

【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】 2024年4月12日

【発行者名】 ブラックロック・ジャパン株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 有田 浩之

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目8番3号

【事務連絡者氏名】 坂井 瑛美

【電話番号】 03-6703-7940

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

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

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

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

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

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

（以下「当ファンド」または「ファンド」という場合があります。）

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

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

当初元本は、1口当たり1円です。

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

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

(3)【発行（売出）価額の総額】

5,000億円を上限とします。

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

(4)【発行（売出）価格】

購入受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額につきましては、販売会社または下記にお問い合わせください。

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

ホームページアドレス：www.blackrock.com/jp/

(5)【申込手数料】

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

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

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

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

(6)【申込単位】

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

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

(7)【申込期間】

2024年4月13日から2024年10月11日まで

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

(8)【申込取扱場所】

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

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

ホームページアドレス：www.blackrock.com/jp/

(9)【払込期日】

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

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

(10)【払込取扱場所】

上記「(8)申込取扱場所」で払い込みください。

(11)【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構です。

(12)【その他】

購入代金の利息

購入代金には利息をつけません。

日本以外の地域における発行

行いません。

購入不可日

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

振替受益権について

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

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

（参考）

投資信託振替制度とは、

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

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

<商品分類表>

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

<属性区分表>

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

< 各分類および区分の定義 >

・ 商品分類

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

・ 属性区分

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

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

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

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

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

ファンドの特色

1

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

絶対収益追求とは

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

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

＜主要投資対象ファンド＞…絶対収益を追求するファンド

ブラックロック・ストラテジック・ファンズ ブラックロック・システムティック・スタイル・ファクター・ファンドクラス投資証券

＜副次的投資対象ファンド＞…短期債券等に投資するファンド

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

※投資対象ファンドは、委託会社の判断により適宜見直しを行うことがあります。

- 主要投資対象ファンドへの投資割合を高位に保ちます。
※投資対象ファンドへの投資割合は、原則として市場動向および投資対象ファンドの収益性等を勘案して委託会社が決定します。
- 主要投資対象ファンドは、世界の株式、債券、通貨等の複数の資産に投資し、市場の変動に関わらない中長期的なリターンを獲得を目指します。

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

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

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

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

*後述の「ロングショート戦略について」をあわせてご参照ください。

2

米ドルに対する為替ヘッジを行い、為替リスクの低減を図ります。

- 主要投資対象ファンドにおいては、当該ファンドで保有する資産を米ドル換算し、米ドル換算した額に対して米ドル売り・円買いの為替取引(ヘッジ取引)を行うことによって、為替変動リスクの低減を図ります(また、米ドル金利が円金利より高い場合、ヘッジコストがかかります。)。主要投資対象ファンドが運用戦略上保有する米ドル建て以外の資産、および収益追求のために取得した通貨市場における米ドル以外のエクスポージャーについては、米ドルでの為替ヘッジを行っておりません。したがって、米ドル以外の通貨の為替変動の影響を受けます。
- 米ドル建ての副次的投資対象ファンドに対しては、マザーファンドにおいて為替ヘッジを行います。

運用プロセス(主要投資対象ファンドの運用プロセス)



※上記の投資候補銘柄数は、今後変更になる可能性があります。

※資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

※主要投資対象ファンドの運用プロセスは変更となる場合があります。

(追加的記載事項)

主要投資対象ファンドの概要

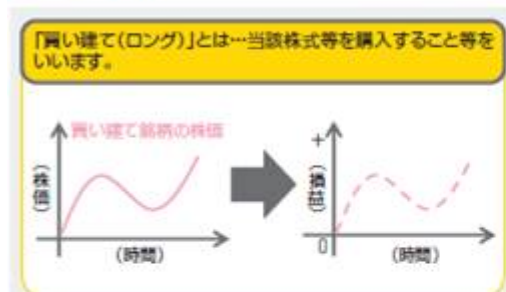
ファンド名	ブラックロック・ストラテジック・ファンズ ブラックロック・システムティック・スタイル・ファクター・ファンド クラスI投資証券(円建て円ヘッジ)
形態	ルクセンブルグ籍(オープン・エンド型)会社型外国投資証券(円建て円ヘッジ)
投資目的および投資態度	当ファンドは、長期的に市場動向に左右されない絶対収益の追求を目指して運用を行います。 当ファンドは機動的にエクスポージャーを調整することで様々なスタイルファクター戦略からプレミアムを獲得することを目指します。 独自の計量化モデルを用いて銘柄の選定を行い投資目的の達成を目指します。 また、バリュー、モメンタム、キャリー、ディフェンシブとい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

ロングショート戦略とは

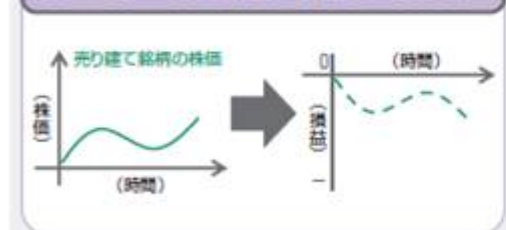
■ロングショート戦略とは、相対的に投資魅力度の高い資産を買い建て(ロング)、相対的に投資魅力度が低い資産を売り建て(ショート)する投資手法をいいます。「買い建て」銘柄の方が「売り建て」銘柄よりも良いパフォーマンスの場合にロングショート戦略全体としての損益はプラスになります(逆の場合には、損益はマイナスになります)。

「買い建て」と「売り建て」について

[イメージ図]

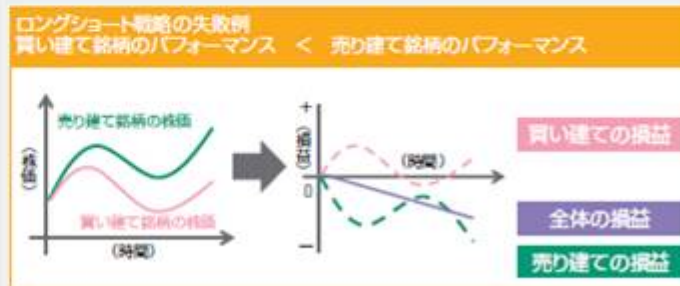
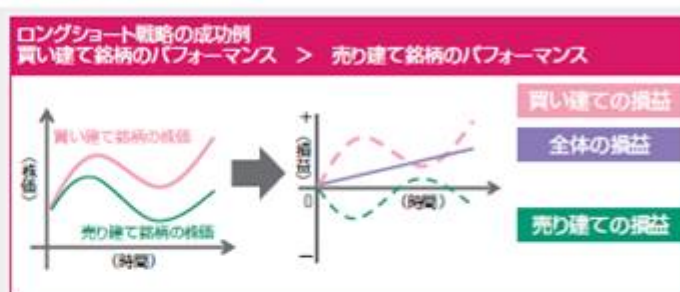


「売り建て(ショート)」とは…当該株式等を他から借りて売却すること等をいいます。(後で買い戻す必要があります。)



ロングショート戦略による損益

[イメージ図]



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

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

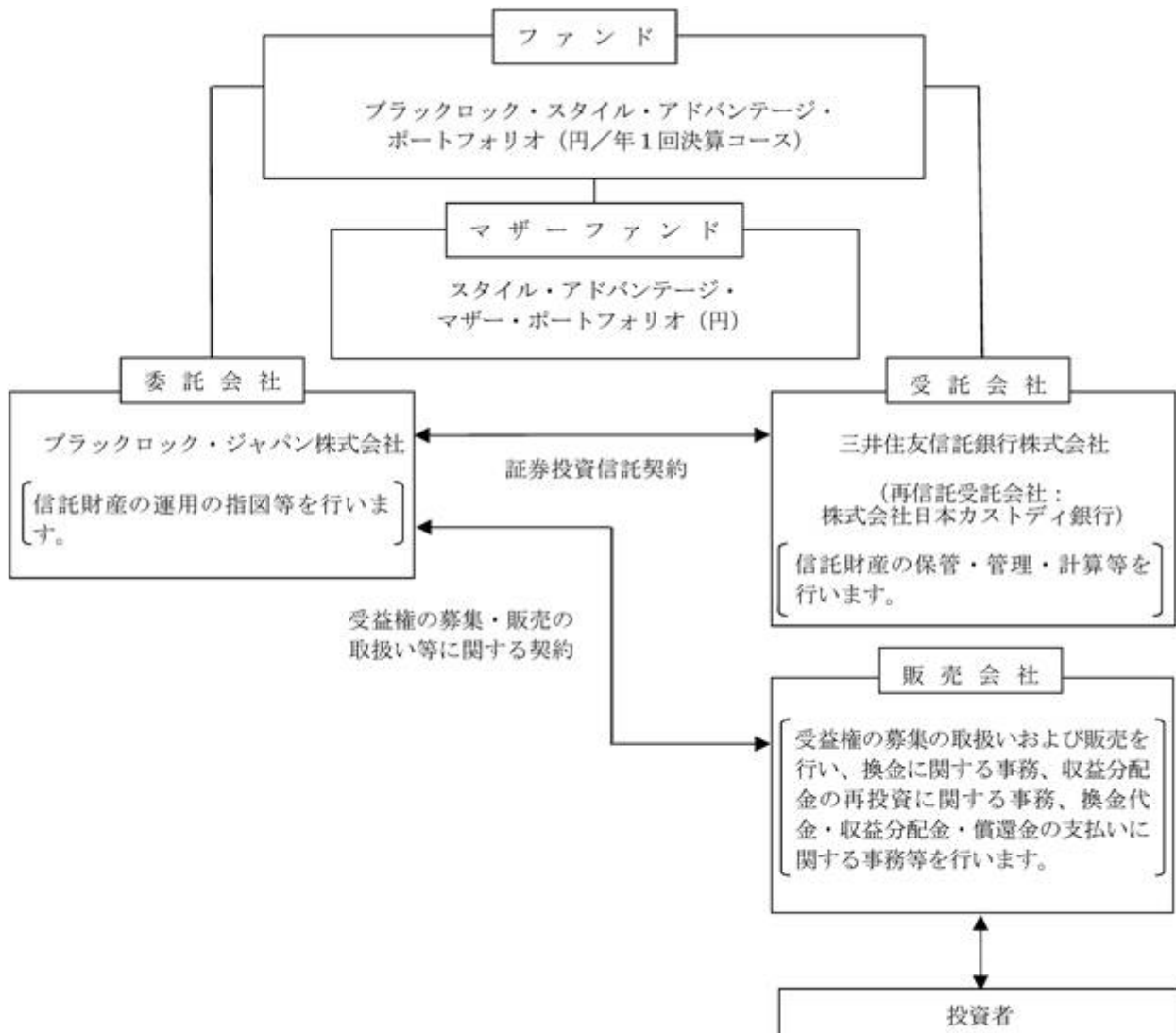
※ロングとショートの双方で損失した場合は、通常想定される以上に当ファンドの運用成果が影響を被る可能性があります。

(2) 【ファンドの沿革】

2017年8月4日

信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



< 契約等の概要 >

a. 「証券投資信託契約」

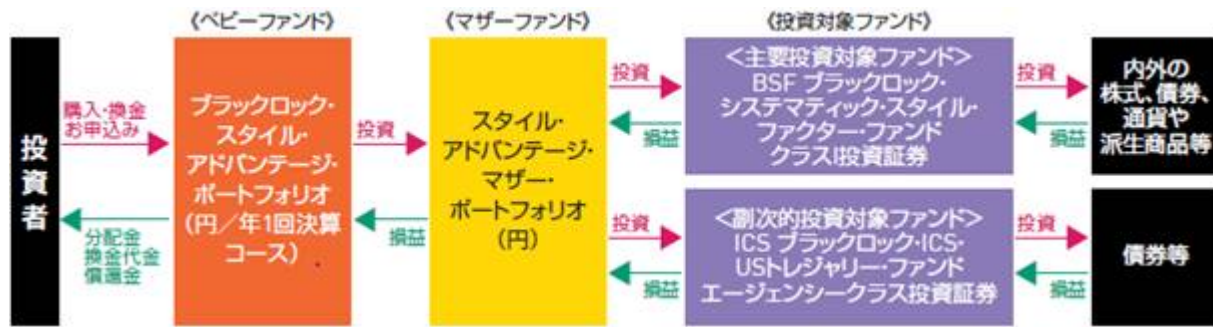
ファンドの設定・運営に関する事項、信託財産の運用・管理に関する事項、委託会社および受託会社の業務に関する事項、投資者に関する事項等について規定しています。

b. 「受益権の募集・販売の取扱い等に関する契約」

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

<ファンドの仕組み>

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



<委託会社の概況>

2024年1月末現在の委託会社の概況は、以下のとおりです。

a . 資本金 3,120百万円

b . 沿革

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

c . 大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

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

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

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

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

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

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

<参考> マザーファンドの運用の基本方針

スタイル・アドバンテージ・マザー・ポートフォリオ（円）

- 運用の基本方針 -

1. 基本方針

この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を目標に運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

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

(2) 投資態度

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

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

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

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

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

(3) 投資制限

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

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

(2)【投資対象】

投資対象とする資産の種類

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

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

投資対象とする有価証券

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

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

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

投資対象とする金融商品

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

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

マザーファンドの投資対象ファンドの概要

a. B S F ブラックロック・システムティック・スタイル・ファクター・ファンド

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

b. I C S ブラックロック・ICS・USTレジャリー・ファンド

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

(3) 【運用体制】

ファンドの運用・管理の各業務の役割分担を社内規程により定めております。

ファンドの運用については委託会社の運用部門が統括しています。

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

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

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

ブラックロック・グループ

ブラックロック・グループは、運用資産残高約10兆ドル^{*}（約1,411兆円）を持つ世界最大級の独立系資産運用グループであり、当社はその日本法人です。

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

* 2023年12月末現在。（円換算レートは1ドル＝140.980円を使用）

(4) 【分配方針】

収益分配方針

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

a．分配対象額の範囲

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

b．分配対象収益についての分配方針

分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。

c．留保益の運用方針

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

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

収益の分配

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

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

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

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

収益分配金の支払い

a. 支払時期と支払場所

(a) 一般コースの場合

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

(b) 累積投資コースの場合

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

b. 時効

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

(5)【投資制限】

以下は当ファンドの約款で定める投資制限です。

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

投資信託証券への投資制限

投資信託証券への実質投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資制限

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

公社債の借入れ

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

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

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

d. a. の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

外国為替予約の指図および範囲

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

資金の借入れ

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

信用リスク集中回避のための投資制限

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

3【投資リスク】

(1) 投資リスク

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

当ファンドにかかる主なリスクは以下の通りです。

基準価額の変動要因

a．ロングショート戦略によるリスク

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

b．株価変動リスク

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

c．債券投資のリスク

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

d．デリバティブ取引のリスク

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

（レバレッジ・リスク）

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

（デリバティブ取引の取引先に関するリスク）

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

e．為替変動リスク

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

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

f．カントリーリスク

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

ファンド運営上のリスク

a．購入および換金の受付の中止・取消

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

b．ファンドの繰上償還

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

c．法令・税制・会計等の変更

法令・税制・会計方法等は今後変更される可能性があります。

d．流動性リスクに関する事項

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

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

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

e．収益分配金に関する留意点

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

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

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

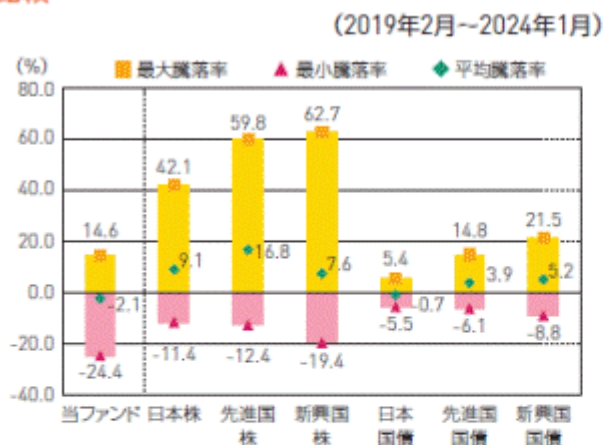
(2) リスクの管理体制

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

リスクの管理体制は、変更となる場合があります。

(参考情報)

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



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

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

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

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

※各資産クラスの指数

- 日本株…東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)
 - 先進国株…MSCIコクサイ指数 (配当込み、円ベース)
 - 新興国株…MSCIエマージング・マーケット指数 (配当込み、円ベース)
 - 日本国債…NOMURA-BPI国債
 - 先進国国債…FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)
 - 新興国国債…J.P.モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・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、各月末における分配金再投資基準価額の1年間の騰落率および分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算しており、実際の基準価額とは異なる場合があります。

<各指数について>

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

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

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

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

J.P.モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・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4.40%（税抜4.00%）を上限として、販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。詳細は販売会社にお問い合わせください。

販売会社につきましては、下記にお問い合わせください。

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

ホームページアドレス：www.blackrock.com/jp/

なお、購入時手数料には消費税等相当額が含まれています（以下同じ。）。

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

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

(2)【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬の総額

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

a．ファンドの信託報酬

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

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

b．主要投資対象ファンドにかかる運用管理費用

年0.55%が投資対象ファンドから支払われます。

信託報酬の支払時期と支払方法等

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

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

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

個別元本方式について

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

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

換金時および償還時の課税について

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

収益分配金の課税について

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

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

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

個人、法人の課税の取扱いについて

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

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

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

公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合にNISA（少額投資非課税制度）の適用対象となります。当ファンドは、NISAの対象ではありません。

b. 法人の投資者に対する課税

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

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

上記は2024年1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。

(参考情報) ファンドの総経費率

・直近の運用報告書の対象期間(2023年1月17日から2024年1月15日)における当ファンドの総経費率(年率換算)は以下の通りです。

総経費率 (①+②+③)	① 当ファンドの 費用の比率	② 投資先ファンドの 運用管理費用比率	③ 投資先ファンドの 運用管理費用以外の比率
1.67%	0.80%	0.54%	0.33%

※上記は、対象期間の運用報告書に記載されている総経費率(原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税は含まれません。消費税等のかかるものは消費税等を含む。)です。

※①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

※①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

※計算方法等の詳細は、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。なお、新たな対象期間にかかる運用報告書が作成され、上記の総経費率が更新されている場合があります。

5 【運用状況】

以下の運用状況は2024年1月末現在のものです。

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

(1) 【投資状況】

資産の種類	金額(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	9,675,389,548	100.03
内 日本	9,675,389,548	100.03
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,349,116	0.03
純資産総額	9,672,040,432	100.00

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

順位	銘柄	国/地域	種類	数量(口)	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
1	スタイル・アドバンテージ・マザー・ポートフォリオ(円)	日本	親投資信託受益証券	10,976,051,672	0.8689	9,537,260,533	0.8815	9,675,389,548	100.03

(注) 投資比率は、純資産総額に対する評価金額の比率です。

種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.03

(注) 投資比率は、純資産総額に対する評価金額の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

2024年1月末現在、同日前1年以内における各月末および各計算期間末の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額(円)		1口当たりの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期(2018年1月15日)	26,606,655,103	(同左)	0.9910	(同左)
第2期(2019年1月15日)	21,207,097,954	(同左)	0.8968	(同左)
第3期(2020年1月15日)	12,865,922,909	(同左)	0.8658	(同左)
第4期(2021年1月15日)	5,467,430,556	(同左)	0.6644	(同左)
第5期(2022年1月17日)	7,463,918,044	(同左)	0.7495	(同左)
第6期(2023年1月16日)	7,559,849,931	(同左)	0.7382	(同左)
第7期(2024年1月15日)	9,536,064,154	(同左)	0.8252	(同左)
2023年1月末現在	7,664,480,163		0.7498	
2023年2月末現在	7,801,305,203		0.7701	
2023年3月末現在	7,175,046,775		0.7898	
2023年4月末現在	7,186,060,205		0.7985	
2023年5月末現在	7,447,112,327		0.7917	
2023年6月末現在	7,855,461,043		0.8077	
2023年7月末現在	7,925,112,964		0.7964	
2023年8月末現在	8,454,768,334		0.8206	
2023年9月末現在	9,100,717,373		0.8376	
2023年10月末現在	9,366,340,970		0.8431	
2023年11月末現在	9,417,455,913		0.8326	
2023年12月末現在	9,255,045,711		0.8031	
2024年1月末現在	9,672,040,432		0.8369	

【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	

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1期	0.9
第2期	9.5
第3期	3.5
第4期	23.3
第5期	12.8
第6期	1.5
第7期	11.8

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

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)	発行済数量(口)
第1期	26,923,816,773	76,558,715	26,847,258,058
第2期	5,356,776,069	8,556,726,598	23,647,307,529
第3期	546,810,054	9,333,232,291	14,860,885,292
第4期	186,127	6,631,910,102	8,229,161,317
第5期	3,971,381,798	2,242,031,337	9,958,511,778
第6期	2,004,265,980	1,721,514,128	10,241,263,630
第7期	3,382,775,645	2,068,059,879	11,555,979,396

(参考情報)

「スタイル・アドバンテージ・マザー・ポートフォリオ(円)」

(1) 投資状況

資産の種類	金額(円)	投資比率(%)
投資証券	9,590,798,578	99.13
内 ルクセンブルグ	9,499,445,903	98.19
内 アイルランド	91,352,675	0.94
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	84,047,411	0.87
純資産総額	9,674,845,989	100.00

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

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

順位	銘柄	国/地域	種類	投資口数	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	ブラックロック・ストラテジック・ファンズ ブラックロック・システムティック・スタイル・ファクター・ファンド クラスI投資証券	ルクセンブルグ	投資証券	973,625	9,614.89	9,361,307,973	9,756.77	9,499,445,903	98.19
2	インスティテューショナル・キャッシュ・シリーズplc ブラックロック・ICS・USTレジャーリー・ファンド エージェンシークラス投資証券	アイルランド	投資証券	5,441	16,751.89	91,152,600	16,788.66	91,352,675	0.94

(注) 投資比率は、純資産総額に対する評価金額の比率です。

種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.13

(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

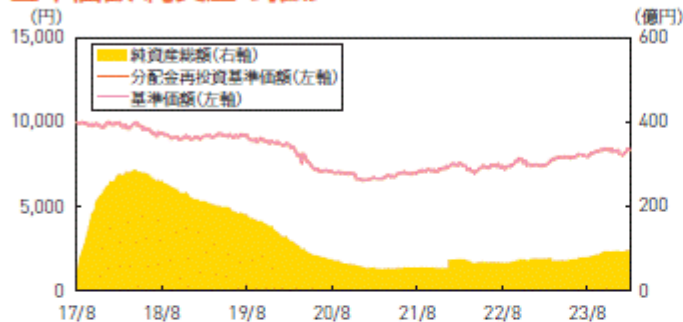
該当事項はありません。

(参考情報)

運用実績

2024年1月末現在

基準価額・純資産の推移



※ 基準価額および分配金再投資基準価額は信託報酬控除後の値です。信託報酬等については、後述の「ファンドの費用」をご覧ください。

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

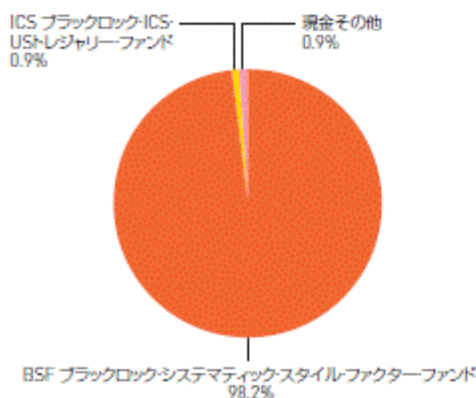
分配の推移

設定来累計		0円
第3期	2020年1月	0円
第4期	2021年1月	0円
第5期	2022年1月	0円
第6期	2023年1月	0円
第7期	2024年1月	0円

※ 分配金は税引前、1万口当たり

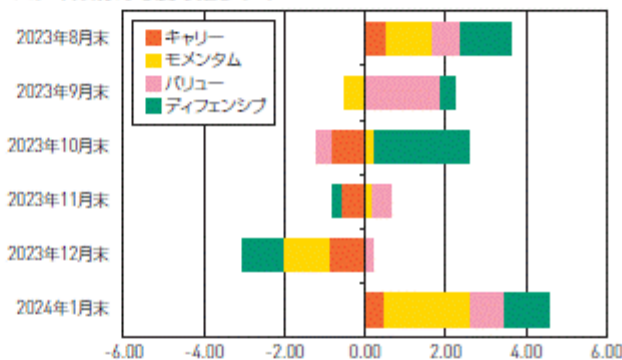
主要な資産の状況

資産構成比率



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

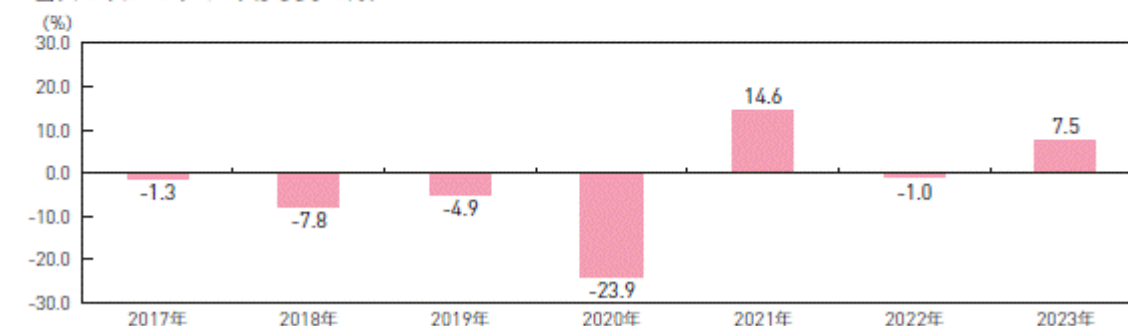
スタイル別寄与度の推移 (%)



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

年間収益率の推移

※ 2017年は設定日(8月4日)から年末までの収益率を表示しています。
 ※ ファンドの年間収益率は、決算時の分配金を非課税で再投資したものとして算出しています。
 ※ 当ファンドにベンチマークはありません。



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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

(1) 申込方法

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

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

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

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

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

(2) 申込期間

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

(3) 受付時間

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

販売会社につきましては、下記にお問い合わせください。

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

ホームページアドレス：www.blackrock.com/jp/

(4) 購入不可日

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

(5) 購入単位

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

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

(6) 購入価額

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

(7) 購入時手数料

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

なお、購入時手数料には消費税等相当額が含まれています。

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

(8) 購入代金のお支払い

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

(9) 購入の受付の中止、既に受付けた購入の受付の取消

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

2【換金（解約）手続等】

(1) 換金の申込と受付

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

(2) 換金単位

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

(3) 換金不可日

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

(4) 換金価額

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

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

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

(5) 換金受付の制限

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

(6) 換金代金の支払い

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

(7) 換金の申込の受付中止および取消

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

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

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

当ファンドの主たる投資対象の評価方法は以下の通りです。

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

（参考）マザーファンドの主たる投資対象の評価方法

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

ブラックロック・ジャパン株式会社

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

ホームページアドレス：www.blackrock.com/jp/

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

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

(4)【計算期間】

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

(5)【その他】

ファンドの償還条件等

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

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

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

信託約款の変更

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

c . b . の書面決議において、投資者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る投資者としての受託会社を除きます。以下c . において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている投資者が議決権を行使しないときは、当該知っている投資者は書面決議について賛成するものとみなします。

d . b . の書面決議は議決権を行使することができる投資者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

e . 書面決議の効力は、この信託のすべての投資者に対してその効力を生じます。

f . b . ~ e . までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての投資者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

g . a . ~ f . までの規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっては、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

h . 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときはa . ~ f . の規定にしたがいます。

信託事務の委託

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

運用報告書の作成

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

関係法人との契約の更改等に関する手続

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

公告

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

www.blackrock.com/jp/

但し、当該公告方法に支障がある場合には、日本経済新聞による公告を行います。

4【受益者の権利等】

ファンドの受益者（投資者）の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金受領権

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

<一般コース>

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

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

<累積投資コース>

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

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

(2) 償還金受領権

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

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

償還金の支払いは、販売会社において行います。

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

(3) 受益権の換金請求権

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

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

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

(4) 反対受益者の買取請求の不適用

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

(5) 帳簿書類の閲覧または謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期計算期間(2023年1月17日から2024年1月15日まで)の財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人による監査を受けております。

なお、従来、当ファンドが監査証明を受けているPwCあらた有限責任監査法人は、2023年12月1日付でPwC京都監査法人と合併、名称を変更しPwC Japan有限責任監査法人となりました。

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

なお、当該参考情報は監査意見の対象外となっております。

1【財務諸表】

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

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第6期 (2023年1月16日現在)	第7期 (2024年1月15日現在)
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	7,588,873,231	9,570,849,982
未収入金	-	10,900
流動資産合計	7,588,873,231	9,570,860,882
資産合計	7,588,873,231	9,570,860,882
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	10,900
未払受託者報酬	745,099	924,483
未払委託者報酬	25,491,506	31,628,675
その他未払費用	2,786,695	2,232,670
流動負債合計	29,023,300	34,796,728
負債合計	29,023,300	34,796,728
純資産の部		
元本等		
元本	10,241,263,630	11,555,979,396
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2,681,413,699	2,019,915,242
(分配準備積立金)	-	-
元本等合計	7,559,849,931	9,536,064,154
純資産合計	7,559,849,931	9,536,064,154
負債純資産合計	7,588,873,231	9,570,860,882

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第6期 (自 2022年1月18日 至 2023年1月16日)	第7期 (自 2023年1月17日 至 2024年1月15日)
営業収益		
有価証券売買等損益	94,801,586	914,314,628
営業収益合計	94,801,586	914,314,628
営業費用		
受託者報酬	1,475,019	1,705,904
委託者報酬	50,464,043	58,362,754
その他費用	5,661,574	5,026,416
営業費用合計	57,600,636	65,095,074
営業利益又は営業損失()	152,402,222	849,219,554
経常利益又は経常損失()	152,402,222	849,219,554
当期純利益又は当期純損失()	152,402,222	849,219,554
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()	31,328,052	92,605,203
期首剰余金又は期首欠損金()	2,494,593,734	2,681,413,699
剰余金増加額又は欠損金減少額	431,318,157	533,399,345
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	431,318,157	533,399,345
剰余金減少額又は欠損金増加額	497,063,952	628,515,239
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	497,063,952	628,515,239
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金()	2,681,413,699	2,019,915,242

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法

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

2 収益及び費用の計上基準

有価証券売買等損益の計上基準

約定日基準で計上しております。

3 その他財務諸表作成のための基礎となる事項

計算期間末日の取扱い

第7期計算期間は前計算期間末が休業日であったため、2023年1月17日から2024年1月15日までとなっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	第6期 (2023年1月16日現在)	第7期 (2024年1月15日現在)
1 当該計算期間の末日における受益権総数	10,241,263,630口	11,555,979,396口
2 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 2,681,413,699円	元本の欠損 2,019,915,242円
3 1口当たり純資産額	0.7382円	0.8252円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第6期 (自 2022年1月18日 至 2023年1月16日)	第7期 (自 2023年1月17日 至 2024年1月15日)
分配金の計算過程	当計算期末における、費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(0円)、分配準備積立金(0円)により、分配対象収益は0円となり、当期は分配ができませんでした。	当計算期末における、費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(0円)、分配準備積立金(0円)により、分配対象収益は0円となり、当期は分配ができませんでした。

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

1 金融商品に対する取組方針

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

2 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク

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

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

3 金融商品に係るリスク管理体制

(1) 市場リスクの管理

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

(2) 信用リスクの管理

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

(3) 取引先リスクの管理

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

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

金融商品の時価等に関する事項

第6期 (2023年1月16日現在)	第7期 (2024年1月15日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左
2 時価の算定方法 (1) 有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。	2 時価の算定方法 (1) 有価証券 同左 (2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
3 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	3 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 同左
4 金銭債権の計算期間末日後の償還予定額 金銭債権については全て1年以内に償還予定であります。	4 金銭債権の計算期間末日後の償還予定額 同左

金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 期中元本変動額

項目	第6期 (2023年1月16日現在)	第7期 (2024年1月15日現在)
期首元本額	9,958,511,778円	10,241,263,630円
期中追加設定元本額	2,004,265,980円	3,382,775,645円
期中一部解約元本額	1,721,514,128円	2,068,059,879円

2 有価証券関係

第6期(2023年1月16日現在)

売買目的有価証券

種類	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	66,937,541
合計	66,937,541

第7期(2024年1月15日現在)

売買目的有価証券

種類	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	816,298,571
合計	816,298,571

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	スタイル・アドバンテージ・マザー・ ポートフォリオ(円)	11,014,903,881	9,570,849,982	
親投資信託受益証券	合計	11,014,903,881	9,570,849,982	
合計		11,014,903,881	9,570,849,982	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考情報)

当ファンドは、「スタイル・アドバンテージ・マザー・ポートフォリオ（円）」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。同マザーファンドの2024年1月15日現在(以下「計算日」という)の状況は次の通りであります。

なお、以下に記載した情報は監査意見の対象外であります。

「スタイル・アドバンテージ・マザー・ポートフォリオ（円）」の状況

(1) 貸借対照表

項目	(2024年1月15日現在)
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	120,133,178
投資証券	9,450,990,271
流動資産合計	9,571,123,449
資産合計	9,571,123,449
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	729,162
未払解約金	10,900
流動負債合計	740,062
負債合計	740,062
純資産の部	
元本等	
元本	11,014,903,881
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,444,520,494
元本等合計	9,570,383,387
純資産合計	9,570,383,387
負債純資産合計	9,571,123,449

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

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法

投資証券は移動平均法に基づき、原則として以下の通り時価評価しております。

(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券

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

(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券

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

(3) 時価が入手できなかった有価証券

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

2 デリバティブの評価基準及び評価方法

為替予約取引

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

3 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準

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

4 その他財務諸表作成のための基礎となる事項

外貨建資産等の会計処理

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2024年1月15日現在)
1 当該計算日における受益権総数	11,014,903,881口
2 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 1,444,520,494円
3 1口当たり純資産額	0.8689円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

1 金融商品に対する取組方針

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

2 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク

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

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

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

3 金融商品に係るリスク管理体制

(1) 市場リスクの管理

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

(2) 信用リスクの管理

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

(3) 取引先リスクの管理

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

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

金融商品の時価等に関する事項

(2024年1月15日現在)

- 1 貸借対照表計上額、時価及び差額
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
- 2 時価の算定方法
 - (1) 有価証券
「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」に記載しております。
 - (2) デリバティブ取引
デリバティブ取引については、「(その他の注記)」の「3 デリバティブ取引関係」に記載しております。
 - (3) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務
これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。
- 3 金融商品の時価等に関する事項の補足説明
金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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。

金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

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

(2024年1月15日現在)	
同計算期間の期首元本額	9,840,343,920円
同計算期間中の追加設定元本額	3,223,180,305円
同計算期間中の一部解約元本額	2,048,620,344円
同計算期間末日の元本額	11,014,903,881円
当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託の元本額は次の通りです。	
ブラックロック・スタイル・アドバンテージ・ポートフォリオ（円/年 1回決算コース）	11,014,903,881円
合計	11,014,903,881円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	(2024年1月15日現在)
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	861,161,038
合計	861,161,038

(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	(2024年1月15日現在)			
		契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 アメリカドル	88,408,828	-	89,137,990	729,162
合計		88,408,828	-	89,137,990	729,162

(注1) 時価の算定方法

為替予約取引

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

(注2) 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	日本円	ブラックロック・ストラテジック・ファンズ ブラックロック・システムティック・スタイル・ファクター・ファンド クラスI投資証券	973,625	9,361,307,973	
	日本円	小計	973,625	9,361,307,973	
	アメリカドル	インスティテューショナル・キャッシュ・シリーズplc ブラックロック・ICS・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	5,441.330	617,774.320	
	アメリカドル	小計	5,441.330	617,774.320 (89,682,298)	
投資証券	合計		9,450,990,271 (89,682,298)		
合計			9,450,990,271 (89,682,298)		

(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 1 銘柄	100.0%	100.0%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

当該事項はデリバティブ取引関係の注記事項として記載しております。

(参考情報)

当ファンドは、「ブラックロック・ストラテジック・ファンズ ブラックロック・システムティック・スタイル・ファクター・ファンド クラスI投資証券」及び「インスティテューショナル・キャッシュ・シリーズplc ブラックロック・ICS・USTレジャリー・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・システムティック・スタイル・ファクター・ファンド クラスI投資証券」は、ルクセンブルグにおいて設立されたオープンエンド型投資法人が発行するファンドであり、当該ファンドの現時点で日本語に翻訳された直近の情報は、2023年5月31日に終了する計算期間(2022年6月1日から2023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2023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。

なお、「ブラックロック・ストラテジック・ファンズ ブラックロック・スタイル・アドバンテージ・ファンド クラスI投資証券」は、2023年8月1日付で「ブラックロック・ストラテジック・ファンズ ブラックロック・システムティック・スタイル・ファクター・ファンド クラスI投資証券」へ名称変更いたしました。

(2)「インスティテューショナル・キャッシュ・シリーズplc ブラックロック・ICS・USTレジャリー・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、2023年3月31日に終了する中間計算期間(2022年10月1日から2023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2023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 2023年5月31日現在

