Goldman Sachs	82,165
(1,603)	Sanderson Farms Inc	Bank of America Merrill Lynch	19,685
(469)	Sanderson Farms Inc	Morgan Stanley	1,466
68,479	Sandy Spring Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	73,957
30,054	Sandy Spring Bancorp Inc	Goldman Sachs	32,458
12,442	Sandy Spring Bancorp Inc	Morgan Stanley	(1,120)
7,482	Sanmina Corp	Bank of America Merrill Lynch	(748)
5,844	Sanmina Corp	Goldman Sachs	(584)
19,605	Sanmina Corp	Morgan Stanley	1,961
8,175	Santander Consumer USA Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(14,674)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(17,798)	Sarepta Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(79,735)
(3,839)	Sarepta Therapeutics Inc	Goldman Sachs	(17,199)
(3,167)	Sarepta Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(25,114)
(26,848)	SBA Communications Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(26,546)
(31,082)	SBA Communications Corp (Reit)	Morgan Stanley	(39,732)
14,258	ScanSource Inc	Morgan Stanley	19,248
58,553	ScanSource Inc	Bank of America Merrill Lynch	187,370
19,602	ScanSource Inc	Goldman Sachs	62,726
5,222	Schlumberger Ltd	Morgan Stanley	(3,072)
(55,940)	Schlumberger Ltd	Bank of America Merrill Lynch	168,185
(9,100)	Schneider National Inc ' B '	Morgan Stanley	(8,736)
77,438	Schnitzer Steel Industries Inc ' A '	Bank of America Merrill Lynch	7,744
25,269	Schnitzer Steel Industries Inc ' A '	Goldman Sachs	2,527
(73,854)	Scholastic Corp	Bank of America Merrill Lynch	(179,823)
29,651	Schweitzer-Mauduit International Inc	Bank of America Merrill Lynch	34,988
5,271	Schweitzer-Mauduit International Inc	Goldman Sachs	6,220
(41,870)	Schweitzer-Mauduit International Inc	Morgan Stanley	29,309
(62,583)	Science Applications International Corp	Bank of America Merrill Lynch	81,984
(49,362)	Scientific Games Corp/DE ' A '	Bank of America Merrill Lynch	(15,664)
(1,081)	Scientific Games Corp/DE ' A '	Morgan Stanley	973
13,315	Scorpio Bulkers Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,995)
3,691	Scorpio Bulkers Inc	Goldman Sachs	(1,107)
17,803	Scorpio Tankers Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,047
(24,717)	Scotts Miracle-Gro Co/The	Bank of America Merrill Lynch	(54,872)
(20,868)	Scotts Miracle-Gro Co/The	Morgan Stanley	10,643
(586)	Seaboard Corp	Bank of America Merrill Lynch	(116,941)
(16,829)	Seachange International Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,851
21,055	Seacoast Banking Corp of Florida	Bank of America Merrill Lynch	32,635
(68,564)	Seacoast Banking Corp of Florida	Morgan Stanley	22,810
(12,090)	SEACOR Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,770)
(15,091)	Seagate Technology Plc	Goldman Sachs	(6,942)
(42,214)	Seagate Technology Plc	Morgan Stanley	(9,287)
(157,049)	Sealed Air Corp	Bank of America Merrill Lynch	(134,640)
17,432	Sears Hometown and Outlet Stores Inc	Bank of America Merrill Lynch	12,202
33,246	Sears Hometown and Outlet Stores Inc	Morgan Stanley	6,649
1,684	SeaSpine Holdings Corp	Morgan Stanley	(152)
35,957	SeaSpine Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(25,170)
(14,213)	SecureWorks Corp ' A '	Morgan Stanley	3,980
(98,890)	Select Income (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(140,424)
23,444	Select Income (Reit)	Morgan Stanley	21,100
4,127	Select Income REIT (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	6,091
538	Selective Insurance Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	407
3,982	Selective Insurance Group Inc	Morgan Stanley	2,484
(20,379)	Selective Insurance Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(32,606)
12,893	SemGroup Corp ' A '	Bank of America Merrill Lynch	6,876

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
47,424	SemGroup Corp 'A'	Morgan Stanley	81,177
(49,970)	Sempra Energy	Bank of America Merrill Lynch	(27,983)
(11,709)	Sempra Energy	Morgan Stanley	1,580
6,886	SendGrid Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,407
5,570	SendGrid Inc	Goldman Sachs	3,565
5,286	SendGrid Inc	Morgan Stanley	2,062
(13,352)	Senior Housing Properties Trust (Reit)	Goldman Sachs	(20,562)
(181,179)	Senior Housing Properties Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(279,016)
(54,926)	Senior Housing Properties Trust (Reit)	Morgan Stanley	(58,222)
4,666	Sensata Technologies Holding Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2,311)
11,393	Sensata Technologies Holding Plc	Morgan Stanley	(8,254)
(12,099)	Sensata Technologies Holding Plc	Goldman Sachs	6,412
(117,152)	Sequential Brands Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(52,718)
11,202	Seres Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,576
13,162	Seres Therapeutics Inc	Goldman Sachs	1,984
5,132	Seres Therapeutics Inc	Morgan Stanley	(458)
(78,785)	Seritage Growth Properties 'A' (Reit)	Goldman Sachs	(372,686)
(10,059)	Seritage Growth Properties 'A' (Reit)	Morgan Stanley	(12,272)
(12,483)	Seritage Growth Properties 'A' (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(8,884)
3,227	Service Corp International/US	Bank of America Merrill Lynch	(258)
105,806	Service Corp International/US	Morgan Stanley	(40,206)
(36,818)	Service Corp International/US	Bank of America Merrill Lynch	2,945
13,609	ServiceMaster Global Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11,159)
17,596	ServiceMaster Global Holdings Inc	Morgan Stanley	(1,760)
(153)	ServiceNow Inc	Bank of America Merrill Lynch	(938)
17,157	ServiceSource International Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,976
15,707	ServiceSource International Inc	Morgan Stanley	785
12,553	ServiceSource International Inc	Goldman Sachs	3,640
(429)	ServisFirst Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	124
(134,460)	Shenandoah Telecommunications Co	Bank of America Merrill Lynch	(118,839)
(23,853)	Shenandoah Telecommunications Co	Morgan Stanley	(8,349)
(19,906)	Sherwin-Williams Co/The	Bank of America Merrill Lynch	(127,398)
(16,944)	Sherwin-Williams Co/The	Morgan Stanley	(168,648)
(68,524)	Ship Finance International Ltd	Morgan Stanley	3,426
(2,117)	Ship Finance International Ltd	Goldman Sachs	423
62,610	Ship Finance International Ltd	Morgan Stanley	(3,409)
2,612	Shoe Carnival Inc	Bank of America Merrill Lynch	8,440
1,041	Shoe Carnival Inc	Morgan Stanley	(200)
(7,912)	ShotSpotter Inc	Morgan Stanley	(6,883)
1,593	Shutterfly Inc	Morgan Stanley	(906)
12,955	Shutterstock Inc	Bank of America Merrill Lynch	25,133
(6,027)	Shutterstock Inc	Morgan Stanley	(4,339)
2,620	SI Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,441
932	SI Financial Group Inc	Goldman Sachs	513
107	SI Financial Group Inc	Morgan Stanley	11

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(52,091)	Sientra Inc	Bank of America Merrill Lynch	(76,053)
51,029	Sierra Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	16,840
71,247	Sierra Bancorp	Morgan Stanley	(25,649)
(85)	Signature Bank/New York NY	Bank of America Merrill Lynch	337
(27,741)	Signet Jewelers Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(105,384)
(19,713)	Signet Jewelers Ltd	Morgan Stanley	(66,039)
(389)	Signet Jewelers Ltd	Goldman Sachs	(1,953)
(33,154)	Silgan Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(13,925)
(66,374)	Silgan Holdings Inc	Morgan Stanley	5,974
(5,188)	Silicon Laboratories Inc	Bank of America Merrill Lynch	(22,308)
(27,347)	Silicon Laboratories Inc	Morgan Stanley	(272,233)
3,254	Silvercrest Asset Management Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	2,374
2,843	Silvercrest Asset Management Group Inc 'A'	Goldman Sachs	1,457
5,394	Silvercrest Asset Management Group Inc 'A'	Morgan Stanley	4,025
(224,823)	Simmons First National Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(281,029)
(100,776)	Simmons First National Corp 'A'	Morgan Stanley	(84,561)
25,292	Simon Property Group Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	153,775
4,507	SINA Corp/China	Morgan Stanley	(6,763)
(18,565)	Sinclair Broadcast Group Inc 'A'	Morgan Stanley	45,484
67,322	Sinclair Broadcast Group Inc 'A'	Morgan Stanley	(164,939)
(308,762)	Sirius XM Holdings Inc	Morgan Stanley	(58,665)
(156,259)	Sirius XM Holdings Inc	Goldman Sachs	(40,627)
(67,424)	SiteOne Landscape Supply Inc	Bank of America Merrill Lynch	188,264
(26,434)	SiteOne Landscape Supply Inc	Morgan Stanley	64,235
(14,402)	SITO Mobile Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,872
(66,470)	SITO Mobile Ltd	Goldman Sachs	8,641
(3,478)	Six Flags Entertainment Corp	Bank of America Merrill Lynch	(6,678)
(54,608)	Six Flags Entertainment Corp	Morgan Stanley	(61,204)
30,162	SJW Group	Bank of America Merrill Lynch	141,158
1,129	SJW Group	Goldman Sachs	5,284
2,206	SJW Group	Morgan Stanley	6,750
47,882	Skechers U.S.A. Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	11,013
18,686	Skechers U.S.A. Inc 'A'	Goldman Sachs	4,298
(10,316)	Skyline Corp	Bank of America Merrill Lynch	(25,481)
(31,751)	Skyline Corp	Goldman Sachs	(77,528)
(1,823)	Skyline Corp	Morgan Stanley	(3,318)
15,483	Skyworks Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	20,438
6,225	Skyworks Solutions Inc	Goldman Sachs	8,217
(18,453)	SL Green Realty Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(8,304)
(51,385)	Sleep Number Corp	Bank of America Merrill Lynch	14,902
(1,564)	Sleep Number Corp	Morgan Stanley	657
(249,760)	SLM Corp	Bank of America Merrill Lynch	23,727
12,111	SM Energy Co	Bank of America Merrill Lynch	14,291

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
2,896	SM Energy Co	Goldman Sachs	3,312
8,758	SM Energy Co	Morgan Stanley	(2,190)
379,815	Smart & Final Stores Inc	Bank of America Merrill Lynch	(25,261)
58,611	Smart & Final Stores Inc	Goldman Sachs	(4,396)
46,680	Smart & Final Stores Inc	Morgan Stanley	1,167
(33,406)	SMART Global Holdings Inc	Goldman Sachs	(21,120)
(17,823)	SMART Global Holdings Inc	Morgan Stanley	(11,407)
33,721	SmartFinancial Inc	Bank of America Merrill Lynch	5,725
20,197	SmartFinancial Inc	Goldman Sachs	3,837
19,938	SmartFinancial Inc	Morgan Stanley	(18,742)
145,362	Snap Inc 'A'	Morgan Stanley	93,032
43,726	Snap Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	31,438
15,561	Snap Inc 'A'	Goldman Sachs	11,360
43,645	Snap-on Inc	Morgan Stanley	(192,474)
3,476	Snap-on Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,870)
415	Snap-on Inc	Goldman Sachs	(2,166)
(18,064)	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA ADR	Goldman Sachs	103,145
(14,125)	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA ADR	Morgan Stanley	35,415
10,557	Sohu.com Inc	Morgan Stanley	3,378
704	Sohu.com Inc	Bank of America Merrill Lynch	(592)
1,386	Solaris Oilfield Infrastructure Inc 'A'	Goldman Sachs	(292)
93,834	Sonic Automotive Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	115,672
39,966	Sonic Automotive Inc 'A'	Goldman Sachs	48,140
23,158	Sonic Automotive Inc 'A'	Morgan Stanley	10,421
(31,134)	Sonic Corp	Bank of America Merrill Lynch	7,472
(260,601)	Sonic Corp	Goldman Sachs	62,544
7,999	Sonoco Products Co	Bank of America Merrill Lynch	5,519
7,226	Sonoco Products Co	Goldman Sachs	4,986
52,549	Sonoco Products Co	Morgan Stanley	4,255
15,133	Sotheby's	Bank of America Merrill Lynch	(19,219)
27,673	Sotheby's	Morgan Stanley	(3,874)
1,496	Sotheby's	Goldman Sachs	(1,900)
(118,588)	South Jersey Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(83,012)
(55,692)	South Jersey Industries Inc	Morgan Stanley	(186,903)
(11,778)	South Jersey Industries Inc	Goldman Sachs	(8,245)
58,283	South State Corp	Bank of America Merrill Lynch	96,167
(112,995)	Southern Co/The	Bank of America Merrill Lynch	(46,328)
(135,047)	Southern Co/The	Morgan Stanley	91,609
(35,634)	Southern Copper Corp	Bank of America Merrill Lynch	70,199
(58,556)	Southern Copper Corp	Goldman Sachs	114,084
(33,821)	Southern Copper Corp	Morgan Stanley	66,992
414	Southern First Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	(123)
(6,029)	Southern National Bancorp of Virginia Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,667)
(2,675)	Southern National Bancorp of Virginia Inc	Goldman Sachs	(2,515)
29,256	Southwest Airlines Co	Bank of America Merrill Lynch	(17,953)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
111,101	Southwest Airlines Co	Morgan Stanley	(129,669)
5,806	Southwest Airlines Co	Goldman Sachs	(3,600)
549	Southwest Gas Holdings Inc	Morgan Stanley	15
12,621	Southwest Gas Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	42,154
(27,758)	Southwestern Energy Co	Morgan Stanley	298
77,751	Southwestern Energy Co	Bank of America Merrill Lynch	13,995
(801)	Spark Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,316)
1,979	SpartanNash Co	Bank of America Merrill Lynch	9,931
200	SpartanNash Co	Morgan Stanley	681
(56,367)	Spectrum Brands Holdings Inc	Morgan Stanley	(274,962)
3,927	Spectrum Brands Holdings Inc	Goldman Sachs	7,304
(1,211)	Spire Inc	Morgan Stanley	(1,695)
(6,925)	Spire Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,925)
40,855	Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A'	Morgan Stanley	191,205
(7,098)	Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(9,298)
2,512	Spirit Airlines Inc	Morgan Stanley	301
(322,439)	Spirit Realty Capital Inc (Reit)	Morgan Stanley	(49,978)
(518,685)	Spirit Realty Capital Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(236,002)
12,398	Splunk Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9,918)
1,960	Splunk Inc	Goldman Sachs	(1,568)
27,567	Splunk Inc	Morgan Stanley	(57,339)
31,722	Spotify Technology SA	Morgan Stanley	100,140
255,582	Sprint Corp	Bank of America Merrill Lynch	5,112
1,086,407	Sprint Corp	Morgan Stanley	(38,442)
1,680	Sprouts Farmers Market Inc	Bank of America Merrill Lynch	(50)
2,478	Sprouts Farmers Market Inc	Goldman Sachs	(74)
66,495	Sprouts Farmers Market Inc	Morgan Stanley	5,985
8,005	SPS Commerce Inc	Bank of America Merrill Lynch	33,249
5,776	SPS Commerce Inc	Morgan Stanley	12,848
(13,794)	SPX Corp	Bank of America Merrill Lynch	(910)
(39,694)	SPX Corp	Morgan Stanley	17,068
(753)	SPX Flow Inc	Morgan Stanley	(42)
1,599	Square Inc 'A'	Morgan Stanley	6,604
21,692	Square Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	89,154
783	Square Inc 'A'	Goldman Sachs	3,218
(4,919)	Square Inc 'A'	Morgan Stanley	(16,067)
(102,140)	SRC Energy Inc	Morgan Stanley	(35,749)
43,645	SS&C Technologies Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	77,252
25,862	STAAR Surgical Co	Bank of America Merrill Lynch	133,189
1,165	STAAR Surgical Co	Goldman Sachs	6,000
9,818	STAAR Surgical Co	Morgan Stanley	26,018
42,130	STAG Industrial Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	41,709
15,180	STAG Industrial Inc (Reit)	Goldman Sachs	15,028
(2,658)	Stamps.com Inc	Bank of America Merrill Lynch	(22,726)
552	Stamps.com Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,135