	注記	ブラックロック・システム ティック・スタイル・ ファクター・ファンド ⁽¹⁾ 米ドル
資産		
投資有価証券 - 取得原価		104,280,370
未実現評価損		(67,089)
投資有価証券 - 時価	2 (a)	104,213,281
銀行預金	2 (a)	16,622,799
ブローカーに対する債権	15	9,011,529
未収利息および未収配当金	2 (a)、2 (d)	337,889
売却投資有価証券未収金	2 (a)、2 (d)	7,897,615
販売投資証券未収金	2 (a)	4,588,516
以下に係る未実現評価益：		
先物取引	2 (d)	2,625,442
未決済先渡為替予約	2 (d)	4,099,762
差金決済契約	2 (d)	7,073,809
スワップの時価	2 (d)	1,120,661
その他の資産	2 (a)	1,262
資産合計		157,592,565
負債		
銀行からの借入金	2 (a)	26
ブローカーに対する債務	15	2,207,704
未払利息および未払配当金	2 (a)、2 (d)	102,659
購入投資有価証券未払金	2 (a)、2 (d)	19,298,514
買戻し投資証券未払金	2 (a)	54,900
未払収益分配金	2 (a)、11	60
以下に係る未実現評価損：		
先物取引	2 (d)	663,697
未決済先渡為替予約	2 (d)	7,886,341
差金決済契約	2 (d)	5,727,537
スワップの時価	2 (d)	1,780,820
未払費用およびその他の負債	2 (a)、4、5、6、7、8	174,122
負債合計		37,896,380
純資産合計		119,696,185

⁽¹⁾ ファンドの名称が前会計年度末に変更された。詳細については注記17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。

3 会計年度末における純資産価額の概要 2023年5月31日現在

ブラックロック・システムティック・スタイル・
ファクター・ファンド⁽¹⁾

	通貨	2023年	2022年	2021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	119,696,185	120,998,037	176,150,611
以下の1口当たり純資産価額：				
クラスA分配型投資証券	米ドル	98.78	87.42	83.40
クラスAユーロ・ヘッジ分配型投資証券	ユーロ	87.22	78.72	75.62
クラスA無分配投資証券	米ドル	97.23	86.03	82.07
クラスAユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	77.20	69.65	66.82
クラスAスウェーデン・クローナ・ヘッジ無分配投資証券	スウェーデン・クローナ	80.20	71.95	68.74
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	79.40	72.06	68.93
クラスD無分配投資証券(ユーロ)	ユーロ	106.24	93.16	77.56
クラスD無分配英国報告型投資証券	米ドル	102.45	90.15	85.52
クラスDユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	ユーロ	89.91	80.72	77.10
クラスD英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	英ポンド	88.72	78.28	74.14
クラスE無分配投資証券(ユーロ)	ユーロ	97.96	86.83	73.07
クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	83.23	75.51	72.91
クラスIスイス・フラン・ヘッジPF無分配投資証券	スイス・フラン	82.62	74.74	71.19
クラスIユーロ・ヘッジPF無分配投資証券	ユーロ	91.56	81.94	78.66
クラスIブラジル・リアル・ヘッジ無分配投資証券	米ドル	75.59	66.09	52.21
クラスIスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	スイス・フラン	80.45	72.85	69.47
クラスI無分配英国報告型投資証券	米ドル	91.11	80.01	76.09
クラスIユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	ユーロ	91.19	81.70	77.84
クラスI英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	英ポンド	89.08	78.48	74.20
クラスI日本円ヘッジ無分配英国報告型投資証券	日本円	9,156.87	8,331.96	7,918.17
クラスX無分配投資証券	米ドル	108.78	95.02	89.48
クラスX豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	豪ドル	108.79	95.44	89.80
クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	87.11	77.59	73.46
クラスXニュージーランド・ドル・ヘッジ無分配投資証券	ニュージーランド・ドル	112.34	97.60	90.03
クラスX英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	英ポンド	106.12	92.93	87.26
クラスZ無分配投資証券	米ドル	103.43	90.96	86.16
クラスZユーロ・ヘッジ無分配投資証券	ユーロ	90.98	81.62	77.84

⁽¹⁾ ファンドの名称が前会計年度末に変更された。詳細については注記17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 2023年5月31日に終了した会計年度

	注記	ブラックロック・システム ティック・スタイル・ ファクター・ファンド ⁽¹⁾ 米ドル
期首純資産		120,998,037
収益		
預金利息	2 (c)	131,245
債券利息、源泉徴収税控除後	2 (c)	2,507,309
差金決済契約に係る受取利息	2 (c)、2 (d)	266,920
スワップに係る受取利息および受取配当金	2 (c)	174,043
差金決済契約に係る受取配当金、源泉徴収税控除後	2 (c)、2 (d)	2,598,615
収益合計		5,678,132
費用		
差金決済契約に係る支払利息	2 (c)、2 (d)	448,269
スワップに係る支払利息および支払配当金	2 (c)	177,104
差金決済契約に係る支払配当金、源泉徴収税控除後	2 (c)、2 (d)	2,533,940
年間サービス費用	5	67,964
預託報酬	2 (i)、6	320,859
税金	8	14,539
販売報酬	4	6,254
ローン・コミットメント・フィー	14	862
投資運用報酬	4	491,122
費用合計		4,060,913
投資純利益		1,617,219
以下に係る実現純利益 / (損失) :		
投資有価証券	2 (a)、2 (b)	(72,631)
差金決済契約	2 (d)	3,230,937
先物取引	2 (d)	593,679
外貨および先渡為替予約	2 (d)、2 (e)、2 (j)	809,095
スワップ取引	2 (d)	427,298
当期実現純利益		4,988,378
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)	23,982
差金決済契約	2 (d)	2,199,575
先物取引	2 (d)	2,921,860
外貨および先渡為替予約	2 (d)、2 (e)、2 (j)	(5,274,018)
スワップ取引	2 (d)	(1,963,630)
当期末実現評価益 / (損) の純変動		(2,092,231)
運用成績による純資産の増加		4,513,366
資本の変動		
投資証券発行による正味受取額		31,205,502
投資証券買戻しによる正味支払額		(37,020,661)
資本の変動による純資産の減少		(5,815,159)
配当金宣言額		(59)
期末純資産		119,696,185

(1) ファンドの名称が前会計年度末に変更された。詳細については注記17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。

発行済投資証券口数変動表 2023年5月31日に終了した会計年度

ブラックロック・システムティック・スタイル・ファクター・

ファンド⁽¹⁾

	期首発行済 投資証券口数	当期発行 投資証券口数	当期買戻し 投資証券口数	期末発行済 投資証券口数
クラスA分配型投資証券	622	4,988	3,420	2,190
クラスAユーロ・ヘッジ分配型投資証券	1,768	6,357	683	7,442
クラスA無分配投資証券	7,465	8,378	9,541	6,302
クラスAユーロ・ヘッジ無分配投資証券	45	562	385	222
クラスAスウェーデン・クローナ・ヘッジ 無分配投資証券	440	-	-	440
クラスDスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	5,299	-	-	5,299
クラスD無分配投資証券（ユーロ）	480	16,244	15,012	1,712
クラスD無分配英国報告型投資証券	6,282	21,538	19,161	8,659
クラスDユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	25,604	1,489	1,752	25,341
クラスD英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	2,222	6,489	6,660	2,051
クラスE無分配投資証券（ユーロ）	3,448	18,349	12,427	9,370
クラスEユーロ・ヘッジ無分配投資証券	2,148	14,437	3,903	12,682
クラスIスイス・フラン・ヘッジPF無分配投資証券	50	-	-	50
クラスIユーロ・ヘッジPF無分配投資証券	45	-	-	45
クラスIブラジル・レアル・ヘッジ無分配投資証券	50	-	-	50
クラスIスイス・フラン・ヘッジ無分配投資証券	48	-	-	48
クラスI無分配英国報告型投資証券	50	-	-	50
クラスIユーロ・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	185	-	69	116
クラスI英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	4,104	-	1,381	2,723
クラスI日本円ヘッジ無分配英国報告型投資証券	1,266,232	161,366	214,378	1,213,220
クラスX無分配投資証券	2,671	1,046	1,810	1,907
クラスX豪ドル・ヘッジ無分配投資証券	489,869	195,555	231,027	454,397
クラスXユーロ・ヘッジ無分配投資証券	42	-	-	42
クラスXニュージーランド・ドル・ヘッジ無分配 投資証券	2	-	-	2
クラスX英ポンド・ヘッジ無分配英国報告型投資証券	35	-	-	35
クラスZ無分配投資証券	50	-	-	50
クラスZユーロ・ヘッジ無分配投資証券	46	-	-	46

(1) ファンドの名称が前会計年度末に変更された。詳細については注記17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・システマティック・スタイル・ファクター・ファンド

投資有価証券明細表 2023年5月31日現在

保有高	銘柄	時価 (米ドル)	純資産比率 (%)
公認の証券取引所に上場されているまたはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券および短期金融商品 債券			
カナダ			
USD 4,000,000	Export Development Canada 2.625% 21/2/2024	3,924,365	3.28
		3,924,365	3.28
国際機関 (Supranational)			
USD 10,000,000	Council Of Europe Development Bank 2.50% 27/2/2024	9,794,500	8.18
USD 6,500,000	European Reconstruction Bank for & Development 0.25% 10/7/2023	6,466,005	5.40
USD 6,000,000	Inter-American Development Bank 3.00% 4/10/2023	5,947,721	4.97
USD 15,000,000	International Reconstruction Bank for & Development 3.00% 27/9/2023	14,877,332	12.43
		37,085,558	30.98
米国			
USD 6,000,000	United States Treasury Bill 1/6/2023 (Zero Coupon)	6,000,000	5.01
USD 10,078,000	United States Treasury Bill 10/8/2023 (Zero Coupon)	9,999,569	8.35
USD 5,000,000	United States Treasury Bill 24/8/2023 (Zero Coupon)	4,940,541	4.13
USD 11,000,000	United States Treasury Bill 5/10/2023 (Zero Coupon)	10,828,910	9.05
USD 12,000,000	United States Treasury Bill 30/11/2023 (Zero Coupon)	11,717,824	9.79
USD 9,000,000	United States Treasury Bill 28/12/2023 (Zero Coupon)	8,769,840	7.33
USD 11,500,000	United States Treasury Bill 16/5/2024 (Zero Coupon)	10,946,674	9.15
		63,203,358	52.81
債券合計		104,213,281	87.07
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			
		104,213,281	87.07
投資有価証券 (時価) 合計		104,213,281	87.07
その他の純資産		15,482,904	12.93
純資産合計 (米ドル)		119,696,185	100.00

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
金融デリバティブ商品			
差金決済契約			
オーストラリア			
(1,672)	ANZ Group Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	661
(1,764)	ANZ Group Holdings Ltd	Barclays Bank	994
(3,751)	ANZ Group Holdings Ltd	BNP Paribas	1,482
(1,564)	ANZ Group Holdings Ltd	Citibank	882
(6,054)	ANZ Group Holdings Ltd	Goldman Sachs	2,393
(1,452)	ANZ Group Holdings Ltd	HSBC	856
(691)	ANZ Group Holdings Ltd	JP Morgan	407
(8,739)	APA Group (Unit)	BNP Paribas	1,189
(5,688)	APA Group (Unit)	Goldman Sachs	774
402	Aristocrat Leisure Ltd	Barclays Bank	(321)
4,486	Aristocrat Leisure Ltd	BNP Paribas	(6,859)
7,473	Aristocrat Leisure Ltd	Goldman Sachs	(11,427)
(800)	ASX Ltd	Bank of America Merrill Lynch	684
(848)	ASX Ltd	Barclays Bank	478
(2,176)	ASX Ltd	BNP Paribas	1,861
(547)	ASX Ltd	Goldman Sachs	468
(223)	ASX Ltd	JP Morgan	332
(9,954)	Aurizon Holdings Ltd	Barclays Bank	(252)
(10,889)	Aurizon Holdings Ltd	BNP Paribas	(353)
(33,890)	Aurizon Holdings Ltd	Citibank	(657)
(15,767)	Aurizon Holdings Ltd	Goldman Sachs	(511)
(5,136)	Aurizon Holdings Ltd	JP Morgan	(233)
3,586	BlueScope Steel Ltd	Barclays Bank	(1,952)
1,705	BlueScope Steel Ltd	BNP Paribas	(1,060)
9,754	BlueScope Steel Ltd	Goldman Sachs	(6,067)
1,266	Brambles Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(558)
1,128	Brambles Ltd	Barclays Bank	(541)
24,406	Brambles Ltd	BNP Paribas	(10,753)
1,057	Brambles Ltd	Goldman Sachs	(466)
1,310	Brambles Ltd	HSBC	(373)
1,200	Brambles Ltd	JP Morgan	(342)
344	Cochlear Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,163)
1,810	Cochlear Ltd	Barclays Bank	(1,746)
752	Cochlear Ltd	BNP Paribas	(2,543)
279	Cochlear Ltd	Citibank	(282)
311	Cochlear Ltd	Goldman Sachs	(1,052)
189	Cochlear Ltd	HSBC	(60)
147	Cochlear Ltd	JP Morgan	(47)
379	Coles Group Ltd	Barclays Bank	(39)
6,717	Coles Group Ltd	BNP Paribas	(1,523)
9,112	Coles Group Ltd	Goldman Sachs	(2,066)
2,339	Coles Group Ltd	HSBC	(167)
(263)	Commonwealth Bank of Australia	Bank of America Merrill Lynch	293

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	オーストラリア(続き)		
(1,068)	Commonwealth Bank of Australia	Barclays Bank	1,428
(2,025)	Commonwealth Bank of Australia	BNP Paribas	2,257
(1,529)	Commonwealth Bank of Australia	Goldman Sachs	1,704
(161)	Commonwealth Bank of Australia	HSBC	35
(645)	Computershare Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(226)
(4,036)	Computershare Ltd	Barclays Bank	(1,177)
(7,993)	Computershare Ltd	BNP Paribas	(2,796)
(2,845)	Computershare Ltd	Goldman Sachs	(995)
(8,684)	Computershare Ltd	HSBC	(2,082)
(254)	CSL Ltd	Barclays Bank	140
(548)	CSL Ltd	BNP Paribas	504
(588)	CSL Ltd	Goldman Sachs	541
(262)	CSL Ltd	HSBC	(869)
(288)	CSL Ltd	JP Morgan	(955)
(1)	Deterra Royalties Ltd	Bank of America Merrill Lynch	-
(10,669)	Endeavour Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,244
(9,050)	Endeavour Group Ltd	Barclays Bank	762
(4,876)	Endeavour Group Ltd	BNP Paribas	569
(9,043)	Endeavour Group Ltd	Goldman Sachs	1,055
(12,344)	Endeavour Group Ltd	HSBC	1,919
(3,147)	Endeavour Group Ltd	JP Morgan	489
662	Fortescue Metals Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(498)
2,105	Fortescue Metals Group Ltd	Barclays Bank	(1,827)
7,510	Fortescue Metals Group Ltd	BNP Paribas	(5,644)
1,350	Fortescue Metals Group Ltd	Goldman Sachs	(1,015)
1,003	Fortescue Metals Group Ltd	HSBC	(923)
1,031	IDP Education Ltd	BNP Paribas	(3,881)
296	IDP Education Ltd	Goldman Sachs	(1,114)
(1,249)	IGO Ltd	Bank of America Merrill Lynch	332
(3,831)	IGO Ltd	Barclays Bank	1,539
(11,678)	IGO Ltd	BNP Paribas	3,102
(3,910)	IGO Ltd	Citibank	1,571
(2,563)	IGO Ltd	HSBC	1,046
(2)	Iluka Resources Ltd	Bank of America Merrill Lynch	-
(59,131)	Insurance Australia Group Ltd	Barclays Bank	383
(28,904)	Insurance Australia Group Ltd	BNP Paribas	(5,618)
(6,286)	Insurance Australia Group Ltd	JP Morgan	(855)
2,182	James Hardie Industries Plc - CDI	Barclays Bank	156
3,080	James Hardie Industries Plc - CDI	BNP Paribas	7,783
2,132	James Hardie Industries Plc - CDI	Goldman Sachs	5,387
(6,691)	Lendlease Corp Ltd (Unit)	Bank of America Merrill Lynch	1,257
(2,678)	Lendlease Corp Ltd (Unit)	Barclays Bank	(35)
(4,876)	Lendlease Corp Ltd (Unit)	BNP Paribas	916
(8,961)	Lendlease Corp Ltd (Unit)	Goldman Sachs	1,684
(1,968)	Lendlease Corp Ltd (Unit)	HSBC	(140)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	オーストラリア(続き)		
3,258	Lottery Corp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	63
35,018	Lottery Corp Ltd	Barclays Bank	227
19,626	Lottery Corp Ltd	BNP Paribas	381
15,107	Lottery Corp Ltd	Citibank	98
10,438	Lottery Corp Ltd	Goldman Sachs	203
12,356	Lottery Corp Ltd	HSBC	160
170	Macquarie Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(452)
250	Macquarie Group Ltd	Barclays Bank	(944)
317	Macquarie Group Ltd	BNP Paribas	(842)
270	Macquarie Group Ltd	Citibank	(1,020)
477	Macquarie Group Ltd	Goldman Sachs	(1,267)
176	Macquarie Group Ltd	HSBC	(315)
269	Macquarie Group Ltd	JP Morgan	(481)
(58,982)	Medibank Pvt Ltd	Goldman Sachs	(1,146)
(614)	Mineral Resources Ltd	Barclays Bank	1,571
(1,498)	Mineral Resources Ltd	BNP Paribas	2,873
(347)	Mineral Resources Ltd	HSBC	139
(1,140)	National Australia Bank Ltd	BNP Paribas	362
(993)	National Australia Bank Ltd	HSBC	184
(1,131)	Newcrest Mining Ltd	BNP Paribas	2,191
(135)	Newcrest Mining Ltd	HSBC	342
(7,037)	Orica Ltd	BNP Paribas	5,106
(8,514)	Pilbara Minerals Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,765
(5,403)	Pilbara Minerals Ltd	BNP Paribas	1,120
(11,888)	Pilbara Minerals Ltd	Goldman Sachs	2,465
(8,381)	Qantas Airways Ltd	Barclays Bank	(1,023)
(17,790)	Qantas Airways Ltd	Citibank	(2,217)
(1)	Ramsay Health Care Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3
(1,483)	Ramsay Health Care Ltd	Barclays Bank	2,354
(3,467)	Ramsay Health Care Ltd	BNP Paribas	9,053
(1,974)	Ramsay Health Care Ltd	Goldman Sachs	5,154
(169)	Ramsay Health Care Ltd	HSBC	417
(204)	REA Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(110)
(186)	REA Group Ltd	Barclays Bank	118
(1,565)	REA Group Ltd	BNP Paribas	(842)
(870)	REA Group Ltd	Goldman Sachs	(468)
(270)	REA Group Ltd	HSBC	430
(1,170)	Reece Ltd	Barclays Bank	76
(3,477)	Reece Ltd	BNP Paribas	(68)
(1,040)	Reece Ltd	Goldman Sachs	(20)
(3,532)	Reece Ltd	HSBC	160
1,212	Rio Tinto Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,539)
536	Rio Tinto Ltd	Barclays Bank	(778)
1,447	Rio Tinto Ltd	BNP Paribas	(1,837)
590	Rio Tinto Ltd	Goldman Sachs	(749)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	オーストラリア(続き)		
333	Rio Tinto Ltd	HSBC	(1,070)
1,163	Rio Tinto Ltd	JP Morgan	(3,737)
(16,593)	Santos Ltd	Barclays Bank	968
(7,677)	Santos Ltd	BNP Paribas	(597)
(16,205)	Santos Ltd	Goldman Sachs	(1,260)
(5,870)	SEEK Ltd	Barclays Bank	2,890
(868)	SEEK Ltd	Goldman Sachs	281
(2)	Sierra Rutile Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	-
1,288	Sonic Healthcare Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(876)
818	Sonic Healthcare Ltd	Barclays Bank	(562)
3,756	Sonic Healthcare Ltd	BNP Paribas	(2,555)
3,861	Sonic Healthcare Ltd	Goldman Sachs	(2,627)
9	Sonic Healthcare Ltd	HSBC	(4)
16,084	South32 Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,667)
44,583	South32 Ltd	Barclays Bank	(4,333)
44,920	South32 Ltd	BNP Paribas	(4,657)
1,099	South32 Ltd	Citibank	(107)
22,211	South32 Ltd	Goldman Sachs	(2,302)
612	South32 Ltd	JP Morgan	(127)
11,869	Suncorp Group Ltd	Barclays Bank	4,153
24,139	Telstra Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	156
39,157	Telstra Group Ltd	Barclays Bank	507
60,875	Telstra Group Ltd	BNP Paribas	394
38,545	Telstra Group Ltd	Citibank	448
28,149	Telstra Group Ltd	Goldman Sachs	182
22,990	Telstra Group Ltd	HSBC	447
32,214	Telstra Group Ltd	JP Morgan	687
(30,654)	Transurban Group (Unit)	Bank of America Merrill Lynch	1,788
(4,862)	Transurban Group (Unit)	Barclays Bank	(472)
(10,710)	Transurban Group (Unit)	BNP Paribas	625
(23,883)	Transurban Group (Unit)	Goldman Sachs	1,393
(2,071)	Transurban Group (Unit)	HSBC	(201)
(1,087)	Transurban Group (Unit)	JP Morgan	(106)
(6,358)	Treasury Wine Estates Ltd	Barclays Bank	6,715
(1,096)	Treasury Wine Estates Ltd	BNP Paribas	1,186
(2,252)	Treasury Wine Estates Ltd	Goldman Sachs	2,437
(3,354)	Treasury Wine Estates Ltd	JP Morgan	3,955
1,697	Wesfarmers Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(4,574)
766	Wesfarmers Ltd	Barclays Bank	(1,578)
1,790	Wesfarmers Ltd	BNP Paribas	(4,824)
1,779	Wesfarmers Ltd	Goldman Sachs	(4,795)
366	Wesfarmers Ltd	HSBC	(908)
(7,230)	Westpac Banking Corp	Barclays Bank	1,780
(2,243)	Westpac Banking Corp	BNP Paribas	654
(1,794)	Westpac Banking Corp	Goldman Sachs	523

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
オーストラリア(続き)			
(908)	WiseTech Global Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,135)
(2,044)	Woodside Energy Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(503)
(3,000)	Woodside Energy Group Ltd	Barclays Bank	641
(560)	Woodside Energy Group Ltd	BNP Paribas	(138)
(1,663)	Woodside Energy Group Ltd	Goldman Sachs	(409)
(397)	Woodside Energy Group Ltd	HSBC	(64)
1,843	Woolworths Group Ltd	Barclays Bank	(752)
2,105	Woolworths Group Ltd	BNP Paribas	(1,759)
1,158	Woolworths Group Ltd	Goldman Sachs	(968)
379	Woolworths Group Ltd	HSBC	(270)
(672)	Xero Ltd	Barclays Bank	(196)
(545)	Xero Ltd	Goldman Sachs	(5,537)
(735)	Xero Ltd	HSBC	(8,015)
			<u>(43,484)</u>
オーストリア			
(539)	Erste Group Bank AG	BNP Paribas	339
(347)	Erste Group Bank AG	Goldman Sachs	219
56	OMV AG	Barclays Bank	(68)
2,356	OMV AG	BNP Paribas	(2,088)
603	OMV AG	Goldman Sachs	(535)
139	OMV AG	JP Morgan	(160)
(406)	Verbund AG	Bank of America Merrill Lynch	2,709
(1,249)	Verbund AG	Barclays Bank	5,068
(466)	Verbund AG	BNP Paribas	3,110
(800)	Verbund AG	Citibank	3,246
588	voestalpine AG	Barclays Bank	(1,130)
584	voestalpine AG	BNP Paribas	(935)
			<u>9,775</u>
ベルギー			
(527)	Ageas SA	BNP Paribas	1,773
(264)	Ageas SA	HSBC	837
160	Anheuser-Busch InBev SA	Bank of America Merrill Lynch	(1,027)
472	Anheuser-Busch InBev SA	Barclays Bank	(2,132)
3,438	Anheuser-Busch InBev SA	BNP Paribas	(22,062)
936	Anheuser-Busch InBev SA	Goldman Sachs	(6,006)
436	Anheuser-Busch InBev SA	HSBC	(3,962)
286	Anheuser-Busch InBev SA	JP Morgan	(2,599)
(85)	Argenx SE	Bank of America Merrill Lynch	672
(774)	Argenx SE	Barclays Bank	18,512
(201)	Argenx SE	BNP Paribas	1,588
(21)	Argenx SE	Citibank	502
(67)	Argenx SE	Goldman Sachs	529
(66)	Argenx SE	HSBC	(225)
(544)	D'iereeren Group	Barclays Bank	2,891
(453)	D'iereeren Group	BNP Paribas	2,418

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 / (損) (米ドル)
ベルギー（続き）			
(438)	D' ieteren Group	Citibank	2,065
(510)	D' ieteren Group	Goldman Sachs	2,723
(129)	D' ieteren Group	HSBC	1,088
276	Elia Group SA	HSBC	(3,448)
26	Groupe Bruxelles Lambert NV	Bank of America Merrill Lynch	(136)
939	Groupe Bruxelles Lambert NV	Barclays Bank	(4,692)
1,932	Groupe Bruxelles Lambert NV	BNP Paribas	(10,108)
386	Groupe Bruxelles Lambert NV	Goldman Sachs	(2,019)
23	Groupe Bruxelles Lambert NV	HSBC	(199)
(747)	KBC Group NV	Barclays Bank	(551)
(155)	KBC Group NV	Goldman Sachs	99
(386)	KBC Group NV	HSBC	1,195
97	Sofina SA	Citibank	(624)
68	Sofina SA	Goldman Sachs	(327)
1,486	Solvay SA	Bank of America Merrill Lynch	(12,455)
96	Solvay SA	JP Morgan	(1,143)
(136)	UCB SA	Bank of America Merrill Lynch	749
(912)	UCB SA	BNP Paribas	5,025
(108)	UCB SA	Citibank	701
(562)	UCB SA	Goldman Sachs	3,096
(156)	UCB SA	JP Morgan	403
(1,497)	Umicore SA	BNP Paribas	5,035
(308)	Umicore SA	Goldman Sachs	1,036
(369)	Umicore SA	HSBC	1,501
(343)	Warehouses De Pauw CVA (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	125
(364)	Warehouses De Pauw CVA (REIT)	Goldman Sachs	(126)
			<u>(19,278)</u>
カナダ			
(768)	Agnico Eagle Mines Ltd	Bank of America Merrill Lynch	5,092
(1,120)	Agnico Eagle Mines Ltd	BNP Paribas	7,425
(383)	Agnico Eagle Mines Ltd	Citibank	550
(1,145)	Agnico Eagle Mines Ltd	Goldman Sachs	7,591
(574)	Agnico Eagle Mines Ltd	HSBC	4,724
(2,933)	Air Canada	Bank of America Merrill Lynch	(1,206)
(9,755)	Air Canada	BNP Paribas	(4,011)
(572)	Air Canada	Citibank	(101)
(15,880)	Algonquin Power & Utilities Corp	Bank of America Merrill Lynch	4,780
(9,833)	Algonquin Power & Utilities Corp	BNP Paribas	2,960
(1,024)	Algonquin Power & Utilities Corp	Goldman Sachs	308
(13,170)	Algonquin Power & Utilities Corp	HSBC	6,382
(4,022)	Algonquin Power & Utilities Corp	JP Morgan	1,949
4,532	AltaGas Ltd	Goldman Sachs	(965)
4,220	AltaGas Ltd	HSBC	(682)
1,701	ARC Resources Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,087)
3,329	ARC Resources Ltd	BNP Paribas	(2,126)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	カナダ(続き)		
6,659	ARC Resources Ltd	Goldman Sachs	(4,253)
5,410	ARC Resources Ltd	HSBC	(2,463)
3,587	ARC Resources Ltd	JP Morgan	(1,633)
516	Bank of Montreal	Bank of America Merrill Lynch	(2,296)
3,618	Bank of Montreal	BNP Paribas	(16,097)
831	Bank of Montreal	Citibank	(2,160)
1,361	Bank of Montreal	Goldman Sachs	(6,055)
147	Bank of Montreal	HSBC	(442)
432	Bank of Montreal	JP Morgan	(1,300)
335	Bank of Nova Scotia	BNP Paribas	(209)
(848)	BCE Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,494
(372)	BCE Inc	Citibank	355
(88)	BCE Inc	HSBC	173
(353)	BCE Inc	JP Morgan	695
(1,277)	Brookfield Asset Management Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1,341
(2,264)	Brookfield Asset Management Ltd 'A'	BNP Paribas	2,377
(1,087)	Brookfield Asset Management Ltd 'A'	Goldman Sachs	1,141
(946)	Brookfield Asset Management Ltd 'A'	HSBC	1,966
441	Brookfield Corp	Citibank	(414)
(1,296)	Brookfield Renewable Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	2,997
143	BRP Inc	Bank of America Merrill Lynch	(214)
406	BRP Inc	BNP Paribas	(608)
251	BRP Inc	JP Morgan	(391)
(2,135)	CAE Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,082
(2,394)	CAE Inc	BNP Paribas	1,213
(1,153)	Cameco Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,109
(3,910)	Cameco Corp	BNP Paribas	3,761
(427)	Cameco Corp	Citibank	139
(4,992)	Cameco Corp	Goldman Sachs	4,801
(610)	Cameco Corp	HSBC	412
(60)	Cameco Corp	JP Morgan	41
486	Canadian Apartment Properties (REIT)	BNP Paribas	(567)
1,111	Canadian Imperial Bank of Commerce	Citibank	(226)
3,112	Canadian Imperial Bank of Commerce	JP Morgan	2,582
280	Canadian National Railway Co	Bank of America Merrill Lynch	(1,984)
1,889	Canadian National Railway Co	BNP Paribas	(13,383)
812	Canadian National Railway Co	Citibank	(1,312)
894	Canadian National Railway Co	Goldman Sachs	(6,334)
527	Canadian National Railway Co	HSBC	(3,010)
299	Canadian National Railway Co	JP Morgan	(1,708)
(35)	Canadian Pacific Kansas City Ltd	Bank of America Merrill Lynch	200
(5,022)	Canadian Pacific Kansas City Ltd	BNP Paribas	9,833
(661)	Canadian Pacific Kansas City Ltd	Citibank	506
(2,033)	Canadian Pacific Kansas City Ltd	Goldman Sachs	11,642
(1,560)	Canadian Pacific Kansas City Ltd	HSBC	5,143

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	カナダ(続き)		
(333)	Canadian Pacific Kansas City Ltd	JP Morgan	1,098
(134)	Canadian Tire Corp Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	446
(587)	Canadian Tire Corp Ltd 'A'	BNP Paribas	1,952
(536)	Canadian Tire Corp Ltd 'A'	Goldman Sachs	1,783
(328)	Canadian Tire Corp Ltd 'A'	HSBC	2,692
(32)	Canadian Tire Corp Ltd 'A'	JP Morgan	263
2,596	Canadian Utilities Ltd 'A'	BNP Paribas	(5,146)
364	Canadian Utilities Ltd 'A'	Citibank	(120)
364	Canadian Utilities Ltd 'A'	Goldman Sachs	(722)
675	Canadian Utilities Ltd 'A'	HSBC	(1,388)
(89)	CCL Industries Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	344
(2,464)	CCL Industries Inc 'B'	BNP Paribas	9,516
352	CGI Inc	Bank of America Merrill Lynch	57
434	CGI Inc	BNP Paribas	70
447	CGI Inc	Citibank	614
741	CGI Inc	Goldman Sachs	120
160	CGI Inc	JP Morgan	464
194	Constellation Software Inc	Goldman Sachs	7,718
(155)	Descartes Systems Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(46)
(254)	Descartes Systems Group Inc	BNP Paribas	(75)
375	Dollarama Inc	Bank of America Merrill Lynch	(407)
597	Dollarama Inc	BNP Paribas	(649)
932	Dollarama Inc	Citibank	(178)
1,390	Dollarama Inc	Goldman Sachs	(1,510)
309	Dollarama Inc	JP Morgan	(265)
1,703	Element Fleet Management Corp	BNP Paribas	(606)
4,136	Element Fleet Management Corp	Citibank	(137)
782	Element Fleet Management Corp	HSBC	1,432
2,622	Element Fleet Management Corp	JP Morgan	4,803
555	Empire Co Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(137)
805	Empire Co Ltd 'A'	BNP Paribas	(198)
1,686	Empire Co Ltd 'A'	Citibank	161
7,279	Empire Co Ltd 'A'	Goldman Sachs	(1,790)
746	Empire Co Ltd 'A'	HSBC	(200)
956	Enbridge Inc	BNP Paribas	(2,744)
2,442	Enbridge Inc	Citibank	(2,546)
786	Enbridge Inc	HSBC	(2,833)
(84)	Fairfax Financial Holdings Ltd	Goldman Sachs	(1,066)
(1,623)	First Quantum Minerals Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4,576
(1,302)	First Quantum Minerals Ltd	BNP Paribas	3,671
(1,216)	First Quantum Minerals Ltd	Citibank	1,277
(1,083)	First Quantum Minerals Ltd	JP Morgan	5,622
114	FirstService Corp	Citibank	310
140	FirstService Corp	HSBC	605
79	FirstService Corp	JP Morgan	355

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
カナダ(続き)			
(2,289)	Fortis Inc	Goldman Sachs	7,781
183	Franco-Nevada Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,334)
2,503	Franco-Nevada Corp	BNP Paribas	(31,920)
763	Franco-Nevada Corp	Citibank	(526)
1,114	Franco-Nevada Corp	Goldman Sachs	(14,207)
676	Franco-Nevada Corp	HSBC	(8,993)
334	Franco-Nevada Corp	JP Morgan	(4,443)
270	George Weston Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,794)
(5,690)	GFL Environmental Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,799
(9,122)	GFL Environmental Inc	BNP Paribas	4,487
(609)	GFL Environmental Inc	Citibank	(32)
(5,571)	GFL Environmental Inc	HSBC	(4,581)
9,465	Great-West Lifeco Inc	BNP Paribas	2,224
139	Great-West Lifeco Inc	Goldman Sachs	33
8,436	Hydro One Ltd	BNP Paribas	(5,203)
12,476	Hydro One Ltd	Goldman Sachs	(7,694)
3,423	Hydro One Ltd	HSBC	(2,312)
2,383	iA Financial Corp Inc	Bank of America Merrill Lynch	752
224	iA Financial Corp Inc	Citibank	(120)
331	iA Financial Corp Inc	Goldman Sachs	105
402	iA Financial Corp Inc	HSBC	(428)
215	iA Financial Corp Inc	JP Morgan	(229)
(5,748)	IGM Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	633
(258)	IGM Financial Inc	BNP Paribas	28
(1,305)	Intact Financial Corp	BNP Paribas	3,468
(70)	Intact Financial Corp	Citibank	237
(236)	Intact Financial Corp	Goldman Sachs	627
(241)	Intact Financial Corp	HSBC	517
(312)	Intact Financial Corp	JP Morgan	669
(1,956)	Ivanhoe Mines Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1,594
(13,182)	Ivanhoe Mines Ltd 'A'	BNP Paribas	10,743
(886)	Ivanhoe Mines Ltd 'A'	Citibank	247
(22,662)	Ivanhoe Mines Ltd 'A'	Goldman Sachs	18,468
(3,778)	Ivanhoe Mines Ltd 'A'	HSBC	5,658
(3,153)	Keyera Corp	Bank of America Merrill Lynch	5,046
(6,808)	Keyera Corp	BNP Paribas	10,896
(1,680)	Keyera Corp	Citibank	530
(4,281)	Keyera Corp	Goldman Sachs	6,852
(1,388)	Keyera Corp	HSBC	774
13,121	Kinross Gold Corp	Bank of America Merrill Lynch	(8,959)
424	Loblaw Cos Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(965)
391	Loblaw Cos Ltd	BNP Paribas	(890)
1,295	Loblaw Cos Ltd	Goldman Sachs	(2,947)
(1,444)	Lundin Mining Corp	Citibank	258
(194)	Magna International Inc	Bank of America Merrill Lynch	732