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
1,828	Stamps.com Inc	Morgan Stanley	6,722
(58,664)	Standard Motor Products Inc	Bank of America Merrill Lynch	(100,315)
808	Standex International Corp	Morgan Stanley	1,293
13,705	Standex International Corp	Bank of America Merrill Lynch	70,631
2,022	Standex International Corp	Goldman Sachs	9,240
1,574	Stanley Black & Decker Inc	Bank of America Merrill Lynch	(8,623)
59,918	Stanley Black & Decker Inc	Morgan Stanley	(144,228)
(86,352)	Starbucks Corp	Bank of America Merrill Lynch	(38,705)
(172,382)	Starbucks Corp	Morgan Stanley	54,096
(115,248)	StarTek Inc	Bank of America Merrill Lynch	(41,397)
(82,202)	StarTek Inc	Goldman Sachs	(32,059)
(476,732)	Starwood Property Trust Inc (Reit)	Morgan Stanley	(536,420)
(160,137)	Starwood Property Trust Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(49,482)
(336,031)	State Auto Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(591,415)
(56,942)	State Auto Financial Corp	Morgan Stanley	(524,436)
(81,150)	State Bank Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	4,923
(690)	State Bank Financial Corp	Morgan Stanley	(159)
(1,991)	State Street Corp	Bank of America Merrill Lynch	9,716
17,479	State Street Corp	Morgan Stanley	(33,874)
9,966	Steel Dynamics Inc	Bank of America Merrill Lynch	12,059
(23,792)	Steel Dynamics Inc	Morgan Stanley	(5,710)
27,554	Steelcase Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	13,777
84,582	Steelcase Inc 'A'	Morgan Stanley	21,146
2,602	Stepan Co	Bank of America Merrill Lynch	9,940
(49,707)	Stericycle Inc	Bank of America Merrill Lynch	(31,315)
(33,707)	Stericycle Inc	Morgan Stanley	(31,923)
49,504	Steris Plc	Bank of America Merrill Lynch	181,680
3,264	Steris Plc	Goldman Sachs	11,979
13,219	Sterling Bancorp Inc/MI	Bank of America Merrill Lynch	3,305
4,435	Sterling Bancorp Inc/MI	Goldman Sachs	1,109
(2,499)	Sterling Bancorp/DE	Goldman Sachs	(1,125)
(548,429)	Sterling Bancorp/DE	Bank of America Merrill Lynch	(246,793)
(324,038)	Sterling Bancorp/DE	Morgan Stanley	-
(2,721)	Steven Madden Ltd	Morgan Stanley	(3,481)
1,101	Stifel Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	716
2,019	Stifel Financial Corp	Goldman Sachs	1,312
14,487	Stoneridge Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,477
11,747	Stoneridge Inc	Goldman Sachs	2,819
2,849	Stoneridge Inc	Morgan Stanley	(1,111)
100,590	STORE Capital Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	137,808
3,556	STORE Capital Corp (Reit)	Goldman Sachs	4,872
(20,984)	Stratasys Ltd	Bank of America Merrill Lynch	29,797
(37,196)	Stratasys Ltd	Morgan Stanley	31,989
(13,982)	Stratus Properties Inc	Morgan Stanley	(9,088)
(4,588)	Stratus Properties Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,423)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(15,543)	Stratus Properties Inc	Goldman Sachs	(21,760)
(7,201)	Strayer Education Inc	Bank of America Merrill Lynch	(64,881)
(2,550)	Strayer Education Inc	Morgan Stanley	(1,103)
26,997	Stryker Corp	Bank of America Merrill Lynch	161,948
11,133	Stryker Corp	Morgan Stanley	76,551
1,867	Stryker Corp	Goldman Sachs	14,301
2,969	Summit Hotel Properties Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	2,642
54,059	Summit Hotel Properties Inc (Reit)	Morgan Stanley	26,489
5,472	Summit Materials Inc 'A'	Goldman Sachs	(7,661)
23,475	Summit Materials Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(32,865)
630	Summit Materials Inc 'A'	Morgan Stanley	(372)
26,754	Sun Communities Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	94,675
1,305	Sun Communities Inc (Reit)	Goldman Sachs	5,101
(79,032)	Sun Hydraulics Corp	Bank of America Merrill Lynch	(118,966)
(22,346)	Sun Hydraulics Corp	Morgan Stanley	9,162
(101,113)	Sunrun Inc	Bank of America Merrill Lynch	(61,449)
(53,575)	Sunrun Inc	Morgan Stanley	(37,468)
(26,545)	Sunrun Inc	Goldman Sachs	(19,270)
137,845	Sunstone Hotel Investors Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	169,549
11,417	Sunstone Hotel Investors Inc (Reit)	Goldman Sachs	14,043
2,312	Sunstone Hotel Investors Inc (Reit)	Morgan Stanley	740
22,678	SunTrust Banks Inc	Bank of America Merrill Lynch	(45,810)
8,050	SunTrust Banks Inc	Morgan Stanley	(1,066)
(2,745)	Super Micro Computer Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,488)
(106,988)	Super Micro Computer Inc	Morgan Stanley	(269,491)
80,134	Superior Energy Services Inc	Morgan Stanley	(88,949)
4,054	Superior Energy Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,986)
(53,650)	Superior Energy Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	26,289
(629)	Supernus Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	(821)
(66,394)	SuperValu Inc	Bank of America Merrill Lynch	(170,068)
(61,028)	SuperValu Inc	Goldman Sachs	(155,349)
56,077	Surface Oncology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10,214)
10,285	Surface Oncology Inc	Goldman Sachs	(3,553)
2,298	Surface Oncology Inc	Morgan Stanley	(2,183)
(4,469)	SVB Financial Group	Bank of America Merrill Lynch	38,746
9,811	SVB Financial Group	Morgan Stanley	(81,152)
11,254	Switch Inc 'A'	Morgan Stanley	1,006
(148,030)	Sykes Enterprises Inc	Bank of America Merrill Lynch	(249,075)
(125,789)	Symantec Corp	Morgan Stanley	46,652
(122,262)	Symantec Corp	Bank of America Merrill Lynch	163,831
(3,149)	Synaptics Inc	Morgan Stanley	(1,669)
(82,988)	Synchronoss Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	29,876
(78,125)	Synchronoss Technologies Inc	Morgan Stanley	(11,719)
2,766	Synchrony Financial	Bank of America Merrill Lynch	1,189
6,858	Syndax Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(15,019)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
21,839	Syndax Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(47,827)
(3,407)	Syneos Health Inc	Morgan Stanley	(3,237)
(54,273)	Syneos Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	(149,251)
4,310	SYNNEX Corp	Morgan Stanley	3,707
29,298	SYNNEX Corp	Bank of America Merrill Lynch	4,688
7,965	SYNNEX Corp	Goldman Sachs	1,274
88,883	Synopsys Inc	Bank of America Merrill Lynch	(24,887)
61,300	Synopsys Inc	Morgan Stanley	339,284
(4,318)	Synovus Financial Corp	Morgan Stanley	(3,623)
124,547	Synovus Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,075
3,249	Synovus Financial Corp	Goldman Sachs	682
815	Syntel Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,111
4,347	Syntel Inc	Goldman Sachs	5,912
17,242	Syntel Inc	Morgan Stanley	4,138
(46,147)	Sysco Corp	Bank of America Merrill Lynch	(118,500)
(64,759)	Sysco Corp	Morgan Stanley	(253,643)
4,252	Systemax Inc	Bank of America Merrill Lynch	11,693
(21,624)	T Rowe Price Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(90,719)
(65,130)	T Rowe Price Group Inc	Morgan Stanley	73,854
(109,871)	T-Mobile US Inc	Morgan Stanley	150,523
(2,625)	T2 Biosystems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,995)
(5,518)	T2 Biosystems Inc	Morgan Stanley	5,352
18,767	Tableau Software Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	125,402
2,883	Tableau Software Inc 'A'	Morgan Stanley	11,918
(10,457)	Tabula Rasa HealthCare Inc	Bank of America Merrill Lynch	(58,036)
(15,194)	Tactile Systems Technology Inc	Morgan Stanley	(41,024)
(94,572)	Tahoe Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	(31,832)
(35,268)	Tailored Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	32,272
(17,865)	Take-Two Interactive Software Inc	Morgan Stanley	(47,996)
(2,602)	Take-Two Interactive Software Inc	Bank of America Merrill Lynch	8,566
3,332	Talend SA ADR	Morgan Stanley	3,499
(11,254)	Talos Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(12,830)
4,458	Talos Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	8,373
14,931	Talos Energy Inc	Morgan Stanley	17,981
52,013	Tanger Factory Outlet Centers Inc (Reit)	Morgan Stanley	43,691
(8,206)	Tanger Factory Outlet Centers Inc (Reit)	Goldman Sachs	(12,801)
(34,381)	Tapestry Inc	Morgan Stanley	140,650
(75,098)	Tapestry Inc	Bank of America Merrill Lynch	102,133
(33,557)	Targa Resources Corp	Bank of America Merrill Lynch	21,476
88,348	Target Corp	Bank of America Merrill Lynch	37,044
2,607	Target Corp	Goldman Sachs	(346)
67,581	Target Corp	Morgan Stanley	(78,458)
(72)	Taro Pharmaceutical Industries Ltd	Morgan Stanley	(1,327)
(16,644)	Taubman Centers Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(25,404)
(19,058)	Taubman Centers Inc (Reit)	Morgan Stanley	(31,446)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
101,607	Taylor Morrison Home Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	69,093
21,487	Taylor Morrison Home Corp 'A'	Goldman Sachs	14,611
(30,070)	Taylor Morrison Home Corp A'	Morgan Stanley	11,578
(30,896)	TCF Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(20,082)
(75,319)	TCF Financial Corp	Morgan Stanley	(6,779)
(5,517)	TD Ameritrade Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	8,110
134,959	TE Connectivity Ltd	Morgan Stanley	(600,818)
76,731	TE Connectivity Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(63,763)
(157,753)	Team Inc	Bank of America Merrill Lynch	(118,315)
1,316	Tech Data Corp	Bank of America Merrill Lynch	13,715
4,124	Tech Data Corp	Morgan Stanley	40,966
32,842	TechnipFMC Plc	Bank of America Merrill Lynch	(22,661)
1,393	TechnipFMC Plc	Goldman Sachs	(961)
20,329	TechnipFMC Plc	Morgan Stanley	(33,843)
97,084	TechTarget Inc	Bank of America Merrill Lynch	293,748
17,137	TechTarget Inc	Goldman Sachs	49,669
21,935	TechTarget Inc	Morgan Stanley	51,547
5,621	Tegna Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,911)
(5,149)	Tegna Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,751
42,174	Tegna Inc	Morgan Stanley	(21,930)
(43,403)	Teladoc Inc	Morgan Stanley	(71,615)
(3,411)	Telaria Inc	Bank of America Merrill Lynch	102
4,687	Teledyne Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	32,272
305	Teledyne Technologies Inc	Goldman Sachs	1,742
(21,078)	Teleflex Inc	Bank of America Merrill Lynch	(193,074)
(409)	Teleflex Inc	Morgan Stanley	(1,948)
25,696	Telefonica Brasil SA ADR	Goldman Sachs	(12,833)
15,362	Telefonica Brasil SA ADR	Morgan Stanley	(6,452)
100,899	Telephone & Data Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(38,751)
8,045	Telephone & Data Systems Inc	Goldman Sachs	(3,666)
154,140	Telephone & Data Systems Inc	Morgan Stanley	(135,643)
(32,016)	Teligent Inc/NJ	Bank of America Merrill Lynch	1,281
(504,412)	Teligent Inc/NJ	Morgan Stanley	(65,574)
(19,151)	Teligent Inc/NJ	Goldman Sachs	766
(8,022)	Tempur Sealy International Inc	Morgan Stanley	16,525
(1,204)	Tempur Sealy International Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,311
(29,004)	Tempur Sealy International Inc	Goldman Sachs	67,340
3,720	Tenet Healthcare Corp	Morgan Stanley	10,490
14,519	Tenet Healthcare Corp	Bank of America Merrill Lynch	40,798
(70,405)	Tennant Co	Bank of America Merrill Lynch	(415,390)
(10,379)	Tennant Co	Morgan Stanley	(21,277)
24,866	Tenneco Inc	Bank of America Merrill Lynch	(63,906)
10,883	Tenneco Inc	Goldman Sachs	(27,969)
17,669	Tenneco Inc	Morgan Stanley	(57,778)
(17,539)	Teradata Corp	Bank of America Merrill Lynch	(17,446)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
802	Teradata Corp	Morgan Stanley	1,123
(5,346)	Teradyne Inc	Bank of America Merrill Lynch	(15,878)
(133,351)	Teradyne Inc	Morgan Stanley	(69,343)
5,030	Terex Corp	Bank of America Merrill Lynch	(8,149)
1,681	Terex Corp	Morgan Stanley	(4,236)
(7,580)	TerraForm Power Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(379)
(80,869)	TerraForm Power Inc 'A'	Goldman Sachs	(4,043)
910	TerraForm Power Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	177
192,071	TerraForm Power Inc 'A'	Morgan Stanley	42,868
147,056	Terreno Realty Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	79,410
3,912	TESARO Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9,232)
3,219	TESARO Inc	Goldman Sachs	(7,597)
257	TESARO Inc	Morgan Stanley	(1,090)
(10,243)	Tesla Inc	Goldman Sachs	359,154
(8,044)	Tesla Inc	Bank of America Merrill Lynch	(42,163)
33,133	Tetra Tech Inc	Bank of America Merrill Lynch	54,921
11,302	Tetra Tech Inc	Morgan Stanley	16,953
2,046	Tetra Tech Inc	Goldman Sachs	6,240
43,413	Tetraphase Pharmaceuticals Inc	Morgan Stanley	4,341
12,988	Tetraphase Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(260)
33,792	Tetraphase Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(676)
(32,233)	Texas Capital Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	108,546
33,031	Texas Instruments Inc	Bank of America Merrill Lynch	106,571
331	Texas Instruments Inc	Goldman Sachs	449
2,772	Texas Roadhouse Inc	Morgan Stanley	6,698
273,339	Texas Roadhouse Inc	Bank of America Merrill Lynch	789,663
2,722	Texas Roadhouse Inc	Goldman Sachs	7,879
(3,185)	Textainer Group Holdings Ltd	Morgan Stanley	1,911
172,784	TFS Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	133,908
28,972	TFS Financial Corp	Morgan Stanley	13,472
16,969	TFS Financial Corp	Goldman Sachs	13,151
(23,824)	TG Therapeutics Inc	Morgan Stanley	7,147
(5,120)	TG Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	768
(5,211)	TG Therapeutics Inc	Goldman Sachs	782
38,229	TherapeuticsMD Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,172)
31,802	TherapeuticsMD Inc	Morgan Stanley	1,272
(1,870)	Theravance Biopharma Inc	Goldman Sachs	(262)
5,865	Theravance Biopharma Inc	Morgan Stanley	(1,580)
1,479	Thermo Fisher Scientific Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,834
4,961	Thermon Group Holdings Inc	Morgan Stanley	(5,854)
25,833	Thermon Group Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	517
8,511	Thermon Group Holdings Inc	Goldman Sachs	170
(153,190)	Third Point Reinsurance Ltd	Morgan Stanley	30,638
289	Thor Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,295)
(4,664)	TIER Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(2,009)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
15,073	Tiffany & Co	Bank of America Merrill Lynch	445,558
130,687	Tile Shop Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	62,076
22,571	Tile Shop Holdings Inc	Goldman Sachs	10,721
4,450	Tile Shop Holdings Inc	Morgan Stanley	779
(34,731)	Tilly's Inc	Bank of America Merrill Lynch	(74,324)
(6,496)	Tilly's Inc	Goldman Sachs	(13,901)
67,416	TIM Participacoes SA ADR	Goldman Sachs	(68,216)
28,823	TIM Participacoes SA ADR	Morgan Stanley	(23,347)
1,020	Timberland Bancorp Inc/WA	Morgan Stanley	612
3,448	Timberland Bancorp Inc/WA	Bank of America Merrill Lynch	3,290
680	Timberland Bancorp Inc/WA	Goldman Sachs	714
1,200	Time Warner Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,200)
1,119	Time Warner Inc	Morgan Stanley	(1,130)
(890)	Timken Co/The	Bank of America Merrill Lynch	846
30,415	Timken Co/The	Morgan Stanley	(54,747)
21,350	TimkenSteel Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,989
6,752	TimkenSteel Corp	Goldman Sachs	945
5,181	TimkenSteel Corp	Morgan Stanley	(1,347)
(5,105)	Tiptree Inc 'A' (Reit)	Goldman Sachs	(1,404)
(37,318)	Titan International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,603)
(79,178)	Titan International Inc	Morgan Stanley	28,504
18,005	Titan Machinery Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,402)
6,277	Titan Machinery Inc	Goldman Sachs	(1,883)
2,825	Titan Machinery Inc	Morgan Stanley	(7,204)
46,351	Tivity Health Inc	Morgan Stanley	(70,998)
(11,111)	TiVo Corp	Morgan Stanley	(1,049)
(22,221)	TJX Cos Inc/The	Morgan Stanley	(31,872)
(8,007)	TJX Cos Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	(36,992)
387	Tompkins Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,567
1,705	Tompkins Financial Corp	Goldman Sachs	6,905
900	Tompkins Financial Corp	Morgan Stanley	(288)
(11,446)	TopBuild Corp	Bank of America Merrill Lynch	(66,143)
(123,659)	Torchmark Corp	Morgan Stanley	315,463
1,316	Torchmark Corp	Goldman Sachs	(763)
(16,659)	Toro Co/The	Bank of America Merrill Lynch	(7,250)
37,126	Total System Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	8,539
1,636	Total System Services Inc	Goldman Sachs	376
1,270	Total System Services Inc	Morgan Stanley	1,448
25,387	Tower International Inc	Morgan Stanley	8,885
160,809	Tower International Inc	Bank of America Merrill Lynch	209,052
34,885	Tower International Inc	Goldman Sachs	45,351
34,725	Tower Semiconductor Ltd	Morgan Stanley	20,609
(2,985)	Town Sports International Holdings Inc	Goldman Sachs	(1,642)
24,382	TPG RE Finance Trust Inc (Reit)	Goldman Sachs	3,901
15,389	TPG RE Finance Trust Inc (Reit)	Morgan Stanley	2,462