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	カナダ(続き)		
(253)	Magna International Inc	Citibank	749
(617)	Magna International Inc	Goldman Sachs	2,328
(769)	Magna International Inc	HSBC	3,467
18,902	Manulife Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(10,131)
22,523	Manulife Financial Corp	BNP Paribas	(12,071)
3,957	Manulife Financial Corp	Citibank	(988)
7,227	Manulife Financial Corp	Goldman Sachs	(3,873)
789	Manulife Financial Corp	HSBC	(857)
994	Manulife Financial Corp	JP Morgan	(1,080)
(190)	Metro Inc	Bank of America Merrill Lynch	766
(1,304)	Metro Inc	Goldman Sachs	5,256
457	National Bank of Canada	Bank of America Merrill Lynch	(1,168)
1,522	National Bank of Canada	BNP Paribas	(3,889)
2,297	National Bank of Canada	Goldman Sachs	(5,869)
(6,017)	Northland Power Inc	BNP Paribas	1,988
(945)	Northland Power Inc	Goldman Sachs	312
(409)	Northland Power Inc	HSBC	790
(411)	Northland Power Inc	JP Morgan	794
(235)	Nutrien Ltd	BNP Paribas	1,859
(1,665)	Nutrien Ltd	Citibank	10,201
(182)	Nutrien Ltd	HSBC	1,764
(1,237)	Nuvei Corp	BNP Paribas	3,742
(326)	Nuvei Corp	JP Morgan	3,205
168	Onex Corp	Bank of America Merrill Lynch	274
1,822	Onex Corp	Goldman Sachs	2,970
758	Onex Corp	HSBC	768
(2,598)	Open Text Corp	Citibank	(2,442)
(10,841)	Pan American Silver Corp	Bank of America Merrill Lynch	16,476
(5,370)	Pan American Silver Corp	BNP Paribas	8,161
(6,591)	Pan American Silver Corp	Citibank	717
(2,823)	Parkland Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,513
(2,631)	Parkland Corp	BNP Paribas	1,410
(2,282)	Parkland Corp	Citibank	3,066
(2,063)	Parkland Corp	Goldman Sachs	1,106
(481)	Parkland Corp	HSBC	74
1,100	Pembina Pipeline Corp	BNP Paribas	(1,833)
524	Pembina Pipeline Corp	Citibank	(172)
6,583	Pembina Pipeline Corp	Goldman Sachs	(10,971)
417	Pembina Pipeline Corp	HSBC	(643)
407	Pembina Pipeline Corp	JP Morgan	(742)
977	Power Corp of Canada	Bank of America Merrill Lynch	(556)
4,787	Power Corp of Canada	BNP Paribas	(2,724)
2,310	Power Corp of Canada	Citibank	(331)
4,803	Power Corp of Canada	Goldman Sachs	(2,733)
2,396	Power Corp of Canada	HSBC	(976)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	カナダ(続き)		
2,321	Power Corp of Canada	JP Morgan	(946)
(4,671)	Quebecor Inc 'B'	BNP Paribas	4,664
(1,307)	Quebecor Inc 'B'	Citibank	1,574
(2,499)	Quebecor Inc 'B'	Goldman Sachs	2,495
(652)	Quebecor Inc 'B'	HSBC	584
(977)	RB Global Inc	Bank of America Merrill Lynch	(531)
(178)	RB Global Inc	BNP Paribas	(97)
(3,977)	RB Global Inc	Citibank	10,679
(688)	RB Global Inc	Goldman Sachs	(374)
(538)	RB Global Inc	HSBC	1,572
(245)	Restaurant Brands International Inc	Bank of America Merrill Lynch	34
(1,467)	Restaurant Brands International Inc	BNP Paribas	205
(906)	Restaurant Brands International Inc	Goldman Sachs	126
(317)	Restaurant Brands International Inc	HSBC	(293)
(182)	Restaurant Brands International Inc	JP Morgan	(168)
(2,200)	Rogers Communications Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	9,724
(4,234)	Rogers Communications Inc 'B'	BNP Paribas	18,713
(6,047)	Rogers Communications Inc 'B'	Goldman Sachs	26,727
(3,219)	Rogers Communications Inc 'B'	HSBC	14,156
612	Royal Bank of Canada	Bank of America Merrill Lynch	(3,707)
161	Royal Bank of Canada	BNP Paribas	(975)
712	Royal Bank of Canada	Citibank	(1,678)
2,994	Royal Bank of Canada	Goldman Sachs	(18,135)
(2,999)	Saputo Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,180
(128)	Shopify Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	343
(2,032)	Shopify Inc 'A'	BNP Paribas	5,445
(559)	Shopify Inc 'A'	HSBC	2,770
1,238	Sun Life Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(614)
3,393	Sun Life Financial Inc	BNP Paribas	(1,681)
688	Sun Life Financial Inc	Citibank	(634)
5,305	Sun Life Financial Inc	Goldman Sachs	(2,629)
4,164	Sun Life Financial Inc	HSBC	1,238
144	Sun Life Financial Inc	JP Morgan	43
(4,010)	TC Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	8,950
(5,487)	TC Energy Corp	BNP Paribas	12,247
(81)	TC Energy Corp	HSBC	187
(14,771)	TELUS Corp	BNP Paribas	18,111
(198)	TELUS Corp	Goldman Sachs	243
(2,183)	TELUS Corp	HSBC	2,548
448	TFI International Inc	Bank of America Merrill Lynch	289
212	TFI International Inc	BNP Paribas	137
91	TFI International Inc	Citibank	(222)
110	TFI International Inc	Goldman Sachs	71
98	TFI International Inc	JP Morgan	230
(946)	Thomson Reuters Corp	BNP Paribas	(2,966)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
カナダ(続き)			
(973)	Thomson Reuters Corp	Goldman Sachs	(3,050)
(151)	TMX Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(68)
(685)	TMX Group Ltd	BNP Paribas	(307)
(99)	TMX Group Ltd	Citibank	(92)
(564)	TMX Group Ltd	Goldman Sachs	(253)
(309)	TMX Group Ltd	JP Morgan	(1,121)
782	Toromont Industries Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(230)
634	Toromont Industries Ltd	BNP Paribas	(186)
28	Toromont Industries Ltd	Goldman Sachs	(8)
155	Toromont Industries Ltd	HSBC	183
97	Toronto-Dominion Bank	BNP Paribas	(402)
192	Toronto-Dominion Bank	HSBC	(713)
184	Toronto-Dominion Bank	JP Morgan	(684)
362	Tourmaline Oil Corp	BNP Paribas	(146)
71	Tourmaline Oil Corp	Citibank	(183)
992	Tourmaline Oil Corp	Goldman Sachs	(401)
263	West Fraser Timber Co Ltd	Goldman Sachs	(1,464)
468	West Fraser Timber Co Ltd	HSBC	(2,869)
(708)	Wheaton Precious Metals Corp	Bank of America Merrill Lynch	4,252
(268)	Wheaton Precious Metals Corp	BNP Paribas	1,610
(309)	Wheaton Precious Metals Corp	HSBC	2,071
(333)	WSP Global Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,046
(1,867)	WSP Global Inc	BNP Paribas	5,867
(663)	WSP Global Inc	Citibank	1,232
(84)	WSP Global Inc	Goldman Sachs	264
(109)	WSP Global Inc	HSBC	587
(170)	WSP Global Inc	JP Morgan	916
			160,487
デンマーク			
26	AP Moller - Maersk A/S 'B'	BNP Paribas	(1,528)
451	Carlsberg AS 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(5,496)
472	Carlsberg AS 'B'	Barclays Bank	(5,616)
120	Carlsberg AS 'B'	BNP Paribas	(1,462)
274	Carlsberg AS 'B'	Goldman Sachs	(3,339)
81	Carlsberg AS 'B'	HSBC	(842)
174	Carlsberg AS 'B'	JP Morgan	(1,809)
(82)	Coloplast A/S 'B'	Bank of America Merrill Lynch	421
(1,337)	Coloplast A/S 'B'	Barclays Bank	2,341
(598)	Coloplast A/S 'B'	BNP Paribas	3,069
(558)	Coloplast A/S 'B'	Citibank	206
(265)	Coloplast A/S 'B'	Goldman Sachs	1,360
(370)	Coloplast A/S 'B'	HSBC	5,655
(17)	Coloplast A/S 'B'	JP Morgan	260
992	Danske Bank A/S	Barclays Bank	(188)
1,415	Danske Bank A/S	Citibank	(233)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
デンマーク(続き)			
(749)	Demant A/S	Bank of America Merrill Lynch	1,170
(1,587)	Demant A/S	Barclays Bank	5,529
(1,641)	Demant A/S	BNP Paribas	2,564
(342)	Demant A/S	Goldman Sachs	534
139	DSV A/S	Bank of America Merrill Lynch	648
515	DSV A/S	Barclays Bank	(148)
548	DSV A/S	BNP Paribas	2,553
57	DSV A/S	Citibank	(16)
63	DSV A/S	Goldman Sachs	294
120	DSV A/S	HSBC	731
574	Genmab A/S	BNP Paribas	(12,426)
138	Genmab A/S	Goldman Sachs	(2,987)
754	Novo Nordisk A/S 'B'	Barclays Bank	(6,702)
1,263	Novo Nordisk A/S 'B'	BNP Paribas	(8,003)
105	Novo Nordisk A/S 'B'	Citibank	(58)
127	Novo Nordisk A/S 'B'	Goldman Sachs	(805)
409	Novo Nordisk A/S 'B'	HSBC	(1,654)
2,226	Novozymes A/S 'B'	BNP Paribas	(8,234)
(889)	Orsted AS	Barclays Bank	3,798
(900)	Orsted AS	BNP Paribas	6,219
(236)	Orsted AS	Citibank	1,008
(209)	Orsted AS	HSBC	282
1,391	Pandora A/S	BNP Paribas	(11,846)
345	Pandora A/S	Citibank	(1,376)
817	Pandora A/S	Goldman Sachs	(6,957)
(348)	ROCKWOOL A/S 'B'	Barclays Bank	5,463
(163)	ROCKWOOL A/S 'B'	BNP Paribas	1,881
(435)	Tryg A/S	Bank of America Merrill Lynch	97
(1,348)	Tryg A/S	Barclays Bank	386
(8,151)	Tryg A/S	BNP Paribas	1,811
(425)	Tryg A/S	Goldman Sachs	94
(1,869)	Tryg A/S	HSBC	(281)
(939)	Vestas Wind Systems	A/S Bank of America Merrill Lynch	1,014
(1,421)	Vestas Wind Systems A/S	Barclays Bank	1,901
(6,207)	Vestas Wind Systems A/S	BNP Paribas	6,701
(96)	Vestas Wind Systems A/S	Goldman Sachs	104
(551)	Vestas Wind Systems A/S	HSBC	(449)
			<u>(24,361)</u>
フィンランド			
570	Elisa Oyj	Bank of America Merrill Lynch	(2,045)
1,490	Elisa Oyj	Barclays Bank	(3,862)
1,665	Elisa Oyj	BNP Paribas	(5,973)
893	Elisa Oyj	Citibank	(1,865)
232	Elisa Oyj	Goldman Sachs	(832)
1,524	Elisa Oyj	HSBC	(5,858)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
フィンランド(続き)			
572	Elisa Oyj	JP Morgan	(2,199)
(3,662)	Fortum Oyj	Barclays Bank	2,307
(1,904)	Fortum Oyj	BNP Paribas	3,039
(4,759)	Fortum Oyj	Goldman Sachs	7,597
(872)	Kesko Oyj 'B'	Barclays Bank	(17)
(417)	Kone Oyj 'B'	Bank of America Merrill Lynch	1,496
(1,363)	Kone Oyj 'B'	Barclays Bank	3,435
(1,347)	Kone Oyj 'B'	BNP Paribas	4,832
(937)	Kone Oyj 'B'	Goldman Sachs	3,362
(734)	Kone Oyj 'B'	HSBC	3,997
(1,037)	Neste Oyj	BNP Paribas	3,344
(328)	Neste Oyj	Citibank	676
11,703	Nokia Oyj	Bank of America Merrill Lynch	300
1,152	Nokia Oyj	Barclays Bank	4
9,286	Nokia Oyj	BNP Paribas	238
404	Nokia Oyj	HSBC	16
3,996	Nokia Oyj	JP Morgan	158
427	Orion Oyj 'B'	Barclays Bank	(752)
194	Orion Oyj 'B'	HSBC	(723)
(209)	Sampo Oyj 'A'	Bank of America Merrill Lynch	645
(904)	Sampo Oyj 'A'	Citibank	19
146	Stora Enso Oyj 'R'	Bank of America Merrill Lynch	12
2,065	Stora Enso Oyj 'R'	Barclays Bank	551
885	Stora Enso Oyj 'R'	Goldman Sachs	71
1,718	Stora Enso Oyj 'R'	HSBC	(495)
(671)	UPM-Kymmene Oyj	Bank of America Merrill Lynch	831
(3,761)	UPM-Kymmene Oyj	Barclays Bank	4,070
(4,962)	UPM-Kymmene Oyj	BNP Paribas	6,146
(1,538)	UPM-Kymmene Oyj	Citibank	1,708
(4,977)	UPM-Kymmene Oyj	Goldman Sachs	6,164
(1,343)	UPM-Kymmene Oyj	HSBC	3,226
(279)	UPM-Kymmene Oyj	JP Morgan	670
(4,374)	Wartsila Oyj Abp	BNP Paribas	2,475
			<u>36,768</u>
フランス			
(392)	Accor SA	Barclays Bank	615
(4,761)	Accor SA	Goldman Sachs	915
(306)	Accor SA	HSBC	278
(318)	Accor SA	JP Morgan	289
(1,203)	Aeroports de Paris	Barclays Bank	2,826
(1,306)	Air Liquide SA	Barclays Bank	7,921
(156)	Air Liquide SA	Goldman Sachs	630
(1,500)	Alstom SA	Bank of America Merrill Lynch	(64)
(2,236)	Alstom SA	Barclays Bank	4,083
(262)	Alstom SA	Goldman Sachs	(11)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	フランス(続き)		
(4,066)	Alstom SA	HSBC	(8,032)
286	Amundi SA	Bank of America Merrill Lynch	(2,764)
926	Amundi SA	Barclays Bank	(5,586)
288	Amundi SA	Goldman Sachs	(2,783)
725	Amundi SA	HSBC	(6,154)
769	Arkema SA	Bank of America Merrill Lynch	(4,056)
557	Arkema SA	Barclays Bank	(3,949)
104	Arkema SA	Citibank	(737)
1,001	Arkema SA	Goldman Sachs	(5,280)
1,457	Arkema SA	HSBC	(11,948)
125	Arkema SA	JP Morgan	(1,025)
(522)	AXA SA	Goldman Sachs	507
9	BioMerieux	Barclays Bank	(66)
336	BioMerieux	Goldman Sachs	(1,571)
461	BioMerieux	HSBC	(2,136)
1,271	BNP Paribas SA	Goldman Sachs	(5,741)
2,907	Bollere SE	Bank of America Merrill Lynch	(419)
5,537	Bollere SE	Barclays Bank	(473)
2,518	Bollere SE	Goldman Sachs	(363)
2,065	Bollere SE	HSBC	(265)
(1,305)	Bouygues SA	Bank of America Merrill Lynch	2,397
(3,451)	Bouygues SA	Barclays Bank	1,806
(3,805)	Bouygues SA	Citibank	1,991
(6,473)	Bouygues SA	Goldman Sachs	11,888
(4,525)	Bouygues SA	HSBC	9,905
1,971	Bureau Veritas SA	Bank of America Merrill Lynch	(1,515)
2,808	Bureau Veritas SA	Barclays Bank	(2,608)
357	Bureau Veritas SA	Citibank	(332)
4,303	Bureau Veritas SA	Goldman Sachs	(3,308)
3,072	Bureau Veritas SA	HSBC	(6,068)
449	Bureau Veritas SA	JP Morgan	(887)
92	Capgemini SE	Bank of America Merrill Lynch	192
558	Carrefour SA	Barclays Bank	(115)
1,666	Cie de Saint-Gobain	Bank of America Merrill Lynch	(3,344)
1,842	Cie de Saint-Gobain	Barclays Bank	(4,817)
1,618	Cie de Saint-Gobain	Citibank	(4,062)
2,402	Cie de Saint-Gobain	Goldman Sachs	(4,822)
3,214	Cie de Saint-Gobain	HSBC	(892)
749	Cie de Saint-Gobain	JP Morgan	(208)
(3,302)	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	Bank of America Merrill Lynch	8,814
(4,627)	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	Barclays Bank	5,978
(2,400)	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	Citibank	3,101
(504)	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	Goldman Sachs	1,345
(3,045)	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA	HSBC	8,713
12,252	Credit Agricole SA	Barclays Bank	(15,568)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	フランス(続き)		
7,125	Credit Agricole SA	Goldman Sachs	(7,182)
1,817	Credit Agricole SA	HSBC	(784)
246	Danone SA	Citibank	(58)
184	Danone SA	JP Morgan	(976)
946	Dassault Systemes SE	Barclays Bank	2,015
1,831	Dassault Systemes SE	HSBC	10,411
(466)	Edenred	Barclays Bank	50
(1,502)	Edenred	Citibank	160
486	Eiffage SA	Bank of America Merrill Lynch	(1,603)
1,104	Eiffage SA	Barclays Bank	(4,527)
77	Eiffage SA	Citibank	(316)
1,816	Eiffage SA	Goldman Sachs	(5,992)
386	Eiffage SA	HSBC	(2,325)
476	Eiffage SA	JP Morgan	(2,867)
1,975	Engie SA	Bank of America Merrill Lynch	(1,451)
806	Engie SA	Barclays Bank	(291)
9,393	Engie SA	Goldman Sachs	(6,900)
501	Engie SA	HSBC	(309)
(78)	EssilorLuxottica SA	Bank of America Merrill Lynch	1,259
(767)	EssilorLuxottica SA	Barclays Bank	8,310
(195)	EssilorLuxottica SA	Citibank	1,420
(422)	EssilorLuxottica SA	Goldman Sachs	6,813
(129)	EssilorLuxottica SA	HSBC	2,036
(414)	EssilorLuxottica SA	JP Morgan	6,533
324	Eurazeo SE	Bank of America Merrill Lynch	(35)
307	Eurazeo SE	Barclays Bank	34
346	Eurazeo SE	Citibank	659
4,252	Eurazeo SE	HSBC	(6,583)
(359)	Eurofins Scientific SE	Bank of America Merrill Lynch	(744)
(2,324)	Eurofins Scientific SE	Barclays Bank	(4,318)
(762)	Eurofins Scientific SE	Citibank	(1,416)
(2,299)	Eurofins Scientific SE	Goldman Sachs	(4,762)
(2,704)	Eurofins Scientific SE	HSBC	7,333
(262)	Euronext NV	Bank of America Merrill Lynch	2,042
(1,827)	Euronext NV	Goldman Sachs	14,241
(1,114)	Getlink SE	Barclays Bank	1,558
(1,660)	Getlink SE	Goldman Sachs	1,604
(18,698)	Getlink SE	HSBC	14,974
(821)	Getlink SE	JP Morgan	657
31	Hermes International	Bank of America Merrill Lynch	(2,218)
175	Hermes International	Barclays Bank	(20,610)
16	Hermes International	Citibank	(1,884)
3	Hermes International	Goldman Sachs	(215)
45	Hermes International	HSBC	(4,675)
21	Hermes International	JP Morgan	(2,182)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	フランス(続き)		
887	Ipsen SA	HSBC	(3,599)
23	Kering SA	Bank of America Merrill Lynch	(1,308)
102	Kering SA	Barclays Bank	(4,776)
9	Kering SA	Citibank	(421)
136	Kering SA	Goldman Sachs	(7,733)
22	Kering SA	HSBC	(1,559)
796	La Francaise des Jeux SAEM	Bank of America Merrill Lynch	(1,139)
71	La Francaise des Jeux SAEM	Barclays Bank	(156)
258	La Francaise des Jeux SAEM	Goldman Sachs	(369)
6,483	La Francaise des Jeux SAEM	HSBC	(10,106)
351	La Francaise des Jeux SAEM	JP Morgan	(547)
507	Legrand SA	Bank of America Merrill Lynch	1,321
156	Legrand SA	Goldman Sachs	406
321	Legrand SA	HSBC	1,097
57	L'Oreal SA	Bank of America Merrill Lynch	(1,315)
202	L'Oreal SA	Barclays Bank	(4,130)
24	L'Oreal SA	Citibank	(491)
95	L'Oreal SA	Goldman Sachs	(2,191)
58	L'Oreal SA	HSBC	(1,777)
62	L'Oreal SA	JP Morgan	(1,900)
(13)	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	Bank of America Merrill Lynch	922
(103)	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	Barclays Bank	6,984
(71)	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	Citibank	4,045
(80)	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	Goldman Sachs	5,672
(29)	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	HSBC	2,161
18,378	Orange SA	Barclays Bank	(5,337)
171	Pernod Ricard SA	Bank of America Merrill Lynch	(2,337)
175	Pernod Ricard SA	Barclays Bank	(2,261)
1	Pernod Ricard SA	Citibank	(13)
356	Pernod Ricard SA	Goldman Sachs	(4,866)
173	Pernod Ricard SA	HSBC	(2,882)
871	Publicis Groupe SA	Barclays Bank	(2,213)
1,135	Publicis Groupe SA	Goldman Sachs	461
2,451	Publicis Groupe SA	HSBC	(1,361)
(466)	Remy Cointreau SA	Barclays Bank	2,424
(383)	Remy Cointreau SA	Citibank	2,974
(58)	Remy Cointreau SA	Goldman Sachs	864
(701)	Remy Cointreau SA	HSBC	14,745
(348)	Renault SA	Bank of America Merrill Lynch	609
(2,075)	Renault SA	Barclays Bank	2,738
(536)	Renault SA	Citibank	1,073
(2,826)	Renault SA	Goldman Sachs	4,949
(1,026)	Renault SA	HSBC	1,008
(492)	Sanofi	Barclays Bank	2,868
(386)	Sanofi	Citibank	2,250

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
フランス(続き)			
(1,679)	Sanofi	Goldman Sachs	8,677
(461)	Sanofi	HSBC	2,668
(55)	Sartorius Stedim Biotech	Bank of America Merrill Lynch	29
(395)	Sartorius Stedim Biotech	Barclays Bank	195
(146)	Sartorius Stedim Biotech	Citibank	(75)
(344)	Sartorius Stedim Biotech	Goldman Sachs	184
(31)	Sartorius Stedim Biotech	HSBC	278
304	Schneider Electric SE	Bank of America Merrill Lynch	1,461
687	Schneider Electric SE	Barclays Bank	(1,819)
146	Schneider Electric SE	Citibank	(387)
1,152	Schneider Electric SE	Goldman Sachs	5,535
162	Schneider Electric SE	HSBC	720
203	Schneider Electric SE	JP Morgan	902
(83)	SEB SA	Bank of America Merrill Lynch	1,453
(789)	SEB SA	Barclays Bank	12,721
(125)	SEB SA	Citibank	2,015
(504)	SEB SA	Goldman Sachs	8,826
(335)	SEB SA	HSBC	5,401
127	Societe Generale SA	Barclays Bank	(221)
2,511	Societe Generale SA	Goldman Sachs	(1,475)
(388)	Sodexo SA	HSBC	(1,781)
2,596	STMicroelectronics NV	Barclays Bank	(1,946)
652	STMicroelectronics NV	Goldman Sachs	1,566
259	STMicroelectronics NV	HSBC	640
(162)	Teleperformance	Bank of America Merrill Lynch	3,632
(63)	Teleperformance	Barclays Bank	1,359
(60)	Teleperformance	Citibank	1,294
(37)	Teleperformance	HSBC	668
2,501	TotalEnergies SE	Barclays Bank	(8,652)
(545)	Valeo	Bank of America Merrill Lynch	38
(482)	Valeo	HSBC	(522)
415	Veolia Environnement SA	Barclays Bank	325
205	Vinci SA	Bank of America Merrill Lynch	(508)
195	Vinci SA	Barclays Bank	(708)
406	Vinci SA	Goldman Sachs	(1,006)
3,104	Vivendi SE	Barclays Bank	(3,666)
4,424	Vivendi SE	Citibank	(5,224)
761	Vivendi SE	JP Morgan	(1,170)
2,474	Wendel SE	Barclays Bank	(9,246)
(1,210)	Worldline SA	Barclays Bank	5,969
(90)	Worldline SA	Citibank	444
(2,176)	Worldline SA	HSBC	8,434
			<u>(9,077)</u>
ドイツ			
(159)	adidas AG	Bank of America Merrill Lynch	2,346

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	ドイツ(続き)		
(543)	adidas AG	Barclays Bank	5,717
(432)	adidas AG	BNP Paribas	6,375
(636)	adidas AG	Citibank	4,684
(203)	adidas AG	Goldman Sachs	2,996
(288)	adidas AG	HSBC	5,332
172	Allianz SE Reg	Bank of America Merrill Lynch	(1,745)
50	Allianz SE Reg	Barclays Bank	(563)
495	Allianz SE Reg	BNP Paribas	(5,021)
255	Allianz SE Reg	Citibank	(2,872)
64	Allianz SE Reg	Goldman Sachs	(649)
129	Allianz SE Reg	JP Morgan	(2,197)
(2,240)	Aroundtown SA	Bank of America Merrill Lynch	264
(31,389)	Aroundtown SA	Barclays Bank	835
(12,648)	Aroundtown SA	BNP Paribas	1,491
(17,752)	Aroundtown SA	Citibank	1,315
(6,499)	Aroundtown SA	Goldman Sachs	766
(1,936)	Aroundtown SA	HSBC	305
226	BASF SE	Bank of America Merrill Lynch	(706)
231	BASF SE	Barclays Bank	(613)
618	BASF SE	BNP Paribas	(1,930)
389	BASF SE	Citibank	(1,032)
(540)	Bayer AG Reg	Barclays Bank	589
(174)	Bayer AG Reg	BNP Paribas	108
(194)	Bayer AG Reg	Citibank	273
(717)	Bayer AG Reg	Goldman Sachs	444
(382)	Bayer AG Reg	HSBC	2,280
(188)	Bayerische Motoren Werke AG (Pref)	Bank of America Merrill Lynch	(301)
(1,166)	Bayerische Motoren Werke AG (Pref)	BNP Paribas	(1,867)
(143)	Bechtle AG	Bank of America Merrill Lynch	302
(236)	Bechtle AG	Barclays Bank	577
(1,354)	Bechtle AG	BNP Paribas	2,863
(921)	Bechtle AG	Citibank	955
(719)	Bechtle AG	Goldman Sachs	1,520
(249)	Bechtle AG	HSBC	1,500
272	Beiersdorf AG	Bank of America Merrill Lynch	(1,960)
692	Beiersdorf AG	Barclays Bank	(4,877)
436	Beiersdorf AG	BNP Paribas	(3,142)
56	Beiersdorf AG	Citibank	(395)
721	Beiersdorf AG	Goldman Sachs	(5,196)
380	Beiersdorf AG	HSBC	(2,597)
(183)	Brenntag SE	Bank of America Merrill Lynch	543
(577)	Brenntag SE	Goldman Sachs	1,713
(321)	Brenntag SE	HSBC	555
(399)	Carl Zeiss Meditec AG	Barclays Bank	1,125
(5,513)	Commerzbank AG	Bank of America Merrill Lynch	3,232

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	ドイツ(続き)		
(5,137)	Commerzbank AG	BNP Paribas	3,011
(850)	Commerzbank AG	Citibank	430
(1,967)	Continental AG	BNP Paribas	8,569
(76)	Continental AG	Goldman Sachs	331
(346)	Covestro AG	Bank of America Merrill Lynch	1,082
(1,422)	Covestro AG	Barclays Bank	4,737
(2,875)	Covestro AG	BNP Paribas	8,994
(787)	Covestro AG	Citibank	2,622
(2,016)	Covestro AG	Goldman Sachs	6,307
(151)	Covestro AG	HSBC	571
(618)	Daimler Truck Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	416
(377)	Daimler Truck Holding AG	Citibank	346
(1,690)	Daimler Truck Holding AG	Goldman Sachs	1,137
(375)	Delivery Hero SE	Bank of America Merrill Lynch	1,822
(403)	Delivery Hero SE	Barclays Bank	676
(1,620)	Delivery Hero SE	BNP Paribas	7,870
(184)	Delivery Hero SE	Goldman Sachs	894
2,231	Deutsche Bank AG Reg	BNP Paribas	(562)
258	Deutsche Bank AG Reg	Goldman Sachs	(65)
4,169	Deutsche Bank AG Reg	HSBC	(837)
531	Deutsche Bank AG Reg	JP Morgan	(107)
(386)	Deutsche Boerse AG	Barclays Bank	1,865
(56)	Deutsche Boerse AG	BNP Paribas	532
(69)	Deutsche Boerse AG	HSBC	900
(2,538)	Deutsche Lufthansa AG Reg	Barclays Bank	1,314
(4,204)	Deutsche Lufthansa AG Reg	BNP Paribas	(247)
(992)	Deutsche Lufthansa AG Reg	Goldman Sachs	(58)
791	Deutsche Post AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	1,339
10,998	Deutsche Post AG Reg	BNP Paribas	18,613
5,579	Deutsche Post AG Reg	Goldman Sachs	9,442
1,093	Deutsche Post AG Reg	HSBC	502
2,013	E.ON SE	Bank of America Merrill Lynch	(1,537)
2,456	E.ON SE	Barclays Bank	73
13,628	E.ON SE	BNP Paribas	(10,404)
1,811	E.ON SE	Goldman Sachs	(1,383)
7,797	E.ON SE	HSBC	(6,286)
(1,311)	Evonik Industries AG	Goldman Sachs	1,120
(3,326)	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	Barclays Bank	9,837
(3,045)	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	BNP Paribas	12,290
(1,052)	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	Goldman Sachs	4,246
(355)	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	HSBC	986
(1,035)	Fresenius SE & Co KGaA	Barclays Bank	1,945
(4,068)	Fresenius SE & Co KGaA	BNP Paribas	9,295
(1,084)	Fresenius SE & Co KGaA	Citibank	2,037
(772)	Fresenius SE & Co KGaA	Goldman Sachs	1,764

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	ドイツ(続き)		
5,516	GEA Group AG	BNP Paribas	(7,480)
307	GEA Group AG	Goldman Sachs	(416)
(201)	Hannover Rueck SE	Barclays Bank	(1,331)
(691)	Hannover Rueck SE	BNP Paribas	(8,337)
(108)	Hannover Rueck SE	Citibank	(715)
(381)	Hannover Rueck SE	Goldman Sachs	(4,597)
(114)	Hannover Rueck SE	HSBC	(1,442)
146	Heidelberg Materials AG	Bank of America Merrill Lynch	(253)
815	Heidelberg Materials AG	Barclays Bank	(3,028)
821	Heidelberg Materials AG	BNP Paribas	(1,420)
376	Heidelberg Materials AG	Citibank	(1,397)
719	Heidelberg Materials AG	Goldman Sachs	(1,244)
495	Heidelberg Materials AG	HSBC	(1,638)
143	Heidelberg Materials AG	JP Morgan	(473)
(448)	HelloFresh SE	Barclays Bank	(125)
(419)	HelloFresh SE	Citibank	(159)
331	Henkel AG & Co KGaA (Pref)	Barclays Bank	(1,039)
809	Henkel AG & Co KGaA (Pref)	BNP Paribas	(2,280)
637	Henkel AG & Co KGaA (Pref)	Goldman Sachs	(1,796)
292	Henkel AG & Co KGaA (Pref)	HSBC	131
1,332	Infineon Technologies AG	Barclays Bank	1,102
976	Infineon Technologies AG	BNP Paribas	1,636
1,739	Infineon Technologies AG	Citibank	(215)
(1,332)	LEG Immobilien SE	Bank of America Merrill Lynch	8,391
(779)	LEG Immobilien SE	Barclays Bank	3,194
(315)	LEG Immobilien SE	BNP Paribas	1,984
(625)	LEG Immobilien SE	Citibank	2,563
(715)	LEG Immobilien SE	Goldman Sachs	4,504
(667)	LEG Immobilien SE	HSBC	4,587
351	Mercedes-Benz Group AG	Bank of America Merrill Lynch	847
4,371	Mercedes-Benz Group AG	Barclays Bank	(5,321)
122	Mercedes-Benz Group AG	BNP Paribas	294
2	Mercedes-Benz Group AG	Citibank	(2)
432	Mercedes-Benz Group AG	Goldman Sachs	1,042
(327)	Merck KGaA	Bank of America Merrill Lynch	646
(13)	Merck KGaA	Barclays Bank	43
(680)	Merck KGaA	BNP Paribas	1,343
(127)	Merck KGaA	Citibank	420
(187)	Merck KGaA	Goldman Sachs	369
(219)	Merck KGaA	HSBC	(386)
(109)	MTU Aero Engines AG	Barclays Bank	1,443
(41)	MTU Aero Engines AG	HSBC	359
48	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen Reg	Bank of America Merrill Lynch	764
173	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen Reg	Barclays Bank	1,252

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	ドイツ(続き)		
297	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen Reg	BNP Paribas	4,725
28	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen Reg	Citibank	300
179	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen Reg	Goldman Sachs	2,848
99	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen Reg	HSBC	1,047
27	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen Reg	JP Morgan	285
1,732	Nemetschek SE	BNP Paribas	9,062
(664)	Puma SE	Barclays Bank	231
(202)	Puma SE	BNP Paribas	1,408
(858)	Puma SE	Citibank	2,055
(995)	Puma SE	Goldman Sachs	6,938
(205)	Puma SE	JP Morgan	1,714
30	Rational AG	Bank of America Merrill Lynch	(160)
62	Rational AG	Barclays Bank	(232)
67	Rational AG	BNP Paribas	(358)
17	Rational AG	Citibank	(64)
8	Rational AG	Goldman Sachs	(43)
41	Rational AG	HSBC	(832)
59	Rational AG	JP Morgan	(1,197)
837	SAP SE	Bank of America Merrill Lynch	1,644
304	SAP SE	Barclays Bank	(493)
432	SAP SE	BNP Paribas	849
498	SAP SE	Goldman Sachs	978
(131)	Sartorius AG (Pref)	Bank of America Merrill Lynch	3,693
(147)	Sartorius AG (Pref)	Barclays Bank	1,758
(339)	Sartorius AG (Pref)	BNP Paribas	9,556
(28)	Sartorius AG (Pref)	Citibank	264
(100)	Sartorius AG (Pref)	Goldman Sachs	2,819
549	Scout24 SE	Bank of America Merrill Lynch	610
1,007	Scout24 SE	Barclays Bank	(194)
552	Scout24 SE	BNP Paribas	613
181	Scout24 SE	Citibank	(35)
689	Scout24 SE	Goldman Sachs	765
793	Scout24 SE	HSBC	1,880
225	Scout24 SE	JP Morgan	533
1,002	Siemens AG Reg	Barclays Bank	(1,851)
101	Siemens AG Reg	BNP Paribas	356
1,195	Siemens AG Reg	Citibank	(3,674)
204	Siemens AG Reg	HSBC	893
(3,662)	Siemens Energy AG	Barclays Bank	2,111
(8)	Siemens Energy AG	BNP Paribas	(6)
(193)	Siemens Healthineers AG	Barclays Bank	165
(4,267)	Siemens Healthineers AG	BNP Paribas	8,110

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
ドイツ(続き)			
(213)	Siemens Healthineers AG	Citibank	182
(436)	Siemens Healthineers AG	Goldman Sachs	829
(137)	Symrise AG	Barclays Bank	680
(390)	Symrise AG	BNP Paribas	3,061
(223)	Symrise AG	Goldman Sachs	1,750
(835)	Symrise AG	HSBC	7,712
(13)	Symrise AG	JP Morgan	120
(1,095)	Telefonica Deutschland Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	531
(15,702)	Telefonica Deutschland Holding AG	Barclays Bank	2,180
(9,337)	Telefonica Deutschland Holding AG	BNP Paribas	4,526
(9,062)	Telefonica Deutschland Holding AG	Goldman Sachs	4,393
(4,169)	Vonovia SE	Barclays Bank	2,893
(8,659)	Vonovia SE	BNP Paribas	14,978
(2,918)	Vonovia SE	Goldman Sachs	5,047
(1,871)	Vonovia SE	HSBC	3,037
(1,451)	Zalando SE	Bank of America Merrill Lynch	7,189
(1,181)	Zalando SE	Goldman Sachs	5,851
			235,621
香港			
11,800	AIA Group Ltd	Barclays Bank	(7,305)
55,000	BOC Hong Kong Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(9,829)
(40,200)	Budweiser Brewing Co APAC Ltd	Citibank	6,517
63,000	CK Asset Holdings Ltd	HSBC	(34,580)
9,000	CK Hutchison Holdings Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(5,744)
8,500	CK Hutchison Holdings Ltd	Barclays Bank	(3,960)
12,000	CK Hutchison Holdings Ltd	BNP Paribas	(7,659)
12,500	CK Hutchison Holdings Ltd	Goldman Sachs	(7,978)
10,000	CK Hutchison Holdings Ltd	HSBC	(8,233)
(9,600)	ESR Group Ltd	Goldman Sachs	172
(6,000)	Galaxy Entertainment Group Ltd	BNP Paribas	2,604
(10,000)	Galaxy Entertainment Group Ltd	Citibank	4,531
(27,000)	Galaxy Entertainment Group Ltd	Goldman Sachs	11,718
(13,000)	Hang Lung Properties Ltd	Goldman Sachs	1,128
(1,700)	Hang Seng Bank Ltd	BNP Paribas	1,953
(1,300)	Hang Seng Bank Ltd	HSBC	1,726
84,000	Henderson Land Development Co Ltd	Goldman Sachs	(31,632)
(141,000)	HKT Trust & HKT Ltd (Unit)	Bank of America Merrill Lynch	3,600
(258,900)	Hong Kong & China Gas Co Ltd	Barclays Bank	10,906
(900)	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	Goldman Sachs	3,079
(92,452)	MTR Corp Ltd	Barclays Bank	32,454
(5,000)	New World Development Co Ltd	Goldman Sachs	957
(28,800)	Sands China Ltd	Goldman Sachs	4,044
(1)	Sisram Medical Ltd	JP Morgan	-
4,000	SITC International Holdings Co Ltd	Citibank	122
35,500	Sun Hung Kai Properties Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(24,470)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
香港(続き)			
2,000	Sun Hung Kai Properties Ltd	Goldman Sachs	(1,379)
21,000	Swire Pacific Ltd 'A'	HSBC	(25,600)
(40,400)	Swire Properties Ltd	Bank of America Merrill Lynch	11,036
(2,500)	Techtronic Industries Co Ltd	Barclays Bank	2,058
(4,000)	Techtronic Industries Co Ltd	BNP Paribas	5,157
(4,000)	Techtronic Industries Co Ltd	Goldman Sachs	5,157
(33,000)	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	Citibank	7,161
(15,000)	Xinyi Glass Holdings Ltd	BNP Paribas	3,332
(15,000)	Xinyi Glass Holdings Ltd	Goldman Sachs	3,332
(8,000)	Xinyi Glass Holdings Ltd	HSBC	2,390
			<u>(43,235)</u>
アイルランド			
(15,493)	AIB Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	2,018
(9,013)	AIB Group Plc	Barclays Bank	1,463
(37,691)	AIB Group Plc	BNP Paribas	4,910
(2,762)	AIB Group Plc	Goldman Sachs	360
(4,578)	AIB Group Plc	HSBC	391
1,411	CRH Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1,281)
3,388	CRH Plc	Barclays Bank	(5,897)
3,475	CRH Plc	BNP Paribas	(3,154)
1,369	CRH Plc	Citibank	(2,383)
2,599	CRH Plc	Goldman Sachs	(2,359)
1,209	CRH Plc	HSBC	(581)
883	CRH Plc	JP Morgan	(424)
(254)	Flutter Entertainment Plc	Barclays Bank	2,373
(86)	Flutter Entertainment Plc	BNP Paribas	225
(324)	Flutter Entertainment Plc	Goldman Sachs	848
(439)	Flutter Entertainment Plc	HSBC	(937)
102	Kerry Group Plc 'A'	Barclays Bank	(416)
(550)	Kingspan Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	24
(1,689)	Kingspan Group Plc	Barclays Bank	3,174
(717)	Kingspan Group Plc	BNP Paribas	31
(292)	Kingspan Group Plc	Goldman Sachs	12
(434)	Kingspan Group Plc	HSBC	(454)
602	Smurfit Kappa Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(701)
579	Smurfit Kappa Group Plc	Barclays Bank	(785)
430	Smurfit Kappa Group Plc	BNP Paribas	(500)
132	Smurfit Kappa Group Plc	Goldman Sachs	(154)
385	Smurfit Kappa Group Plc	HSBC	(428)
			<u>(4,625)</u>
イスラエル			
1,911	Bank Hapoalim BM	Bank of America Merrill Lynch	(1,150)
3,348	Bank Hapoalim BM	Barclays Bank	(1,484)
3,844	Bank Hapoalim BM	Goldman Sachs	(2,313)
684	Bank Leumi Le-Israel BM	Barclays Bank	(343)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	イスラエル(続き)		
3,631	Bank Leumi Le-Israel BM	Goldman Sachs	(2,585)
14,920	Bezeq The Israeli Telecommunication Corp Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(882)
31,467	Bezeq The Israeli Telecommunication Corp Ltd	Barclays Bank	(2,029)
23,582	Israel Discount Bank Ltd 'A'	Goldman Sachs	(5,765)
			<u>(16,551)</u>
	イタリア		
(761)	Amplifon SpA	Barclays Bank	1,308
(4,414)	Amplifon SpA	BNP Paribas	15,977
(822)	Amplifon SpA	Goldman Sachs	2,975
(1,257)	Amplifon SpA	HSBC	4,711
641	Assicurazioni Generali SpA	Barclays Bank	(216)
484	Assicurazioni Generali SpA	Goldman Sachs	(587)
354	Assicurazioni Generali SpA	HSBC	(476)
(665)	CNH Industrial NV	Citibank	525
(2,098)	Davide Campari-Milano NV	Bank of America Merrill Lynch	101
(11,623)	Davide Campari-Milano NV	Barclays Bank	2,358
(5,393)	Davide Campari-Milano NV	BNP Paribas	259
(7,585)	Davide Campari-Milano NV	Citibank	1,539
(4,665)	Davide Campari-Milano NV	Goldman Sachs	224
(4,713)	Davide Campari-Milano NV	HSBC	428
(187)	DiaSorin SpA	Bank of America Merrill Lynch	1,464
(508)	DiaSorin SpA	Barclays Bank	2,783
(278)	DiaSorin SpA	BNP Paribas	2,176
(94)	DiaSorin SpA	Citibank	515
(473)	DiaSorin SpA	Goldman Sachs	3,702
(189)	DiaSorin SpA	HSBC	874
(94)	DiaSorin SpA	JP Morgan	435
5,237	Enel SpA	Barclays Bank	(867)
23,942	Enel SpA	BNP Paribas	(3,426)
4,059	Enel SpA	Goldman Sachs	(581)
21,208	Eni SpA	BNP Paribas	(18,071)
220	Ferrari NV	BNP Paribas	(376)
73	Ferrari NV	Goldman Sachs	(125)
(931)	FinecoBank Banca Fineco SpA	Barclays Bank	(231)
(41,555)	Infrastrutture Wireless Italiane SpA	BNP Paribas	6,656
(5,641)	Intesa Sanpaolo SpA	Bank of America Merrill Lynch	1,506
(28,433)	Intesa Sanpaolo SpA	Citibank	5,176
16,761	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	Bank of America Merrill Lynch	9,467
3,168	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	Barclays Bank	254
2,623	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	BNP Paribas	1,482
5,612	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	Citibank	449
9,821	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	Goldman Sachs	5,547
4,468	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	HSBC	1,312
358	Moncler SpA	Bank of America Merrill Lynch	(864)
830	Moncler SpA	Barclays Bank	(1,205)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
イタリア(続き)			
905	Moncler SpA	BNP Paribas	(2,184)
(3,900)	Nexi SpA	Bank of America Merrill Lynch	1,616
(13,763)	Nexi SpA	Barclays Bank	6,936
(17,234)	Nexi SpA	BNP Paribas	7,140
(4,856)	Nexi SpA	Goldman Sachs	2,012
(4,000)	Nexi SpA	HSBC	683
(1,426)	Nexi SpA	JP Morgan	244
790	Poste Italiane SpA	Bank of America Merrill Lynch	61
2,237	Poste Italiane SpA	Barclays Bank	(401)
13,173	Poste Italiane SpA	BNP Paribas	1,013
860	Poste Italiane SpA	Citibank	(154)
1,876	Poste Italiane SpA	Goldman Sachs	144
1,709	Poste Italiane SpA	HSBC	438
598	Prysmian SpA	Citibank	(57)
(627)	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	Bank of America Merrill Lynch	3,140
(355)	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	Barclays Bank	1,077
(299)	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	BNP Paribas	1,497
(222)	Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	Goldman Sachs	1,112
13,175	Snam SpA	Bank of America Merrill Lynch	(2,968)
26,641	Snam SpA	Barclays Bank	(4,807)
14,469	Snam SpA	BNP Paribas	(3,260)
6,675	Snam SpA	Citibank	(1,205)
6,700	Snam SpA	Goldman Sachs	(1,509)
23,185	Snam SpA	HSBC	(4,184)
8,582	Snam SpA	JP Morgan	(1,549)
911	Stellantis NV	Bank of America Merrill Lynch	(533)
727	Stellantis NV	Barclays Bank	(782)
14,171	Stellantis NV	BNP Paribas	(8,292)
2,637	Stellantis NV	Goldman Sachs	(1,543)
1,082	Stellantis NV	HSBC	(585)
884	Stellantis NV	JP Morgan	(478)
(7,228)	Tenaris SA	BNP Paribas	3,666
(706)	Tenaris SA	Citibank	290
(6,596)	Tenaris SA	Goldman Sachs	3,345
(8,626)	Terna - Rete Elettrica Nazionale	Barclays Bank	276
(1,651)	Terna - Rete Elettrica Nazionale	HSBC	138
587	UniCredit SpA	Barclays Bank	(595)
604	UniCredit SpA	BNP Paribas	(399)
562	UniCredit SpA	Citibank	(570)
			45,951
日本			
(200)	Avantest Corp	Barclays Bank	(5,108)
(200)	Avantest Corp	Goldman Sachs	(8,233)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(4,400)	Aeon Co Ltd	Barclays Bank	4,285
(2,500)	Aeon Co Ltd	BNP Paribas	767
(1,900)	Aeon Co Ltd	Citibank	1,850
(600)	Aeon Co Ltd	Goldman Sachs	184
(1,000)	Aeon Co Ltd	HSBC	(146)
1,000	AGC Inc	BNP Paribas	571
(1,600)	Aisin Corp	Barclays Bank	(114)
(900)	Aisin Corp	BNP Paribas	(482)
(500)	Aisin Corp	Citibank	(36)
(700)	Aisin Corp	Goldman Sachs	(375)
(600)	Aisin Corp	HSBC	(342)
(500)	Aisin Corp	JP Morgan	(285)
700	Ajinomoto Co Inc	BNP Paribas	1,633
3,900	Ajinomoto Co Inc	Goldman Sachs	9,099
900	Ajinomoto Co Inc	HSBC	3,596
2,100	ANA Holdings Inc	Barclays Bank	(974)
1,800	ANA Holdings Inc	Citibank	(591)
1,300	ANA Holdings Inc	Goldman Sachs	417
400	Asahi Group Holdings Ltd	BNP Paribas	(360)
400	Asahi Group Holdings Ltd	Goldman Sachs	(360)
300	Asahi Group Holdings Ltd	JP Morgan	368
(1,700)	Asahi Intecc Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(982)
(1,700)	Asahi Intecc Co Ltd	Barclays Bank	2,401
(500)	Asahi Intecc Co Ltd	Goldman Sachs	(289)
(1,500)	Asahi Kasei Corp	Bank of America Merrill Lynch	140
(3,000)	Asahi Kasei Corp	BNP Paribas	280
2,800	Astellas Pharma Inc	Bank of America Merrill Lynch	629
8,200	Astellas Pharma Inc	Barclays Bank	(5,938)
23,400	Astellas Pharma Inc	BNP Paribas	5,259
2,500	Astellas Pharma Inc	Citibank	(1,810)
7,300	Astellas Pharma Inc	Goldman Sachs	1,641
5,000	Astellas Pharma Inc	HSBC	4,941
2,200	Astellas Pharma Inc	JP Morgan	2,174
(800)	Azbil Corp	BNP Paribas	(57)
(500)	Azbil Corp	Citibank	214
(800)	Azbil Corp	Goldman Sachs	(57)
(400)	Azbil Corp	HSBC	(1,712)
(500)	Bandai Namco Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(36)
(600)	Bandai Namco Holdings Inc	Barclays Bank	552
(3,300)	Bandai Namco Holdings Inc	BNP Paribas	(235)
(1,500)	Bandai Namco Holdings Inc	Citibank	1,381
(4,200)	Bandai Namco Holdings Inc	Goldman Sachs	(300)
(1,400)	Bandai Namco Holdings Inc	HSBC	(1,698)
600	Bridgestone Corp	Bank of America Merrill Lynch	184
5,300	Bridgestone Corp	Barclays Bank	(1,850)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	日本(続き)		
5,400	Bridgestone Corp	BNP Paribas	1,657
300	Bridgestone Corp	Citibank	(232)
1,000	Bridgestone Corp	Goldman Sachs	307
400	Bridgestone Corp	HSBC	488
600	Bridgestone Corp	JP Morgan	732
(700)	Brother Industries Ltd	Barclays Bank	465
(1,000)	Canon Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,541)
(2,400)	Canon Inc	Barclays Bank	(342)
(5,000)	Canon Inc	BNP Paribas	(7,705)
(600)	Canon Inc	Citibank	(86)
(500)	Canon Inc	HSBC	(760)
(400)	Capcom Co Ltd	Barclays Bank	88
1,800	Central Japan Railway Co	Barclays Bank	(2,575)
400	Central Japan Railway Co	BNP Paribas	(271)
600	Central Japan Railway Co	Citibank	(828)
500	Central Japan Railway Co	JP Morgan	801
(16,500)	Chiba Bank Ltd	Goldman Sachs	3,649
7,900	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	Barclays Bank	3,044
1,700	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	BNP Paribas	1,722
400	Chugai Pharmaceutical Co Ltd	Goldman Sachs	405
(2,600)	Concordia Financial Group Ltd	Barclays Bank	(56)
(3,600)	Concordia Financial Group Ltd	BNP Paribas	(411)
(3,300)	CyberAgent Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,050
(4,100)	CyberAgent Inc	Barclays Bank	3,422
(9,900)	CyberAgent Inc	BNP Paribas	12,149
(3,600)	CyberAgent Inc	Citibank	3,005
(5,600)	CyberAgent Inc	Goldman Sachs	6,872
(4,000)	CyberAgent Inc	HSBC	4,167
(1,300)	Dai Nippon Printing Co Ltd	Barclays Bank	927
(800)	Dai Nippon Printing Co Ltd	BNP Paribas	(342)
(1,800)	Dai Nippon Printing Co Ltd	Citibank	1,284
(1,800)	Dai Nippon Printing Co Ltd	Goldman Sachs	(771)
(400)	Dai Nippon Printing Co Ltd	JP Morgan	(200)
(900)	Daiichi Sankyo Co Ltd	Barclays Bank	2,151
(1,100)	Daiichi Sankyo Co Ltd	BNP Paribas	1,067
(800)	Daiichi Sankyo Co Ltd	Goldman Sachs	776
(400)	Daikin Industries Ltd	Barclays Bank	3,221
(300)	Daikin Industries Ltd	BNP Paribas	(589)
(100)	Daikin Industries Ltd	Citibank	942
(400)	Daikin Industries Ltd	Goldman Sachs	(785)
(200)	Daito Trust Construction Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	214
(100)	Daito Trust Construction Co Ltd	Barclays Bank	350
(200)	Daito Trust Construction Co Ltd	BNP Paribas	214
(600)	Daito Trust Construction Co Ltd	Goldman Sachs	642
(200)	Daito Trust Construction Co Ltd	HSBC	(385)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(100)	Daito Trust Construction Co Ltd	JP Morgan	(193)
2,700	Daiwa House Industry Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,984
8,200	Daiwa House Industry Co Ltd	Barclays Bank	3,159
6,800	Daiwa House Industry Co Ltd	BNP Paribas	4,997
1,600	Daiwa House Industry Co Ltd	Citibank	616
2,700	Daiwa House Industry Co Ltd	Goldman Sachs	1,984
4,900	Daiwa Securities Group Inc	BNP Paribas	(35)
(300)	Denso Corp	Bank of America Merrill Lynch	(745)
(800)	Denso Corp	Barclays Bank	257
(400)	Denso Corp	BNP Paribas	(993)
(700)	Denso Corp	Goldman Sachs	(1,738)
400	Dentsu Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,370)
3,800	Dentsu Group Inc	BNP Paribas	(13,013)
1,100	Dentsu Group Inc	Goldman Sachs	(3,767)
300	Dentsu Group Inc	HSBC	(771)
300	Dentsu Group Inc	JP Morgan	(771)
(300)	Disco Corp	Bank of America Merrill Lynch	(6,592)
(600)	Disco Corp	BNP Paribas	(13,184)
(2,800)	East Japan Railway Co	Goldman Sachs	8,310
(700)	Eisai Co Ltd	Barclays Bank	(2,113)
(1,100)	Eisai Co Ltd	BNP Paribas	(5,289)
(200)	Eisai Co Ltd	Citibank	(604)
(300)	Eisai Co Ltd	Goldman Sachs	(1,443)
(200)	Eisai Co Ltd	HSBC	(1,016)
14,700	ENEOS Holdings Inc	Barclays Bank	(1,038)
(500)	FANUC Corp	Barclays Bank	(78)
(2,100)	FANUC Corp	BNP Paribas	(3,146)
(2,200)	FANUC Corp	Goldman Sachs	(3,296)
(3,300)	FANUC Corp	HSBC	(5,062)
(700)	FANUC Corp	JP Morgan	(1,074)
(100)	Fast Retailing Co Ltd	BNP Paribas	(521)
(100)	Fast Retailing Co Ltd	Citibank	992
1,000	Fuji Electric Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	785
7,500	Fuji Electric Co Ltd	Barclays Bank	(16,052)
300	Fuji Electric Co Ltd	Goldman Sachs	235
300	Fuji Electric Co Ltd	HSBC	920
700	FUJIFILM Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	3,766
1,900	FUJIFILM Holdings Corp	Barclays Bank	3,240
2,600	FUJIFILM Holdings Corp	BNP Paribas	13,986
1,900	FUJIFILM Holdings Corp	Goldman Sachs	10,221
700	FUJIFILM Holdings Corp	JP Morgan	6,657
(200)	Fujitsu Ltd	BNP Paribas	721
(1,600)	GMO Payment Gateway Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,310
(100)	GMO Payment Gateway Inc	Barclays Bank	207
6,900	Hakuhodo DY Holdings Inc	Barclays Bank	(5,218)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	日本(続き)		
2,400	Hakuhodo DY Holdings Inc	Citibank	(1,815)
1,000	Hakuhodo DY Holdings Inc	Goldman Sachs	(706)
1,300	Hamamatsu Photonics KK	Bank of America Merrill Lynch	(371)
300	Hamamatsu Photonics KK	Barclays Bank	(428)
1,400	Hamamatsu Photonics KK	BNP Paribas	(400)
700	Hamamatsu Photonics KK	Goldman Sachs	(200)
800	Hamamatsu Photonics KK	HSBC	(1,655)
600	Hamamatsu Photonics KK	JP Morgan	(1,241)
800	Hankyu Hanshin Holdings Inc	Barclays Bank	(828)
2,100	Hankyu Hanshin Holdings Inc	BNP Paribas	(225)
600	Hankyu Hanshin Holdings Inc	Goldman Sachs	(64)
(100)	Hikari Tsushin Inc	Bank of America Merrill Lynch	(899)
(500)	Hikari Tsushin Inc	Barclays Bank	428
(100)	Hikari Tsushin Inc	BNP Paribas	(899)
(100)	Hirose Electric Co Ltd	BNP Paribas	(228)
1,300	Hitachi Ltd	Bank of America Merrill Lynch	705
2,900	Hitachi Ltd	Barclays Bank	(3,950)
1,400	Hitachi Ltd	BNP Paribas	759
1,300	Hitachi Ltd	Citibank	(851)
1,200	Hitachi Ltd	Goldman Sachs	651
700	Hitachi Ltd	HSBC	1,169
200	Hitachi Ltd	JP Morgan	334
1,700	Honda Motor Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3,105
1,600	Honda Motor Co Ltd	Barclays Bank	491
1,800	Honda Motor Co Ltd	Citibank	(46)
4,100	Honda Motor Co Ltd	Goldman Sachs	7,488
1,400	Hoya Corp	Bank of America Merrill Lynch	21,625
100	Hoya Corp	Barclays Bank	938
200	Hoya Corp	BNP Paribas	3,089
100	Hoya Corp	Goldman Sachs	1,545
100	Hoya Corp	HSBC	1,784
5,600	Hulic Co Ltd	Barclays Bank	(1,623)
7,900	Hulic Co Ltd	Citibank	(2,365)
1,400	Hulic Co Ltd	Goldman Sachs	(280)
(300)	Ibiden Co Ltd	Citibank	(2,440)
2,300	Idemitsu Kosan Co Ltd	BNP Paribas	(1,592)
1,500	Idemitsu Kosan Co Ltd	Goldman Sachs	(1,038)
900	Idemitsu Kosan Co Ltd	JP Morgan	(1,162)
(2,900)	Iida Group Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3,497
(2,600)	Iida Group Holdings Co Ltd	Barclays Bank	4,415
(9,400)	Iida Group Holdings Co Ltd	BNP Paribas	11,334
(1,400)	Iida Group Holdings Co Ltd	Citibank	2,377
(5,100)	Iida Group Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	6,149
(900)	Iida Group Holdings Co Ltd	HSBC	552
1,000	Inpex Corp	Citibank	(150)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	日本(続き)		
1,000	Inpex Corp	Goldman Sachs	114
3,600	Isuzu Motors Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(693)
2,100	Isuzu Motors Ltd	Barclays Bank	(1,663)
2,600	Isuzu Motors Ltd	BNP Paribas	(501)
1,500	Isuzu Motors Ltd	Citibank	(1,188)
4,600	Isuzu Motors Ltd	Goldman Sachs	(886)
1,000	Isuzu Motors Ltd	HSBC	157
(400)	ITOCHU Corp	Bank of America Merrill Lynch	(11)
(2,200)	ITOCHU Corp	Barclays Bank	1,946
(600)	ITOCHU Corp	BNP Paribas	(17)
(900)	ITOCHU Corp	Goldman Sachs	(26)
(1,500)	Itochu Techno-Solutions Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,177)
(1,500)	Itochu Techno-Solutions Corp	Barclays Bank	(428)
(2,500)	Itochu Techno-Solutions Corp	BNP Paribas	(1,962)
(900)	Itochu Techno-Solutions Corp	Citibank	(257)
(1,400)	Itochu Techno-Solutions Corp	Goldman Sachs	(1,099)
(1,600)	Itochu Techno-Solutions Corp	HSBC	(1,541)
(700)	Japan Airlines Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	20
(2,100)	Japan Airlines Co Ltd	Barclays Bank	1,528
(3,100)	Japan Airlines Co Ltd	BNP Paribas	88
(7,900)	Japan Airlines Co Ltd	Goldman Sachs	225
(600)	Japan Airlines Co Ltd	HSBC	111
(600)	Japan Airlines Co Ltd	JP Morgan	111
(4,200)	Japan Exchange Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,363)
(4,800)	Japan Exchange Group Inc	Barclays Bank	1,849
(5,200)	Japan Exchange Group Inc	BNP Paribas	(1,688)
(3,700)	Japan Exchange Group Inc	Goldman Sachs	(1,201)
(3,500)	Japan Exchange Group Inc	HSBC	(2,160)
(15,200)	Japan Post Bank Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3,470
12,100	Japan Post Bank Co Ltd	BNP Paribas	(2,762)
(3,000)	Japan Post Holdings Co Ltd	Barclays Bank	365
(7,700)	Japan Post Holdings Co Ltd	Citibank	892
800	Japan Post Insurance Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,102)
1,000	Japan Post Insurance Co Ltd	Barclays Bank	(849)
3,100	Japan Post Insurance Co Ltd	BNP Paribas	(4,269)
1,000	Japan Post Insurance Co Ltd	Citibank	(849)
1,200	Japan Post Insurance Co Ltd	HSBC	(865)
(400)	JFE Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	174
(1,600)	JFE Holdings Inc	Barclays Bank	833
(1,300)	JFE Holdings Inc	Citibank	677
(3,100)	JFE Holdings Inc	Goldman Sachs	1,349
(1,000)	JSR Corp	Goldman Sachs	(2,461)
(500)	JSR Corp	HSBC	(1,052)
9,500	Kajima Corp	Bank of America Merrill Lynch	4,677
6,900	Kajima Corp	Barclays Bank	(8,566)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	日本(続き)		
1,000	Kajima Corp	Citibank	(1,241)
800	Kajima Corp	Goldman Sachs	394
900	Kajima Corp	HSBC	790
100	Kao Corp	Bank of America Merrill Lynch	(274)
500	Kao Corp	Citibank	(1,448)
900	Kao Corp	HSBC	(3,698)
1,000	KDDI Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,512)
11,800	KDDI Corp	Barclays Bank	(16,669)
4,700	KDDI Corp	BNP Paribas	(7,109)
2,400	KDDI Corp	Citibank	(3,390)
4,000	KDDI Corp	Goldman Sachs	(6,050)
1,800	KDDI Corp	HSBC	1,015
(1,500)	Keio Corp	BNP Paribas	2,782
(400)	Keio Corp	Goldman Sachs	742
(400)	Keio Corp	HSBC	628
(5,500)	Keio Corp	JP Morgan	8,633
(1,600)	Keisei Electric Railway Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(457)
(3,000)	Keisei Electric Railway Co Ltd	Barclays Bank	1,712
(1,600)	Keisei Electric Railway Co Ltd	BNP Paribas	(457)
(600)	Keisei Electric Railway Co Ltd	Citibank	342
(1,200)	Keisei Electric Railway Co Ltd	Goldman Sachs	(342)
(1,300)	Keisei Electric Railway Co Ltd	HSBC	(2,782)
(800)	Keisei Electric Railway Co Ltd	JP Morgan	(1,712)
(100)	Keyence Corp	Goldman Sachs	(1,127)
700	Kikkoman Corp	Barclays Bank	(849)
(4,000)	Kintetsu Group Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4,566
(2,500)	Kintetsu Group Holdings Co Ltd	Barclays Bank	4,370
(400)	Kintetsu Group Holdings Co Ltd	BNP Paribas	457
(500)	Kintetsu Group Holdings Co Ltd	Citibank	874
(400)	Kintetsu Group Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	457
(1,300)	Kintetsu Group Holdings Co Ltd	HSBC	835
700	Kirin Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(449)
4,600	Kirin Holdings Co Ltd	Barclays Bank	(3,430)
7,500	Kirin Holdings Co Ltd	BNP Paribas	(4,816)
1,600	Kirin Holdings Co Ltd	Citibank	(1,193)
800	Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd	Barclays Bank	(359)
300	Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd	Citibank	(106)
300	Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd	Goldman Sachs	(920)
(5,500)	Kobe Bussan Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	6,082
(300)	Kobe Bussan Co Ltd	Goldman Sachs	332
(800)	Koei Tecmo Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	731
(12,920)	Koei Tecmo Holdings Co Ltd	Barclays Bank	8,296
(5,800)	Koei Tecmo Holdings Co Ltd	BNP Paribas	5,297
(8,200)	Koei Tecmo Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	7,488
(3,300)	Koei Tecmo Holdings Co Ltd	HSBC	1,789

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
日本(続き)			
(1,800)	Koito Manufacturing Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	912
(4,200)	Koito Manufacturing Co Ltd	Barclays Bank	3,895
(4,000)	Koito Manufacturing Co Ltd	BNP Paribas	2,026
(600)	Koito Manufacturing Co Ltd	Citibank	556
(1,800)	Koito Manufacturing Co Ltd	Goldman Sachs	912
(4,600)	Komatsu Ltd	Barclays Bank	5,650
(1,800)	Komatsu Ltd	Citibank	2,447
(1,100)	Konami Group Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,648)
(800)	Konami Group Corp	Barclays Bank	1,655
(1,100)	Konami Group Corp	BNP Paribas	(1,648)
(300)	Konami Group Corp	Citibank	621
(1,400)	Konami Group Corp	Goldman Sachs	(2,098)
(300)	Konami Group Corp	HSBC	(1,798)
(300)	Konami Group Corp	JP Morgan	(1,798)
(1,200)	Kose Corp	BNP Paribas	12,328
(200)	Kose Corp	Citibank	2,040
(7,700)	Kubota Corp	Barclays Bank	5,805
(10,900)	Kubota Corp	BNP Paribas	3,499
(1,900)	Kubota Corp	Citibank	1,223
(900)	Kubota Corp	Goldman Sachs	289
(100)	Kubota Corp	HSBC	106
300	Kurita Water Industries Ltd	Citibank	(407)
(400)	Kyocera Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,507)
(1,400)	Kyocera Corp	BNP Paribas	(5,274)
(300)	Kyocera Corp	HSBC	(1,599)
(300)	Kyocera Corp	JP Morgan	(1,599)
(300)	Kyowa Kirin Co Ltd	BNP Paribas	54
(1,500)	Kyowa Kirin Co Ltd	Goldman Sachs	268
(700)	Lasertec Corp	Barclays Bank	(1,648)
(100)	Lasertec Corp	Citibank	(235)
(300)	Lasertec Corp	Goldman Sachs	(7,084)
(6,000)	Lixil Corp	Barclays Bank	6,381
(4,600)	Lixil Corp	BNP Paribas	6,728
(4,700)	Lixil Corp	Citibank	6,472
(3,700)	Lixil Corp	Goldman Sachs	5,411
(600)	M3 Inc	Bank of America Merrill Lynch	(120)
(3,300)	M3 Inc	BNP Paribas	(659)
(600)	Makita Corp	Bank of America Merrill Lynch	(107)
(3,600)	Makita Corp	Barclays Bank	6,036
(1,500)	Makita Corp	BNP Paribas	(268)
(900)	Makita Corp	Citibank	1,509
(6,200)	Makita Corp	Goldman Sachs	(1,106)
(1,100)	Makita Corp	HSBC	(1,099)
(1,800)	Makita Corp	JP Morgan	(1,798)
3,600	Marubeni Corp	Barclays Bank	26

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	日本(続き)		
17,000	Marubeni Corp	BNP Paribas	4,670
(300)	MatsukiyoCocokara & Co	HSBC	(471)
1,600	Mazda Motor Corp	Bank of America Merrill Lynch	(160)
27,900	Mazda Motor Corp	Barclays Bank	(2,787)
1,400	Mazda Motor Corp	Citibank	(140)
2,900	Mazda Motor Corp	Goldman Sachs	(290)
2,800	Mazda Motor Corp	HSBC	(859)
1,500	Mazda Motor Corp	JP Morgan	(460)
(700)	McDonald's Holdings Co Japan Ltd	Bank of America Merrill Lynch	400
(200)	McDonald's Holdings Co Japan Ltd	Barclays Bank	(14)
(2,500)	McDonald's Holdings Co Japan Ltd	Goldman Sachs	1,427
(2,100)	McDonald's Holdings Co Japan Ltd	HSBC	1,199
3,800	MEIJI Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(5,151)
2,100	MEIJI Holdings Co Ltd	BNP Paribas	(2,847)
1,200	MEIJI Holdings Co Ltd	Citibank	(1,541)
3,200	MEIJI Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(4,338)
3,200	MEIJI Holdings Co Ltd	HSBC	(5,251)
(1,300)	MINEBEA MITSUMI Inc	Barclays Bank	(287)
(1,900)	MINEBEA MITSUMI Inc	BNP Paribas	(2,413)
(1,200)	MINEBEA MITSUMI Inc	Citibank	(511)
(600)	MINEBEA MITSUMI Inc	Goldman Sachs	(762)
(600)	MINEBEA MITSUMI Inc	HSBC	(492)
500	MISUMI Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,516)
500	MISUMI Group Inc	HSBC	(1,052)
(5,600)	Mitsubishi Chemical Group Corp	Bank of America Merrill Lynch	667
(13,500)	Mitsubishi Chemical Group Corp	Barclays Bank	2,880
(2,300)	Mitsubishi Chemical Group Corp	BNP Paribas	274
(1,700)	Mitsubishi Chemical Group Corp	Citibank	363
(9,600)	Mitsubishi Chemical Group Corp	Goldman Sachs	1,144
(4,300)	Mitsubishi Chemical Group Corp	HSBC	212
(1,700)	Mitsubishi Chemical Group Corp	JP Morgan	84
700	Mitsubishi Corp	Barclays Bank	(205)
800	Mitsubishi Corp	BNP Paribas	1,136
1,500	Mitsubishi Corp	Citibank	(1,774)
25,200	Mitsubishi Electric Corp	Bank of America Merrill Lynch	18,159
5,700	Mitsubishi Electric Corp	BNP Paribas	4,107
9,100	Mitsubishi Electric Corp	Citibank	747
1,900	Mitsubishi Electric Corp	Goldman Sachs	1,369
1,200	Mitsubishi Electric Corp	HSBC	608
1,900	Mitsubishi Electric Corp	JP Morgan	962
4,400	Mitsubishi Estate Co Ltd	Barclays Bank	(1,253)
3,000	Mitsubishi Estate Co Ltd	BNP Paribas	(856)
2,400	Mitsubishi Estate Co Ltd	Citibank	(848)
9,100	Mitsubishi HC Capital Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,428
13,400	Mitsubishi HC Capital Inc	Barclays Bank	(956)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	日本(続き)		
21,200	Mitsubishi HC Capital Inc	BNP Paribas	3,328
31,800	Mitsubishi HC Capital Inc	Goldman Sachs	4,991
5,200	Mitsubishi HC Capital Inc	HSBC	1,892
9,200	Mitsubishi HC Capital Inc	JP Morgan	3,347
(300)	Mitsubishi Heavy Industries Ltd	Barclays Bank	(411)
1,600	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	Barclays Bank	274
2,600	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	BNP Paribas	883
1,700	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	Citibank	24
700	Mitsui & Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	644
2,900	Mitsui & Co Ltd	Barclays Bank	(455)
2,100	Mitsui & Co Ltd	BNP Paribas	1,933
1,400	Mitsui & Co Ltd	Goldman Sachs	1,288
100	Mitsui Chemicals Inc	Bank of America Merrill Lynch	11
1,900	Mitsui Chemicals Inc	Barclays Bank	(813)
2,700	Mitsui Chemicals Inc	BNP Paribas	289
4,500	Mitsui Chemicals Inc	Goldman Sachs	482
2,400	Mitsui Chemicals Inc	HSBC	1,284
(1,700)	Mitsui Fudosan Co Ltd	Barclays Bank	873
(500)	Mitsui Fudosan Co Ltd	BNP Paribas	25
(2,300)	Mitsui Fudosan Co Ltd	Goldman Sachs	115
(400)	Mitsui OSK Lines Ltd	Bank of America Merrill Lynch	14
(5,900)	Mitsui OSK Lines Ltd	Barclays Bank	(255)
(1,100)	Mitsui OSK Lines Ltd	BNP Paribas	39
(1,800)	Mitsui OSK Lines Ltd	Citibank	126
(2,600)	Mitsui OSK Lines Ltd	Goldman Sachs	93
700	Mizuho Financial Group Inc	Citibank	(30)
(3,400)	MonotaRO Co Ltd	Barclays Bank	1,552
(600)	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(741)
(2,100)	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	Barclays Bank	(60)
(1,500)	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	BNP Paribas	(1,851)
(1,300)	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	Citibank	(37)
(800)	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	Goldman Sachs	(987)
(500)	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	JP Morgan	(1,138)
(4,300)	Murata Manufacturing Co Ltd	Barclays Bank	(1,536)
(1,300)	Murata Manufacturing Co Ltd	Citibank	(677)
(2,700)	Murata Manufacturing Co Ltd	Goldman Sachs	(5,586)
300	NEC Corp	Bank of America Merrill Lynch	771
300	NEC Corp	Citibank	449
1,600	NEC Corp	Goldman Sachs	4,109
1,400	NEC Corp	HSBC	5,993
400	NEC Corp	JP Morgan	1,712
(500)	Nexon Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	585
(7,500)	Nexon Co Ltd	Barclays Bank	9,846
(800)	Nexon Co Ltd	BNP Paribas	936
(400)	Nexon Co Ltd	HSBC	482