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
124,474	TPG RE Finance Trust Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	19,916
(4,328)	TPI Composites Inc	Bank of America Merrill Lynch	(995)
(164,311)	TPI Composites Inc	Goldman Sachs	(37,792)
9,926	Tractor Supply Co	Bank of America Merrill Lynch	41,888
(934)	Trade Desk Inc/The 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(2,966)
(4,397)	TransDigm Group Inc	Morgan Stanley	(38,078)
(7,329)	TransDigm Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(78,132)
66,555	Transocean Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(66,555)
4,740	Transocean Ltd	Goldman Sachs	(4,740)
17,356	TransUnion	Bank of America Merrill Lynch	(4,450)
6,849	TransUnion	Morgan Stanley	2,150
1,522	TransUnion	Goldman Sachs	(517)
14,074	Travelers Cos Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	(23,785)
702	Travelers Cos Inc/The	Goldman Sachs	(1,186)
54,453	Travelport Worldwide Ltd	Bank of America Merrill Lynch	17,425
(6,631)	Travelport Worldwide Ltd	Morgan Stanley	303
(133,701)	Trecora Resources	Bank of America Merrill Lynch	(120,331)
(13,445)	Trecora Resources	Morgan Stanley	(6,723)
(38,421)	Tredegar Corp	Bank of America Merrill Lynch	(124,868)
(4,411)	TreeHouse Foods Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,044)
(6,200)	TreeHouse Foods Inc	Morgan Stanley	(4,787)
(37,599)	Trevena Inc	Goldman Sachs	1,967
21,795	Trex Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	174,013
428	Trex Co Inc	Morgan Stanley	1,866
20,470	TRI Pointe Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	32,752
2,950	TRI Pointe Group Inc	Goldman Sachs	4,720
47,359	TriCo Bancshares	Bank of America Merrill Lynch	70,565
76,326	TriCo Bancshares	Morgan Stanley	(15,265)
(74,308)	Trimble Inc	Bank of America Merrill Lynch	47,557
(40,122)	Trimble Inc	Morgan Stanley	27,684
(19,448)	TriNet Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(28,394)
(34,481)	Trinity Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	21,021
(3,773)	Trinity Industries Inc	Goldman Sachs	2,037
(19,342)	Trinity Place Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,996)
(1,221)	Trinity Place Holdings Inc	Goldman Sachs	(4)
856	Trinseo SA	Goldman Sachs	(2,054)
961	Trinseo SA	Bank of America Merrill Lynch	(2,306)
845	Trinseo SA	Morgan Stanley	(2,831)
(83,178)	Triple-S Management Corp 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(310,254)
155,452	TriState Capital Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	-
35,573	TriState Capital Holdings Inc	Goldman Sachs	-
9,849	TriState Capital Holdings Inc	Morgan Stanley	(10,341)
(17,536)	Triton International Ltd/Bermuda	Goldman Sachs	12,741
(33,239)	Triton International Ltd/Bermuda	Morgan Stanley	(19,040)
(24,765)	Triumph Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(23,527)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
4,920	Triumph Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(12,735)
43,375	Triumph Group Inc	Morgan Stanley	(118,081)
(28,100)	tronc Inc	Bank of America Merrill Lynch	7,306
(74,330)	Tronox Ltd 'A'	Goldman Sachs	(47,908)
(7,667)	TrueBlue Inc	Morgan Stanley	(7,250)
58,690	TrueCar Inc	Bank of America Merrill Lynch	25,144
13,722	TrueCar Inc	Morgan Stanley	10,566
32,014	TrueCar Inc	Goldman Sachs	12,875
(7,757)	Trupanion Inc	Bank of America Merrill Lynch	(32,564)
(2,417)	TTEC Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,325)
(21,111)	Tucows Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1,056
(1,279)	Tucows Inc 'A'	Goldman Sachs	64
(18,102)	Tupperware Brands Corp	Bank of America Merrill Lynch	8,689
(41,445)	Tupperware Brands Corp	Morgan Stanley	64,356
31,257	Tutor Perini Corp	Morgan Stanley	(1,563)
(77,905)	Twenty-First Century Fox Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(49,859)
33,515	Twilio Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	46,586
(7,173)	Twilio Inc 'A'	Morgan Stanley	(4,989)
7,923	Twin Disc Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,060)
3,952	Twin Disc Inc	Goldman Sachs	(1,028)
2,642	Twin Disc Inc	Morgan Stanley	(3,461)
11,443	Twitter Inc	Goldman Sachs	21,398
46,261	Twitter Inc	Bank of America Merrill Lynch	82,500
21,342	Twitter Inc	Morgan Stanley	37,562
(147,396)	Two Harbors Investment Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(17,826)
(16,126)	Tyler Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(63,053)
13,072	Tyson Foods Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	19,216
885	Tyson Foods Inc 'A'	Morgan Stanley	770
(78,682)	Tyson Foods Inc 'A'	Morgan Stanley	(49,774)
177	Tyson Foods Inc 'A'	Goldman Sachs	260
6,492	Ubiquiti Networks Inc	Bank of America Merrill Lynch	22,332
1,042	Ubiquiti Networks Inc	Morgan Stanley	1,315
3,437	UBS Group AG	Bank of America Merrill Lynch	(2,669)
7,064	UBS Group AG	Morgan Stanley	(5,538)
65,693	UDR Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	70,292
47,346	UDR Inc (Reit)	Morgan Stanley	54,538
118,859	UGI Corp	Morgan Stanley	158,082
48,048	UGI Corp	Bank of America Merrill Lynch	53,463
2,780	Ulta Salon Cosmetics & Fragrance Inc	Bank of America Merrill Lynch	(132)
3,670	Ulta Salon Cosmetics & Fragrance Inc	Morgan Stanley	(8,368)
2,234	Ultimate Software Group Inc/The	Morgan Stanley	11,713
7,253	Ultra Clean Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,958
3,477	Ultra Clean Holdings Inc	Morgan Stanley	4,520
6,772	Ultra Petroleum Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,625)
(1,287)	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,849)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(3,125)	Ultragenyx Pharmaceutical Inc	Morgan Stanley	(23,875)
(46,498)	Ultrapar Participacoes SA ADR	Goldman Sachs	60,447
(77,665)	Ultrapar Participacoes SA ADR	Morgan Stanley	511,787
22,264	UMB Financial Corp	Morgan Stanley	110,402
(55,211)	Umpqua Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	3,679
(8,883)	Under Armour Inc 'A'	Morgan Stanley	(14,568)
(64,619)	Under Armour Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(163,127)
(11,344)	Under Armour Inc 'A'	Goldman Sachs	(29,494)
(48,567)	Unifi Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10,639)
(4,602)	UniFirst Corp/MA	Bank of America Merrill Lynch	(19,328)
(12,239)	UniFirst Corp/MA	Morgan Stanley	(41,001)
44,429	Union Bankshares Corp	Morgan Stanley	202,344
(136,162)	Union Bankshares Corp	Bank of America Merrill Lynch	(56,201)
(1,602)	Union Pacific Corp	Bank of America Merrill Lynch	(7,770)
21,639	Unit Corp	Morgan Stanley	(10,603)
(15,714)	United Bankshares Inc/WV	Morgan Stanley	4,437
219,193	United Community Banks Inc/GA	Bank of America Merrill Lynch	(28,670)
107,503	United Community Banks Inc/GA	Morgan Stanley	(56,176)
37,284	United Community Banks Inc/GA	Goldman Sachs	(5,294)
370,176	United Community Financial Corp/OH	Bank of America Merrill Lynch	103,649
13,228	United Community Financial Corp/OH	Goldman Sachs	3,704
69,321	United Community Financial Corp/OH	Morgan Stanley	3,466
(4,644)	United Continental Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,898)
(3,002)	United Continental Holdings Inc	Morgan Stanley	710
(29,768)	United Insurance Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4,763)
(11,378)	United Insurance Holdings Corp	Goldman Sachs	(1,820)
49,263	United Natural Foods Inc	Bank of America Merrill Lynch	30,711
8,814	United Natural Foods Inc	Goldman Sachs	5,905
86,792	United Natural Foods Inc	Morgan Stanley	8,679
(11,628)	United Parcel Service Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(11,744)
(237)	United Rentals Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,121
1,058	United States Cellular Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,418)
680	United States Cellular Corp	Morgan Stanley	(823)
(9,731)	United States Steel Corp	Bank of America Merrill Lynch	(21,700)
(36,594)	United Technologies Corp	Bank of America Merrill Lynch	(30,007)
(42,504)	United Technologies Corp	Morgan Stanley	104,122
11,993	United Therapeutics Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,319
1,719	United Therapeutics Corp	Goldman Sachs	189
191	United Therapeutics Corp	Morgan Stanley	552
6,104	UnitedHealth Group Inc	Morgan Stanley	8,918
(173,418)	Uniti Group Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(145,671)
(207,995)	Uniti Group Inc (Reit)	Morgan Stanley	(545,792)
(39,519)	Uniti Group Inc (Reit)	Goldman Sachs	(33,196)
84,955	Univar Inc	Bank of America Merrill Lynch	18,416
56,804	Univar Inc	Morgan Stanley	15,292