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	日本(続き)		
2,900	NGK Insulators Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(972)
4,800	NGK Insulators Ltd	Barclays Bank	(2,637)
22,500	NGK Insulators Ltd	Goldman Sachs	(7,545)
6,600	NGK Insulators Ltd	HSBC	(2,872)
800	NGK Insulators Ltd	JP Morgan	(348)
(900)	NIDEC Corp	Bank of America Merrill Lynch	83
(1,100)	NIDEC Corp	Barclays Bank	3,798
(400)	NIDEC Corp	Goldman Sachs	37
(700)	NIDEC Corp	HSBC	(859)
(800)	NIDEC Corp	JP Morgan	(982)
(1,400)	Nihon M&A Center Holdings Inc	Barclays Bank	220
(2,400)	Nintendo Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,329)
(1,200)	Nintendo Co Ltd	Barclays Bank	756
(4,800)	Nintendo Co Ltd	BNP Paribas	(4,657)
(300)	Nintendo Co Ltd	Citibank	265
(4,000)	Nintendo Co Ltd	Goldman Sachs	(3,881)
800	NIPPON EXPRESS HOLDINGS Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,484)
4,200	NIPPON EXPRESS HOLDINGS Inc	Barclays Bank	(15,582)
3,900	NIPPON EXPRESS HOLDINGS Inc	BNP Paribas	(7,234)
300	NIPPON EXPRESS HOLDINGS Inc	Citibank	(1,113)
300	NIPPON EXPRESS HOLDINGS Inc	Goldman Sachs	(556)
700	NIPPON EXPRESS HOLDINGS Inc	HSBC	(1,648)
400	NIPPON EXPRESS HOLDINGS Inc	JP Morgan	(942)
(13,600)	Nippon Paint Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	17,271
(2,300)	Nippon Paint Holdings Co Ltd	Barclays Bank	2,609
(3,600)	Nippon Paint Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	4,572
(400)	Nippon Paint Holdings Co Ltd	HSBC	519
(2,100)	Nippon Sanso Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,019)
(1,100)	Nippon Sanso Holdings Corp	Citibank	432
(2,900)	Nippon Sanso Holdings Corp	HSBC	(7,779)
1,000	Nippon Steel Corp	Barclays Bank	(1,067)
8,100	Nippon Steel Corp	BNP Paribas	(8,293)
(2,900)	Nippon Telegraph & Telephone Corp	Barclays Bank	4,552
(4,700)	Nippon Telegraph & Telephone Corp	Citibank	6,026
(2,400)	Nippon Yusen KK	Barclays Bank	718
(1,500)	Nippon Yusen KK	BNP Paribas	1,493
(900)	Nippon Yusen KK	Citibank	382
(2,500)	Nippon Yusen KK	Goldman Sachs	2,488
1,700	Nissan Chemical Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,819)
2,100	Nissan Chemical Corp	Barclays Bank	(2,397)
2,900	Nissan Chemical Corp	Goldman Sachs	(3,103)
300	Nissan Chemical Corp	HSBC	171
900	Nissan Chemical Corp	JP Morgan	514
(29,000)	Nissan Motor Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,090)
(13,000)	Nissan Motor Co Ltd	Barclays Bank	(56)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
日本(続き)			
(3,700)	Nissan Motor Co Ltd	Goldman Sachs	(267)
(10,700)	Nissan Motor Co Ltd	HSBC	(1,672)
1,000	Nisshin Seifun Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(114)
1,800	Nisshin Seifun Group Inc	Barclays Bank	(689)
6,300	Nisshin Seifun Group Inc	Citibank	(2,651)
2,400	Nisshin Seifun Group Inc	Goldman Sachs	(274)
1,100	Nisshin Seifun Group Inc	HSBC	698
900	Nisshin Seifun Group Inc	JP Morgan	571
700	Nissin Foods Holdings Co Ltd	Barclays Bank	(2,497)
3,800	Nissin Foods Holdings Co Ltd	BNP Paribas	(14,098)
400	Nissin Foods Holdings Co Ltd	HSBC	(3,567)
(100)	Nitori Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,345
(200)	Nitori Holdings Co Ltd	Barclays Bank	2,048
(200)	Nitori Holdings Co Ltd	BNP Paribas	2,690
(300)	Nitori Holdings Co Ltd	Citibank	3,071
(600)	Nitori Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	8,069
(200)	Nitori Holdings Co Ltd	HSBC	392
(100)	Nitori Holdings Co Ltd	JP Morgan	196
800	Nitto Denko Corp	Bank of America Merrill Lynch	3,082
900	Nitto Denko Corp	Barclays Bank	(1,092)
800	Nitto Denko Corp	Citibank	(970)
2,500	Nitto Denko Corp	Goldman Sachs	9,632
200	Nitto Denko Corp	HSBC	1,612
7,600	Nitto Denko Corp	JP Morgan	61,271
(26,500)	Nomura Holdings Inc	Barclays Bank	2,080
(19,400)	Nomura Holdings Inc	BNP Paribas	1,107
(24,200)	Nomura Holdings Inc	Citibank	2,581
(5,600)	Nomura Holdings Inc	Goldman Sachs	320
(2,800)	Nomura Holdings Inc	HSBC	(226)
100	Nomura Real Estate Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11)
3,600	Nomura Real Estate Holdings Inc	Barclays Bank	(1,669)
6,000	Nomura Real Estate Holdings Inc	BNP Paribas	(642)
1,000	Nomura Real Estate Holdings Inc	Goldman Sachs	(107)
100	Nomura Real Estate Holdings Inc	HSBC	36
200	Nomura Real Estate Holdings Inc	JP Morgan	71
(2,100)	Nomura Research Institute Ltd	Bank of America Merrill Lynch	375
(1,800)	Nomura Research Institute Ltd	Barclays Bank	1,926
(600)	Nomura Research Institute Ltd	BNP Paribas	107
(2,400)	Nomura Research Institute Ltd	Citibank	2,568
(2,400)	Nomura Research Institute Ltd	Goldman Sachs	428
(1,000)	Nomura Research Institute Ltd	HSBC	(392)
(1,700)	NTT Data Corp	Bank of America Merrill Lynch	(934)
(16,800)	NTT Data Corp	Barclays Bank	(1,678)
(2,400)	NTT Data Corp	BNP Paribas	(1,318)
(1,100)	NTT Data Corp	Citibank	(110)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(6,200)	NTT Data Corp	Goldman Sachs	(3,406)
(5,400)	NTT Data Corp	HSBC	(5,201)
6,100	Obayashi Corp	BNP Paribas	(218)
100	Obic Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	14
200	Obic Co Ltd	Barclays Bank	(856)
200	Obic Co Ltd	BNP Paribas	29
100	Obic Co Ltd	Citibank	(428)
100	Obic Co Ltd	Goldman Sachs	14
100	Obic Co Ltd	JP Morgan	778
(15,700)	Odakyu Electric Railway Co Ltd	Barclays Bank	15,794
(3,100)	Odakyu Electric Railway Co Ltd	Goldman Sachs	1,526
3,400	Oji Holdings Corp	BNP Paribas	(24)
6,100	Oji Holdings Corp	Citibank	(305)
4,200	Oji Holdings Corp	HSBC	(60)
(700)	Olympus Corp	Barclays Bank	914
(1,400)	Olympus Corp	BNP Paribas	1,553
(700)	Olympus Corp	Citibank	243
(800)	Olympus Corp	JP Morgan	1,761
400	Omron Corp	Barclays Bank	(263)
100	Omron Corp	HSBC	184
1,600	Ono Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	394
6,700	Ono Pharmaceutical Co Ltd	Barclays Bank	(1,649)
3,200	Ono Pharmaceutical Co Ltd	BNP Paribas	788
2,100	Ono Pharmaceutical Co Ltd	Goldman Sachs	517
800	Ono Pharmaceutical Co Ltd	HSBC	(702)
600	Ono Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	(527)
(2,500)	Open House Group Co Ltd	BNP Paribas	6,421
(1,500)	Oriental Land Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,092)
(400)	Oriental Land Co Ltd	Barclays Bank	713
(300)	Oriental Land Co Ltd	Goldman Sachs	(218)
(900)	Oriental Land Co Ltd	JP Morgan	(2,138)
400	ORIX Corp	Bank of America Merrill Lynch	(11)
9,100	ORIX Corp	Barclays Bank	(454)
4,400	ORIX Corp	BNP Paribas	(126)
6,300	ORIX Corp	Citibank	(212)
1,100	ORIX Corp	Goldman Sachs	(31)
1,600	ORIX Corp	HSBC	1,022
1,400	ORIX Corp	JP Morgan	894
17,000	Osaka Gas Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(10,552)
2,600	Osaka Gas Co Ltd	Barclays Bank	(1,410)
1,000	Osaka Gas Co Ltd	HSBC	(285)
500	Otsuka Corp	Bank of America Merrill Lynch	178
400	Otsuka Corp	Barclays Bank	(200)
700	Otsuka Holdings Co Ltd	Barclays Bank	425
(700)	Pan Pacific International Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,149

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
日本(続き)			
(2,500)	Pan Pacific International Holdings Corp	Barclays Bank	5,172
(5,100)	Pan Pacific International Holdings Corp	BNP Paribas	8,369
(2,200)	Pan Pacific International Holdings Corp	Goldman Sachs	3,610
(1,600)	Panasonic Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	(890)
(3,700)	Panasonic Holdings Corp	Barclays Bank	370
(2,500)	Panasonic Holdings Corp	BNP Paribas	(1,391)
(1,200)	Panasonic Holdings Corp	HSBC	(1,297)
1,500	Persol Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,526)
800	Persol Holdings Co Ltd	BNP Paribas	(1,347)
2,000	Persol Holdings Co Ltd	Citibank	(3,451)
600	Persol Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(1,010)
700	Persol Holdings Co Ltd	JP Morgan	(594)
(10,100)	Rakuten Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,828
(37,800)	Rakuten Group Inc	Barclays Bank	9,978
(24,200)	Rakuten Group Inc	BNP Paribas	11,568
(3,000)	Rakuten Group Inc	Citibank	792
(60,700)	Rakuten Group Inc	Goldman Sachs	29,015
(10,500)	Rakuten Group Inc	HSBC	6,817
100	Recruit Holdings Co Ltd	Barclays Bank	(88)
600	Recruit Holdings Co Ltd	BNP Paribas	1,772
200	Recruit Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	591
(7,500)	Renesas Electronics Corp	Bank of America Merrill Lynch	(18,541)
(6,300)	Renesas Electronics Corp	Barclays Bank	(9,304)
(4,800)	Renesas Electronics Corp	BNP Paribas	(11,866)
(3,300)	Renesas Electronics Corp	Goldman Sachs	(8,158)
(800)	Renesas Electronics Corp	HSBC	(2,546)
(6,600)	Resona Holdings Inc	Barclays Bank	692
5,000	Ricoh Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	4,067
1,500	Ricoh Co Ltd	Barclays Bank	-
6,100	Ricoh Co Ltd	BNP Paribas	4,961
3,000	Ricoh Co Ltd	JP Morgan	728
(100)	Rohm Co Ltd	Barclays Bank	(30)
(800)	SBI Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	594
(1,800)	SBI Holdings Inc	BNP Paribas	1,336
(5,000)	SBI Holdings Inc	Goldman Sachs	3,710
(6,900)	SBI Holdings Inc	HSBC	1,920
(1,300)	SBI Holdings Inc	JP Morgan	362
(8,000)	SCSK Corp	Barclays Bank	3,139
(900)	SCSK Corp	BNP Paribas	(199)
(900)	SCSK Corp	Citibank	353
(2,000)	SCSK Corp	Goldman Sachs	(442)
(3,400)	SCSK Corp	HSBC	(2,547)
1,400	Secom Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(979)
900	Secom Co Ltd	BNP Paribas	(629)
300	Secom Co Ltd	Citibank	(659)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	日本(続き)		
600	Secom Co Ltd	Goldman Sachs	(420)
400	Secom Co Ltd	HSBC	1,116
300	Secom Co Ltd	JP Morgan	837
800	Seiko Epson Corp	Bank of America Merrill Lynch	285
2,700	Seiko Epson Corp	Barclays Bank	(674)
1,100	Seiko Epson Corp	BNP Paribas	392
700	Seiko Epson Corp	Goldman Sachs	250
1,500	Sekisui Chemical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	11
2,500	Sekisui Chemical Co Ltd	Barclays Bank	(1,516)
39,600	Sekisui Chemical Co Ltd	BNP Paribas	283
3,300	Sekisui Chemical Co Ltd	Citibank	(2,001)
4,100	Sekisui Chemical Co Ltd	Goldman Sachs	29
700	Sekisui Chemical Co Ltd	HSBC	270
800	Sekisui Chemical Co Ltd	JP Morgan	308
4,700	Sekisui House Ltd	BNP Paribas	(4,259)
1,200	SG Holdings Co Ltd	Barclays Bank	(1,147)
400	SG Holdings Co Ltd	HSBC	(77)
(17,600)	Sharp Corp	Bank of America Merrill Lynch	9,543
(35,900)	Sharp Corp	Barclays Bank	16,392
(17,100)	Sharp Corp	Goldman Sachs	9,272
(5,900)	Sharp Corp	HSBC	7,745
(800)	Sharp Corp	JP Morgan	1,050
400	Shimadzu Corp	Barclays Bank	(428)
1,300	Shimadzu Corp	Goldman Sachs	(185)
(100)	Shimano Inc	Bank of America Merrill Lynch	(243)
(500)	Shimano Inc	Barclays Bank	375
(100)	Shimano Inc	BNP Paribas	(243)
(300)	Shimano Inc	Citibank	225
(400)	Shimano Inc	Goldman Sachs	(970)
(19,600)	Shimizu Corp	BNP Paribas	1,678
1,700	Shin-Etsu Chemical Co	Ltd BNP Paribas	4,087
700	Shin-Etsu Chemical Co	Ltd Goldman Sachs	1,683
3,100	Shin-Etsu Chemical Co	Ltd HSBC	7,055
1,500	Shin-Etsu Chemical Co	Ltd JP Morgan	3,414
800	Shionogi & Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	320
2,200	Shionogi & Co Ltd	Barclays Bank	(1,193)
3,100	Shionogi & Co Ltd	BNP Paribas	1,239
800	Shionogi & Co Ltd	Citibank	(434)
2,600	Shionogi & Co Ltd	Goldman Sachs	1,039
1,100	Shionogi & Co Ltd	HSBC	589
300	Shionogi & Co Ltd	JP Morgan	161
300	Shiseido Co Ltd	Barclays Bank	(1,256)
300	Shiseido Co Ltd	BNP Paribas	(1,190)
500	Shiseido Co Ltd	Goldman Sachs	(1,983)
300	Shiseido Co Ltd	HSBC	(458)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(3,400)	Shizuoka Financial Group Inc	BNP Paribas	485
100	SMC Corp	Barclays Bank	114
200	SMC Corp	BNP Paribas	5,180
9,500	SoftBank Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,948)
5,700	SoftBank Corp	Barclays Bank	(1,220)
3,900	SoftBank Corp	BNP Paribas	(1,210)
2,100	SoftBank Corp	Citibank	(449)
2,500	SoftBank Corp	Goldman Sachs	(776)
5,300	SoftBank Corp	JP Morgan	(2,136)
(400)	SoftBank Group Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,498)
(800)	SoftBank Group Corp	Barclays Bank	(1,467)
(800)	SoftBank Group Corp	BNP Paribas	(2,996)
(600)	SoftBank Group Corp	Citibank	(1,100)
(2,000)	SoftBank Group Corp	Goldman Sachs	(7,491)
(3,600)	SoftBank Group Corp	HSBC	(9,118)
(900)	Sompo Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,015
(600)	Sompo Holdings Inc	Barclays Bank	1,387
(2,400)	Sompo Holdings Inc	BNP Paribas	2,705
(600)	Sompo Holdings Inc	Citibank	1,387
(1,800)	Sompo Holdings Inc	Goldman Sachs	2,029
(600)	Sompo Holdings Inc	HSBC	(43)
(300)	Sompo Holdings Inc	JP Morgan	(21)
(200)	Sony Group Corp	Barclays Bank	642
(900)	Sony Group Corp	BNP Paribas	(1,830)
(600)	Sony Group Corp	Citibank	1,926
(100)	Sony Group Corp	Goldman Sachs	(203)
(300)	Square Enix Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,092
(2,300)	Square Enix Holdings Co Ltd	Barclays Bank	8,533
(1,800)	Square Enix Holdings Co Ltd	BNP Paribas	6,549
(600)	Square Enix Holdings Co Ltd	Citibank	2,226
(1,000)	Square Enix Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	3,639
(1,300)	Square Enix Holdings Co Ltd	HSBC	3,710
(300)	Square Enix Holdings Co Ltd	JP Morgan	856
2,400	Subaru Corp	Barclays Bank	908
3,200	Subaru Corp	BNP Paribas	3,527
3,500	Subaru Corp	Goldman Sachs	3,858
2,800	Subaru Corp	HSBC	3,845
800	Subaru Corp	JP Morgan	1,099
(1,800)	SUMCO Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,811)
(600)	SUMCO Corp	Barclays Bank	(197)
(1,900)	SUMCO Corp	Citibank	(624)
(2,400)	SUMCO Corp	Goldman Sachs	(2,414)
(4,900)	SUMCO Corp	HSBC	(2,937)
(3,000)	Sumitomo Chemical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	749
(4,800)	Sumitomo Chemical Co Ltd	Barclays Bank	411

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
日本(続き)			
(8,800)	Sumitomo Chemical Co Ltd	BNP Paribas	2,197
(7,800)	Sumitomo Chemical Co Ltd	Citibank	668
(3,000)	Sumitomo Chemical Co Ltd	Goldman Sachs	749
(11,600)	Sumitomo Chemical Co Ltd	HSBC	2,979
(3,600)	Sumitomo Chemical Co Ltd	JP Morgan	925
1,500	Sumitomo Corp	Bank of America Merrill Lynch	476
2,400	Sumitomo Corp	Barclays Bank	(642)
6,200	Sumitomo Corp	BNP Paribas	1,968
600	Sumitomo Corp	Citibank	(161)
2,100	Sumitomo Corp	Goldman Sachs	667
2,600	Sumitomo Corp	HSBC	2,903
700	Sumitomo Corp	JP Morgan	782
(4,800)	Sumitomo Electric Industries Ltd	Barclays Bank	2,329
(26,900)	Sumitomo Electric Industries Ltd	BNP Paribas	7,101
(3,300)	Sumitomo Electric Industries Ltd	Goldman Sachs	871
(500)	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	710
(9,600)	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	Barclays Bank	10,462
(1,600)	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	BNP Paribas	2,272
(3,800)	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	Citibank	4,275
(400)	Sumitomo Metal Mining Co Ltd	Goldman Sachs	568
2,300	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,018)
2,600	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	Barclays Bank	519
2,300	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	BNP Paribas	(2,018)
300	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	Citibank	60
1,000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	Goldman Sachs	(878)
1,200	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,370)
300	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	Barclays Bank	(591)
800	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	Citibank	(1,575)
1,000	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	Goldman Sachs	(1,142)
600	Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	JP Morgan	68
400	Sumitomo Realty & Development Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	365
300	Suntory Beverage & Food Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(407)
1,500	Suntory Beverage & Food Ltd	Barclays Bank	(3,960)
300	Suntory Beverage & Food Ltd	Goldman Sachs	(407)
400	Suntory Beverage & Food Ltd	JP Morgan	285
400	Suzuki Motor Corp	Barclays Bank	(394)
400	Suzuki Motor Corp	BNP Paribas	(930)
700	Systemex Corp	Bank of America Merrill Lynch	(924)
300	Systemex Corp	BNP Paribas	(396)
300	Systemex Corp	Goldman Sachs	(396)
(900)	T&D Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(700)
(4,500)	T&D Holdings Inc	BNP Paribas	(3,499)
(1,400)	T&D Holdings Inc	Citibank	390
(800)	T&D Holdings Inc	Goldman Sachs	(622)
(1,900)	T&D Holdings Inc	HSBC	(3,009)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(2,200)	Taisei Corp	Barclays Bank	4,241
(700)	Taisei Corp	BNP Paribas	1,973
(400)	Taisei Corp	Goldman Sachs	1,127
(400)	Taisei Corp	HSBC	785
(400)	Taisei Corp	JP Morgan	785
(400)	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	197
(800)	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	Barclays Bank	753
(1,600)	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	BNP Paribas	788
(1,300)	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	Goldman Sachs	640
(700)	Takeda Pharmaceutical Co Ltd	JP Morgan	859
700	TDK Corp	Goldman Sachs	2,322
1,600	TDK Corp	HSBC	5,650
3,700	Terumo Corp	Barclays Bank	185
1,700	Terumo Corp	BNP Paribas	49
100	Terumo Corp	HSBC	96
(1,700)	TIS Inc	HSBC	(364)
(3,000)	Tobu Railway Co Ltd	Barclays Bank	2,889
(300)	Toho Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	64
(5,000)	Toho Co Ltd	HSBC	(2,497)
(700)	Tokio Marine Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,643)
(4,300)	Tokio Marine Holdings Inc	Barclays Bank	(3,681)
(1,400)	Tokio Marine Holdings Inc	BNP Paribas	(3,286)
(2,400)	Tokio Marine Holdings Inc	Goldman Sachs	(5,633)
(2,400)	Tokio Marine Holdings Inc	HSBC	(7,269)
(700)	Tokio Marine Holdings Inc	JP Morgan	(2,120)
(100)	Tokyo Electron Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,240)
(600)	Tokyo Electron Ltd	Barclays Bank	(2,804)
12,600	Tokyo Gas Co Ltd	Barclays Bank	(2,337)
3,900	Tokyo Gas Co Ltd	BNP Paribas	(56)
2,400	Tokyo Gas Co Ltd	HSBC	2,175
(11,500)	Tokyu Corp	Bank of America Merrill Lynch	14,686
(13,700)	Tokyu Corp	Barclays Bank	16,225
(14,300)	Tokyu Corp	BNP Paribas	18,262
(1,900)	Tokyu Corp	Citibank	2,250
(11,300)	Tokyu Corp	Goldman Sachs	14,431
(1,800)	Tokyu Corp	HSBC	1,888
(1,300)	Tokyu Corp	JP Morgan	1,363
7,600	TOPPAN Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,928
3,100	TOPPAN Inc	Barclays Bank	(597)
1,300	TOPPAN Inc	Goldman Sachs	501
17,600	Toray Industries Inc	Goldman Sachs	(2,687)
(900)	Toshiba Corp	Bank of America Merrill Lynch	(398)
(4,700)	Toshiba Corp	Barclays Bank	(351)
(400)	Toshiba Corp	BNP Paribas	(177)
(4,200)	Toshiba Corp	Citibank	(330)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	日本(続き)		
(1,400)	Toshiba Corp	HSBC	(719)
(500)	Toshiba Corp	JP Morgan	(257)
400	Tosoh Corp	Bank of America Merrill Lynch	(228)
900	Tosoh Corp	Barclays Bank	(674)
4,400	TOTO Ltd	Barclays Bank	(11,458)
500	Toyota Industries Corp	Barclays Bank	1,106
1,100	Toyota Industries Corp	BNP Paribas	4,944
900	Toyota Industries Corp	Goldman Sachs	4,045
(2,200)	Toyota Motor Corp	Bank of America Merrill Lynch	385
(3,500)	Toyota Motor Corp	Barclays Bank	1,036
(3,200)	Toyota Motor Corp	BNP Paribas	559
(800)	Toyota Motor Corp	Citibank	237
(8,000)	Toyota Motor Corp	Goldman Sachs	1,398
(5,800)	Toyota Motor Corp	HSBC	(2,172)
800	Toyota Tsusho Corp	Bank of America Merrill Lynch	799
900	Toyota Tsusho Corp	Barclays Bank	(916)
900	Toyota Tsusho Corp	BNP Paribas	899
600	Toyota Tsusho Corp	Citibank	(428)
1,500	Toyota Tsusho Corp	HSBC	3,960
900	Trend Micro Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,926
300	Trend Micro Inc	Citibank	385
600	Trend Micro Inc	Goldman Sachs	1,284
200	Trend Micro Inc	HSBC	86
300	Trend Micro Inc	JP Morgan	128
300	Unicharm Corp	Bank of America Merrill Lynch	(291)
300	Unicharm Corp	Barclays Bank	(223)
2,200	Unicharm Corp	BNP Paribas	(2,135)
400	Unicharm Corp	Citibank	(297)
700	Unicharm Corp	Goldman Sachs	(679)
600	Unicharm Corp	HSBC	(886)
300	Unicharm Corp	JP Morgan	(443)
8,300	USS Co Ltd	BNP Paribas	(5,981)
(600)	Welcia Holdings Co Ltd	Barclays Bank	972
(1,300)	Welcia Holdings Co Ltd	BNP Paribas	(9)
(300)	Welcia Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(2)
(200)	Welcia Holdings Co Ltd	HSBC	(156)
(400)	West Japan Railway Co	Bank of America Merrill Lynch	813
(1,500)	West Japan Railway Co	HSBC	2,140
200	Yakult Honsha Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,256)
1,800	Yakult Honsha Co Ltd	Barclays Bank	(8,861)
700	Yakult Honsha Co Ltd	BNP Paribas	(4,395)
400	Yakult Honsha Co Ltd	Goldman Sachs	(2,511)
400	Yakult Honsha Co Ltd	HSBC	(3,425)
200	Yakult Honsha Co Ltd	JP Morgan	(1,712)
(300)	Yamaha Corp	Bank of America Merrill Lynch	(300)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 / (損) (米ドル)
日本（続き）			
(900)	Yamaha Corp	Barclays Bank	963
(400)	Yamaha Corp	BNP Paribas	(400)
(700)	Yamaha Corp	Citibank	749
(2,000)	Yamaha Corp	Goldman Sachs	(1,998)
1,300	Yamaha Motor Co Ltd	Barclays Bank	(232)
500	Yamaha Motor Co Ltd	JP Morgan	(63)
(1,700)	Yamato Holdings Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(825)
(2,900)	Yamato Holdings Co Ltd	Barclays Bank	807
(4,500)	Yamato Holdings Co Ltd	BNP Paribas	(2,183)
(1,000)	Yamato Holdings Co Ltd	Citibank	278
(2,900)	Yamato Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	(1,407)
(800)	Yamato Holdings Co Ltd	HSBC	(1,159)
(1,000)	Yaskawa Electric Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,356)
(1,500)	Yaskawa Electric Corp	Barclays Bank	(642)
(1,600)	Yaskawa Electric Corp	BNP Paribas	(2,169)
(1,200)	Yaskawa Electric Corp	Goldman Sachs	(1,627)
6,300	Yokogawa Electric Corp	Bank of America Merrill Lynch	8,315
(8,100)	Z Holdings Corp	Bank of America Merrill Lynch	693
(24,900)	Z Holdings Corp	Barclays Bank	2,167
(54,600)	Z Holdings Corp	BNP Paribas	4,674
(4,300)	Z Holdings Corp	Citibank	374
(42,200)	Z Holdings Corp	Goldman Sachs	3,613
(49,900)	Z Holdings Corp	HSBC	3,133
500	ZOZO Inc	Bank of America Merrill Lynch	(842)
4,900	ZOZO Inc	Barclays Bank	(5,628)
2,600	ZOZO Inc	BNP Paribas	(4,378)
2,100	ZOZO Inc	Goldman Sachs	(3,536)
1,600	ZOZO Inc	HSBC	(205)
1,200	ZOZO Inc	JP Morgan	(154)
			327,597
リベリア			
(175)	Royal Caribbean Cruises Ltd	Barclays Bank	25
(767)	Royal Caribbean Cruises Ltd	Goldman Sachs	(3,122)
(220)	Royal Caribbean Cruises Ltd	HSBC	(405)
			(3,502)
オランダ			
(4,950)	ABN AMRO Bank NV - CVA	BNP Paribas	2,563
(621)	ABN AMRO Bank NV - CVA	HSBC	484
(17)	Adyen NV	Barclays Bank	(497)
(81)	Adyen NV	BNP Paribas	(10,067)
(7)	Adyen NV	Goldman Sachs	(870)
(33)	Adyen NV	HSBC	(3,883)
(7)	Adyen NV	JP Morgan	(824)
(12,507)	Aegon NV	Barclays Bank	3,138
(20,752)	Aegon NV	BNP Paribas	1,219

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	オランダ(続き)		
(3,973)	Aegon NV	Citibank	997
(2,421)	Aegon NV	JP Morgan	(119)
(387)	Akzo Nobel NV	Bank of America Merrill Lynch	2,273
(876)	Akzo Nobel NV	Barclays Bank	5,294
(2,664)	Akzo Nobel NV	BNP Paribas	15,645
(469)	Akzo Nobel NV	Citibank	2,834
(963)	Akzo Nobel NV	Goldman Sachs	5,655
(545)	Akzo Nobel NV	HSBC	2,595
(438)	Akzo Nobel NV	JP Morgan	2,086
978	ArcelorMittal SA	Bank of America Merrill Lynch	(1,138)
3,767	ArcelorMittal SA	Barclays Bank	(3,161)
2,371	ArcelorMittal SA	Citibank	(2,682)
350	ArcelorMittal SA	HSBC	(676)
(15)	ASM International NV	Barclays Bank	(617)
(198)	ASM International NV	BNP Paribas	(14,260)
48	ASML Holding NV	Bank of America Merrill Lynch	4,167
161	ASML Holding NV	Barclays Bank	4,596
423	ASML Holding NV	BNP Paribas	36,720
78	ASML Holding NV	Goldman Sachs	6,771
19	ASML Holding NV	HSBC	1,737
17	ASML Holding NV	JP Morgan	1,554
(81)	DSM-Firmenich AG	Bank of America Merrill Lynch	1,159
(1,032)	DSM-Firmenich AG	Barclays Bank	14,832
(367)	DSM-Firmenich AG	BNP Paribas	5,251
(494)	DSM-Firmenich AG	HSBC	7,965
612	EXOR NV	Barclays Bank	(1,804)
1,545	EXOR NV	BNP Paribas	(759)
133	Heineken Holding NV	Barclays Bank	(774)
(27)	Heineken NV	Bank of America Merrill Lynch	306
(112)	Heineken NV	Barclays Bank	911
(1,169)	Heineken NV	BNP Paribas	13,256
(35)	Heineken NV	Citibank	285
(113)	Heineken NV	Goldman Sachs	1,281
(349)	Heineken NV	HSBC	4,013
(63)	IMCD NV	Bank of America Merrill Lynch	(7)
(196)	IMCD NV	Barclays Bank	235
(584)	IMCD NV	BNP Paribas	(62)
(472)	IMCD NV	Citibank	458
1,121	ING Groep NV	Bank of America Merrill Lynch	(112)
2,183	ING Groep NV	Barclays Bank	(662)
1,732	ING Groep NV	BNP Paribas	(174)
834	ING Groep NV	Goldman Sachs	(84)
(1,334)	JDE Peet ' s NV	BNP Paribas	541
(363)	JDE Peet ' s NV	Goldman Sachs	147
(843)	Just Eat Takeaway.com NV	Barclays Bank	1,465

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
オランダ(続き)			
(1,708)	Just Eat Takeaway.com NV	BNP Paribas	4,636
(405)	Just Eat Takeaway.com NV	Goldman Sachs	1,099
(266)	Just Eat Takeaway.com NV	HSBC	623
373	Koninklijke Ahold Delhaize NV	Bank of America Merrill Lynch	(570)
1,160	Koninklijke Ahold Delhaize NV	Barclays Bank	(1,325)
8,617	Koninklijke Ahold Delhaize NV	BNP Paribas	(13,157)
707	Koninklijke Ahold Delhaize NV	Goldman Sachs	(1,079)
6,068	Koninklijke KPN NV	Bank of America Merrill Lynch	(577)
44,395	Koninklijke KPN NV	Barclays Bank	(1,849)
79,927	Koninklijke KPN NV	BNP Paribas	(7,595)
8,703	Koninklijke KPN NV	Citibank	(220)
11,288	Koninklijke KPN NV	HSBC	(928)
3,920	Koninklijke KPN NV	JP Morgan	(322)
74	Koninklijke Philips NV	Bank of America Merrill Lynch	(46)
528	Koninklijke Philips NV	BNP Paribas	(319)
253	Koninklijke Philips NV	Citibank	(322)
614	Koninklijke Philips NV	Goldman Sachs	(362)
4,732	NN Group NV	BNP Paribas	(2,324)
1,831	NN Group NV	Goldman Sachs	(899)
(3,757)	OCI NV	Barclays Bank	9,679
(290)	OCI NV	BNP Paribas	709
(2,097)	OCI NV	Citibank	3,964
(496)	OCI NV	Goldman Sachs	1,213
(573)	Prosus NV	Barclays Bank	734
(3,352)	Prosus NV	BNP Paribas	21,367
(148)	Prosus NV	Citibank	412
(660)	Prosus NV	Goldman Sachs	4,207
(263)	Prosus NV	HSBC	1,362
374	Randstad NV	Bank of America Merrill Lynch	(639)
208	Randstad NV	Barclays Bank	(482)
1,788	Randstad NV	BNP Paribas	(3,055)
414	Randstad NV	Citibank	(959)
361	Randstad NV	HSBC	(686)
(10,238)	Universal Music Group NV	BNP Paribas	(1,476)
(531)	Universal Music Group NV	JP Morgan	326
872	Wolters Kluwer NV	Barclays Bank	(838)
1,045	Wolters Kluwer NV	BNP Paribas	(2,622)
124	Wolters Kluwer NV	Goldman Sachs	(311)
128	Wolters Kluwer NV	HSBC	(102)
123	Wolters Kluwer NV	JP Morgan	(98)
			116,370
ニュージーランド			
(82,472)	Auckland International Airport Ltd	HSBC	(6,182)
(2,001)	EBOS Group Ltd	BNP Paribas	2,364
(1,106)	EBOS Group Ltd	Goldman Sachs	1,306

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
ニュージーランド(続き)			
12,829	Fisher & Paykel Healthcare Corp Ltd	Goldman Sachs	(26,543)
(54,097)	Mercury NZ Ltd	HSBC	(5,840)
22,661	Meridian Energy Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,310)
14,116	Meridian Energy Ltd	BNP Paribas	(1,439)
8,424	Spark New Zealand Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(303)
24,869	Spark New Zealand Ltd	Barclays Bank	(1,342)
54,495	Spark New Zealand Ltd	BNP Paribas	(1,961)
10,539	Spark New Zealand Ltd	Citibank	(569)
23,437	Spark New Zealand Ltd	Goldman Sachs	(843)
			<u>(43,662)</u>
ノルウェー			
(1,316)	Adevinta ASA	Bank of America Merrill Lynch	41
(11,487)	Adevinta ASA	BNP Paribas	360
(1,042)	Aker BP ASA	Bank of America Merrill Lynch	644
(3,721)	Aker BP ASA	Barclays Bank	2,157
(3,081)	Aker BP ASA	BNP Paribas	1,905
(2,472)	Aker BP ASA	Goldman Sachs	1,529
(1,498)	Aker BP ASA	HSBC	591
4,627	DNB Bank ASA	Bank of America Merrill Lynch	311
4,642	DNB Bank ASA	Barclays Bank	(354)
7,333	DNB Bank ASA	BNP Paribas	493
3,749	DNB Bank ASA	Citibank	117
5,314	DNB Bank ASA	Goldman Sachs	357
1,410	DNB Bank ASA	HSBC	38
1,289	DNB Bank ASA	JP Morgan	35
9	Equinor ASA	Bank of America Merrill Lynch	(13)
1,028	Equinor ASA	Barclays Bank	(914)
1,423	Equinor ASA	BNP Paribas	(2,117)
1,190	Equinor ASA	Citibank	(1,971)
1,518	Equinor ASA	Goldman Sachs	(2,258)
1,251	Equinor ASA	HSBC	(3,392)
61	Equinor ASA	JP Morgan	(165)
(101)	Gjensidige Forsikring ASA	Bank of America Merrill Lynch	(35)
(2,110)	Gjensidige Forsikring ASA	Barclays Bank	(548)
(4,696)	Gjensidige Forsikring ASA	BNP Paribas	(1,641)
(851)	Gjensidige Forsikring ASA	Citibank	(221)
(1,395)	Gjensidige Forsikring ASA	Goldman Sachs	(488)
(310)	Kongsberg Gruppen ASA	Bank of America Merrill Lynch	717
(261)	Kongsberg Gruppen ASA	Goldman Sachs	604
(1,449)	Mowi ASA	Barclays Bank	(662)
(2,732)	Mowi ASA	BNP Paribas	73
(144)	Mowi ASA	Citibank	(66)
2,728	Norsk Hydro ASA	Bank of America Merrill Lynch	(411)
11,755	Norsk Hydro ASA	Barclays Bank	(2,297)
4,270	Norsk Hydro ASA	BNP Paribas	(643)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
ノルウェー(続き)			
2,871	Norsk Hydro ASA	Citibank	(561)
3,094	Norsk Hydro ASA	Goldman Sachs	(466)
4,379	Norsk Hydro ASA	HSBC	(2,999)
(1,481)	Orkla ASA	Bank of America Merrill Lynch	154
(7,353)	Orkla ASA	Barclays Bank	1,094
(5,752)	Orkla ASA	BNP Paribas	598
(6,521)	Orkla ASA	Goldman Sachs	678
(6,596)	Orkla ASA	HSBC	(2,779)
(258)	Salmar ASA	Bank of America Merrill Lynch	(606)
(2,706)	Salmar ASA	Barclays Bank	(7,979)
(908)	Salmar ASA	BNP Paribas	(2,132)
(337)	Salmar ASA	Citibank	(994)
(1,026)	Salmar ASA	Goldman Sachs	(2,409)
(1,561)	Telenor ASA	Bank of America Merrill Lynch	1,098
(4,433)	Telenor ASA	Barclays Bank	1,192
(6,687)	Telenor ASA	BNP Paribas	4,705
(2,809)	Telenor ASA	Citibank	755
(3,843)	Telenor ASA	Goldman Sachs	2,704
(6,409)	Telenor ASA	HSBC	8,301
(2,150)	Yara International ASA	Barclays Bank	1,813
(903)	Yara International ASA	Citibank	776
(229)	Yara International ASA	Goldman Sachs	158
			<u>(5,123)</u>
ポルトガル			
(1,830)	Galp Energia SGPS SA	BNP Paribas	1,479
(2,479)	Galp Energia SGPS SA	Citibank	569
(1,737)	Galp Energia SGPS SA	Goldman Sachs	1,404
2,312	Jeronimo Martins SGPS SA	Bank of America Merrill Lynch	346
1,487	Jeronimo Martins SGPS SA	Barclays Bank	(64)
951	Jeronimo Martins SGPS SA	BNP Paribas	142
484	Jeronimo Martins SGPS SA	Citibank	(21)
1,536	Jeronimo Martins SGPS SA	Goldman Sachs	230
			<u>4,085</u>
シンガポール			
(7,700)	CapitaLand Investment Ltd	Bank of America Merrill Lynch	1,536
(11,600)	CapitaLand Investment Ltd	Barclays Bank	1,114
(50,600)	CapitaLand Investment Ltd	BNP Paribas	10,092
(4,000)	CapitaLand Investment Ltd	Citibank	384
(10,400)	CapitaLand Investment Ltd	Goldman Sachs	2,074
(5,100)	CapitaLand Investment Ltd	HSBC	1,921
(2,300)	City Developments Ltd	BNP Paribas	442
400	DBS Group Holdings Ltd	Citibank	(180)
10,500	Singapore Airlines Ltd	Bank of America Merrill Lynch	3,955
5,300	Singapore Airlines Ltd	Barclays Bank	(313)
16,200	Singapore Airlines Ltd	BNP Paribas	6,103

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
シンガポール(続き)			
8,000	Singapore Airlines Ltd	Citibank	(473)
36,500	Singapore Airlines Ltd	Goldman Sachs	13,750
10,400	Singapore Airlines Ltd	HSBC	4,148
7,600	Singapore Airlines Ltd	JP Morgan	3,031
(1,700)	Singapore Exchange Ltd	Barclays Bank	50
(8,600)	Singapore Exchange Ltd	Goldman Sachs	1,525
(14,000)	Singapore Technologies Engineering Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(414)
(39,000)	Singapore Technologies Engineering Ltd	Barclays Bank	2,881
(135,700)	Singapore Technologies Engineering Ltd	BNP Paribas	(4,009)
(33,200)	Singapore Technologies Engineering Ltd	Citibank	2,452
(64,400)	Singapore Technologies Engineering Ltd	Goldman Sachs	(1,903)
(45,800)	Singapore Technologies Engineering Ltd	HSBC	(338)
(11,200)	Singapore Technologies Engineering Ltd	JP Morgan	(83)
600	Singapore Telecommunications Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(27)
39,700	Singapore Telecommunications Ltd	Barclays Bank	(208)
19,000	Singapore Telecommunications Ltd	BNP Paribas	(842)
(17,500)	UOL Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	6,593
(3,200)	Venture Corp Ltd	Barclays Bank	95
(13,800)	Venture Corp Ltd	BNP Paribas	1,019
(4,400)	Venture Corp Ltd	Citibank	300
(6,400)	Venture Corp Ltd	Goldman Sachs	473
3,500	Wilmar International Ltd	Barclays Bank	(207)
13,800	Wilmar International Ltd	BNP Paribas	(917)
8,800	Wilmar International Ltd	Goldman Sachs	(585)
8,900	Wilmar International Ltd	HSBC	(132)
			53,307
韓国			
1	Doosan Co Ltd	Citibank	-
1	HDC Holdings Co Ltd	Goldman Sachs	-
1	HDC Holdings Co Ltd	JP Morgan	-
(1)	Lotte Shopping Co Ltd	Bank of America Merrill Lynch	-
			-
スペイン			
(90)	Acciona SA	BNP Paribas	1,326
347	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	Barclays Bank	(93)
1,382	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	BNP Paribas	708
1,558	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	Citibank	(416)
992	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	Goldman Sachs	508
7,686	ACS Actividades de Construccion y Servicios SA	HSBC	(5,991)
(164)	Aena SME SA	BNP Paribas	324
140	Amadeus IT Group SA	Barclays Bank	106
197	Amadeus IT Group SA	BNP Paribas	349

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 / (損) (米ドル)
	スペイン (続き)		
143	Amadeus IT Group SA	Citibank	24
172	Amadeus IT Group SA	Goldman Sachs	305
409	Amadeus IT Group SA	HSBC	2,288
10,934	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Bank of America Merrill Lynch	(1,821)
5,544	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Barclays Bank	(2,001)
20,816	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	BNP Paribas	(3,467)
8,116	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	Goldman Sachs	(1,352)
3,324	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	HSBC	(788)
987	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	JP Morgan	(234)
18,543	Banco Santander SA	Barclays Bank	(3,207)
19,071	Banco Santander SA	BNP Paribas	(1,639)
2,050	Banco Santander SA	Goldman Sachs	(176)
(16,402)	CaixaBank SA	BNP Paribas	(1,734)
(16,837)	CaixaBank SA	Goldman Sachs	(1,780)
(9,000)	CaixaBank SA	JP Morgan	(903)
(3,415)	Cellnex Telecom SA	Bank of America Merrill Lynch	(510)
(2,995)	Cellnex Telecom SA	Barclays Bank	1,023
(6,190)	Cellnex Telecom SA	BNP Paribas	(925)
(641)	Cellnex Telecom SA	Citibank	(347)
(1,525)	Cellnex Telecom SA	Goldman Sachs	(228)
(439)	Cellnex Telecom SA	HSBC	(131)
280	Corp ACCIONA Energias Renovables SA	Barclays Bank	(173)
386	Corp ACCIONA Energias Renovables SA	JP Morgan	(800)
(1,081)	Endesa SA	Goldman Sachs	(421)
(492)	Endesa SA	HSBC	(31)
(1,917)	Ferrovial SA	Bank of America Merrill Lynch	(348)
(362)	Ferrovial SA	Barclays Bank	259
(4,373)	Ferrovial SA	BNP Paribas	(794)
(15,768)	Ferrovial SA	Citibank	11,280
(971)	Ferrovial SA	Goldman Sachs	(176)
(442)	Ferrovial SA	HSBC	14
(925)	Grifols SA	Bank of America Merrill Lynch	380
(2,812)	Grifols SA	Barclays Bank	2,267
(11,373)	Grifols SA	BNP Paribas	4,675
(543)	Grifols SA	Goldman Sachs	223
19,100	Grifols SA	HSBC	-
(123)	Grifols SA	JP Morgan	(187)
37,445	Iberdrola SA	BNP Paribas	(14,393)
5,669	Iberdrola SA	Goldman Sachs	(2,179)
2,288	Industria de Diseno Textil SA	BNP Paribas	220
349	Industria de Diseno Textil SA	HSBC	(268)
319	Naturgy Energy Group SA	Barclays Bank	(232)
732	Repsol SA	Barclays Bank	(559)
9,736	Repsol SA	BNP Paribas	(6,653)
3,992	Repsol SA	Goldman Sachs	(2,728)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
スペイン(続き)			
(1,462)	Telefonica SA	BNP Paribas	(53)
(39,020)	Telefonica SA	Goldman Sachs	(1,417)
(3,078)	Telefonica SA	HSBC	174
			<u>(32,702)</u>
スウェーデン			
(629)	Alfa Laval AB	Bank of America Merrill Lynch	(214)
(1,739)	Alfa Laval AB	Barclays Bank	784
(650)	Alfa Laval AB	BNP Paribas	(221)
(663)	Alfa Laval AB	Citibank	299
(849)	Alfa Laval AB	Goldman Sachs	(289)
(417)	Alfa Laval AB	HSBC	(318)
557	Assa Abloy AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(195)
2,106	Assa Abloy AB 'B'	Barclays Bank	(885)
5,063	Assa Abloy AB 'B'	BNP Paribas	(1,770)
1,567	Assa Abloy AB 'B'	Citibank	(688)
3,111	Assa Abloy AB 'B'	Goldman Sachs	(1,088)
903	Assa Abloy AB 'B'	HSBC	83
1,286	Assa Abloy AB 'B'	JP Morgan	118
(6,955)	Atlas Copco AB 'A'	BNP Paribas	(5,663)
171	Boliden AB	Barclays Bank	(997)
2,110	Boliden AB	BNP Paribas	(4,232)
(3,446)	Electrolux AB 'B'	Barclays Bank	6,689
(168)	Electrolux AB 'B'	Citibank	326
(11,789)	Electrolux AB 'B'	Goldman Sachs	21,258
(2,042)	Electrolux AB 'B'	JP Morgan	4,518
(14,398)	Embracer Group AB	Bank of America Merrill Lynch	37,182
(14,495)	Embracer Group AB	Barclays Bank	11,024
(21,652)	Embracer Group AB	Citibank	(3,837)
(20,440)	Embracer Group AB	Goldman Sachs	52,785
(2,161)	Embracer Group AB	JP Morgan	5,422
4,065	Epiroc AB 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(5,404)
4,471	Epiroc AB 'A'	Barclays Bank	(7,630)
1,430	Epiroc AB 'A'	BNP Paribas	(1,901)
773	Epiroc AB 'A'	Citibank	(1,319)
2,693	Epiroc AB 'A'	HSBC	(3,977)
767	Epiroc AB 'A'	JP Morgan	(1,133)
(3,341)	EQT AB	BNP Paribas	1,629
(437)	Essity AB 'B'	Barclays Bank	808
(10)	Essity AB 'B'	Goldman Sachs	14
81	Evolution AB	Bank of America Merrill Lynch	516
194	Evolution AB	Barclays Bank	(36)
202	Evolution AB	HSBC	2,698
120	Evolution AB	JP Morgan	1,603
(364)	Fastighets AB Balder 'B'	Bank of America Merrill Lynch	138
(6,717)	Fastighets AB Balder 'B'	BNP Paribas	2,552

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
スウェーデン(続き)			
(2,195)	Fastighets AB Balder 'B'	Goldman Sachs	834
(1,324)	Getinge AB 'B'	Barclays Bank	365
(396)	Getinge AB 'B'	HSBC	(26)
(1,689)	H & M Hennes & Mauritz AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	1,113
(5,578)	H & M Hennes & Mauritz AB 'B'	BNP Paribas	3,674
(5,226)	Hexagon AB 'B'	Barclays Bank	(2,207)
(14,898)	Hexagon AB 'B'	BNP Paribas	(13,912)
(136)	Hexagon AB 'B'	Goldman Sachs	(127)
(1,132)	Holmen AB 'B'	Barclays Bank	(10)
(1,274)	Holmen AB 'B'	BNP Paribas	375
(1,364)	Holmen AB 'B'	Goldman Sachs	402
(1,240)	Holmen AB 'B'	HSBC	(171)
(4,960)	Husqvarna AB 'B'	Barclays Bank	4,536
(8,974)	Husqvarna AB 'B'	BNP Paribas	9,577
(9,187)	Husqvarna AB 'B'	Goldman Sachs	9,804
2,160	Industrivarden AB 'C'	Barclays Bank	(537)
1,960	Industrivarden AB 'C'	BNP Paribas	(18)
2,358	Industrivarden AB 'C'	Citibank	(586)
2,574	Industrivarden AB 'C'	Goldman Sachs	(24)
4,184	Industrivarden AB 'C'	HSBC	192
1,508	Indutrade AB	BNP Paribas	(291)
464	Indutrade AB	Citibank	(149)
1,226	Indutrade AB	Goldman Sachs	(237)
932	Indutrade AB	JP Morgan	(9)
(9,359)	Investment AB Latour 'B'	Goldman Sachs	4,994
3,238	Investor AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	1,668
2,046	Investor AB 'B'	Barclays Bank	452
4,237	Investor AB 'B'	BNP Paribas	2,183
3,035	Investor AB 'B'	Goldman Sachs	1,564
1,831	Investor AB 'B'	HSBC	463
6,456	Investor AB 'B'	JP Morgan	1,633
(434)	L E Lundbergforetagen AB 'B'	Barclays Bank	1,238
(1,588)	L E Lundbergforetagen AB 'B'	BNP Paribas	5,157
(1,422)	Lifco AB 'B'	BNP Paribas	1,060
(2)	NCC AB 'B'	BNP Paribas	2
(641)	Nibe Industrier AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	793
(951)	Nibe Industrier AB 'B'	BNP Paribas	1,177
(3,731)	Nibe Industrier AB 'B'	Goldman Sachs	4,617
(1,356)	Nibe Industrier AB 'B'	HSBC	1,279
2,407	Nordea Bank Abp	Bank of America Merrill Lynch	(142)
1,183	Nordea Bank Abp	Barclays Bank	(231)
15,251	Nordea Bank Abp	BNP Paribas	(898)
3,272	Nordea Bank Abp	Goldman Sachs	(193)
5,544	Nordea Bank Abp	HSBC	(887)
2,269	Sandvik AB	Barclays Bank	(2,672)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	スウェーデン(続き)		
655	Sandvik AB	Citibank	(771)
1,296	Sandvik AB	Goldman Sachs	(1,323)
(6,786)	Securitas AB 'B'	BNP Paribas	4,220
(79)	Securitas AB 'B'	Goldman Sachs	49
1,177	Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A'	Barclays Bank	(184)
4,493	Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A'	BNP Paribas	(475)
2,004	Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A'	HSBC	(221)
1,944	Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A'	JP Morgan	(215)
663	Skanska AB 'B'	Barclays Bank	(409)
1,695	Skanska AB 'B'	BNP Paribas	(1,294)
2,421	Skanska AB 'B'	Goldman Sachs	(1,849)
(510)	SKF AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	441
(646)	SKF AB 'B'	BNP Paribas	559
(1,753)	SKF AB 'B'	HSBC	2,064
(2,488)	Svenska Cellulosa AB SCA 'B'	Bank of America Merrill Lynch	149
(2,722)	Svenska Cellulosa AB SCA 'B'	Barclays Bank	(163)
(15,635)	Svenska Cellulosa AB SCA 'B'	BNP Paribas	935
(1,259)	Svenska Cellulosa AB SCA 'B'	Citibank	(75)
(8,796)	Svenska Cellulosa AB SCA 'B'	Goldman Sachs	526
(840)	Svenska Cellulosa AB SCA 'B'	HSBC	(4)
1,208	Svenska Handelsbanken AB 'A'	Citibank	(137)
628	Swedbank AB 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(127)
498	Swedbank AB 'A'	Barclays Bank	(124)
2,294	Swedbank AB 'A'	BNP Paribas	(464)
669	Swedbank AB 'A'	Citibank	(166)
1,642	Swedbank AB 'A'	Goldman Sachs	(332)
(2,204)	Swedish Orphan Biovitrum AB	Bank of America Merrill Lynch	3,731
(713)	Swedish Orphan Biovitrum AB	Barclays Bank	155
(340)	Swedish Orphan Biovitrum AB	BNP Paribas	576
(1,246)	Swedish Orphan Biovitrum AB	Goldman Sachs	2,109
(8,733)	Tele2 AB 'B'	BNP Paribas	6,652
(2,333)	Tele2 AB 'B'	Citibank	500
(2,069)	Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B'	Barclays Bank	99
(1,881)	Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B'	BNP Paribas	(268)
(2,393)	Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B'	HSBC	(192)
(8,842)	Telia Co AB	Bank of America Merrill Lynch	1,375
(26,746)	Telia Co AB	Barclays Bank	2,364
(54,814)	Telia Co AB	BNP Paribas	8,522
(12,662)	Telia Co AB	Goldman Sachs	1,969
(8,784)	Telia Co AB	JP Morgan	1,350
637	Volvo AB 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(352)
1,310	Volvo AB 'B'	Barclays Bank	(976)
1,067	Volvo AB 'B'	BNP Paribas	(589)
3,935	Volvo AB 'B'	Goldman Sachs	(2,172)
525	Volvo AB 'B'	HSBC	(307)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	スウェーデン(続き)		
5,639	Volvo AB 'B'	JP Morgan	(3,294)
			166,336
	スイス		
(11,404)	ABB Ltd Reg	Barclays Bank	(125)
(825)	Adecco Group AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	1,790
(1,210)	Adecco Group AG Reg	Barclays Bank	2,108
(9)	Adecco Group AG Reg	BNP Paribas	20
(1,052)	Adecco Group AG Reg	Goldman Sachs	2,282
(211)	Alcon Inc	HSBC	(1,077)
(112)	Bachem Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	160
(48)	Bachem Holding AG	Barclays Bank	79
(2,157)	Bachem Holding AG	BNP Paribas	3,072
(165)	Bachem Holding AG	HSBC	1,473
222	Baloise Holding AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	170
286	Baloise Holding AG Reg	Barclays Bank	(345)
371	Baloise Holding AG Reg	Goldman Sachs	285
103	Baloise Holding AG Reg	HSBC	(34)
(278)	Banque Cantonale Vaudois Reg	Bank of America Merrill Lynch	(1,295)
(666)	Banque Cantonale Vaudois Reg	Barclays Bank	(1,605)
(1,503)	Banque Cantonale Vaudois Reg	BNP Paribas	(6,999)
(13)	Banque Cantonale Vaudois Reg	Citibank	(31)
(1,314)	Banque Cantonale Vaudois Reg	Goldman Sachs	(6,119)
(598)	Banque Cantonale Vaudois Reg	HSBC	(2,555)
(47)	Barry Callebaut AG Reg	Barclays Bank	3,914
(12)	Barry Callebaut AG Reg	BNP Paribas	1,433
(22)	Barry Callebaut AG Reg	Citibank	1,832
(28)	Barry Callebaut AG Reg	Goldman Sachs	3,344
4	Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	Bank of America Merrill Lynch	(1,315)
2	Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	Barclays Bank	(351)
5	Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	BNP Paribas	(1,644)
3	Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	HSBC	(1,019)
2	Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	JP Morgan	(679)
573	Clariant AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(553)
1,330	Clariant AG Reg	Barclays Bank	(1,020)
1,390	Clariant AG Reg	BNP Paribas	(1,340)
1,361	Clariant AG Reg	Citibank	(1,044)
1,857	Clariant AG Reg	Goldman Sachs	(1,791)
2,461	Clariant AG Reg	HSBC	(3,101)
1,974	Clariant AG Reg	JP Morgan	(2,487)
(140)	EMS-Chemie Holding AG Reg	Barclays Bank	690
20	Geberit AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(348)
77	Geberit AG Reg	Barclays Bank	(772)
135	Geberit AG Reg	BNP Paribas	(2,352)
60	Geberit AG Reg	Citibank	(655)
53	Geberit AG Reg	Goldman Sachs	(923)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	スイス(続き)		
168	Geberit AG Reg	HSBC	(4,731)
42	Geberit AG Reg	JP Morgan	(1,183)
(4)	Givaudan SA Reg	Barclays Bank	(53)
(7)	Givaudan SA Reg	BNP Paribas	1,012
(5)	Givaudan SA Reg	HSBC	685
740	Holcim AG	Bank of America Merrill Lynch	(1,816)
675	Holcim AG	Barclays Bank	(1,145)
7,378	Holcim AG	BNP Paribas	(18,109)
253	Holcim AG	HSBC	(1,103)
1,348	Julius Baer Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(9,630)
700	Julius Baer Group Ltd	Goldman Sachs	(5,001)
84	Julius Baer Group Ltd	HSBC	(628)
1,494	Kuehne + Nagel International AG Reg	Barclays Bank	(3,929)
93	Kuehne + Nagel International AG Reg	Citibank	(256)
85	Kuehne + Nagel International AG Reg	HSBC	(1,285)
107	Kuehne + Nagel International AG Reg	JP Morgan	(1,618)
187	Logitech International SA Reg	Barclays Bank	(105)
469	Logitech International SA Reg	Citibank	(130)
(129)	Lonza Group AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	2,064
(113)	Lonza Group AG Reg	Barclays Bank	916
(241)	Lonza Group AG Reg	BNP Paribas	3,855
(55)	Lonza Group AG Reg	Citibank	(188)
(32)	Lonza Group AG Reg	Goldman Sachs	512
(98)	Lonza Group AG Reg	HSBC	902
638	Nestle SA Reg	Barclays Bank	(2,412)
719	Nestle SA Reg	BNP Paribas	(4,648)
281	Nestle SA Reg	Citibank	184
679	Nestle SA Reg	Goldman Sachs	(4,390)
50	Novartis AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(255)
504	Novartis AG Reg	Barclays Bank	438
1,263	Novartis AG Reg	BNP Paribas	(6,449)
145	Novartis AG Reg	Citibank	(117)
2,069	Novartis AG Reg	Goldman Sachs	(10,564)
1,470	Novartis AG Reg	JP Morgan	(9,471)
36	Partners Group Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	(923)
44	Partners Group Holding AG	Barclays Bank	(1,116)
51	Partners Group Holding AG	BNP Paribas	(1,308)
13	Partners Group Holding AG	Citibank	(55)
12	Partners Group Holding AG	Goldman Sachs	(308)
50	Partners Group Holding AG	HSBC	(1,665)
43	Partners Group Holding AG	JP Morgan	(1,432)
338	Roche Holding AG	Bank of America Merrill Lynch	1,056
444	Roche Holding AG	Barclays Bank	341
129	Roche Holding AG	BNP Paribas	403
213	Roche Holding AG	Goldman Sachs	665

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	スイス(続き)		
312	Roche Holding AG	HSBC	1,026
(391)	Schindler Holding AG	Barclays Bank	3,192
(57)	Schindler Holding AG	BNP Paribas	518
(221)	Schindler Holding AG	Goldman Sachs	2,010
(9)	Schindler Holding AG	HSBC	101
(175)	SGS SA Reg	Citibank	(104)
(450)	SGS SA Reg	Goldman Sachs	(473)
(200)	SGS SA Reg	HSBC	26
(2,130)	SIG Group AG	Bank of America Merrill Lynch	560
(1,277)	SIG Group AG	Barclays Bank	896
(3,684)	SIG Group AG	BNP Paribas	969
(438)	SIG Group AG	Citibank	307
(2,415)	SIG Group AG	Goldman Sachs	635
(1,397)	SIG Group AG	HSBC	1,439
(722)	SIG Group AG	JP Morgan	744
84	Sika AG Reg	BNP Paribas	(64)
115	Sika AG Reg	Goldman Sachs	(88)
(92)	Sonova Holding AG Reg	Barclays Bank	1,197
(85)	Sonova Holding AG Reg	BNP Paribas	4,107
137	Straumann Holding AG Reg	Barclays Bank	(1,111)
3	Straumann Holding AG Reg	HSBC	(24)
113	Swatch Group AG	Bank of America Merrill Lynch	(3,244)
44	Swatch Group AG	Barclays Bank	(877)
228	Swatch Group AG	BNP Paribas	(6,545)
30	Swatch Group AG	Citibank	(598)
33	Swatch Group AG	Goldman Sachs	(947)
43	Swiss Life Holding AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(396)
91	Swiss Life Holding AG Reg	Barclays Bank	(518)
231	Swiss Life Holding AG Reg	Goldman Sachs	(2,126)
28	Swiss Life Holding AG Reg	HSBC	(792)
48	Swiss Life Holding AG Reg	JP Morgan	(1,357)
(400)	Swiss Prime Site AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	1,753
(437)	Swiss Prime Site AG Reg	Barclays Bank	1,484
(870)	Swiss Prime Site AG Reg	BNP Paribas	3,813
(231)	Swiss Prime Site AG Reg	Citibank	785
(226)	Swiss Prime Site AG Reg	Goldman Sachs	991
(450)	Swiss Prime Site AG Reg	HSBC	1,775
(116)	Swiss Prime Site AG Reg	JP Morgan	458
(371)	Swiss Re AG	Bank of America Merrill Lynch	(1,049)
(766)	Swiss Re AG	Barclays Bank	(1,007)
(576)	Swiss Re AG	Goldman Sachs	(1,628)
18	Swisscom AG Reg	Bank of America Merrill Lynch	(316)
239	Swisscom AG Reg	Barclays Bank	(1,152)
103	Swisscom AG Reg	BNP Paribas	(1,806)
55	Swisscom AG Reg	Citibank	(88)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	スイス(続き)		
16	Swisscom AG Reg	Goldman Sachs	(281)
18	Swisscom AG Reg	JP Morgan	(462)
(743)	Temenos AG Reg	Barclays Bank	286
(179)	Temenos AG Reg	Citibank	(58)
326	UBS Group AG Reg	Barclays Bank	(291)
8,558	UBS Group AG Reg	BNP Paribas	281
16	UBS Group AG Reg	Citibank	(14)
1,589	UBS Group AG Reg	Goldman Sachs	52
2,080	UBS Group AG Reg	HSBC	(479)
33	VAT Group AG	Barclays Bank	1,522
75	VAT Group AG	BNP Paribas	4,528
119	VAT Group AG	Citibank	5,130
34	VAT Group AG	Goldman Sachs	2,053
			(87,174)
	英国		
612	3i Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	595
1,256	3i Group Plc	Barclays Bank	132
3,106	3i Group Plc	BNP Paribas	3,018
1,106	3i Group Plc	Citibank	116
3,336	3i Group Plc	HSBC	7,599
836	3i Group Plc	JP Morgan	1,904
(9,632)	abrdn Plc	Bank of America Merrill Lynch	835
(22,225)	abrdn Plc	Barclays Bank	3,357
(16,729)	abrdn Plc	BNP Paribas	1,450
(20,689)	abrdn Plc	Goldman Sachs	1,793
(1,466)	Admiral Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1,742)
(1,029)	Admiral Group Plc	BNP Paribas	(1,223)
(1,993)	Admiral Group Plc	Goldman Sachs	(2,368)
(1,812)	Admiral Group Plc	HSBC	(2,714)
2,879	Anglo American Plc	Barclays Bank	(2,699)
(2,383)	Antofagasta Plc	Bank of America Merrill Lynch	1,858
(3,593)	Antofagasta Plc	Barclays Bank	3,136
(2,710)	Antofagasta Plc	BNP Paribas	2,113
(756)	Antofagasta Plc	Goldman Sachs	590
(808)	Antofagasta Plc	HSBC	1,060
278	Ashtead Group Plc	Citibank	(458)
106	Associated British Foods Plc	Goldman Sachs	(93)
555	Associated British Foods Plc	HSBC	(622)
(346)	AstraZeneca Plc	Bank of America Merrill Lynch	1,388
(1,046)	AstraZeneca Plc	Barclays Bank	4,661
(1,003)	AstraZeneca Plc	BNP Paribas	4,023
(541)	AstraZeneca Plc	Citibank	2,411
(125)	AstraZeneca Plc	Goldman Sachs	501
(208)	AstraZeneca Plc	HSBC	613
1,562	Auto Trader Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(35)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	英国(続き)		
10,059	Auto Trader Group Plc	Barclays Bank	(573)
18,251	Auto Trader Group Plc	BNP Paribas	(407)
7,214	Auto Trader Group Plc	Citibank	33
15,443	Auto Trader Group Plc	Goldman Sachs	(344)
3,071	Auto Trader Group Plc	HSBC	281
5,680	Auto Trader Group Plc	JP Morgan	520
(8,958)	Aviva Plc	BNP Paribas	1,730
(7,203)	Aviva Plc	Goldman Sachs	1,391
55,707	Barclays Plc	BNP Paribas	(2,262)
64,589	Barclays Plc	Citibank	(5,813)
18,560	Barclays Plc	Goldman Sachs	(754)
186	Berkeley Group Holdings Plc	Barclays Bank	(711)
183	Berkeley Group Holdings Plc	Citibank	(700)
4,977	BP Plc	Barclays Bank	(1,244)
51,131	BP Plc	BNP Paribas	(16,995)
11,689	BP Plc	Citibank	(2,153)
12,318	BP Plc	Goldman Sachs	(4,094)
(55,051)	BT Group Plc	BNP Paribas	3,544
(15,619)	BT Group Plc	Goldman Sachs	1,005
(18,626)	BT Group Plc	HSBC	1,303
(346)	Bunzl Plc	Bank of America Merrill Lynch	(26)
(413)	Bunzl Plc	Barclays Bank	(133)
(1,199)	Bunzl Plc	BNP Paribas	(89)
(380)	Bunzl Plc	Citibank	(122)
(354)	Bunzl Plc	Goldman Sachs	(26)
370	Burberry Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	(1,713)
1,361	Burberry Group Plc	BNP Paribas	(6,301)
1,176	Burberry Group Plc	Goldman Sachs	(5,445)
1,187	Burberry Group Plc	HSBC	(5,393)
843	Burberry Group Plc	JP Morgan	(3,830)
438	Coca-Cola HBC AG	Barclays Bank	(694)
4,250	Coca-Cola HBC AG	BNP Paribas	(8,049)
1,667	Compass Group Plc	Citibank	158
(107)	Croda International Plc	Barclays Bank	134
(305)	Croda International Plc	Citibank	32
668	DCC Plc	BNP Paribas	(372)
(1,254)	Diageo Plc	Bank of America Merrill Lynch	2,592
(2,965)	Diageo Plc	Barclays Bank	6,295
(1,245)	Diageo Plc	Citibank	2,643
4,717	Dowlais Group Plc	Barclays Bank	(651)
5,212	Dowlais Group Plc	Goldman Sachs	242
4,420	Dowlais Group Plc	HSBC	402
(997)	Entain Plc	BNP Paribas	1,765
(541)	Entain Plc	Citibank	1,025
(544)	Entain Plc	Goldman Sachs	963

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	英国(続き)		
(665)	Entain Plc	JP Morgan	1,309
52	GSK Plc	Bank of America Merrill Lynch	(75)
6,871	GSK Plc	Barclays Bank	(6,209)
3,597	GSK Plc	BNP Paribas	(5,201)
2,574	GSK Plc	Citibank	(2,326)
668	GSK Plc	Goldman Sachs	(966)
480	GSK Plc	HSBC	(555)
(2,307)	Haleon Plc	Bank of America Merrill Lynch	725
(6,029)	Haleon Plc	Barclays Bank	1,433
(10,966)	Haleon Plc	BNP Paribas	3,448
(3,929)	Haleon Plc	Citibank	934
(12,105)	Haleon Plc	Goldman Sachs	3,806
(5,187)	Haleon Plc	JP Morgan	1,188
(773)	Halma Plc	Bank of America Merrill Lynch	478
(5,762)	Hargreaves Lansdown Plc	BNP Paribas	128
(9,446)	Hargreaves Lansdown Plc	Goldman Sachs	210
(4,737)	Hargreaves Lansdown Plc	HSBC	(926)
(1,679)	Hikma Pharmaceuticals Plc	Bank of America Merrill Lynch	686
(2,708)	Hikma Pharmaceuticals Plc	Barclays Bank	872
(357)	Hikma Pharmaceuticals Plc	BNP Paribas	146
(1,431)	Hikma Pharmaceuticals Plc	HSBC	779
(1,746)	HSBC Holdings Plc	Barclays Bank	519
(5,059)	HSBC Holdings Plc	BNP Paribas	1,115
2,994	Informa Plc	Bank of America Merrill Lynch	15
1,567	Informa Plc	Barclays Bank	(539)
6,078	Informa Plc	BNP Paribas	30
94	Informa Plc	Citibank	(32)
1,640	Informa Plc	Goldman Sachs	8
3,592	Informa Plc	HSBC	89
2,539	Informa Plc	JP Morgan	63
1,019	InterContinental Hotels Group Plc	Barclays Bank	(984)
216	InterContinental Hotels Group Plc	BNP Paribas	16
614	InterContinental Hotels Group Plc	Goldman Sachs	46
(407)	Intertek Group Plc	Barclays Bank	(45)
5,196	J Sainsbury Plc	Goldman Sachs	(1,048)
956	Johnson Matthey Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2,414)
378	Johnson Matthey Plc	Barclays Bank	(840)
761	Johnson Matthey Plc	BNP Paribas	(1,922)
761	Johnson Matthey Plc	JP Morgan	(1,743)
(19,371)	Kingfisher Plc	Barclays Bank	1,344
12,748	Legal & General Group Plc	BNP Paribas	(473)
209	London Stock Exchange Group Plc	Barclays Bank	191
138	London Stock Exchange Group Plc	BNP Paribas	154
369	London Stock Exchange Group Plc	Goldman Sachs	411
416	London Stock Exchange Group Plc	HSBC	855

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	英国(続き)		
3,654	M&G Plc	BNP Paribas	32
9,855	M&G Plc	Citibank	(24)
4,717	Melrose Industries Plc	Barclays Bank	(409)
5,212	Melrose Industries Plc	Goldman Sachs	594
4,420	Melrose Industries Plc	HSBC	2,687
1,191	Mondi Plc	Barclays Bank	(627)
1,121	Mondi Plc	BNP Paribas	(687)
256	Mondi Plc	HSBC	(120)
(4,238)	National Grid Plc	Bank of America Merrill Lynch	2,807
(4,400)	National Grid Plc	Barclays Bank	(109)
(13,575)	National Grid Plc	BNP Paribas	8,990
(4,406)	National Grid Plc	Citibank	(109)
(1,453)	National Grid Plc	Goldman Sachs	962
(2,078)	National Grid Plc	HSBC	1,183
(4,282)	National Grid Plc	JP Morgan	2,438
5,238	NatWest Group Plc	Barclays Bank	(707)
28,177	NatWest Group Plc	BNP Paribas	(1,465)
3,265	NatWest Group Plc	Citibank	(441)
20,600	NatWest Group Plc	Goldman Sachs	(1,071)
3,222	NatWest Group Plc	HSBC	(44)
3,399	NatWest Group Plc	JP Morgan	(46)
293	Next Plc	Citibank	(878)
125	Next Plc	HSBC	(607)
(1,813)	Ocado Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	1,347
(6,547)	Ocado Group Plc	Barclays Bank	1,989
(12,259)	Ocado Group Plc	BNP Paribas	9,105
(4,234)	Ocado Group Plc	Goldman Sachs	3,145
(3,764)	Ocado Group Plc	HSBC	4,846
(1,497)	Pearson Plc	Bank of America Merrill Lynch	315
(4,229)	Pearson Plc	Barclays Bank	444
(6,067)	Pearson Plc	BNP Paribas	1,277
(7,322)	Pearson Plc	Citibank	1,386
(1,134)	Persimmon Plc	Bank of America Merrill Lynch	1,874
(2,248)	Persimmon Plc	Barclays Bank	2,922
(5,527)	Persimmon Plc	BNP Paribas	9,134
(1,111)	Persimmon Plc	Citibank	1,444
(3,423)	Persimmon Plc	Goldman Sachs	5,657
(964)	Persimmon Plc	HSBC	1,581
(5,260)	Phoenix Group Holdings Plc	BNP Paribas	951
(1,139)	Prudential Plc	Bank of America Merrill Lynch	1,502
(5,547)	Prudential Plc	Barclays Bank	7,374
(7,820)	Prudential Plc	BNP Paribas	10,310
(688)	Prudential Plc	Goldman Sachs	907
(2,141)	Prudential Plc	HSBC	2,915
(592)	Reckitt Benckiser Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	1,612

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	英国(続き)		
(688)	Reckitt Benckiser Group Plc	Barclays Bank	1,993
(18)	Reckitt Benckiser Group Plc	Goldman Sachs	49
(963)	Reckitt Benckiser Group Plc	HSBC	2,122
(239)	Reckitt Benckiser Group Plc	JP Morgan	527
538	RELX Plc	Bank of America Merrill Lynch	420
2,659	RELX Plc	Barclays Bank	1,415
1,400	RELX Plc	BNP Paribas	1,092
538	RELX Plc	Citibank	286
2,547	RELX Plc	Goldman Sachs	1,986
1,104	RELX Plc	HSBC	806
(13,409)	Rentokil Initial Plc	Bank of America Merrill Lynch	930
(24,993)	Rentokil Initial Plc	Barclays Bank	(970)
(22,381)	Rentokil Initial Plc	BNP Paribas	1,552
(9,783)	Rentokil Initial Plc	Citibank	(938)
(22,654)	Rentokil Initial Plc	Goldman Sachs	1,570
(8,692)	Rentokil Initial Plc	HSBC	(473)
145	Rio Tinto Plc	Bank of America Merrill Lynch	(275)
498	Rio Tinto Plc	Barclays Bank	(780)
791	Rio Tinto Plc	BNP Paribas	(1,498)
263	Rio Tinto Plc	Citibank	(99)
(18,851)	Rolls-Royce Holdings Plc	Goldman Sachs	350
2,589	Sage Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	1,878
10,097	Sage Group Plc	Barclays Bank	900
15,439	Sage Group Plc	BNP Paribas	11,200
9,586	Sage Group Plc	Citibank	854
9,766	Sage Group Plc	Goldman Sachs	7,084
5,443	Sage Group Plc	HSBC	4,582
5,203	Sage Group Plc	JP Morgan	4,380
(5,092)	Schroders Plc	Bank of America Merrill Lynch	1,002
(20,222)	Schroders Plc	Barclays Bank	3,739
(16,981)	Schroders Plc	BNP Paribas	3,342
(13,203)	Schroders Plc	Citibank	1,694
(15,766)	Schroders Plc	Goldman Sachs	3,103
(12,897)	Schroders Plc	HSBC	2,267
(5,215)	Schroders Plc	JP Morgan	917
(1,860)	Severn Trent Plc	Bank of America Merrill Lynch	2,740
(2,358)	Severn Trent Plc	Barclays Bank	292
(4,228)	Severn Trent Plc	BNP Paribas	6,228
(3,038)	Severn Trent Plc	Goldman Sachs	4,475
(845)	Severn Trent Plc	HSBC	1,632
3,334	Shell Plc	Barclays Bank	(3,575)
13,950	Shell Plc	BNP Paribas	(29,961)
1,737	Shell Plc	Citibank	(2,326)
1,216	Shell Plc	Goldman Sachs	(2,612)
(916)	Smith & Nephew Plc	Bank of America Merrill Lynch	924

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	英国(続き)		
(7,434)	Smith & Nephew Plc	Barclays Bank	6,970
(8,326)	Smith & Nephew Plc	BNP Paribas	8,400
(12,386)	Smith & Nephew Plc	Citibank	6,495
(4,191)	Smith & Nephew Plc	Goldman Sachs	4,228
(740)	Smith & Nephew Plc	HSBC	504
(673)	Smith & Nephew Plc	JP Morgan	458
10,935	Smiths Group Plc	Barclays Bank	(8,934)
1,610	Smiths Group Plc	BNP Paribas	(727)
12,059	Smiths Group Plc	Goldman Sachs	(5,449)
1,199	Smiths Group Plc	HSBC	(698)
138	Smiths Group Plc	JP Morgan	(80)
(208)	Spirax-Sarco Engineering Plc	Goldman Sachs	322
2,916	SSE Plc	Barclays Bank	433
192	SSE Plc	BNP Paribas	(29)
2,106	SSE Plc	Goldman Sachs	(313)
492	SSE Plc	HSBC	143
1,097	St James ' s Place Plc	Bank of America Merrill Lynch	(122)
4,046	St James ' s Place Plc	Barclays Bank	(1,578)
2,395	St James ' s Place Plc	BNP Paribas	(267)
850	St James ' s Place Plc	Citibank	(331)
2,783	St James ' s Place Plc	Goldman Sachs	(310)
2,250	St James ' s Place Plc	HSBC	(139)
2,243	St James ' s Place Plc	JP Morgan	(139)
(2,907)	Standard Chartered Plc	Bank of America Merrill Lynch	(655)
(8,291)	Standard Chartered Plc	BNP Paribas	(1,868)
(1,086)	Standard Chartered Plc	Citibank	215
(2,746)	Standard Chartered Plc	Goldman Sachs	(619)
14,430	Taylor Wimpey Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2,144)
38,886	Taylor Wimpey Plc	Barclays Bank	(5,127)
28,306	Taylor Wimpey Plc	BNP Paribas	(4,205)
24,622	Taylor Wimpey Plc	Citibank	(3,246)
23,888	Taylor Wimpey Plc	HSBC	(3,016)
12,437	Taylor Wimpey Plc	JP Morgan	(1,570)
194	Unilever Plc	BNP Paribas	(677)
290	Unilever Plc	Citibank	22
976	Unilever Plc	Goldman Sachs	(3,407)
(38)	United Utilities Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	22
(2,043)	United Utilities Group Plc	Goldman Sachs	1,189
(88,913)	Vodafone Group Plc	Bank of America Merrill Lynch	13,780
(20,053)	Vodafone Group Plc	Goldman Sachs	3,108
(72,110)	Vodafone Group Plc	HSBC	14,970
270	Whitbread Plc	Barclays Bank	(60)
930	Whitbread Plc	Goldman Sachs	437
957	WPP Plc	Bank of America Merrill Lynch	(339)
3,284	WPP Plc	Barclays Bank	(1,325)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
英国(続き)			
9,814	WPP Plc	BNP Paribas	(3,475)
2,052	WPP Plc	Goldman Sachs	(726)
6,181	WPP Plc	HSBC	(2,494)
			109,900
米国			
114	3M Co	Barclays Bank	(282)
225	A O Smith Corp	Bank of America Merrill Lynch	(684)
1,308	A O Smith Corp	Barclays Bank	(3,963)
102	A O Smith Corp	BNP Paribas	(310)
793	A O Smith Corp	Citibank	(2,168)
341	A O Smith Corp	Goldman Sachs	(1,037)
467	A O Smith Corp	HSBC	(2,258)
(1,170)	Abbott Laboratories	Bank of America Merrill Lynch	10,366
(706)	Abbott Laboratories	Barclays Bank	5,133
(317)	Abbott Laboratories	Citibank	2,305
(413)	Abbott Laboratories	JP Morgan	4,097
105	AbbVie Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,115)
75	AbbVie Inc	Goldman Sachs	(797)
86	Accenture Plc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	2,467
54	Accenture Plc 'A'	Barclays Bank	824
43	Accenture Plc 'A'	Citibank	656
243	Accenture Plc 'A'	Goldman Sachs	6,972
156	Accenture Plc 'A'	JP Morgan	6,455
316	Adobe Inc	Bank of America Merrill Lynch	22,003
696	Adobe Inc	Barclays Bank	30,102
112	Adobe Inc	BNP Paribas	7,799
378	Adobe Inc	Goldman Sachs	26,320
(316)	Advance Auto Parts Inc	Bank of America Merrill Lynch	14,214
(943)	Advance Auto Parts Inc	Barclays Bank	39,324
(482)	Advance Auto Parts Inc	Goldman Sachs	21,680
(134)	Advance Auto Parts Inc	HSBC	6,537
(629)	Advanced Micro Devices Inc	Barclays Bank	(8,897)
(310)	Advanced Micro Devices Inc	HSBC	(8,403)
138	AECOM	Bank of America Merrill Lynch	(275)
119	AECOM	Citibank	(231)
249	AECOM	Goldman Sachs	(496)
157	AECOM	HSBC	(791)
115	AECOM	JP Morgan	(580)
454	AerCap Holdings NV	Bank of America Merrill Lynch	(263)
631	AerCap Holdings NV	BNP Paribas	(366)
(149)	Aflac Inc	Bank of America Merrill Lynch	216
(157)	Aflac Inc	BNP Paribas	228
(149)	Aflac Inc	Citibank	289
(332)	Aflac Inc	Goldman Sachs	481
(150)	Aflac Inc	HSBC	450