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
1,921	Univar Inc	Goldman Sachs	768
(56,305)	Universal Corp/VA	Bank of America Merrill Lynch	(662,869)
(14,386)	Universal Corp/VA	Morgan Stanley	(190,143)
(733)	Universal Display Corp	Goldman Sachs	1,283
(3,043)	Universal Display Corp	Bank of America Merrill Lynch	5,325
(46,685)	Universal Electronics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9,337)
254,421	Universal Forest Products Inc	Bank of America Merrill Lynch	811,603
3,437	Universal Forest Products Inc	Goldman Sachs	10,964
11,134	Universal Forest Products Inc	Morgan Stanley	15,588
(125,248)	Universal Health Realty Income Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(485,962)
(7,481)	Universal Health Services Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	8,379
18,094	Universal Logistics Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	9,471
600	Universal Logistics Holdings Inc	Goldman Sachs	420
8,742	Universal Stainless & Alloy Products Inc	Bank of America Merrill Lynch	(10,038)
1,226	Universal Stainless & Alloy Products Inc	Morgan Stanley	(3,907)
(72,544)	Univest Corp of Pennsylvania	Bank of America Merrill Lynch	7,254
58,460	Unum Group	Bank of America Merrill Lynch	(8,775)
13,597	Unum Group	Goldman Sachs	(1,360)
75,111	Unum Group	Morgan Stanley	(79,014)
17,005	Unum Therapeutics Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,423
3,598	Unum Therapeutics Inc	Morgan Stanley	259
394	Urban Edge Properties (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	579
16,444	Urban Edge Properties (Reit)	Morgan Stanley	17,924
58,466	Urban One Inc	Morgan Stanley	23,386
10,737	Urban One Inc	Goldman Sachs	4,832
41,810	Urban Outfitters Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,627)
4,649	Urban Outfitters Inc	Goldman Sachs	(379)
93,862	Urban Outfitters Inc	Morgan Stanley	102,563
53,687	US Auto Parts Network Inc	Morgan Stanley	(4,295)
16,566	US Auto Parts Network Inc	Bank of America Merrill Lynch	(497)
22,460	US Auto Parts Network Inc	Goldman Sachs	(674)
(7,715)	US Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	13,501
40,813	US Bancorp	Morgan Stanley	(72,774)
1,396	US Concrete Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,537
2,713	US Concrete Inc	Morgan Stanley	8,817
(23,789)	US Concrete Inc	Goldman Sachs	(3,568)
(58,515)	US Ecology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(146,288)
6,042	US Foods Holding Corp	Bank of America Merrill Lynch	5,921
(129,648)	US Foods Holding Corp	Morgan Stanley	(66,120)
2,016	US Silica Holdings Inc	Morgan Stanley	(2,298)
(16,988)	US Silica Holdings Inc	Morgan Stanley	19,366
511	US Silica Holdings Inc	Goldman Sachs	(301)
(31,027)	USA Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(62,054)
(154,030)	USA Technologies Inc	Morgan Stanley	(300,359)
(5,716)	USA Truck Inc	Bank of America Merrill Lynch	14,747

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(6,371)	USA Truck Inc	Goldman Sachs	16,437
9,696	USANA Health Sciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	30,088
1,244	USANA Health Sciences Inc	Goldman Sachs	5,287
9,435	USANA Health Sciences Inc	Morgan Stanley	(21,229)
(17,836)	USG Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,319)
(13,117)	USG Corp	Morgan Stanley	(2,654)
3,209	Utah Medical Products Inc	Bank of America Merrill Lynch	17,329
1,523	Utah Medical Products Inc	Goldman Sachs	8,224
95,179	Vale SA ADR	Morgan Stanley	(64,722)
30,016	Vale SA ADR	Goldman Sachs	(16,140)
6,605	Valeant Pharmaceuticals International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(185)
1,008	Valeant Pharmaceuticals International Inc	Goldman Sachs	(100)
(85,685)	Valero Energy Corp	Morgan Stanley	(333,920)
(8,667)	Valero Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	(49,741)
(1,625)	Valero Energy Corp	Goldman Sachs	(4,576)
(3,868)	Valhi Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,940
(321,917)	Valley National Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	28,973
(22,331)	Valmont Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(69,226)
(23,309)	Valmont Industries Inc	Morgan Stanley	(15,151)
(2,885)	Valvoline Inc	Bank of America Merrill Lynch	317
(67,848)	Valvoline Inc	Morgan Stanley	22,451
42,649	Vanda Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	31,987
190	Vanda Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	143
(46,872)	Varex Imaging Corp	Bank of America Merrill Lynch	3,567
(30,915)	Varex Imaging Corp	Morgan Stanley	22,877
2,828	Varian Medical Systems Inc	Goldman Sachs	3,874
14,691	Varian Medical Systems Inc	Morgan Stanley	659
7,420	Varian Medical Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	9,751
78,460	Varonis Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	400,146
(122,015)	VASCO Data Security International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(219,108)
72,064	Vector Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3,199
36,198	Vector Group Ltd	Goldman Sachs	312
37,669	Vector Group Ltd	Morgan Stanley	11,977
(148,297)	Vectren Corp	Morgan Stanley	(84,476)
34,448	Vectren Corp	Bank of America Merrill Lynch	38,926
917	Vectrus Inc	Bank of America Merrill Lynch	451
(63,359)	Veeco Instruments Inc	Bank of America Merrill Lynch	(57,023)
27,359	Veeva Systems Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	49,793
19,544	Veeva Systems Inc 'A'	Morgan Stanley	53,095
906	Veeva Systems Inc 'A'	Goldman Sachs	1,649
39,742	Venator Materials Plc	Morgan Stanley	(12,717)
2,757	Venator Materials Plc	Bank of America Merrill Lynch	110
1,097	Ventas Inc (Reit)	Goldman Sachs	2,457
98,654	Ventas Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	220,985
307	Ventas Inc (Reit)	Morgan Stanley	559

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(85,292)	Vera Bradley Inc	Bank of America Merrill Lynch	(91,262)
76,689	Veracyte Inc	Bank of America Merrill Lynch	91,818
36,203	Veracyte Inc	Goldman Sachs	43,053
25,420	Veracyte Inc	Morgan Stanley	12,964
(205,461)	VEREIT Inc (Reit)	Morgan Stanley	(34,928)
(799,408)	VEREIT Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(111,917)
(25,971)	Vericel Corp	Bank of America Merrill Lynch	-
16,312	Verint Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	14,681
(89,236)	Verint Systems Inc	Bank of America Merrill Lynch	(51,618)
(14,221)	VeriSign Inc	Morgan Stanley	(117,017)
(62,840)	Verisk Analytics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(115,626)
(23,598)	Verisk Analytics Inc	Morgan Stanley	(34,290)
(4,675)	Veritex Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,639)
(18,581)	Veritiv Corp	Bank of America Merrill Lynch	(46,453)
(87,065)	Verizon Communications Inc	Bank of America Merrill Lynch	(26,120)
4,861	Verizon Communications Inc	Morgan Stanley	(3,500)
19,924	Versartis Inc	Bank of America Merrill Lynch	(996)
36,643	Versartis Inc	Goldman Sachs	(1,832)
106,572	Versartis Inc	Morgan Stanley	-
(31,257)	Verso Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(39,384)
(12,210)	Verso Corp 'A'	Goldman Sachs	(15,385)
6,810	Versum Materials Inc	Bank of America Merrill Lynch	10,011
29,418	Versum Materials Inc	Morgan Stanley	79,617
2,879	Versum Materials Inc	Goldman Sachs	4,232
3,252	Vertex Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,325
1,660	VF Corp	Goldman Sachs	5,113
20,834	VF Corp	Morgan Stanley	24,777
22,678	VF Corp	Bank of America Merrill Lynch	69,848
31,337	Viacom Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(35,647)
7,460	Viacom Inc 'B'	Goldman Sachs	(9,474)
56,228	Viacom Inc 'B'	Morgan Stanley	(87,430)
(1,665)	VIAD Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4,829)
(27,957)	ViaSat Inc	Goldman Sachs	(33,269)
(3,356)	ViaSat Inc	Morgan Stanley	(5,974)
(429,058)	Viavi Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	112,827
(37,625)	Viavi Solutions Inc	Morgan Stanley	13,705
21,435	Vici Properties Inc (Reit)	Goldman Sachs	10,050
57,773	Vici Properties Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	26,887
996	Vici Properties Inc (Reit)	Morgan Stanley	120
(30,977)	Vicor Corp	Bank of America Merrill Lynch	(139,397)
(9,712)	Virtu Financial Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(3,885)
(67,525)	Virtu Financial Inc 'A'	Goldman Sachs	(27,010)
(34,135)	Virtu Financial Inc 'A'	Morgan Stanley	(66,563)
(16,794)	Virtus Investment Partners Inc	Goldman Sachs	(26,870)
(3,495)	Virtus Investment Partners Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,592)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(2,623)	Virtusa Corp	Morgan Stanley	(349)
7,682	Visa Inc 'A'	Goldman Sachs	(2,612)
73,680	Vishay Intertechnology Inc	Bank of America Merrill Lynch	(14,736)
24,420	Vishay Intertechnology Inc	Goldman Sachs	(4,884)
14,525	Vishay Intertechnology Inc	Morgan Stanley	3,759
3,871	Vishay Precision Group Inc	Morgan Stanley	7,936
2,427	Vishay Precision Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	5,946
(2,897)	Visteon Corp	Bank of America Merrill Lynch	14,167
(13,148)	Visteon Corp	Morgan Stanley	62,806
(7,126)	Vistra Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	(9,335)
(8,868)	Vivint Solar Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,660
5,779	VMware Inc 'A'	Morgan Stanley	9,399
447	VMware Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1,289
4,511	Vocera Communications Inc	Morgan Stanley	8,120
11,635	Vocera Communications Inc	Bank of America Merrill Lynch	38,046
8,072	Vocera Communications Inc	Goldman Sachs	26,395
4,034	Vonage Holdings Corp	Morgan Stanley	101
(14,244)	Vornado Realty Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(28,488)
(7,886)	VOXX International Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3,154)
(43,044)	VOXX International Corp	Goldman Sachs	(17,218)
(9,138)	Voya Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	12,336
25,533	Voya Financial Inc	Morgan Stanley	(2,722)
(6,717)	VSE Corp	Bank of America Merrill Lynch	(6,247)
2,560	Vulcan Materials Co	Bank of America Merrill Lynch	2,790
393	Vulcan Materials Co	Morgan Stanley	90
660	Vulcan Materials Co	Goldman Sachs	719
34,864	Wabash National Corp	Morgan Stanley	(20,052)
10,957	Wabash National Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,024)
(2,832)	WABCO Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	18,111
(20,575)	WABCO Holdings Inc	Morgan Stanley	160,117
(2,012)	Wabtec Corp/DE	Bank of America Merrill Lynch	(9,316)
(22,726)	Wabtec Corp/DE	Goldman Sachs	(105,221)
(67,124)	Waddell & Reed Financial Inc 'A'	Morgan Stanley	86,408
(340,958)	Waddell & Reed Financial Inc 'A'	Goldman Sachs	(177,298)
118,404	WageWorks Inc	Bank of America Merrill Lynch	337,451
4,135	WageWorks Inc	Morgan Stanley	7,443
25,188	WageWorks Inc	Goldman Sachs	71,786
(13,477)	Walgreens Boots Alliance Inc	Bank of America Merrill Lynch	21,167
(117,803)	Walgreens Boots Alliance Inc	Morgan Stanley	170,814
(13,271)	Walker & Dunlop Inc	Morgan Stanley	(11,811)
26,946	Walmart Inc	Bank of America Merrill Lynch	(21,508)
58,935	Walmart Inc	Morgan Stanley	(22,934)
(19,426)	Walt Disney Co/The	Bank of America Merrill Lynch	60,609
(50,019)	Walt Disney Co/The	Morgan Stanley	116,431
(30,824)	Warrior Met Coal Inc	Morgan Stanley	(19,419)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(49,605)	Warrior Met Coal Inc	Goldman Sachs	(40,348)
375,518	Washington Federal Inc	Bank of America Merrill Lynch	52,534
27,453	Washington Federal Inc	Goldman Sachs	3,176
41,721	Washington Federal Inc	Morgan Stanley	(14,602)
(108,436)	Washington Prime Group Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(47,882)
(120,139)	Washington Prime Group Inc (Reit)	Morgan Stanley	-
(184,298)	Washington Real Estate Investment Trust (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(156,653)
(6,592)	Waste Connections Inc	Morgan Stanley	(6,063)
(17,629)	Waste Connections Inc	Bank of America Merrill Lynch	(40,018)
(16,633)	Waste Management Inc	Bank of America Merrill Lynch	(34,763)
3,655	Waters Corp	Bank of America Merrill Lynch	13,560
(10,160)	Waters Corp	Morgan Stanley	(24,098)
2,358	Waterstone Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	472
465	Waterstone Financial Inc	Goldman Sachs	93
5,696	Waterstone Financial Inc	Morgan Stanley	1,139
162	Watsco Inc	Goldman Sachs	990
19,738	Watsco Inc	Bank of America Merrill Lynch	120,599
132,066	Watts Water Technologies Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	165,219
4,654	Watts Water Technologies Inc 'A'	Goldman Sachs	5,818
10,736	Watts Water Technologies Inc 'A'	Morgan Stanley	3,992
(8,070)	WaVe Life Sciences Ltd	Morgan Stanley	(36,719)
(19,872)	Wayfair Inc 'A'	Morgan Stanley	(208,060)
(11,262)	WD-40 Co	Morgan Stanley	(19,145)
4,316	Weatherford International Plc	Morgan Stanley	(237)
42,973	Weatherford International Plc	Goldman Sachs	(1,074)
15,664	Weatherford International Plc	Bank of America Merrill Lynch	(392)
(1,862)	Web.com Group Inc	Morgan Stanley	(2,048)
135,564	WEC Energy Group Inc	Morgan Stanley	368,734
637	Weight Watchers International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,312)
(738)	Weight Watchers International Inc	Goldman Sachs	3,385
(6,627)	Weight Watchers International Inc	Morgan Stanley	20,544
(5,127)	Weight Watchers International Inc	Bank of America Merrill Lynch	21,458
170,259	Weingarten Realty Investors (Reit)	Morgan Stanley	173,664
81,291	Weingarten Realty Investors (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	168,272
(114,107)	Weis Markets Inc	Bank of America Merrill Lynch	(425,619)
(530)	Weis Markets Inc	Goldman Sachs	(1,977)
(7,953)	Welbilt Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,977)
21,731	WellCare Health Plans Inc	Bank of America Merrill Lynch	186,017
2,019	WellCare Health Plans Inc	Goldman Sachs	17,283
2,357	WellCare Health Plans Inc	Morgan Stanley	17,536
(15,340)	Wells Fargo & Co	Bank of America Merrill Lynch	(4,619)
(4,319)	Wells Fargo & Co	Morgan Stanley	1,163
(56,282)	Welltower Inc (Reit)	Morgan Stanley	(95,117)
(32,126)	Wendy's Co/The	Bank of America Merrill Lynch	4,819
17,478	Wendy's Co/The	Morgan Stanley	2,622

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
3,768	Werner Enterprises Inc	Bank of America Merrill Lynch	12,246
159,865	Werner Enterprises Inc	Morgan Stanley	215,818
114,575	Wesco Aircraft Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	143,219
30,126	Wesco Aircraft Holdings Inc	Morgan Stanley	18,076
31,878	Wesco Aircraft Holdings Inc	Goldman Sachs	39,848
33,382	WESCO International Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,880
2,116	WESCO International Inc	Goldman Sachs	(628)
65,577	West Bancorporation Inc	Bank of America Merrill Lynch	31,669
25,161	West Bancorporation Inc	Goldman Sachs	13,296
27,990	West Bancorporation Inc	Morgan Stanley	(5,598)
(4,882)	West Pharmaceutical Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(22,806)
(44,713)	Westar Energy Inc	Morgan Stanley	(119,346)
(4,824)	Westar Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9)
79,605	Western Alliance Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	(71,645)
6,705	Western Alliance Bancorp	Goldman Sachs	(6,035)
(21,807)	Western Alliance Bancorp	Morgan Stanley	(6,870)
5,956	Western Asset Mortgage Capital Corp (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	2,740
44,137	Western Asset Mortgage Capital Corp (Reit)	Goldman Sachs	20,303
(987)	Western Digital Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,675)
(47,377)	Western New England Bancorp Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,835)
(14,386)	Western Union Co/The	Bank of America Merrill Lynch	1,726
(97,744)	Western Union Co/The	Morgan Stanley	28,346
3,051	Westlake Chemical Corp	Morgan Stanley	28,049
(9,910)	Westlake Chemical Corp	Bank of America Merrill Lynch	12,243
869	WestRock Co	Bank of America Merrill Lynch	(1,138)
3,454	Westwood Holdings Group Inc	Morgan Stanley	3,040
5,614	Westwood Holdings Group Inc	Goldman Sachs	9,432
24,246	Westwood Holdings Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	40,733
(8,678)	WEX Inc	Bank of America Merrill Lynch	23,517
832	WEX Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,569)
8,082	WEX Inc	Morgan Stanley	(11,252)
(589)	Weyco Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,791)
(500)	Weyco Group Inc	Goldman Sachs	(1,520)
(140,293)	Weyerhaeuser Co (Reit)	Morgan Stanley	(21,044)
(8,568)	Weyerhaeuser Co (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(11,138)
11,093	Whirlpool Corp	Bank of America Merrill Lynch	(126,571)
182	Whirlpool Corp	Morgan Stanley	(3,358)
(2,343)	Whitestone (Reit)	Goldman Sachs	(1,687)
(5,461)	Whitestone (Reit)	Morgan Stanley	(2,184)
29,449	Whiting Petroleum Corp	Bank of America Merrill Lynch	113,084
1,051	Whiting Petroleum Corp	Morgan Stanley	2,480
4,469	Whiting Petroleum Corp	Goldman Sachs	17,161
(16,065)	WideOpenWest Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,498)
(2,472)	WideOpenWest Inc	Goldman Sachs	(692)
(14,810)	WildHorse Resource Development Corp	Morgan Stanley	(13,679)

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(20,203)	Willdan Group Inc	Morgan Stanley	(33,335)
(5,848)	Willdan Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11,462)
(2)	Willdan Group Inc	Goldman Sachs	(4)
78,769	William Lyon Homes 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(72,467)
7,053	William Lyon Homes 'A'	Morgan Stanley	(917)
23,951	William Lyon Homes 'A'	Goldman Sachs	(22,035)
2,531	Williams Cos Inc/The	Goldman Sachs	(253)
98,511	Williams Cos Inc/The	Bank of America Merrill Lynch	(9,851)
8,388	Williams Cos Inc/The	Morgan Stanley	(4,781)
5,513	Williams-Sonoma Inc	Bank of America Merrill Lynch	19,098
4,985	Willis Lease Finance Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3,290)
2,510	Willis Lease Finance Corp	Goldman Sachs	(1,657)
2,254	Willis Lease Finance Corp	Morgan Stanley	654
(24,419)	Willis Towers Watson Plc	Goldman Sachs	40,536
(54,418)	Willis Towers Watson Plc	Morgan Stanley	6,408
7,870	Wingstop Inc	Morgan Stanley	(6,060)
(384)	Winmark Corp	Morgan Stanley	(2,726)
(103,152)	Winnebago Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	61,891
(21,137)	Winnebago Industries Inc	Goldman Sachs	12,682
10,347	Winthrop Realty Trust (Reit)*	Bank of America Merrill Lynch	(31,041)
106,074	Wintrust Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(20,154)
(294,738)	WisdomTree Investments Inc	Bank of America Merrill Lynch	183,809
(2,437)	WisdomTree Investments Inc	Goldman Sachs	1,633
(83,077)	WisdomTree Investments Inc	Morgan Stanley	34,244
1,712	Wix.com Ltd	Bank of America Merrill Lynch	8,046
4,002	Wix.com Ltd	Morgan Stanley	13,423
39,319	Wolverine World Wide Inc	Bank of America Merrill Lynch	70,774
25,573	Wolverine World Wide Inc	Morgan Stanley	93,896
21,473	Wolverine World Wide Inc	Goldman Sachs	38,651
5,265	Woodward Inc	Morgan Stanley	5,107
(22,209)	Woodward Inc	Bank of America Merrill Lynch	(44,372)
15,646	Workday Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	15,190
6,784	Workday Inc 'A'	Morgan Stanley	16,350
410	Workday Inc 'A'	Goldman Sachs	82
35,745	Workiva Inc	Bank of America Merrill Lynch	10,109
1,026	Workiva Inc	Goldman Sachs	-
3,452	Workiva Inc	Morgan Stanley	2,204
(8,641)	World Acceptance Corp	Bank of America Merrill Lynch	(18,837)
(3,359)	World Acceptance Corp	Goldman Sachs	(7,323)
1,224	World Fuel Services Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,763)
6,762	World Fuel Services Corp	Goldman Sachs	(9,737)
1,083	World Wrestling Entertainment Inc 'A'	Goldman Sachs	9,396
(5,317)	World Wrestling Entertainment Inc 'A'	Morgan Stanley	(4,008)
1,398	World Wrestling Entertainment Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	21,180

* 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。

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
1,084	Worldpay Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,669)
(14,114)	Worthington Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	(20,901)
(13,877)	WP Carey Inc (Reit)	Morgan Stanley	(25,817)
(114,404)	WP Carey Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(240,429)
(80,435)	WPX Energy Inc	Morgan Stanley	(25,684)
(82,415)	WPX Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(17,636)
(40,738)	WR Berkley Corp	Bank of America Merrill Lynch	25,405
(25,866)	WR Berkley Corp	Morgan Stanley	24,831
(4,516)	WR Grace & Co	Morgan Stanley	(520)
44,114	WR Grace & Co	Bank of America Merrill Lynch	(3,970)
(4,598)	Wright Medical Group NV	Morgan Stanley	(5,708)
(2,141)	WSFS Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(3,542)
155	WW Grainger Inc	Goldman Sachs	505
449	WW Grainger Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,464
15,730	WW Grainger Inc	Morgan Stanley	(27,999)
(6,495)	Wyndham Worldwide Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,962)
(61,340)	Wyndham Worldwide Corp	Morgan Stanley	(61,340)
(3,468)	Wynn Resorts Ltd	Morgan Stanley	(12,765)
5,190	Wynn Resorts Ltd	Bank of America Merrill Lynch	32,957
57,457	Xcel Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	52,286
14,468	Xencor Inc	Bank of America Merrill Lynch	83,625
14,591	Xencor Inc	Goldman Sachs	84,336
4,816	Xencor Inc	Morgan Stanley	12,762
(372,629)	Xenia Hotels & Resorts Inc (Reit)	Bank of America Merrill Lynch	(849,594)
(45,718)	Xenia Hotels & Resorts Inc (Reit)	Morgan Stanley	(218,767)
56,692	Xerium Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	55,558
(13,837)	Xerox Corp	Bank of America Merrill Lynch	12,877
7,144	Xerox Corp	Morgan Stanley	(3,929)
50,191	Xilinx Inc	Bank of America Merrill Lynch	(131,500)
2,424	Xilinx Inc	Goldman Sachs	(6,351)
49,169	Xilinx Inc	Morgan Stanley	98,427
(2,397)	XOMA Corp	Morgan Stanley	4,040
9,423	Xperi Corp	Morgan Stanley	(9,894)
6,918	Xperi Corp	Bank of America Merrill Lynch	(9,452)
3,235	XPO Logistics Inc	Morgan Stanley	21,711
8,447	XPO Logistics Inc	Bank of America Merrill Lynch	19,742
32,551	Xylem Inc/NY	Bank of America Merrill Lynch	(29,296)
1,306	Xylem Inc/NY	Morgan Stanley	(1,215)
205	Xylem Inc/NY	Goldman Sachs	(185)
6,263	Yandex NV 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,127)
42,327	Yandex NV 'A'	Morgan Stanley	(19,629)
3,634	Yelp Inc	Goldman Sachs	(3,266)
120,254	Yelp Inc	Bank of America Merrill Lynch	19,150
25,048	Yelp Inc	Morgan Stanley	(5,298)
2,034	Yext Inc	Bank of America Merrill Lynch	142

保有高	銘柄	取引相手	未実現評価益/ (損) (米ドル)
	米国(続き)		
(18,679)	YRC Worldwide Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,530)
(16,517)	Yum China Holdings Inc	Morgan Stanley	(15,044)
7,355	Yum! Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9,047)
19,570	ZAGG Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,424)
36,479	ZAGG Inc	Goldman Sachs	(1,824)
4,340	ZAGG Inc	Morgan Stanley	(1,302)
21,926	Zayo Group Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	26,312
12,005	Zayo Group Holdings Inc	Goldman Sachs	14,807
4,476	Zebra Technologies Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	9,332
(885)	Zebra Technologies Corp 'A'	Morgan Stanley	(811)
214,409	Zendesk Inc	Bank of America Merrill Lynch	396,657
12,020	Zendesk Inc	Goldman Sachs	22,237
9,525	Zendesk Inc	Morgan Stanley	17,145
(1,993)	Zillow Group Inc 'C'	Bank of America Merrill Lynch	(13,174)
(25,731)	Zillow Group Inc 'C'	Goldman Sachs	(159,100)
(35,918)	Zillow Group Inc 'C'	Morgan Stanley	(206,194)
(52,316)	Zimmer Biomet Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	86,234
(33,057)	Zimmer Biomet Holdings Inc	Morgan Stanley	41,598
1,061	Zions Bancorporation	Goldman Sachs	(3,141)
(52,683)	Zions Bancorporation	Morgan Stanley	80,915
9,977	Zions Bancorporation	Bank of America Merrill Lynch	(29,532)
(21,647)	ZIOPHARM Oncology Inc	Morgan Stanley	(7,347)
(21,286)	Zoe's Kitchen Inc	Goldman Sachs	141,006
44,043	Zoetis Inc	Bank of America Merrill Lynch	60,339
8,076	Zoetis Inc	Morgan Stanley	(109)
1,891	Zoetis Inc	Goldman Sachs	2,591
(13,463)	Zogenix Inc	Morgan Stanley	(29,619)
15,444	Zumiez Inc	Goldman Sachs	(1,544)
73,834	Zumiez Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,383)
28,829	Zumiez Inc	Morgan Stanley	8,649
93,062	Zynga Inc 'A'	Goldman Sachs	33,037
33,673	Zynga Inc 'A'	Morgan Stanley	11,617
316,469	Zynga Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	112,346
			(5,272,224)
	合計(基礎となるエクスポージャー総額 - 6,495,077,524米ドル)		2,513,869