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(385)	Aflac Inc	JP Morgan	1,155
1,052	Agilent Technologies Inc	Barclays Bank	(12,658)
532	Agilent Technologies Inc	BNP Paribas	(6,693)
192	Agilent Technologies Inc	Citibank	(1,720)
781	Agilent Technologies Inc	Goldman Sachs	(9,825)
1,483	Agilent Technologies Inc	HSBC	(25,270)
270	Agilent Technologies Inc	JP Morgan	(4,601)
(68)	Air Products and Chemicals Inc	Bank of America Merrill Lynch	577
(201)	Air Products and Chemicals Inc	Barclays Bank	844
(320)	Air Products and Chemicals Inc	BNP Paribas	2,717
(458)	Air Products and Chemicals Inc	Citibank	1,665
(934)	Air Products and Chemicals Inc	Goldman Sachs	7,930
(65)	Air Products and Chemicals Inc	HSBC	1,611
422	Airbnb Inc 'A'	Barclays Bank	(2,161)
914	Airbnb Inc 'A'	BNP Paribas	(887)
159	Airbnb Inc 'A'	Goldman Sachs	(154)
188	Airbnb Inc 'A'	HSBC	(3,918)
27	Airbnb Inc 'A'	JP Morgan	(563)
196	Akamai Technologies Inc	Barclays Bank	888
(216)	Albemarle Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,216
(231)	Albemarle Corp	Barclays Bank	1,936
(80)	Albemarle Corp	BNP Paribas	450
(186)	Albemarle Corp	Goldman Sachs	1,047
(93)	Albemarle Corp	HSBC	(1,138)
(224)	Alcoa Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,122
(883)	Alcoa Corp	Barclays Bank	3,903
(961)	Alcoa Corp	BNP Paribas	4,815
(40)	Align Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	734
(3)	Align Technology Inc	Barclays Bank	66
(61)	Align Technology Inc	BNP Paribas	1,119
(28)	Align Technology Inc	Goldman Sachs	514
(4)	Align Technology Inc	HSBC	109
573	Allegion Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2,086)
533	Allegion Plc	Barclays Bank	(2,143)
819	Allegion Plc	BNP Paribas	(2,981)
402	Allegion Plc	Citibank	(1,616)
294	Allegion Plc	Goldman Sachs	(1,070)
119	Allegion Plc	HSBC	(224)
144	Allegion Plc	JP Morgan	(271)
(350)	Allstate Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,835
(1,499)	Allstate Corp	BNP Paribas	12,142
(523)	Allstate Corp	Citibank	4,320
(562)	Allstate Corp	Goldman Sachs	4,552
(183)	Allstate Corp	HSBC	1,151
(124)	Allstate Corp	JP Morgan	780

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(1,356)	Ally Financial Inc	Barclays Bank	(149)
(1,429)	Ally Financial Inc	BNP Paribas	(2,043)
(928)	Ally Financial Inc	Citibank	(102)
(355)	Ally Financial Inc	Goldman Sachs	(508)
(248)	Alnylam Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,442
(151)	Alnylam Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	720
(215)	Alnylam Pharmaceuticals Inc	BNP Paribas	3,851
(49)	Alnylam Pharmaceuticals Inc	Citibank	234
(110)	Alnylam Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	1,970
(49)	Alnylam Pharmaceuticals Inc	HSBC	1,062
(113)	Alnylam Pharmaceuticals Inc	JP Morgan	2,449
1,495	Alphabet Inc 'A'	Barclays Bank	(2,627)
224	Alphabet Inc 'A'	Citibank	(250)
230	Alphabet Inc 'A'	Goldman Sachs	1,523
(605)	Amazon.com Inc	Barclays Bank	(4,096)
(181)	Amazon.com Inc	BNP Paribas	(1,915)
(210)	Amazon.com Inc	Citibank	(392)
(269)	Amazon.com Inc	Goldman Sachs	(2,846)
(606)	Amazon.com Inc	HSBC	(9,666)
191	American Express Co	Bank of America Merrill Lynch	1,614
297	American Express Co	Barclays Bank	1,348
801	American Express Co	BNP Paribas	6,768
630	American Express Co	Citibank	2,598
549	American Express Co	Goldman Sachs	4,639
46	American Express Co	HSBC	249
242	American Express Co	JP Morgan	1,309
411	American International Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	612
2,836	American International Group Inc	Barclays Bank	199
3,429	American International Group Inc	BNP Paribas	5,109
179	American International Group Inc	Citibank	13
1,841	American International Group Inc	Goldman Sachs	2,743
448	American International Group Inc	HSBC	125
(393)	American Water Works Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,776
(379)	American Water Works Co Inc	Barclays Bank	201
(313)	American Water Works Co Inc	BNP Paribas	1,415
(78)	American Water Works Co Inc	Citibank	41
(494)	American Water Works Co Inc	Goldman Sachs	2,233
(252)	American Water Works Co Inc	HSBC	1,116
40	Ameriprise Financial Inc	Barclays Bank	(106)
7	Ameriprise Financial Inc	Goldman Sachs	17
43	Ameriprise Financial Inc	JP Morgan	330
(66)	AmerisourceBergen Corp	Bank of America Merrill Lynch	521
(291)	AmerisourceBergen Corp	Barclays Bank	1,752
(213)	AmerisourceBergen Corp	BNP Paribas	1,681
(115)	AmerisourceBergen Corp	Citibank	782

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(76)	AmerisourceBergen Corp	Goldman Sachs	600
187	AMETEK Inc	Bank of America Merrill Lynch	(69)
1,050	AMETEK Inc	Barclays Bank	(2,058)
1,072	AMETEK Inc	BNP Paribas	(397)
518	AMETEK Inc	Citibank	(1,015)
582	AMETEK Inc	Goldman Sachs	(215)
928	AMETEK Inc	HSBC	882
256	AMETEK Inc	JP Morgan	243
46	Amgen Inc	Barclays Bank	(251)
228	Amgen Inc	BNP Paribas	(3,420)
171	Amgen Inc	Goldman Sachs	(2,565)
(312)	Amphenol Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(106)
(1,708)	Amphenol Corp 'A'	Barclays Bank	359
(4,933)	Amphenol Corp 'A'	BNP Paribas	(1,677)
(328)	Amphenol Corp 'A'	Citibank	69
(387)	Amphenol Corp 'A'	Goldman Sachs	(132)
(513)	Amphenol Corp 'A'	HSBC	(374)
(425)	Amphenol Corp 'A'	JP Morgan	(310)
(299)	Analog Devices Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,899
(762)	Analog Devices Inc	Barclays Bank	5,836
(125)	Analog Devices Inc	BNP Paribas	794
(100)	Analog Devices Inc	Citibank	1,329
(136)	Analog Devices Inc	Goldman Sachs	864
71	ANSYS Inc	Barclays Bank	1,447
245	ANSYS Inc	Goldman Sachs	6,804
149	Aon Plc 'A'	Barclays Bank	(1,337)
308	Aon Plc 'A'	Citibank	(2,049)
(578)	APA Corp	Citibank	678
1	Apartment Income Corp (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	(1)
1	Apartment Investment and Management Co 'A' (REIT)	Bank of America Merrill Lynch	-
(810)	Apollo Global Management Inc	Barclays Bank	(996)
(994)	Apollo Global Management Inc	BNP Paribas	(4,026)
234	Apple Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,602
1,853	Apple Inc	Barclays Bank	8,439
779	Apple Inc	BNP Paribas	5,332
1,444	Apple Inc	Goldman Sachs	9,884
492	Applied Materials Inc	Bank of America Merrill Lynch	6,652
203	Applied Materials Inc	Barclays Bank	2,189
765	Applied Materials Inc	BNP Paribas	10,343
638	Applied Materials Inc	Citibank	4,020
3,873	Applied Materials Inc	Goldman Sachs	52,363
1,003	Applied Materials Inc	HSBC	18,937
83	Applied Materials Inc	JP Morgan	1,567
(1,149)	Aptiv Plc	Barclays Bank	7,170
(1,582)	Aptiv Plc	BNP Paribas	7,499

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(971)	Aptiv Plc	Goldman Sachs	4,603
(281)	Aptiv Plc	HSBC	1,624
(1,539)	Aramark	Bank of America Merrill Lynch	(2,278)
(3,651)	Aramark	Barclays Bank	1,168
(1,869)	Aramark	BNP Paribas	(2,766)
(267)	Aramark	Citibank	85
(2,210)	Aramark	Goldman Sachs	(3,271)
(687)	Aramark	HSBC	(3,490)
(963)	Aramark	JP Morgan	(4,892)
548	Arch Capital Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(2,219)
841	Arch Capital Group Ltd	Barclays Bank	(1,247)
382	Arch Capital Group Ltd	BNP Paribas	(1,547)
133	Arch Capital Group Ltd	Citibank	(326)
1,051	Archer-Daniels-Midland Co	Barclays Bank	(2,859)
3	Archer-Daniels-Midland Co	Citibank	(8)
(123)	Ares Management Corp 'A'	Citibank	(127)
402	Arista Networks Inc	Barclays Bank	9,970
(134)	Arrow Electronics Inc	Bank of America Merrill Lynch	(860)
(359)	Arrow Electronics Inc	Barclays Bank	(851)
(97)	Arrow Electronics Inc	BNP Paribas	(623)
(187)	Arrow Electronics Inc	Citibank	(443)
(89)	Arrow Electronics Inc	HSBC	(718)
(243)	Arthur J Gallagher & Co	Bank of America Merrill Lynch	4,267
(1,169)	Arthur J Gallagher & Co	Barclays Bank	16,740
(86)	Arthur J Gallagher & Co	Citibank	1,232
(218)	Aspen Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	743
(876)	Aspen Technology Inc	Barclays Bank	4,141
(803)	Aspen Technology Inc	BNP Paribas	2,738
(538)	Aspen Technology Inc	Citibank	2,910
(497)	Aspen Technology Inc	Goldman Sachs	1,695
(114)	Aspen Technology Inc	HSBC	941
(679)	Assurant Inc	BNP Paribas	6,260
(74)	Assurant Inc	Citibank	572
(82)	Assurant Inc	Goldman Sachs	756
(1,562)	AT&T Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,921
(1,918)	AT&T Inc	Goldman Sachs	2,359
(1,500)	AT&T Inc	HSBC	2,100
73	Atlassian Corp Ltd 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1,998
524	Atlassian Corp Ltd 'A'	Barclays Bank	7,519
86	Atlassian Corp Ltd 'A'	Citibank	1,234
59	Atlassian Corp Ltd 'A'	HSBC	2,520
(104)	Atmos Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	206
(985)	Atmos Energy Corp	Barclays Bank	749
(691)	Atmos Energy Corp	Goldman Sachs	1,368
(168)	Atmos Energy Corp	HSBC	378

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
255	Autodesk Inc	Bank of America Merrill Lynch	133
1,604	Autodesk Inc	Barclays Bank	(7,610)
961	Autodesk Inc	BNP Paribas	500
258	Autodesk Inc	Citibank	(1,563)
498	Autodesk Inc	Goldman Sachs	259
56	Autodesk Inc	HSBC	305
145	Autodesk Inc	JP Morgan	789
232	Automatic Data Processing Inc	Barclays Bank	(2,151)
57	Automatic Data Processing Inc	BNP Paribas	(406)
406	Automatic Data Processing Inc	Citibank	(3,764)
49	Automatic Data Processing Inc	Goldman Sachs	(349)
55	Automatic Data Processing Inc	HSBC	(386)
11	AutoZone Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,054)
10	AutoZone Inc	Barclays Bank	(2,818)
29	AutoZone Inc	BNP Paribas	(10,687)
9	AutoZone Inc	Citibank	(2,536)
23	AutoZone Inc	Goldman Sachs	(8,476)
2	AutoZone Inc	HSBC	(743)
2	AutoZone Inc	JP Morgan	(743)
(1,635)	Avantor Inc	Bank of America Merrill Lynch	327
(4,550)	Avantor Inc	Barclays Bank	2,195
(4,244)	Avantor Inc	BNP Paribas	849
(1,090)	Avantor Inc	Citibank	719
(2,179)	Avantor Inc	Goldman Sachs	436
(1,105)	Avantor Inc	HSBC	(88)
(470)	Avantor Inc	JP Morgan	(38)
(77)	Avery Dennison Corp	Barclays Bank	150
(246)	Avery Dennison Corp	BNP Paribas	2,996
(70)	Axon Enterprise Inc	Barclays Bank	86
(63)	Axon Enterprise Inc	BNP Paribas	727
(52)	Axon Enterprise Inc	Citibank	511
(3,014)	Baker Hughes Co	Barclays Bank	2,694
(862)	Baker Hughes Co	BNP Paribas	397
(1,968)	Baker Hughes Co	Citibank	1,458
(1,640)	Baker Hughes Co	Goldman Sachs	754
(529)	Ball Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,841
(1,435)	Ball Corp	Barclays Bank	3,045
(1,784)	Ball Corp	BNP Paribas	9,580
(175)	Ball Corp	Citibank	532
(2,181)	Ball Corp	Goldman Sachs	11,712
(745)	Ball Corp	HSBC	4,842
(2,784)	Bank of America Corp	Barclays Bank	1,155
1,037	Bank of New York Mellon Corp	Bank of America Merrill Lynch	(321)
988	Bank of New York Mellon Corp	Barclays Bank	(850)
786	Bank of New York Mellon Corp	BNP Paribas	(244)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
847	Bank of New York Mellon Corp	Citibank	(728)
1,863	Bank of New York Mellon Corp	Goldman Sachs	(578)
109	Bank of New York Mellon Corp	HSBC	(121)
1,139	Bank of New York Mellon Corp	JP Morgan	(1,264)
(17,184)	Bank OZK	JP Morgan	(46,053)
179	Bath & Body Works Inc	Bank of America Merrill Lynch	338
256	Bath & Body Works Inc	BNP Paribas	484
708	Bath & Body Works Inc	Goldman Sachs	1,338
(1,497)	Baxter International Inc	Barclays Bank	2,921
(1,630)	Baxter International Inc	BNP Paribas	4,450
(2,239)	Baxter International Inc	Citibank	5,575
(2,775)	Baxter International Inc	Goldman Sachs	7,576
(727)	Baxter International Inc	HSBC	4,013
45	Becton Dickinson & Co	Barclays Bank	(549)
104	Becton Dickinson & Co	BNP Paribas	(1,274)
65	Becton Dickinson & Co	HSBC	(824)
(529)	Bentley Systems Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(1,576)
(1,452)	Bentley Systems Inc 'B'	Barclays Bank	(2,773)
(4,643)	Bentley Systems Inc 'B'	BNP Paribas	(13,836)
(807)	Bentley Systems Inc 'B'	Citibank	(1,541)
(2,324)	Bentley Systems Inc 'B'	Goldman Sachs	(6,926)
(1,301)	Bentley Systems Inc 'B'	HSBC	(8,769)
(247)	Bentley Systems Inc 'B'	JP Morgan	(1,665)
223	Berkshire Hathaway Inc 'B'	BNP Paribas	(729)
150	Berkshire Hathaway Inc 'B'	Goldman Sachs	(491)
249	Best Buy Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	15
474	Best Buy Co Inc	BNP Paribas	28
298	Best Buy Co Inc	Goldman Sachs	18
649	Best Buy Co Inc	HSBC	195
157	Best Buy Co Inc	JP Morgan	47
(103)	BILL Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(259)
(647)	BILL Holdings Inc	Barclays Bank	(560)
(441)	BILL Holdings Inc	BNP Paribas	(1,107)
(349)	BILL Holdings Inc	Goldman Sachs	(876)
(97)	BILL Holdings Inc	HSBC	(276)
13	Biogen Inc	Barclays Bank	(131)
306	Biogen Inc	BNP Paribas	(4,611)
24	Biogen Inc	Goldman Sachs	(362)
(261)	BioMarin Pharmaceutical Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,033
(867)	BioMarin Pharmaceutical Inc	Barclays Bank	3,031
(873)	BioMarin Pharmaceutical Inc	BNP Paribas	6,801
(206)	BioMarin Pharmaceutical Inc	Citibank	1,108
(2,154)	BioMarin Pharmaceutical Inc	Goldman Sachs	16,780
(495)	BioMarin Pharmaceutical Inc	HSBC	4,232
(263)	Bio-Rad Laboratories Inc 'A'	Barclays Bank	3,144

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(54)	Bio-Rad Laboratories Inc 'A'	BNP Paribas	471
(178)	Bio-Rad Laboratories Inc 'A'	Citibank	1,705
(47)	Bio-Rad Laboratories Inc 'A'	Goldman Sachs	410
(136)	Bio-Techne Corp	Bank of America Merrill Lynch	12
(758)	Bio-Techne Corp	Barclays Bank	2,109
(947)	Bio-Techne Corp	BNP Paribas	85
(552)	Bio-Techne Corp	Citibank	1,514
(277)	Bio-Techne Corp	Goldman Sachs	25
(425)	Bio-Techne Corp	HSBC	544
(160)	Blackstone Inc	Bank of America Merrill Lynch	(333)
(808)	Blackstone Inc	Barclays Bank	(162)
(712)	Blackstone Inc	BNP Paribas	(1,481)
(524)	Blackstone Inc	Citibank	(105)
(418)	Blackstone Inc	Goldman Sachs	(869)
(106)	Block Inc	Barclays Bank	(55)
(270)	Block Inc	Citibank	(140)
(238)	Block Inc	Goldman Sachs	(1,016)
14	Booking Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,403)
66	Booking Holdings Inc	Barclays Bank	(9,444)
75	Booking Holdings Inc	BNP Paribas	(12,871)
59	Booking Holdings Inc	Goldman Sachs	(10,125)
12	Booking Holdings Inc	JP Morgan	(1,980)
3	Booz Allen Hamilton Holding Corp	Barclays Bank	15
277	Booz Allen Hamilton Holding Corp	BNP Paribas	1,499
210	Booz Allen Hamilton Holding Corp	Goldman Sachs	1,136
213	BorgWarner Inc	Barclays Bank	(605)
618	BorgWarner Inc	BNP Paribas	161
658	BorgWarner Inc	HSBC	(151)
293	Boston Scientific Corp	Bank of America Merrill Lynch	(900)
935	Boston Scientific Corp	Barclays Bank	(2,870)
845	Boston Scientific Corp	BNP Paribas	(2,594)
215	Boston Scientific Corp	JP Morgan	(540)
3,097	Bristol-Myers Squibb Co	Barclays Bank	(3,097)
2,689	Bristol-Myers Squibb Co	BNP Paribas	(11,912)
1,627	Bristol-Myers Squibb Co	Citibank	(3,286)
2,683	Bristol-Myers Squibb Co	Goldman Sachs	(11,886)
535	Bristol-Myers Squibb Co	HSBC	(2,498)
139	Bristol-Myers Squibb Co	JP Morgan	(649)
(35)	Broadcom Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,789)
(74)	Broadcom Inc	Barclays Bank	(9,385)
(156)	Broadridge Financial Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,328
(1,026)	Broadridge Financial Solutions Inc	Barclays Bank	7,167
(247)	Broadridge Financial Solutions Inc	Citibank	874
(676)	Broadridge Financial Solutions Inc	Goldman Sachs	5,753
(496)	Broadridge Financial Solutions Inc	HSBC	3,288

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(130)	Brown & Brown Inc	Bank of America Merrill Lynch	469
(1,054)	Brown & Brown Inc	Barclays Bank	3,636
(1,741)	Brown & Brown Inc	BNP Paribas	6,285
(297)	Brown & Brown Inc	HSBC	1,037
(965)	Bunge Ltd	Barclays Bank	(2,268)
(815)	Bunge Ltd	BNP Paribas	(676)
(117)	Bunge Ltd	Citibank	(275)
(339)	Bunge Ltd	Goldman Sachs	(281)
(329)	Bunge Ltd	HSBC	(859)
(923)	Burlington Stores Inc	Barclays Bank	11,936
(58)	Burlington Stores Inc	HSBC	1,806
583	Cadence Design Systems Inc	Barclays Bank	9,910
3,915	Cadence Design Systems Inc	Citibank	85,345
(910)	Caesars Entertainment Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,285
(930)	Caesars Entertainment Inc	Barclays Bank	3,543
(523)	Caesars Entertainment Inc	BNP Paribas	1,888
(254)	Caesars Entertainment Inc	Citibank	968
(1,467)	Caesars Entertainment Inc	Goldman Sachs	5,296
(583)	Caesars Entertainment Inc	HSBC	2,589
(576)	Campbell Soup Co	Barclays Bank	713
(617)	Campbell Soup Co	BNP Paribas	1,817
(304)	Campbell Soup Co	Citibank	324
(1,744)	Campbell Soup Co	Goldman Sachs	5,136
(124)	Capital One Financial Corp	Barclays Bank	(606)
(507)	Capital One Financial Corp	BNP Paribas	(7,717)
560	Cardinal Health Inc	Barclays Bank	(2,447)
24	Cardinal Health Inc	BNP Paribas	(95)
485	Cardinal Health Inc	Citibank	(2,236)
847	Cardinal Health Inc	Goldman Sachs	(3,346)
128	Cardinal Health Inc	JP Morgan	(356)
(47)	Carlisle Cos Inc	Barclays Bank	(8)
(204)	Carlisle Cos Inc	BNP Paribas	(20)
(48)	Carlisle Cos Inc	Citibank	(8)
(61)	Carlisle Cos Inc	Goldman Sachs	(6)
(46)	Carlisle Cos Inc	HSBC	(75)
195	Carlyle Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	181
886	Carlyle Group Inc	Barclays Bank	(159)
92	Carlyle Group Inc	Goldman Sachs	86
170	Carlyle Group Inc	JP Morgan	270
(2,902)	CarMax Inc	Barclays Bank	-
(1,117)	CarMax Inc	BNP Paribas	(570)
(1,255)	CarMax Inc	Goldman Sachs	(640)
(9,060)	Carnival Corp	Barclays Bank	(906)
(12,212)	Carnival Corp	BNP Paribas	(12,334)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(8,081)	Carnival Corp	Goldman Sachs	(8,162)
294	Carrier Global Corp	Bank of America Merrill Lynch	(517)
254	Carrier Global Corp	Barclays Bank	(351)
1,069	Carrier Global Corp	BNP Paribas	(1,881)
268	Carrier Global Corp	Citibank	(370)
264	Carrier Global Corp	HSBC	(409)
(1,612)	Catalent Inc	Bank of America Merrill Lynch	(5,239)
(810)	Catalent Inc	Barclays Bank	867
(1,129)	Catalent Inc	BNP Paribas	(3,669)
(1,303)	Catalent Inc	Citibank	318
(484)	Catalent Inc	Goldman Sachs	(1,573)
(236)	Catalent Inc	HSBC	(231)
32	Caterpillar Inc	Bank of America Merrill Lynch	(132)
226	Caterpillar Inc	Barclays Bank	(1,106)
141	Caterpillar Inc	BNP Paribas	(584)
410	Caterpillar Inc	Citibank	(2,193)
(90)	Cboe Global Markets Inc	Bank of America Merrill Lynch	610
(115)	Cboe Global Markets Inc	Barclays Bank	810
(229)	Cboe Global Markets Inc	Goldman Sachs	1,553
(574)	CBRE Group Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(321)
(129)	CBRE Group Inc 'A'	Barclays Bank	431
(644)	CBRE Group Inc 'A'	BNP Paribas	(361)
(757)	CBRE Group Inc 'A'	Citibank	216
(240)	CBRE Group Inc 'A'	Goldman Sachs	(134)
(417)	CBRE Group Inc 'A'	HSBC	(659)
(84)	CDW Corp	Bank of America Merrill Lynch	(101)
(607)	CDW Corp	BNP Paribas	(728)
(479)	CDW Corp	Citibank	1,485
(108)	CDW Corp	Goldman Sachs	(130)
(52)	Centene Corp	Barclays Bank	187
(64)	Centene Corp	BNP Paribas	359
(346)	Centene Corp	Goldman Sachs	1,941
(438)	Centene Corp	HSBC	2,926
(165)	Ceridian HCM Holding Inc	Bank of America Merrill Lynch	(302)
(1,455)	Ceridian HCM Holding Inc	Barclays Bank	1,403
(1,842)	Ceridian HCM Holding Inc	BNP Paribas	(3,371)
(322)	Ceridian HCM Holding Inc	Citibank	602
(599)	Ceridian HCM Holding Inc	Goldman Sachs	(1,096)
(1,233)	Ceridian HCM Holding Inc	HSBC	(3,576)
(872)	CF Industries Holdings Inc	Barclays Bank	4,369
(380)	CF Industries Holdings Inc	BNP Paribas	1,999
128	CH Robinson Worldwide Inc	Bank of America Merrill Lynch	(550)
1,165	CH Robinson Worldwide Inc	BNP Paribas	(5,010)
230	CH Robinson Worldwide Inc	Goldman Sachs	(989)
(159)	Charles River Laboratories International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(229)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(453)	Charles River Laboratories International Inc	Barclays Bank	3,416
(379)	Charles River Laboratories International Inc	BNP Paribas	(546)
(40)	Charles River Laboratories International Inc	Citibank	302
(117)	Charles River Laboratories International Inc	Goldman Sachs	(168)
(126)	Charles River Laboratories International Inc	HSBC	(494)
(63)	Charles River Laboratories International Inc	JP Morgan	(247)
(398)	Charles Schwab Corp	Bank of America Merrill Lynch	(872)
(1,625)	Charles Schwab Corp	Barclays Bank	(1,885)
(1,060)	Charles Schwab Corp	BNP Paribas	(2,321)
(2,650)	Charles Schwab Corp	Goldman Sachs	(5,804)
(48)	Charles Schwab Corp	HSBC	(264)
(109)	Charter Communications Inc 'A'	Barclays Bank	1,203
(160)	Charter Communications Inc 'A'	Goldman Sachs	2,046
(44)	Charter Communications Inc 'A'	HSBC	882
163	Check Point Software Technologies Ltd	BNP Paribas	645
301	Check Point Software Technologies Ltd	Citibank	424
91	Check Point Software Technologies Ltd	HSBC	144
98	Check Point Software Technologies Ltd	JP Morgan	155
(104)	Cheniere Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,344
(129)	Cheniere Energy Inc	Citibank	909
(125)	Cheniere Energy Inc	Goldman Sachs	1,615
(60)	Cheniere Energy Inc	HSBC	763
(129)	Chesapeake Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	799
(913)	Chesapeake Energy Corp	Barclays Bank	5,478
(746)	Chesapeake Energy Corp	BNP Paribas	4,618
(388)	Chesapeake Energy Corp	Citibank	1,514
(157)	Chesapeake Energy Corp	HSBC	393
(123)	Chevron Corp	Bank of America Merrill Lynch	641
(9)	Chevron Corp	BNP Paribas	47
(103)	Chevron Corp	Goldman Sachs	537
(221)	Chevron Corp	HSBC	1,677
(622)	Chewy Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	2,811
(518)	Chewy Inc 'A'	Barclays Bank	1,228
(162)	Chewy Inc 'A'	BNP Paribas	732
32	Chipotle Mexican Grill Inc	BNP Paribas	641
48	Chipotle Mexican Grill Inc	Goldman Sachs	961
(1,394)	Church & Dwight Co Inc	Barclays Bank	4,544
(2,274)	Church & Dwight Co Inc	Goldman Sachs	10,438
216	Cigna Group	Bank of America Merrill Lynch	(3,108)
315	Cigna Group	Barclays Bank	(3,000)
61	Cigna Group	BNP Paribas	(878)
262	Cigna Group	Citibank	(765)
219	Cigna Group	Goldman Sachs	(3,151)
27	Cigna Group	HSBC	(569)
(190)	Cincinnati Financial Corp	Barclays Bank	1,250

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(392)	Cincinnati Financial Corp	BNP Paribas	2,415
(751)	Cincinnati Financial Corp	HSBC	6,121
201	Cintas Corp	Bank of America Merrill Lynch	88
634	Cintas Corp	Barclays Bank	(1,344)
419	Cintas Corp	BNP Paribas	184
135	Cintas Corp	Citibank	(286)
209	Cintas Corp	Goldman Sachs	92
82	Cintas Corp	HSBC	759
47	Cintas Corp	JP Morgan	435
587	Cisco Systems Inc	Barclays Bank	495
42	Citigroup Inc	Bank of America Merrill Lynch	(84)
2,474	Citigroup Inc	Barclays Bank	(2,136)
5,663	Citigroup Inc	BNP Paribas	(11,326)
383	Citigroup Inc	Goldman Sachs	(766)
51	Citigroup Inc	HSBC	(118)
(1,727)	Citizens Financial Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,243)
(529)	Citizens Financial Group Inc	Barclays Bank	370
(328)	Citizens Financial Group Inc	BNP Paribas	(236)
(427)	Citizens Financial Group Inc	Citibank	299
(403)	Citizens Financial Group Inc	Goldman Sachs	(290)
(1,669)	Clarivate Plc	BNP Paribas	893
(6,866)	Clarivate Plc	Goldman Sachs	3,673
(880)	Cleveland-Cliffs Inc	Bank of America Merrill Lynch	986
(578)	Cleveland-Cliffs Inc	Barclays Bank	601
(2,853)	Cleveland-Cliffs Inc	BNP Paribas	3,195
(1,958)	Cleveland-Cliffs Inc	Goldman Sachs	2,193
(715)	Clorox Co	Goldman Sachs	7,064
(268)	Cloudflare Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(4,368)
(742)	Cloudflare Inc 'A'	Barclays Bank	(7,947)
(1,288)	Cloudflare Inc 'A'	BNP Paribas	(20,994)
(188)	Cloudflare Inc 'A'	Goldman Sachs	(3,064)
(498)	Cloudflare Inc 'A'	HSBC	(10,558)
(493)	CME Group Inc	Barclays Bank	1,518
(298)	CME Group Inc	BNP Paribas	1,952
(481)	CME Group Inc	Citibank	1,250
(206)	CME Group Inc	Goldman Sachs	1,349
(100)	CME Group Inc	HSBC	787
(847)	CMS Energy Corp	Barclays Bank	1,063
(1,310)	CMS Energy Corp	BNP Paribas	4,598
(194)	CMS Energy Corp	Citibank	(27)
(297)	CMS Energy Corp	Goldman Sachs	1,042
341	Coca-Cola Co	Bank of America Merrill Lynch	(1,538)
4,191	Coca-Cola Co	Barclays Bank	(7,274)
2,606	Coca-Cola Co	BNP Paribas	(11,753)
1,547	Coca-Cola Co	Citibank	(2,523)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
633	Coca-Cola Co	Goldman Sachs	(2,855)
1,572	Coca-Cola Co	HSBC	(7,058)
408	Coca-Cola Co	JP Morgan	(1,832)
515	Coca-Cola Europacific Partners Plc	Bank of America Merrill Lynch	(2,220)
2,173	Coca-Cola Europacific Partners Plc	Barclays Bank	(4,360)
704	Coca-Cola Europacific Partners Plc	BNP Paribas	(3,034)
664	Coca-Cola Europacific Partners Plc	Citibank	(1,569)
997	Coca-Cola Europacific Partners Plc	Goldman Sachs	(4,297)
631	Coca-Cola Europacific Partners Plc	HSBC	(2,196)
(253)	Cognex Corp	Bank of America Merrill Lynch	(918)
(240)	Cognex Corp	Barclays Bank	(497)
(328)	Cognex Corp	HSBC	(1,706)
(520)	Cognex Corp	JP Morgan	(2,704)
2,422	Cognizant Technology Solutions Corp 'A'	BNP Paribas	(424)
777	Cognizant Technology Solutions Corp 'A'	Goldman Sachs	(136)
(56)	Coinbase Global Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(57)
(620)	Coinbase Global Inc 'A'	Barclays Bank	(446)
(373)	Coinbase Global Inc 'A'	BNP Paribas	(380)
(1,722)	Colgate-Palmolive Co	Barclays Bank	5,464
(258)	Colgate-Palmolive Co	Citibank	439
490	Comcast Corp 'A'	Barclays Bank	(990)
295	Comcast Corp 'A'	BNP Paribas	(289)
1,902	Comcast Corp 'A'	Goldman Sachs	(1,864)
(1,042)	Conagra Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,105
(514)	Conagra Brands Inc	BNP Paribas	1,038
(472)	Conagra Brands Inc	Goldman Sachs	953
113	ConocoPhillips	Bank of America Merrill Lynch	5
364	ConocoPhillips	Barclays Bank	(1,238)
511	ConocoPhillips	BNP Paribas	20
128	ConocoPhillips	Citibank	(112)
687	ConocoPhillips	Goldman Sachs	27
13	ConocoPhillips	HSBC	(7)
(14,613)	ConocoPhillips	JP Morgan	8,329
(682)	Consolidated Edison Inc	Barclays Bank	1,391
(13)	Constellation Brands Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(98)
(365)	Constellation Brands Inc 'A'	Barclays Bank	(891)
(55)	Constellation Brands Inc 'A'	HSBC	(534)
(164)	Constellation Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	(531)
(420)	Constellation Energy Corp	Barclays Bank	50
(468)	Constellation Energy Corp	BNP Paribas	(1,516)
(304)	Constellation Energy Corp	Citibank	35
(267)	Constellation Energy Corp	Goldman Sachs	(865)
(538)	Constellation Energy Corp	HSBC	(2,582)
(39)	Cooper Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	849
(91)	Cooper Cos Inc	Barclays Bank	2,053