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

スワップ 2018年5月31日現在

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現評価益 (米ドル)	時価 (米ドル)
TRS	USD 11,793,222	ファンドは3ヶ月LIBORを受け取り、MSCI Daily TR Net Emerging Markets Chile USD Indexを支払う	Morgan Stanley	15/12/2018	717,517	717,517
TRS	USD 4,396,348	ファンドは3ヶ月LIBORを受け取り、MSCI Daily TR Net Emerging Markets Chile USD Indexを支払う	Morgan Stanley	13/3/2019	328,606	328,606
合計(基礎となる総エクスポージャー - 14,989,845米ドル)					1,046,123	1,046,123

TRS: トータル・リターン・スワップ

未決済先渡為替予約 2018年5月31日現在

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現評価益/(損) (米ドル)
JPY	11,709,763,662	USD	106,966,359	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	1,020,972
USD	417,193	JPY	45,701,781	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(4,268)
						1,016,704
ヘッジを使用したスイス・フラン建投資証券クラス						
CHF	4,719,232	USD	4,722,841	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	68,281
USD	216,177	CHF	216,308	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(3,426)
						64,855
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	430,722,642	USD	512,089,084	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(9,926,453)
USD	25,918,225	EUR	21,733,910	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	579,512
						(9,346,941)
ヘッジを使用した英ポンド建投資証券クラス						
GBP	202,470	USD	274,947	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(5,700)
USD	11,591	GBP	8,520	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	261
						(5,439)
ヘッジを使用したスウェーデン・クローネ建投資証券クラス						
SEK	1,291,043,307	USD	148,012,367	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(1,548,477)
USD	30,733	SEK	272,438	State Street Bank & Trust Company	13/6/2018	(174)
						(1,548,651)
合計(基礎となる総エクスポージャー - 787,696,237米ドル)						(9,819,472)

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

業種別内訳 2018年5月31日現在

	純資産比率 (%)
金融	78.06
政府	15.46
消費財、非循環型	5.18
消費財、循環型	1.91
資産担保証券	0.07
技術	0.05
投資有価証券 - 時価	100.73
その他の純負債	(0.73)
	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。

インスティテューショナル・U Sトレジャリー・ファンド
要約損益計算書

	2018年3月31日に 終了した会計期間	2017年3月31日に 終了した会計期間
	千米ドル	千米ドル
営業収益	57,228	19,267
損益を通じて公正価値で測定する金融負債に係る純損失	(85)	(1,965)
投資収益合計	57,143	17,302
営業費用	(5,571)	(6,275)
当期純営業利益	51,572	11,027
財務費用：		
償還可能参加型投資証券保有者への分配金	(51,199)	(11,797)
財務費用合計	(51,199)	(11,797)
当期純利益 / (損失)	373	(770)
英文目論見書に記載されている評価方法に合わせるための調整	-	937
運用による償還可能参加型投資証券保有者に帰属する純資産の増加	373	167

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

インスティテューショナル・U Sトレジャリー・ファンド
償還可能参加型投資証券保有者に帰属する要約純資産変動計算書

	2018年3月31日に 終了した会計期間	2017年3月31日に 終了した会計期間
	千米ドル	千米ドル
償還可能参加型投資証券保有者に帰属する期首純資産合計	8,000,953	7,669,294
運用による償還可能参加型投資証券保有者に帰属する純資産の増加	373	167
投資証券取引：		
償還可能参加型投資証券の発行による収入	27,827,584	14,862,596
償還可能参加型投資証券の買戻しによる支払	(25,330,690)	(15,132,211)
分配金再投資額	11,875	3,351
投資証券取引による純資産の増加 / (減少)	2,508,769	(266,264)
償還可能参加型投資証券保有者に帰属する期末純資産合計	10,510,095	7,403,197

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

インスティテューショナル・U Sトレジャリー・ファンド
要約貸借対照表

	2018年3月31日現在	2017年9月30日現在
	千米ドル	千米ドル
流動資産		
現金	397,297	399,707
現金同等物	-	-
未収金	299,190	3,978
損益を通じて公正価値で測定する金融資産	10,056,783	7,604,478
流動資産合計	10,753,270	8,008,163
流動負債		
未払金	243,175	7,210
損益を通じて公正価値で測定する金融負債	-	-
流動負債合計	243,175	7,210
償還可能参加型投資証券保有者に帰属する期末純資産価額	10,510,095	8,000,953

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

インスティテューショナル・U Sトレジャリー・ファンド

投資有価証券明細表 2018年3月31日現在

保有高	通貨	銘柄	公正価値 (千米ドル)	純資産比率 (%)
債券				
国債(2017年9月30日:44.11%)				
米国(2017年9月30日:44.11%)				
100,000,000	USD	US Treasury, 0.63%, 30/04/2018	99,956	0.95
235,280,000	USD	US Treasury, 1.38%, 31/07/2018	234,967	2.24
59,725,000	USD	US Treasury, 1.38%, 30/09/2018	59,655	0.57
175,000,000	USD	US Treasury, 0.88%, 15/10/2018	174,281	1.66
3,375,000	USD	US Treasury, 1.38%, 31/12/2018	3,364	0.03
100,000,000	USD	US Treasury, 1.50%, 31/12/2018	99,768	0.95
31,570,000	USD	US Treasury, 1.13%, 15/01/2019	31,374	0.30
23,905,000	USD	US Treasury, 1.13%, 31/01/2019	23,753	0.23
11,480,000	USD	US Treasury, 1.25%, 31/01/2019	11,418	0.11
4,590,000	USD	US Treasury, 1.50%, 31/01/2019	4,575	0.04
540,000,000	USD	US Treasury, FRN, 1.91%, 31/01/2019	540,915	5.15
230,000,000	USD	US Treasury, FRN, 1.84%, 30/04/2019	230,272	2.19
423,000,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 19/04/2018	422,656	4.02
25,000,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 26/04/2018	24,972	0.24
145,240,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 17/05/2018	144,952	1.38
124,380,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 31/05/2018	124,087	1.18
177,785,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 07/06/2018	177,312	1.69
21,280,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 14/06/2018	21,217	0.20
245,070,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 28/06/2018	244,161	2.32
200,000,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 12/07/2018	199,116	1.90
350,635,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 19/07/2018	349,001	3.32
378,550,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 02/08/2018	376,465	3.58
261,450,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 09/08/2018	259,896	2.47
85,025,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 16/08/2018	84,466	0.80
111,085,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 13/09/2018	110,148	1.05
50,000,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 20/09/2018	49,537	0.47
150,000,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 27/09/2018	148,595	1.41
米国合計			4,250,879	40.45
国債に対する投資合計			4,250,879	40.45
債券に対する投資合計			4,250,879	40.45

保有高	通貨	取引相手	金利	期日	公正価値 (千米ドル)	純資産比率 (%)
リバースレポ取引 ¹ (2017年9月30日:50.93%)						
フランス(2017年9月30日:1.37%)						
110,000,000	USD	Natixis	1.80%	31/12/2018	110,000	1.05
フランス合計					110,000	1.05
米国(2017年9月30日:49.56%)						
1,210,000,000	USD	Bank of Nova Scotia	1.77%	02/04/2018	1,210,000	11.51
1,480,000,000	USD	BNP Paribas	1.80%	02/04/2018	1,480,000	14.08
100,000,000	USD	Citigroup	1.80%	02/04/2018	100,000	0.95
400,000,000	USD	Credit Agricole	1.77%	02/04/2018	400,000	3.81
200,000,000	USD	Credit Agricole	1.77%	02/04/2018	200,000	1.90
410,904,000	USD	Merrill Lynch	1.80%	02/04/2018	410,904	3.91
200,000,000	USD	Merrill Lynch	1.80%	02/04/2018	200,000	1.90
95,000,000	USD	Merrill Lynch	1.80%	02/04/2018	95,000	0.91
1,600,000,000	USD	TD Securities (USA)	1.80%	02/04/2018	1,600,000	15.22
米国合計					5,695,904	54.19
リバースレポ取引に対する投資合計					5,805,904	55.24
損益を通じて公正価値で測定する金融資産合計					10,056,783	95.69
現金					397,297	3.78
その他の資産および負債					56,015	0.53
償還可能参加型投資証券保有者に帰属する純資産					10,510,095	100.00
資産合計額の内訳						資産合計に 対する割合 (%)
公認の証券取引所に上場されている譲渡可能な有価証券合計						39.53
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						53.99
その他の資産						6.48
資産合計						100.00

¹ 担保として保有する有価証券は5,940,474,000米ドルであった。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】(2018年12月末現在)

「サイエンティフィック・エクイティ・ファンド」

資産総額	750,362,283円
負債総額	540,538円
純資産総額(-)	749,821,745円
発行済数量	702,004,976口
1 単位当たり純資産額(/)	1.0681円

(参考情報)

「アメリカズ・ロングショート・マザーファンド」

資産総額	1,291,877,869円
負債総額	516,853円
純資産総額(-)	1,291,361,016円
発行済数量	1,034,142,382口
1 単位当たり純資産額(/)	1.2487円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

1 受益証券の名義書換え等
該当事項はありません。

2 受益者名簿の閉鎖の時期
受益者名簿は作成していません。

3 投資者に対する特典
該当事項はありません。

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

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

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します。ただし、の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとしします。

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る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ないません。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します。

9 償還金
償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている投資者（償還日以前において換金が行なわれた受益権に係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なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。また、受益証券を保有している投資者に対しては、償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日から受益証券と引き換えに当該投資者に支払います。

10 質権口記載または記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額等

資本金 3,120百万円

発行する株式の総数 36,000株

発行済株式の総数 15,000株

直近5カ年における主な資本金の額の増減

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

(2) 委託会社の機構

経営の意思決定機構

<株主総会>

株主により構成される会社における最高の意思決定機関として、取締役の選任、利益処分承認、定款の変更等、会社法および定款の定めにしたがって重要事項の決定を行ないます。

<取締役会>

取締役により構成され、当社の業務執行を決定し、その執行について監督します。

<エグゼクティブ委員会他各委員会>

当社における適切な経営戦略の構築、業務執行体制の構築および業務運営の推進を目的として、エグゼクティブ委員会を設置します。また、その他各種委員会を設置し、業務の能率的運営および責任体制の確立を図っています。

運用の意思決定機構

投資委員会

・投資委員会にて運用にかかる投資方針、パフォーマンスおよびリスク管理に関する重要事項を審議します。

運用担当部署

・各運用担当部署では、投資委員会の決定にしたがい、ファンドの個別の運用計画を策定し、各部署の投資プロセスを通して運用を行ないます。

ポートフォリオ・マネジャー

・ポートフォリオ・マネジャーは、策定された運用計画に基づき、個別銘柄を選択し売買に関する指図を行ないます。

リスク管理

・委託会社ではリスク管理を重視しており、独自開発のシステムを用いてリスク管理を行なっております。具体的には、運用担当部門とは異なる部門においてファンドの投資リスクの計測・分析、投資制限のモニタリングなどを行なうことにより、ファンドの投資リスクが運用方針に合致していることを確認し、その結果を運用担当部門にフィードバックするほか、社内関係者で共有しております。また、委託会社の業務に関するリスクについて社内規程を定めて管理を行なっております。

2【事業の内容及び営業の概況】

投信法に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また、金融商品取引法に定める投資助言業務、第一種金融商品取引業務および第二種金融商品取引業務等を行なっています。

委託会社の運用する証券投資信託は2018年12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	純資産総額
公募投資信託	追加型株式投資信託	78本	1,460,120百万円
	単体型株式投資信託	0本	0百万円
私募投資信託		70本	5,777,547百万円
合計		148本	7,237,667百万円

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」(昭和38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」(平成19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31期事業年度(自平成29年1月1日 至平成29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30期 (平成28年12月31日現在)	第31期 (平成29年12月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	12,415	19,097
立替金	49	11
前払費用	127	171
未収入金	2	3
未収委託者報酬	1,163	1,585
未収運用受託報酬	2,771	2,642
未収収益	2	1,384
為替予約	-	0
繰延税金資産	845	860
その他流動資産	5	33
流動資産計	18,573	25,789
固定資産		
有形固定資産		
建物附属設備	1	946
器具備品	1	411
有形固定資産計	1,536	1,358
無形固定資産		
ソフトウェア	8	4
のれん	98	42
無形固定資産計	106	47
投資その他の資産		
投資有価証券	0	3
長期差入保証金	972	1,124
前払年金費用	501	588
長期前払費用	8	25
投資その他の資産計	1,483	1,741
固定資産計	3,127	3,147
資産合計	21,701	28,937

	第30期 (平成28年12月31日現在)	第31期 (平成29年12月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	86	119
未払金	2	
未払収益分配金	3	4
未払償還金	75	74
未払手数料	392	593
その他未払金	1,385	1,737
未払費用	2	
未払消費税等	52	150
未払法人税等	263	438
前受金	-	79
前受収益	-	15
賞与引当金	1,884	1,886
役員賞与引当金	141	144
早期退職慰労引当金	37	9
流動負債計	5,465	6,500
固定負債		
退職給付引当金	60	55
資産除去債務	258	262
繰延税金負債	29	74
固定負債計	348	392
負債合計	5,813	6,892
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,435	3,120
資本剰余金		
資本準備金	2,316	3,001
その他資本剰余金	3,846	3,846
資本剰余金合計	6,162	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	6,953	11,739
利益剰余金合計	7,290	12,076
株主資本合計	15,887	22,044
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	0	0
評価・換算差額等合計	0	0
純資産合計	15,887	22,044
負債・純資産合計	21,701	28,937

(2)【損益計算書】

(単位：百万円)

	第30期 (自 平成28年 1月 1日 至 平成28年12月31日)	第31期 (自 平成29年 1月 1日 至 平成29年12月31日)
営業収益		
委託者報酬	3,977	5,202
運用受託報酬	1 9,036	8,890
その他営業収益	1 10,533	12,257
営業収益計	23,546	26,350
営業費用		
支払手数料	1,296	1,830
広告宣伝費	237	208
調査費		
調査費	383	380
委託調査費	1 4,020	4,313
調査費計	4,404	4,693
委託計算費	114	86
営業雑経費		
通信費	53	50
印刷費	63	62
諸会費	31	32
営業雑経費計	148	145
営業費用計	6,201	6,964
一般管理費		
給料		
役員報酬	604	353
給料・手当	3,809	3,960
賞与	2,232	2,232
給料計	6,646	6,546
退職給付費用	256	287
福利厚生費	822	892
事務委託費	1 2,216	2,433
交際費	51	69
寄付金	2	2
旅費交通費	241	243
租税公課	142	231
不動産賃借料	732	735
水道光熱費	64	65
固定資産減価償却費	229	262
のれん償却額	56	56
資産除去債務利息費用	3	3
諸経費	414	363
一般管理費計	11,881	12,194
営業利益	5,463	7,191

	第30期 (自 平成28年 1月 1日 至 平成28年12月31日)	第31期 (自 平成29年 1月 1日 至 平成29年12月31日)
営業外収益		
受取利息	3	0
有価証券売却益	-	0
為替差益	12	-
雑益	0	0
営業外収益計	16	1
営業外費用		
支払利息	0	-
有価証券売却損	0	-
為替差損	-	34
固定資産除却損	1	-
営業外費用計	1	34
経常利益	5,479	7,158
特別利益		
特別利益計	-	-
特別損失		
特別退職金	163	119
特別損失計	163	119
税引前当期純利益	5,315	7,039
法人税、住民税及び事業税	1,920	2,223
法人税等調整額	76	29
当期純利益	3,318	4,786

(3)【株主資本等変動計算書】

第30期（自 平成28年1月1日 至 平成28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				
平成28年1月1日残高	2,435	2,316	3,846	6,162	336	9,634	9,971	18,569	-	-	18,569
事業年度中の変動額											
剰余金の配当						6,000	6,000	6,000			6,000
当期純利益						3,318	3,318	3,318			3,318
株主資本以外の項目の事業 年度中の変動額（純額）									0	0	0
事業年度中の変動額合計	-	-	-	-	-	2,681	2,681	2,681	0	0	2,681
平成28年12月31日残高	2,435	2,316	3,846	6,162	336	6,953	7,290	15,887	0	0	15,887

第31期（自 平成29年1月1日 至 平成29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				
平成29年1月1日残高	2,435	2,316	3,846	6,162	336	6,953	7,290	15,887	0	0	15,887
事業年度中の変動額											
新株の発行	685	685		685				1,370			1,370
剰余金の配当							-	-			-
当期純利益						4,786	4,786	4,786			4,786
株主資本以外の項目の事業 年度中の変動額（純額）									0	0	0
事業年度中の変動額合計	685	685	-	685	-	4,786	4,786	6,156	0	0	6,156
平成29年12月31日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	11,739	12,076	22,044	0	0	22,044

注 記 事 項

【重要な会計方針】

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

有価証券

その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定）を採用しております。

2. デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

3. 固定資産の減価償却方法

(1) 有形固定資産

定額法により償却しております。なお、主な耐用年数は建物附属設備6～18年、器具備品2～15年であります。

(2) 無形固定資産

自社利用のソフトウェアの減価償却方法については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。

のれんの償却方法については、その効果の及ぶ期間（5～9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。

(3) 賞与引当金の計上方法

従業員の賞与の支払に備えて、賞与支給見込額の当事業年度負担額を計上しております。

(4) 役員賞与引当金の計上方法

役員の賞与の支払に備えて、賞与支給見込額の当事業年度負担額を計上しております。

(5) 早期退職慰労引当金の計上方法

早期退職慰労の支払に備えて、早期退職慰労支給見込額の当事業年度負担額を計上しております。

5. 外貨建の資産又は負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、期末の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

6. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の処理方法

消費税等の会計処理は、税抜方式によっております。

(2) 連結納税制度の適用

親会社であるブラックロック・ジャパン・ホールディングス合同会社を連結納税親会社として、連結納税制度を適用しております。

(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 (平成28年12月31日)	当事業年度 (平成29年12月31日)
建物附属設備	1,191 百万円	1,346 百万円
器具備品	717 百万円	821 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 (平成28年12月31日)	当事業年度 (平成29年12月31日)
未収収益	484 百万円	508 百万円
未払金	1,361 百万円	1,713 百万円
未払費用	173 百万円	356 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 (平成28年12月31日)	当事業年度 (平成29年12月31日)
当座貸越極度額	1,000 百万円	1,000 百万円
借入実行残高	-	-
差引額	1,000 百万円	1,000 百万円

（損益計算書関係）

1 関係会社に対する営業収益及び営業費用

各科目に含まれているものは次のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成28年 1月 1日 至 平成28年12月31日)		当事業年度 (自 平成29年 1月 1日 至 平成29年12月31日)	
	その他営業収益	4,730	百万円	4,670
委託調査費	377	百万円	438	百万円
事務委託費	630	百万円	824	百万円
運用受託報酬	4	百万円	48	百万円

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成28年1月1日 至 平成28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）	10,158	-	-	10,158

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

配当支払額

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
平成28年9月8日 取締役会決議	普通株式	6,000	590,667	平成28年9月9日	平成28年9月9日

当事業年度（自 平成29年1月1日 至 平成29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）	10,158	4,842	-	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

該当事項はありません。

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

投資有価証券は、当社設定の投資信託であり、通常の営業過程において保有しております。

デリバティブについては、外貨建て営業債権及び債務の為替変動リスクを回避するために利用し、投機的な取引は行っておりません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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（平成28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	12,415	12,415	-
(2) 未収委託者報酬	1,163	1,163	-
(3) 未収運用受託報酬	2,771	2,771	-
(4) 未収収益	1,192	1,192	-
(5) 長期差入保証金	972	969	3
資産計	18,516	18,512	3
(1) 未払手数料	392	392	-
(2) 未払費用	1,141	1,141	-
負債計	1,533	1,533	-

当事業年度（平成29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	19,097	19,097	-
(2) 未収委託者報酬	1,585	1,585	-
(3) 未収運用受託報酬	2,642	2,642	-
(4) 未収収益	1,384	1,384	-
(5) 長期差入保証金	1,124	1,109	14
資産計	25,834	25,819	14
(1) 未払手数料	593	593	-
(2) 未払費用	1,245	1,245	-
負債計	1,838	1,838	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法に関する事項

資 産

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収運用受託報酬及び(4) 未収収益

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっています。

(5) 長期差入保証金

事務所敷金の時価については、事務所の敷金を当該賃貸借契約期間を基にしたインターバンク市場で取引されている円金利スワップレートで割り引いて算定する方法によっています。また従業員社宅敷金の時価については、平均残存勤務期間を基にしたインターバンク市場で取引されている円金利スワップレートで割り引いて算定する方法によっています。

負 債

(1)未払手数料、(2) 未払費用

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっています。

(注2) 金銭債権の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成28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	12,415	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	1,163	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	2,771	-	-	-
(4) 未収収益	1,192	-	-	-
(5) 長期差入保証金	-	907	53	11
合計	17,543	907	53	11

当事業年度(平成29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	19,097	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	1,585	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	2,642	-	-	-
(4) 未収収益	1,384	-	-	-
(5) 長期差入保証金	-	1,051	61	11
合計	24,709	1,051	61	11

(有価証券関係)

前事業年度(平成28年12月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(平成29年12月31日)

その他有価証券

	種類	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	その他 投資信託	3	3	0
合計		3	3	0

（退職給付関係）

前事業年度（自 平成28年1月1日 至 平成28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、平成21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、平成23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、平成23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 平成28年 1月 1日 至 平成28年12月31日)
退職給付債務の期首残高	1,661
勤務費用	250
利息費用	11
数理計算上の差異の発生額	8
退職給付の支払額	168
退職給付債務の期末残高	1,745

(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 平成28年 1月 1日 至 平成28年12月31日)
年金資産の期首残高	2,304
期待運用収益	27
数理計算上の差異の発生額	56
事業主からの拠出額	274
退職給付の支払額	168
年金資産の期末残高	2,381

(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 (平成28年12月31日)
積立型制度の退職給付債務	1,685
年金資産	2,381
	696
非積立型制度の退職給付債務	60
未積立退職給付債務	635
未認識数理計算上の差異	174
未認識過去勤務費用	20
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	441
退職給付引当金	60
前払年金費用	501
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	441

(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 平成28年 1月 1日 至 平成28年12月31日)
勤務費用	250
利息費用	11
期待運用収益	27
数理計算上の差異の費用処理額	39
過去勤務費用の処理額	6
確定給付制度に係る退職給付費用合計	188
特別退職金	163
合計	351

(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 (平成28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73%、株式22%及びその他3%となっております。

長期期待運用収益率の算定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (自 平成28年 1月 1日 至 平成28年12月31日)
割引率	0.5%
長期期待運用収益率	0.8%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、68百万円 でありました。

当事業年度（自 平成29年1月1日 至 平成29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、平成21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、平成23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、平成23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 平成29年 1月 1日 至 平成29年12月31日)
退職給付債務の期首残高	1,745
勤務費用	268
利息費用	8
数理計算上の差異の発生額	20
退職給付の支払額	170
退職給付債務の期末残高	1,832

(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 平成29年 1月 1日 至 平成29年12月31日)
年金資産の期首残高	2,381
期待運用収益	19
数理計算上の差異の発生額	83
事業主からの拠出額	290
退職給付の支払額	153
年金資産の期末残高	2,621

(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 (平成29年12月31日)
積立型制度の退職給付債務	1,776
年金資産	2,621
	845
非積立型制度の退職給付債務	55
未積立退職給付債務	789
未認識数理計算上の差異	242
未認識過去勤務費用	13
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	532
退職給付引当金	55
前払年金費用	588
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	532

(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 平成29年 1月 1日 至 平成29年12月31日)
勤務費用	268
利息費用	8
期待運用収益	19
数理計算上の差異の費用処理額	35
過去勤務費用の処理額	6
確定給付制度に係る退職給付費用合計	216
特別退職金	119
合計	335

(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 (平成29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72%、株式23%及びその他5%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 平成29年 1月 1日 至 平成29年12月31日)
割引率	0.4%
長期期待運用収益率	0.9%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、71百万円 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 (平成28年12月31日)	当事業年度 (平成29年12月31日)
繰延税金資産		
未払費用	196	206
賞与引当金	581	537
資産除去債務	79	80
資産調整勘定	24	4
未払事業税	55	74
早期退職慰労引当金	11	2
退職給付引当金	18	17
有形固定資産	5	4
その他	9	44
繰延税金資産合計	983	973
繰延税金負債		
退職給付引当金	153	180
資産除去債務に対応する除去費用	13	6
繰延税金負債合計	167	186
繰延税金資産の純額	815	786

(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 (平成28年12月31日)	当事業年度 (平成29年12月31日)
流動資産 - 繰延税金資産	845	860
固定負債 - 繰延税金負債	29	74

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 (平成28年12月31日)	当事業年度 (平成29年12月31日)
法定実効税率	33.1 %	30.9 %
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	3.3	2.1
損金不算入ののれん償却額	0.3	0.2
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	0.8	0.2
所得拡大促進税制による税額控除	-	1.8
その他	0.0	0.4
税効果会計適用後の法人税等の負担率	37.5 %	32.0 %

(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

使用見込期間を当該定期建物賃貸借契約上の賃貸借期間10年と見積り、割引率は1.5%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。

3. 当該資産除去債務の総額の増減

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 平成28年 1月 1日 至 平成28年12月31日)	当事業年度 (自 平成29年 1月 1日 至 平成29年12月31日)
期首残高	254	258
時の経過による調整額	3	3
資産除去債務の履行による減少額	-	-
期末残高	258	262

(デリバティブ取引関係)

前事業年度（平成28年12月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（平成29年12月31日）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

(単位：百万円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建 米ドル	69	-	0	0
合計		69	-	0	0

(注) 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。

（セグメント情報等）

前事業年度（自 平成28年1月1日 至 平成28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	3,977	9,036	10,533	23,546

(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
12,127	9,200	2,218	23,546

（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	4,735	投資運用業
ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	2,815	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(自平成29年1月1日 至 平成29年12月31日)

1. セグメント情報

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

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位:百万円)

	委託者報酬	運用受託報酬	その他	合計
外部顧客営業収益	5,202	8,890	12,257	26,350

(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
13,186	10,831	2,332	26,350

(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	4,719	投資運用業
ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	3,512	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 平成28年1月1日 至 平成28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	13,889 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	4	未収収益	484
							受入手数料	4,730		
							委託調査費	377	未払費用	173
							事務委託費	630		
親会社	ブラックロック・ジャパン・ホールディングス合同会社	日本 東京都	1万円	持株会社	(被所有) 直接 100	株式の 保有等	営業外収益	0	その他未払金	1,361

当事業年度（自 平成29年1月1日 至 平成29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	14,286 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	48	未収収益	508
							受入手数料	4,670		
							委託調査費	438	未払費用	356
							事務委託費	824		
親会社	ブラックロック・ジャパン・ホールディングス合同会社	日本 東京都	1万円	持株会社	(被所有) 直接 100	株式の 保有等	営業外収益	0	その他未払金	1,645

(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 平成28年1月1日 至 平成28年12月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成29年1月1日 至 平成29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 平成28年1月1日 至 平成28年12月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社を持つ会社	ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	米国 カリフォル ニア州	1,000 米ドル	投資 顧問業	なし	投資顧問 契約の 再委任等	受入手数料	2,815	未収収益	267
							委託調査費	40		
							事務委託費	0	未払費用	3
同一の親会社を持つ会社	ブラックロック・インベストメント・マネジメント・エルエルシー	米国 デラウェア 州	87 百万 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	425	未収収益	35
							委託調査費	1,556		
							事務委託費	81	未払費用	135

当事業年度(自平成29年1月1日至平成29年12月31日)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社を持つ会社	ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	米国カリフォルニア州	1,000米ドル	投資顧問業	なし	投資顧問契約の再委任等	受入手数料	3,512	未収収益	296
							委託調査費	77	未払費用	17
							事務委託費	10		
同一の親会社を持つ会社	ブラックロック・インベストメント・マネジメント・エルエルシー	米国デラウェア州	213百万米ドル	投資顧問業	なし	投資顧問契約の再委任等	受入手数料	363	未収収益	28
							委託調査費	1,427	未払費用	129
							事務委託費	119	その他未払金	1

(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。
- (5) 支払利息については、市場金利を勘案して決定しております。なお、担保は差し入れておりません。
- (6) 長期借入金の期末残高は劣後特約付借入金に係るものであります。

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 (自平成28年1月1日 至平成28年12月31日)	当事業年度 (自平成29年1月1日 至平成29年12月31日)
1株当たり純資産額	1,564,056円75銭	1,469,634円10銭
1株当たり当期純利益金額	326,685円49銭	456,306円62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 (自平成28年1月1日 至平成28年12月31日)	当事業年度 (自平成29年1月1日 至平成29年12月31日)
当期純利益 (百万円)	3,318	4,786
普通株主に帰属しない金額 (百万円)	-	-
普通株式に係る当期純利益 (百万円)	3,318	4,786
普通株式の期中平均株式数 (株)	10,158	10,490

独立監査人の監査報告書は、当事業年度(自平成29年1月1日至平成29年12月31日)を対象としております。

【中間財務諸表】

1. 中間財務諸表の作成方法について

委託会社であるブラックロック・ジャパン株式会社(以下「当社」という。)の中間財務諸表すなわち中間貸借対照表、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52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」(平成19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(自平成30年1月1日 至平成30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 (平成30年6月30日)	
資産の部		
流動資産		
現金・預金	2	20,117
立替金		0
前払費用		185
未収入金		14
未収委託者報酬		1,595
未収運用受託報酬		1,817
未収収益		1,400
為替予約		2
繰延税金資産		620
その他流動資産		11
流動資産計		25,766
固定資産		
有形固定資産		
建物附属設備	1	1,142
器具備品	1	413
有形固定資産計		1,556
無形固定資産		
ソフトウェア		11
のれん		14
無形固定資産計		25
投資その他の資産		
投資有価証券		14
長期差入保証金		1,116
前払年金費用		637
長期前払費用		20
投資その他の資産計		1,788
固定資産計		3,369
資産合計		29,135

(単位：百万円)

中間会計期間末
(平成30年6月30日)

負債の部	
流動負債	
預り金	95
未払金	
未払収益分配金	4
未払償還金	74
未払手数料	564
その他未払金	707
未払費用	1,401
未払消費税等	135
未払法人税等	321
賞与引当金	966
役員賞与引当金	74
流動負債計	4,345
固定負債	
退職給付引当金	59
資産除去債務	339
繰延税金負債	90
固定負債計	490
負債合計	4,835
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	13,996
利益剰余金合計	14,333
株主資本合計	24,300
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	24,300
負債・純資産合計	29,135

(2) 中間損益計算書

(単位：百万円)

	中間会計期間	
	(自 平成30年1月1日	至 平成30年6月30日)
営業収益		
委託者報酬		2,830
運用受託報酬		4,526
その他営業収益		6,435
営業収益計		13,791
営業費用		
支払手数料		964
広告宣伝費		51
調査費		
調査費		187
委託調査費		2,300
調査費計		2,488
委託計算費		41
営業雑経費		
通信費		30
印刷費		23
諸会費		13
営業雑経費計		66
営業費用計		3,613
一般管理費		
給料		
役員報酬		290
給料・手当		2,047
賞与		1,354
給料計		3,692
退職給付費用		140
福利厚生費		459
事務委託費		1,292
交際費		29
寄付金		1
旅費交通費		127
租税公課		134
不動産賃借料		384
水道光熱費		31
固定資産減価償却費	1	145
のれん償却額	1	28
資産除去債務利息費用		2
諸経費		227
一般管理費計		6,696
営業利益		3,481

(単位：百万円)

	中間会計期間 (自 平成30年1月1日 至 平成30年6月30日)
営業外収益	
受取利息	0
雑益	0
営業外収益計	0
営業外費用	
為替差損	1
営業外費用計	1
経常利益	3,480
特別損失	
特別退職金	41
特別損失計	41
税引前中間純利益	3,439
法人税、住民税及び事業税	925
法人税等調整額	257
中間純利益	2,256

(3) 中間株主資本等変動計算書

中間会計期間（自 平成30年1月1日 至 平成30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				
平成30年1月1日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	11,739	12,076	22,044	0	0	22,044
中間事業年度中の変動額											
中間純利益						2,256	2,256	2,256			2,256
株主資本以外の項目の中間事業 年度中の変動額（純額）									0	0	0
中間事業年度中の変動額合計	-	-	-	-	-	2,256	2,256	2,256	0	0	2,255
平成30年6月30日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	13,996	14,333	24,300	0	0	24,300

注 記 事 項
(重要な会計方針)

項 目	中間会計期間 自 平成30年1月 1日 至 平成30年6月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	その他有価証券 時価のあるもの 決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、移動平均法により算定）を採用しております。
2. デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法	時価法を採用しております。
3. 固定資産の減価償却方法	(1) 有形固定資産 定額法により償却しております。 なお、主な耐用年数は建物附属設備6～18年、器具備品2～15年であります。 (2) 無形固定資産 自社利用のソフトウェアの減価償却方法については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。 のれんの償却方法については、その効果の及ぶ期間（5～9年）に基づく定額法によっております。

項 目	<p style="text-align: center;">中間会計期間</p> <p style="text-align: center;">自 平成30年1月 1日</p> <p style="text-align: center;">至 平成30年6月30日</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>
5. 外貨建の資産又は負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間会計期間末の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
6. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 消費税等の会計処理 税抜方式によっております。</p> <p>(2) 連結納税制度の適用 親会社であるブラックロック・ジャパン・ホールディングス合同会社を連結納税親会社として、連結納税制度を適用しております。</p>

(中間貸借対照表関係)

中間会計期間末 平成30年6月30日	
1 有形固定資産の減価償却累計額	
建物附属設備	1,428百万円
器具備品	880百万円
2 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行2行と当座貸越契約を締結しております。これら契約に基づく当中間会計期間末の借入未実行残高は次のとおりであります。	
当座貸越極度額	1,000百万円
借入実行残高	-
差引額	1,000百万円

(中間損益計算書関係)

中間会計期間 自 平成30年1月1日 至 平成30年6月30日	
1 減価償却実施額	
有形固定資産	143百万円
無形固定資産	30百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

中間会計期間				
自 平成30年1月 1日				
至 平成30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				
該当事項はありません。				
(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。				

(金融商品関係)

中間会計期間	
自 平成30年1月 1日	
至 平成30年6月30日	
1. 金融商品の状況に関する事項	
(1) 金融商品に対する取組方針	
<p>当社は、資金運用については短期的な預金等に限定し、また、資金調達については関連当事者からの長期借入に限定しています。</p> <p>投資有価証券は、当社設定の投資信託であり、通常の営業過程において保有しております。</p> <p>デリバティブについては、外貨建て営業債権及び債務の為替変動リスクを回避するために利用し、投機的な取引は行っておりません。</p>	
(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制	
<p>営業債権である未収委託者報酬及び未収運用受託報酬は、顧客の信用リスクに晒されています。当該リスクに関しては、当社の経理規程に従い、取引先ごとの期日管理及び残高管理を行い、個別に未収債権の回収可能性を管理する体制をしいております。</p> <p>営業債務である未払手数料はその全てが1年以内の支払期日となっております。</p> <p>営業債務は流動性リスクに晒されていますが、当社では資金繰計画を作成するなどの方法により管理しております。</p>	

中間会計期間

自 平成30年1月 1日

至 平成30年6月30日

2. 金融商品の時価等に関する事項

平成30年6月30日（中間期の決算日）における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりです。

（単位：百万円）

	中間貸借対照表計上額 (*)	時価(*)	差額
現金・預金	20,117	20,117	-
未収委託者報酬	1,595	1,595	-
未収運用受託報酬	1,817	1,817	-
未収収益	1,400	1,400	-
投資有価証券 その他有価証券	14	14	-
長期差入保証金	1,116	1,102	13
資産計	26,061	26,048	13
未払手数料	564	564	-
未払費用	1,401	1,401	-
負債計	1,965	1,965	-
デリバティブ取引 ヘッジ会計が適用されていない もの	2	2	-
デリバティブ計	2	2	-

(注)

金融商品の時価の算定方法に関する事項

現金・預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬及び未収収益

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっています。

投資有価証券

投資有価証券は、投資信託であり、決算日の基準価格によっております。

長期差入保証金

事務所敷金の時価については、事務所の敷金を当該賃貸借契約期間を基にしたインターバンク市場で取引されている円金利スワップレートで割り引いて算定する方法によっています。また従業員社宅敷金の時価については、平均残存勤務期間を基にしたインターバンク市場で取引されている円金利スワップレートで割り引いて算定する方法によっています。

但し、上記レートがマイナスとなる場合は、割引率はゼロを使用しております。

未払手数料、未払費用

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっています。

デリバティブ取引

デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、()で示しております。

(有価証券関係)

中間会計期間 自 平成30年1月 1日 至 平成30年6月30日				
その他有価証券				
(単位：百万円)				
	種類	中間貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原 価を超えるもの	その他 投資信託	5	5	0
貸借対照表計上額が取得原 価を超えないもの	その他 投資信託	9	10	0
合計		14	15	0

(資産除去債務関係)

中間会計期間 自 平成30年1月 1日 至 平成30年6月30日	
資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの	
1. 当該資産除去債務の概要	当事業所の定期建物賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。
2. 当該資産除去債務の金額の算定方法	使用見込期間を当該定期建物賃貸借契約上の賃貸借期間10年と見積り、割引率は1.5%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	262 百万円
有形固定資産の取得に伴う増加額	75 百万円
時の経過による調整額	2 百万円
中間会計期間末残高	<u>339 百万円</u>

(セグメント情報等)

中間会計期間
自 平成30年1月 1日
至 平成30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

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	2,830	4,526	6,435	13,791

地域に関する情報

(1) 売上高

(単位：百万円)

日本	北米	その他	合計
6,833	5,379	1,578	13,791

(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。

(2) 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。

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	2,721	投資運用業
ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	1,575	投資運用業

(デリバティブ取引関係)

中間会計期間					
自 平成30年1月 1日					
至 平成30年6月30日					
ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引					
通貨関連			(単位：百万円)		
区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建 米ドル	236	-	2	2
合計		236	-	2	2
(注) 時価の算定方法 先物為替相場に基づき算定しております。					

(1株当たり情報)

中間会計期間	
自 平成30年1月 1日	
至 平成30年6月30日	
1株当たり純資産額	1,620,018円36銭
1株当たり中間純利益	150,423円25銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	
1株当たり中間純利益の算定上の基礎	
損益計算書上の中間純利益	2,256百万円
1株当たり中間純利益の算定に	2,256百万円
用いられた普通株式に係る中間純利益	
期中平均株式数	15,000株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

- ・名称 みずほ信託銀行株式会社
- ・資本金の額 247,369百万円（2018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。

<再信託受託会社の概要>

- ・名称 資産管理サービス信託銀行株式会社
- ・資本金 50,000百万円（2018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（資産管理サービス信託銀行株式会社）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) (2018年3月末現在)	事業の内容
S M B C 日興証券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

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

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【その他】

1 交付目論見書の表紙等に、以下の事項を記載します。

(1) 委託会社等の情報

委託会社名

金融商品取引業者登録番号

設立年月日

資本金

当該委託会社が運用する投資信託財産の合計純資産総額

「ファンドの運用の指図を行なう者である。」旨

(2) 受託会社に関する情報

受託会社名および「ファンドの財産の保管および管理を行なう者である。」旨

(3) 詳細情報の入手方法

詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載します。

委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間等

請求目論見書の入手方法および投資信託約款が請求目論見書に添付されている旨

(4) 交付目論見書の使用開始日

(5) 届出の効力に関する事項

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

届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法

届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日

(6) その他の記載事項

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

投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨

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

「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載

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

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

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

独立監査人の監査報告書

平成30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

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 星 知子指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 中 島 紀子

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平成29年1月1日から平成29年12月31日までの第31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。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

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平成29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すべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

2019年2月6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

指定有限責任社員 公認会計士 辻村 和之
業務執行社員

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」に掲げられているサイエンティフィック・エクイティ・ファンドの2018年6月21日から2018年12月20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。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

監査意見

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、サイエンティフィック・エクイティ・ファンドの2018年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成30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

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 田 中 素 子指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 中 島 紀 子

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平成30年1月1日から平成30年12月31日までの第32期事業年度の中間会計期間（平成30年1月1日から平成30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。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、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。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。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示の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、当監査法人は、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。また、中間監査には、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見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

中間監査意見

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平成30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（平成30年1月1日から平成30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。

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。