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(575)	Cooper Cos Inc	BNP Paribas	12,518
(228)	Cooper Cos Inc	Citibank	1,772
(187)	Cooper Cos Inc	Goldman Sachs	4,071
(30)	Cooper Cos Inc	HSBC	556
386	Copart Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,455
2,630	Copart Inc	Barclays Bank	(3,103)
2,051	Copart Inc	BNP Paribas	13,044
2,231	Copart Inc	Goldman Sachs	14,189
1,196	Copart Inc	HSBC	10,238
403	Copart Inc	JP Morgan	3,450
(268)	Corning Inc	Barclays Bank	225
(528)	Corning Inc	Citibank	444
(287)	Corning Inc	Goldman Sachs	155
(291)	Corning Inc	HSBC	236
(228)	Corteva Inc	Barclays Bank	258
(373)	Corteva Inc	BNP Paribas	1,518
(208)	Corteva Inc	Citibank	277
(178)	CoStar Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(562)
(568)	CoStar Group Inc	Barclays Bank	(575)
(404)	CoStar Group Inc	BNP Paribas	(1,277)
(173)	CoStar Group Inc	Citibank	(86)
(40)	CoStar Group Inc	Goldman Sachs	(126)
(163)	CoStar Group Inc	HSBC	(789)
(25)	Costco Wholesale Corp	Bank of America Merrill Lynch	(99)
(84)	Costco Wholesale Corp	Barclays Bank	(862)
(70)	Costco Wholesale Corp	BNP Paribas	(276)
(26)	Costco Wholesale Corp	Citibank	(367)
(51)	Costco Wholesale Corp	Goldman Sachs	(201)
(33)	Costco Wholesale Corp	JP Morgan	(228)
(898)	Coterra Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,931
(2,664)	Coterra Energy Inc	Barclays Bank	6,607
(2,594)	Coterra Energy Inc	BNP Paribas	5,577
(2,238)	Coterra Energy Inc	HSBC	3,245
(853)	Coterra Energy Inc	JP Morgan	1,237
(507)	Crowdstrike Holdings Inc	A' Bank of America Merrill Lynch	(12,553)
(223)	Crowdstrike Holdings Inc	A' Barclays Bank	(2,877)
(89)	Crowdstrike Holdings Inc	A' Goldman Sachs	(2,204)
(184)	Crowdstrike Holdings Inc	A' HSBC	(5,134)
(1,144)	Crown Holdings Inc	Barclays Bank	4,051
(367)	Crown Holdings Inc	BNP Paribas	2,261
(1,311)	Crown Holdings Inc	Goldman Sachs	8,076
(84)	Crown Holdings Inc	HSBC	647
1,343	CSX Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,706)
1,912	CSX Corp	Barclays Bank	(2,218)
4,857	CSX Corp	BNP Paribas	(6,168)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
678	CSX Corp	Citibank	(786)
2,019	CSX Corp	Goldman Sachs	(2,564)
1,819	CSX Corp	HSBC	(2,074)
579	CSX Corp	JP Morgan	(660)
140	Cummins Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,038)
505	Cummins Inc	Barclays Bank	(6,115)
1,159	Cummins Inc	BNP Paribas	(16,875)
49	Cummins Inc	Citibank	(678)
355	Cummins Inc	Goldman Sachs	(5,169)
72	Cummins Inc	HSBC	(1,408)
148	Cummins Inc	JP Morgan	(2,893)
2,868	CVS Health Corp	Barclays Bank	(4,835)
968	CVS Health Corp	BNP Paribas	(1,810)
1,203	CVS Health Corp	Citibank	(2,068)
1,474	CVS Health Corp	Goldman Sachs	(2,756)
1,094	CVS Health Corp	HSBC	(2,954)
103	CVS Health Corp	JP Morgan	(278)
(418)	CyberArk Software Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(3,469)
(114)	CyberArk Software Ltd	Goldman Sachs	(946)
(100)	CyberArk Software Ltd	HSBC	(1,510)
(84)	Danaher Corp	Barclays Bank	550
(169)	Danaher Corp	BNP Paribas	373
(22)	Danaher Corp	Goldman Sachs	49
(203)	Danaher Corp	HSBC	2,946
324	Darden Restaurants Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,420
471	Darden Restaurants Inc	Barclays Bank	(881)
618	Darden Restaurants Inc	BNP Paribas	4,616
70	Darden Restaurants Inc	Citibank	(131)
341	Darden Restaurants Inc	Goldman Sachs	2,547
291	Darden Restaurants Inc	HSBC	2,654
5	Darden Restaurants Inc	JP Morgan	46
(321)	Darling Ingredients Inc	Bank of America Merrill Lynch	205
(837)	Darling Ingredients Inc	Barclays Bank	2,026
(2,783)	Darling Ingredients Inc	BNP Paribas	1,781
(155)	Darling Ingredients Inc	Citibank	375
(1,213)	Darling Ingredients Inc	Goldman Sachs	776
(714)	Darling Ingredients Inc	HSBC	(3,306)
(243)	Datadog Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,561)
(1,449)	Datadog Inc 'A'	Barclays Bank	(1,529)
(24)	Datadog Inc 'A'	BNP Paribas	(154)
(172)	Datadog Inc 'A'	Goldman Sachs	(1,105)
(314)	DaVita Inc	Bank of America Merrill Lynch	970
(322)	DaVita Inc	Barclays Bank	1,942
(946)	DaVita Inc	BNP Paribas	2,923
(35)	DaVita Inc	Citibank	211

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(698)	DaVita Inc	Goldman Sachs	2,157
(489)	DaVita Inc	HSBC	(2,230)
(8)	Deere & Co	Bank of America Merrill Lynch	175
(280)	Deere & Co	Barclays Bank	3,394
(304)	Deere & Co	BNP Paribas	6,636
(30)	Deere & Co	Citibank	364
(42)	Deere & Co	HSBC	1,339
553	Dell Technologies Inc 'C'	Bank of America Merrill Lynch	608
332	Dell Technologies Inc 'C'	Barclays Bank	(501)
1,901	Dell Technologies Inc 'C'	BNP Paribas	2,091
773	Dell Technologies Inc 'C'	Citibank	(1,167)
234	Dell Technologies Inc 'C'	Goldman Sachs	257
234	Dell Technologies Inc 'C'	HSBC	2
15	Delta Air Lines Inc	Bank of America Merrill Lynch	39
468	Delta Air Lines Inc	Barclays Bank	412
905	Delta Air Lines Inc	BNP Paribas	2,371
833	Delta Air Lines Inc	Goldman Sachs	2,182
289	Delta Air Lines Inc	HSBC	618
1,890	DENTSPLY SIRONA Inc	Barclays Bank	(5,649)
892	DENTSPLY SIRONA Inc	Citibank	(3,095)
(1,009)	Devon Energy Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,382
(430)	Devon Energy Corp	Citibank	1,281
220	Dexcom Inc	Barclays Bank	(547)
113	Dexcom Inc	BNP Paribas	(588)
174	Dexcom Inc	Goldman Sachs	(905)
92	Dexcom Inc	JP Morgan	(531)
299	Diamondback Energy Inc	Barclays Bank	(1,606)
396	Diamondback Energy Inc	BNP Paribas	(744)
588	Diamondback Energy Inc	Goldman Sachs	(1,105)
185	Diamondback Energy Inc	HSBC	(1,019)
81	Discover Financial Services	Bank of America Merrill Lynch	496
1,135	Discover Financial Services	Barclays Bank	2,383
440	Discover Financial Services	BNP Paribas	2,693
356	Discover Financial Services	Goldman Sachs	2,179
351	Discover Financial Services	HSBC	2,218
112	Discover Financial Services	JP Morgan	708
(1,404)	DISH Network Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(49)
(11,112)	DISH Network Corp 'A'	Barclays Bank	1,540
(7,459)	DISH Network Corp 'A'	BNP Paribas	(261)
(1,207)	DISH Network Corp 'A'	Citibank	211
(2,392)	DISH Network Corp 'A'	HSBC	1,591
655	DocuSign Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,209
93	DocuSign Inc	Barclays Bank	51
1,414	DocuSign Inc	BNP Paribas	6,929
470	DocuSign Inc	Goldman Sachs	2,303

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
240	DocuSign Inc	HSBC	1,608
228	DocuSign Inc	JP Morgan	1,528
(297)	Dollar General Corp	Bank of America Merrill Lynch	4,681
(140)	Dollar General Corp	Barclays Bank	1,343
(844)	Dollar General Corp	BNP Paribas	13,301
(274)	Dollar General Corp	Goldman Sachs	4,318
(219)	Dollar Tree Inc	Barclays Bank	4,923
(507)	Dollar Tree Inc	BNP Paribas	10,966
(353)	Dollar Tree Inc	Citibank	4,970
(904)	Dollar Tree Inc	Goldman Sachs	19,554
(23)	Dollar Tree Inc	HSBC	414
129	Domino's Pizza Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,052)
180	Domino's Pizza Inc	BNP Paribas	(2,864)
40	Domino's Pizza Inc	Goldman Sachs	(636)
48	Domino's Pizza Inc	HSBC	(816)
52	Domino's Pizza Inc	JP Morgan	(884)
(325)	DoorDash Inc 'A'	Barclays Bank	352
(124)	DoorDash Inc 'A'	Citibank	174
222	Dover Corp	Barclays Bank	(1,168)
(711)	Dow Inc	Goldman Sachs	2,510
692	DR Horton Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,062)
271	DR Horton Inc	Barclays Bank	49
335	DR Horton Inc	Citibank	(54)
6,486	Dropbox Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	1,751
8,702	Dropbox Inc 'A'	Barclays Bank	2,967
21,955	Dropbox Inc 'A'	BNP Paribas	5,928
453	Dropbox Inc 'A'	Citibank	201
16,171	Dropbox Inc 'A'	Goldman Sachs	4,366
4,391	Dropbox Inc 'A'	HSBC	6,411
2,579	Dropbox Inc 'A'	JP Morgan	3,765
5,949	DuPont de Nemours	Inc Bank of America Merrill Lynch	12,255
637	DuPont de Nemours	Inc BNP Paribas	1,312
204	Dynatrace Inc	Barclays Bank	215
534	Eaton Corp Plc	Barclays Bank	2,526
225	Eaton Corp Plc	BNP Paribas	2,023
369	Eaton Corp Plc	Goldman Sachs	3,317
72	Eaton Corp Plc	HSBC	650
349	Eaton Corp Plc	JP Morgan	3,151
550	eBay Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,320)
6,715	eBay Inc	Barclays Bank	(9,334)
9,228	eBay Inc	BNP Paribas	(22,147)
1,059	eBay Inc	Citibank	(1,472)
5,707	eBay Inc	Goldman Sachs	(13,697)
2,381	eBay Inc	HSBC	(8,286)
745	eBay Inc	JP Morgan	(2,593)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(65)	Ecolab Inc	Bank of America Merrill Lynch	613
(120)	Ecolab Inc	BNP Paribas	1,132
(197)	Ecolab Inc	Citibank	1,708
440	Edison International	Barclays Bank	(559)
1,012	Edison International	BNP Paribas	(5,900)
821	Edison International	Goldman Sachs	(4,786)
324	Edison International	HSBC	(2,262)
383	Edison International	JP Morgan	(2,673)
211	Edwards Lifesciences Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,559)
3,073	Edwards Lifesciences Corp	Barclays Bank	(23,447)
3,020	Edwards Lifesciences Corp	BNP Paribas	(22,318)
414	Edwards Lifesciences Corp	Citibank	11
1,714	Edwards Lifesciences Corp	Goldman Sachs	(12,666)
439	Edwards Lifesciences Corp	HSBC	(3,288)
158	Edwards Lifesciences Corp	JP Morgan	(1,183)
(2,016)	Elanco Animal Health Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,794
(13,735)	Elanco Animal Health Inc	Barclays Bank	12,224
(2,535)	Elanco Animal Health Inc	BNP Paribas	2,256
(1,691)	Elanco Animal Health Inc	Citibank	1,505
(4,948)	Elanco Animal Health Inc	Goldman Sachs	4,404
(923)	Elanco Animal Health Inc	JP Morgan	1,246
281	Electronic Arts Inc	Barclays Bank	6
(27)	Elevance Health Inc	Barclays Bank	(17)
(40)	Elevance Health Inc	BNP Paribas	318
(77)	Elevance Health Inc	Citibank	634
(144)	Elevance Health Inc	Goldman Sachs	1,143
(64)	Elevance Health Inc	HSBC	1,317
(27)	Eli Lilly & Co	Bank of America Merrill Lynch	265
(2)	Eli Lilly & Co	BNP Paribas	20
(144)	Eli Lilly & Co	Goldman Sachs	1,411
(188)	Emerson Electric Co	Bank of America Merrill Lynch	1,132
(29)	Emerson Electric Co	Citibank	134
(194)	Emerson Electric Co	Goldman Sachs	1,168
(47)	Enphase Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(231)
(135)	Enphase Energy Inc	BNP Paribas	(664)
(65)	Enphase Energy Inc	Goldman Sachs	(320)
(158)	Enphase Energy Inc	HSBC	(1,634)
(285)	Entegris Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,398)
(1,617)	Entegris Inc	Barclays Bank	(16,720)
(1,354)	Entegris Inc	Citibank	(14,000)
(3,218)	Entegris Inc	Goldman Sachs	(49,654)
(31)	Entegris Inc	JP Morgan	(856)
695	EOG Resources Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,655)
502	EOG Resources Inc	Barclays Bank	(3,027)
631	EOG Resources Inc	BNP Paribas	(2,410)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
194	EOG Resources Inc	Citibank	(1,170)
918	EOG Resources Inc	Goldman Sachs	(3,507)
111	EOG Resources Inc	HSBC	(759)
71	EOG Resources Inc	JP Morgan	(486)
(43)	EPAM Systems Inc	Barclays Bank	302
(40)	EPAM Systems Inc	Citibank	(7)
(949)	EQT Corp	Barclays Bank	1,158
(656)	EQT Corp	BNP Paribas	33
(351)	EQT Corp	Citibank	428
(628)	EQT Corp	Goldman Sachs	31
(771)	EQT Corp	HSBC	(2,159)
(70)	Equifax Inc	Bank of America Merrill Lynch	(229)
(80)	Equifax Inc	Barclays Bank	518
(190)	Equifax Inc	BNP Paribas	(621)
(103)	Equifax Inc	Goldman Sachs	(337)
1,739	Equitable Holdings Inc	BNP Paribas	1,443
386	Equitable Holdings Inc	Goldman Sachs	320
296	Equitable Holdings Inc	HSBC	355
(407)	Erie Indemnity Co 'A'	Bank of America Merrill Lynch	5,087
(570)	Erie Indemnity Co 'A'	Barclays Bank	5,746
(218)	Erie Indemnity Co 'A'	Goldman Sachs	2,725
(2,486)	Essential Utilities Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,903
(1,451)	Essential Utilities Inc	Barclays Bank	116
(1,487)	Essential Utilities Inc	BNP Paribas	2,335
(812)	Essential Utilities Inc	Citibank	65
(873)	Essential Utilities Inc	Goldman Sachs	1,371
(215)	Essential Utilities Inc	HSBC	516
(83)	Estee Lauder Cos Inc 'A'	Barclays Bank	481
(72)	Estee Lauder Cos Inc 'A'	Citibank	854
94	Etsy Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,440)
618	Etsy Inc	Barclays Bank	(4,629)
466	Etsy Inc	BNP Paribas	(7,139)
235	Etsy Inc	Citibank	8
261	Etsy Inc	HSBC	(2,675)
226	Etsy Inc	JP Morgan	(2,317)
60	Everest Re Group Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(1,968)
28	Everest Re Group Ltd	Barclays Bank	(309)
82	Everest Re Group Ltd	Goldman Sachs	(2,690)
29	Everest Re Group Ltd	HSBC	(950)
28	Everest Re Group Ltd	JP Morgan	(918)
(331)	Eversource Energy	Barclays Bank	719
(446)	Eversource Energy	BNP Paribas	3,795
(704)	Eversource Energy	Citibank	2,274
(1,083)	Exact Sciences Corp	Barclays Bank	3,855
3,534	Exelon Corp	Barclays Bank	(3,163)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
122	Exelon Corp	BNP Paribas	(187)
1,885	Exelon Corp	Goldman Sachs	(2,893)
951	Exelon Corp	HSBC	(3,371)
41	Exelon Corp	JP Morgan	(145)
476	Expedia Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,109
2,055	Expedia Group Inc	Barclays Bank	(4,591)
289	Expedia Group Inc	BNP Paribas	673
803	Expedia Group Inc	Citibank	(1,049)
1,023	Expedia Group Inc	Goldman Sachs	2,384
40	Expedia Group Inc	HSBC	83
173	Expeditors International of Washington Inc	Barclays Bank	(757)
1,306	Expeditors International of Washington Inc	BNP Paribas	(2,560)
1,791	Expeditors International of Washington Inc	Goldman Sachs	(3,510)
1,282	Expeditors International of Washington Inc	JP Morgan	(7,461)
424	Exxon Mobil Corp	Barclays Bank	(1,407)
106	Exxon Mobil Corp	Citibank	(251)
213	Exxon Mobil Corp	Goldman Sachs	(526)
104	Exxon Mobil Corp	JP Morgan	(677)
169	F5 Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,406
332	F5 Inc	Barclays Bank	1,165
91	F5 Inc	BNP Paribas	757
79	F5 Inc	Citibank	277
69	F5 Inc	JP Morgan	912
17	Fair Isaac Corp	Bank of America Merrill Lynch	602
34	Fair Isaac Corp	Barclays Bank	39
18	Fair Isaac Corp	BNP Paribas	638
225	Fair Isaac Corp	Goldman Sachs	7,972
17	Fair Isaac Corp	JP Morgan	938
332	Fastenal Co	BNP Paribas	(37)
527	Fastenal Co	Citibank	(514)
490	Fastenal Co	JP Morgan	(113)
73	FedEx Corp	Bank of America Merrill Lynch	(192)
306	FedEx Corp	Barclays Bank	(2,720)
146	FedEx Corp	Goldman Sachs	(384)
5	FedEx Corp	HSBC	(55)
350	Ferguson Plc	Barclays Bank	(9)
95	Ferguson Plc	BNP Paribas	(143)
99	Ferguson Plc	Citibank	(61)
75	Ferguson Plc	JP Morgan	384
(490)	Fidelity National Information Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	911
(1,623)	Fidelity National Information Services Inc	Barclays Bank	6,167
(226)	Fidelity National Information Services Inc	BNP Paribas	420
(858)	Fifth Third Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	(626)
(400)	Fifth Third Bancorp	Barclays Bank	200
(841)	Fifth Third Bancorp	BNP Paribas	(614)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(568)	Fifth Third Bancorp	Citibank	284
(431)	Fifth Third Bancorp	Goldman Sachs	(315)
(1,236)	Fifth Third Bancorp	HSBC	(667)
(10)	First Citizens BancShares Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	39
(29)	First Citizens BancShares Inc 'A'	Barclays Bank	1,298
(181)	First Citizens BancShares Inc 'A'	BNP Paribas	699
(28)	First Citizens BancShares Inc 'A'	HSBC	(4,813)
(591)	First Solar Inc	Bank of America Merrill Lynch	11,867
(693)	First Solar Inc	Barclays Bank	125
(197)	First Solar Inc	Citibank	76
(1,095)	Fiserv Inc	Barclays Bank	9,307
(137)	FleetCor Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	493
(209)	FleetCor Technologies Inc	Barclays Bank	1,331
(221)	FleetCor Technologies Inc	Goldman Sachs	796
(106)	FleetCor Technologies Inc	HSBC	347
253	FMC Corp	Barclays Bank	(1,083)
(811)	Ford Motor Co	Barclays Bank	(511)
(4,866)	Ford Motor Co	BNP Paribas	(3,017)
(3,880)	Ford Motor Co	Goldman Sachs	(2,406)
1,499	Fortinet Inc	Bank of America Merrill Lynch	135
2,005	Fortinet Inc	BNP Paribas	180
561	Fortinet Inc	Citibank	173
52	Fortinet Inc	Goldman Sachs	5
393	Fortinet Inc	HSBC	1,010
607	Fortive Corp	Bank of America Merrill Lynch	231
175	Fortive Corp	Barclays Bank	(65)
150	Fortive Corp	Citibank	(56)
146	Fortive Corp	JP Morgan	183
967	Fortune Brands Innovations Inc	Barclays Bank	(1,713)
1,929	Fortune Brands Innovations Inc	BNP Paribas	(9,568)
529	Fortune Brands Innovations Inc	Citibank	(447)
394	Fortune Brands Innovations Inc	Goldman Sachs	(1,954)
326	Fortune Brands Innovations Inc	HSBC	(1,676)
200	Fortune Brands Innovations Inc	JP Morgan	(1,028)
5,603	Franklin Resources Inc	Barclays Bank	(2,970)
613	Franklin Resources Inc	BNP Paribas	(264)
654	Franklin Resources Inc	Goldman Sachs	(281)
(876)	Freeport-McMoRan Inc	Barclays Bank	1,813
483	Garmin Ltd	BNP Paribas	657
827	Garmin Ltd	Goldman Sachs	1,125
(125)	Gartner Inc	Barclays Bank	(1,620)
(239)	GE Healthcare Inc	Bank of America Merrill Lynch	(975)
(201)	GE Healthcare Inc	Barclays Bank	14
(545)	GE Healthcare Inc	BNP Paribas	(2,224)
(291)	GE Healthcare Inc	Goldman Sachs	(1,187)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(2,546)	Gen Digital Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,610)
(11,767)	Gen Digital Inc	Barclays Bank	(4,259)
(9,806)	Gen Digital Inc	BNP Paribas	(10,051)
(4,523)	Gen Digital Inc	Citibank	(1,696)
(3,451)	Gen Digital Inc	Goldman Sachs	(3,537)
(2,626)	Gen Digital Inc	HSBC	(1,011)
(104)	Generac Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	553
(173)	Generac Holdings Inc	BNP Paribas	920
(326)	Generac Holdings Inc	Goldman Sachs	1,734
(110)	Generac Holdings Inc	HSBC	(98)
(289)	General Electric Co	Barclays Bank	1,107
(1,376)	General Electric Co	BNP Paribas	1,761
(783)	General Mills Inc	Bank of America Merrill Lynch	5,387
(167)	General Mills Inc	Barclays Bank	382
(1,337)	General Mills Inc	Goldman Sachs	9,199
(2)	General Mills Inc	HSBC	13
(297)	General Mills Inc	JP Morgan	1,919
900	General Motors Co	Barclays Bank	(485)
441	General Motors Co	BNP Paribas	106
1,025	General Motors Co	Citibank	(615)
300	General Motors Co	Goldman Sachs	72
347	General Motors Co	HSBC	(364)
849	General Motors Co	JP Morgan	(677)
(60)	Genuine Parts Co	Bank of America Merrill Lynch	1,217
(751)	Genuine Parts Co	Barclays Bank	10,510
(542)	Genuine Parts Co	BNP Paribas	10,992
(325)	Genuine Parts Co	Citibank	4,144
(190)	Genuine Parts Co	Goldman Sachs	3,853
(106)	Genuine Parts Co	HSBC	2,594
173	Gilead Sciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	(315)
1,004	Gilead Sciences Inc	Barclays Bank	(2,068)
735	Gilead Sciences Inc	BNP Paribas	(1,338)
290	Gilead Sciences Inc	Citibank	(597)
165	Gilead Sciences Inc	Goldman Sachs	(300)
223	Gilead Sciences Inc	HSBC	(453)
117	Gilead Sciences Inc	JP Morgan	(238)
(105)	Globe Life Inc	Bank of America Merrill Lynch	354
(114)	Globe Life Inc	Barclays Bank	475
(1,057)	Globe Life Inc	BNP Paribas	3,562
(97)	Globe Life Inc	Citibank	404
(243)	Globe Life Inc	Goldman Sachs	819
(161)	Globe Life Inc	HSBC	657
377	GoDaddy Inc 'A'	Barclays Bank	102
950	GoDaddy Inc 'A'	BNP Paribas	1,083
252	GoDaddy Inc 'A'	Goldman Sachs	287

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
482	GoDaddy Inc 'A'	HSBC	1,350
(7,646)	Grab Holdings Ltd 'A'	Barclays Bank	879
646	Graco Inc	Bank of America Merrill Lynch	(640)
1,844	Graco Inc	Barclays Bank	(5,182)
404	Graco Inc	Citibank	(1,135)
2,702	Graco Inc	Goldman Sachs	(2,675)
149	Graco Inc	HSBC	(322)
794	Graco Inc	JP Morgan	(1,715)
314	Halliburton Co	Barclays Bank	(371)
2,813	Halliburton Co	BNP Paribas	(169)
1,515	Hartford Financial Services Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(3,151)
1,609	Hartford Financial Services Group Inc	Barclays Bank	(4,489)
1,602	Hartford Financial Services Group Inc	BNP Paribas	(3,332)
1,892	Hartford Financial Services Group Inc	Goldman Sachs	(3,935)
960	Hartford Financial Services Group Inc	HSBC	(2,218)
(726)	Hasbro Inc	Barclays Bank	515
(2,251)	Hasbro Inc	BNP Paribas	5,988
(459)	Hasbro Inc	Citibank	263
(350)	Hasbro Inc	Goldman Sachs	931
(885)	Hasbro Inc	HSBC	(204)
407	HCA Healthcare Inc	Bank of America Merrill Lynch	(6,732)
294	HCA Healthcare Inc	Barclays Bank	(4,722)
172	HCA Healthcare Inc	BNP Paribas	(2,845)
153	HCA Healthcare Inc	Citibank	(1,091)
57	HCA Healthcare Inc	Goldman Sachs	(943)
45	HCA Healthcare Inc	HSBC	(756)
41	HCA Healthcare Inc	JP Morgan	(689)
225	HEICO Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4,811)
132	HEICO Corp	Barclays Bank	(2,827)
370	HEICO Corp	Citibank	(7,925)
(179)	Henry Schein Inc	Citibank	310
1,956	Hershey Co	Barclays Bank	(8,412)
404	Hershey Co	BNP Paribas	(5,244)
221	Hershey Co	Citibank	(1,193)
274	Hershey Co	Goldman Sachs	(3,557)
183	Hershey Co	HSBC	(3,164)
3	Hershey Co	JP Morgan	(52)
(77)	Hess Corp	Bank of America Merrill Lynch	751
(885)	Hess Corp	Barclays Bank	6,489
(1,520)	Hess Corp	BNP Paribas	14,820
(92)	Hess Corp	Citibank	753
(1,433)	Hess Corp	Goldman Sachs	13,972
(106)	Hess Corp	HSBC	1,271
699	Hewlett Packard Enterprise Co	Bank of America Merrill Lynch	143
3,564	Hewlett Packard Enterprise Co	Barclays Bank	160

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
1,551	Hewlett Packard Enterprise Co	BNP Paribas	318
2,961	Hewlett Packard Enterprise Co	Citibank	(1,195)
2,736	Hewlett Packard Enterprise Co	Goldman Sachs	561
3,548	Hewlett Packard Enterprise Co	HSBC	1,082
2,241	Hewlett Packard Enterprise Co	JP Morgan	684
(676)	Hilton Worldwide Holdings Inc	Barclays Bank	5,536
(230)	Hilton Worldwide Holdings Inc	BNP Paribas	1,817
(219)	Hilton Worldwide Holdings Inc	Citibank	1,794
473	Hologic Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,821)
1,306	Hologic Inc	Barclays Bank	(4,062)
736	Hologic Inc	BNP Paribas	(2,834)
548	Hologic Inc	Citibank	(1,002)
1,541	Hologic Inc	Goldman Sachs	(5,933)
962	Hologic Inc	HSBC	(4,406)
(63)	Home Depot Inc	Bank of America Merrill Lynch	184
(289)	Home Depot Inc	Barclays Bank	1,697
(151)	Home Depot Inc	BNP Paribas	441
(773)	Home Depot Inc	Citibank	4,021
(180)	Home Depot Inc	Goldman Sachs	526
(475)	Home Depot Inc	HSBC	1,097
(968)	Hormel Foods Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,500
(6,730)	Hormel Foods Corp	Barclays Bank	4,830
(8,516)	Hormel Foods Corp	BNP Paribas	13,200
(1,240)	Hormel Foods Corp	Citibank	1,017
(4,796)	Hormel Foods Corp	Goldman Sachs	7,434
(1,378)	Hormel Foods Corp	HSBC	3,541
(1,319)	Hormel Foods Corp	JP Morgan	3,390
(502)	Howmet Aerospace Inc	BNP Paribas	914
(606)	Howmet Aerospace Inc	Goldman Sachs	1,103
(311)	Howmet Aerospace Inc	JP Morgan	342
1,446	HP Inc	Bank of America Merrill Lynch	260
753	HP Inc	Barclays Bank	(723)
2,464	HP Inc	BNP Paribas	444
712	HP Inc	HSBC	(313)
98	Hubbell Inc	Barclays Bank	331
641	Hubbell Inc	BNP Paribas	7,878
120	Hubbell Inc	Goldman Sachs	1,475
17	Hubbell Inc	JP Morgan	260
1	HubSpot Inc	Barclays Bank	21
41	HubSpot Inc	BNP Paribas	1,798
7	HubSpot Inc	Citibank	144
24	HubSpot Inc	Goldman Sachs	1,053
55	HubSpot Inc	HSBC	3,855
45	Humana Inc	Citibank	90
20	Humana Inc	Goldman Sachs	(462)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(885)	Huntington Bancshares Inc	Bank of America Merrill Lynch	(814)
(6,004)	Huntington Bancshares Inc	Barclays Bank	300
(2,479)	Huntington Bancshares Inc	BNP Paribas	(2,281)
(984)	Huntington Bancshares Inc	Goldman Sachs	(905)
621	IDEX Corp	BNP Paribas	(4,502)
81	IDEXX Laboratories Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,413)
178	IDEXX Laboratories Inc	Barclays Bank	(4,656)
146	IDEXX Laboratories Inc	BNP Paribas	(4,349)
101	IDEXX Laboratories Inc	Citibank	(2,642)
101	IDEXX Laboratories Inc	Goldman Sachs	(3,009)
117	IDEXX Laboratories Inc	HSBC	(2,976)
95	IDEXX Laboratories Inc	JP Morgan	(2,417)
158	Illinois Tool Works Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,547)
449	Illinois Tool Works Inc	Barclays Bank	(3,191)
1,751	Illinois Tool Works Inc	BNP Paribas	(17,142)
108	Illinois Tool Works Inc	Goldman Sachs	(1,057)
51	Illinois Tool Works Inc	JP Morgan	(467)
(63)	Illumina Inc	Bank of America Merrill Lynch	677
(45)	Illumina Inc	Barclays Bank	663
(108)	Illumina Inc	BNP Paribas	1,160
(117)	Illumina Inc	Citibank	778
(55)	Illumina Inc	HSBC	87
500	Incyte Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,135)
879	Incyte Corp	Barclays Bank	(2,162)
3,696	Incyte Corp	BNP Paribas	(15,782)
508	Incyte Corp	Citibank	(483)
851	Incyte Corp	Goldman Sachs	(3,634)
135	Incyte Corp	HSBC	(521)
471	Incyte Corp	JP Morgan	(1,818)
1,309	Ingersoll Rand Inc	Barclays Bank	(2,245)
430	Ingersoll Rand Inc	Citibank	(766)
(196)	Insulet Corp	Barclays Bank	6,337
(67)	Insulet Corp	Citibank	(42)
(73)	Insulet Corp	Goldman Sachs	3,400
(34)	Insulet Corp	HSBC	1,522
(3,355)	Intel Corp	Barclays Bank	(1,897)
(427)	Intel Corp	BNP Paribas	(226)
(425)	Intel Corp	Goldman Sachs	(225)
(751)	Intel Corp	JP Morgan	330
(122)	Intercontinental Exchange Inc	Bank of America Merrill Lynch	642
(6)	Intercontinental Exchange Inc	BNP Paribas	32
(133)	Intercontinental Exchange Inc	Citibank	609
(216)	Intercontinental Exchange Inc	HSBC	566
(252)	International Business Machines Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,366)
(731)	International Business Machines Corp	Barclays Bank	(800)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(1,124)	International Business Machines Corp	BNP Paribas	(6,092)
(154)	International Business Machines Corp	Citibank	107
(1,209)	International Business Machines Corp	Goldman Sachs	(6,553)
(1,247)	International Business Machines Corp	HSBC	(6,709)
(371)	International Business Machines Corp	JP Morgan	(1,996)
(129)	International Flavors & Fragrances Inc	Bank of America Merrill Lynch	920
(290)	International Flavors & Fragrances Inc	Barclays Bank	1,789
(788)	International Flavors & Fragrances Inc	BNP Paribas	5,618
(280)	International Flavors & Fragrances Inc	Goldman Sachs	1,996
(266)	International Flavors & Fragrances Inc	HSBC	5,296
(661)	International Paper Co	Bank of America Merrill Lynch	1,428
(2,587)	International Paper Co	Barclays Bank	4,623
(1,167)	International Paper Co	BNP Paribas	2,521
(2,409)	International Paper Co	Citibank	1,975
(78)	International Paper Co	Goldman Sachs	168
(868)	International Paper Co	HSBC	2,361
2,304	Interpublic Group of Cos Inc	Barclays Bank	(622)
2,988	Interpublic Group of Cos Inc	BNP Paribas	7,111
833	Intuit Inc	Barclays Bank	(33,248)
98	Intuit Inc	BNP Paribas	(1,595)
37	Intuit Inc	Goldman Sachs	(602)
62	Intuitive Surgical Inc	Barclays Bank	(706)
113	Intuitive Surgical Inc	BNP Paribas	(657)
61	Intuitive Surgical Inc	Goldman Sachs	(354)
283	Intuitive Surgical Inc	HSBC	(241)
415	Invesco Ltd	Bank of America Merrill Lynch	(295)
377	Invesco Ltd	Barclays Bank	(260)
2,006	Invesco Ltd	BNP Paribas	(1,424)
1,421	Invesco Ltd	Goldman Sachs	(1,009)
1,208	Invesco Ltd	HSBC	(2,162)
63	IQVIA Holdings Inc	Goldman Sachs	301
55	IQVIA Holdings Inc	HSBC	354
523	J M Smucker Co	Citibank	(1,066)
(419)	Jack Henry & Associates Inc	Barclays Bank	951
(1,805)	Jack Henry & Associates Inc	BNP Paribas	11,263
(73)	Jack Henry & Associates Inc	Citibank	166
(1,234)	Jack Henry & Associates Inc	Goldman Sachs	7,700
413	Jazz Pharmaceuticals Plc	Barclays Bank	(1,378)
316	Jazz Pharmaceuticals Plc	BNP Paribas	(2,673)
700	Jazz Pharmaceuticals Plc	Citibank	(3,109)
241	Jazz Pharmaceuticals Plc	Goldman Sachs	(2,039)
136	Jazz Pharmaceuticals Plc	HSBC	(1,254)
92	JB Hunt Transport Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(764)
552	JB Hunt Transport Services Inc	Barclays Bank	(891)
1,093	JB Hunt Transport Services Inc	BNP Paribas	(9,077)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
181	JB Hunt Transport Services Inc	Citibank	(588)
113	JB Hunt Transport Services Inc	Goldman Sachs	(938)
82	JB Hunt Transport Services Inc	HSBC	(907)
44	Johnson & Johnson	Bank of America Merrill Lynch	(242)
109	Johnson & Johnson	Barclays Bank	(306)
25	Johnson & Johnson	JP Morgan	(206)
(522)	Johnson Controls International Plc	Goldman Sachs	934
(626)	Johnson Controls International Plc	HSBC	1,540
(257)	JPMorgan Chase & Co	Bank of America Merrill Lynch	(10)
(1,489)	JPMorgan Chase & Co	BNP Paribas	(60)
(405)	JPMorgan Chase & Co	Citibank	1,118
(93)	JPMorgan Chase & Co	Goldman Sachs	(4)
(11)	JPMorgan Chase & Co	HSBC	20
307	Juniper Networks Inc	Bank of America Merrill Lynch	347
3,726	Juniper Networks Inc	Barclays Bank	2,459
424	Juniper Networks Inc	BNP Paribas	479
383	Juniper Networks Inc	Citibank	253
3,477	Juniper Networks Inc	Goldman Sachs	3,929
862	Juniper Networks Inc	HSBC	1,310
725	Juniper Networks Inc	JP Morgan	1,102
(237)	Kellogg Co	Barclays Bank	574
(324)	Kellogg Co	BNP Paribas	1,361
(790)	Kellogg Co	Goldman Sachs	3,318
(341)	Kellogg Co	JP Morgan	1,777
(621)	Keurig Dr Pepper Inc	Bank of America Merrill Lynch	925
(4,111)	Keurig Dr Pepper Inc	BNP Paribas	6,125
(1,783)	Keurig Dr Pepper Inc	Goldman Sachs	2,657
(657)	Keurig Dr Pepper Inc	HSBC	1,301
(1,821)	KeyCorp	Bank of America Merrill Lynch	(146)
(969)	KeyCorp	Barclays Bank	591
(4,340)	KeyCorp	BNP Paribas	(347)
(1,068)	KeyCorp	Goldman Sachs	(85)
(2,327)	KeyCorp	HSBC	23
80	Keysight Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,121
822	Keysight Technologies Inc	Barclays Bank	3,362
1,436	Keysight Technologies Inc	BNP Paribas	20,118
255	Keysight Technologies Inc	Citibank	381
1,187	Keysight Technologies Inc	Goldman Sachs	16,630
145	Keysight Technologies Inc	JP Morgan	2,854
(75)	Kimberly-Clark Corp	Bank of America Merrill Lynch	824
(821)	Kimberly-Clark Corp	Barclays Bank	5,130
(195)	Kimberly-Clark Corp	BNP Paribas	2,143
(186)	Kimberly-Clark Corp	Citibank	638
(209)	Kimberly-Clark Corp	Goldman Sachs	2,297
(186)	Kimberly-Clark Corp	HSBC	2,210

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(572)	Kinder Morgan Inc	Barclays Bank	240
(3,713)	Kinder Morgan Inc	BNP Paribas	2,191
(3,917)	Kinder Morgan Inc	Citibank	1,039
(1,391)	Kinder Morgan Inc	Goldman Sachs	821
184	KKR & Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	462
403	KKR & Co Inc	Barclays Bank	173
305	KKR & Co Inc	BNP Paribas	766
346	KKR & Co Inc	Goldman Sachs	868
226	KKR & Co Inc	JP Morgan	522
167	KLA Corp	Barclays Bank	5,033
683	KLA Corp	BNP Paribas	31,999
29	KLA Corp	Citibank	874
79	KLA Corp	Goldman Sachs	3,701
80	KLA Corp	HSBC	5,394
3,031	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	Barclays Bank	515
822	Knight-Swift Transportation Holdings Inc	JP Morgan	(1,866)
(628)	Kraft Heinz Co	Barclays Bank	578
(241)	Kroger Co	Bank of America Merrill Lynch	848
196	Laboratory Corp of America Holdings	Bank of America Merrill Lynch	(2,609)
97	Laboratory Corp of America Holdings	Barclays Bank	(876)
43	Laboratory Corp of America Holdings	BNP Paribas	(572)
39	Laboratory Corp of America Holdings	Goldman Sachs	(519)
95	Laboratory Corp of America Holdings	HSBC	(1,233)
103	Laboratory Corp of America Holdings	JP Morgan	(1,337)
100	Lam Research Corp	Bank of America Merrill Lynch	7,389
73	Lam Research Corp	Barclays Bank	3,000
306	Lam Research Corp	BNP Paribas	22,610
82	Lam Research Corp	Citibank	3,369
111	Lam Research Corp	Goldman Sachs	8,202
43	Lam Research Corp	HSBC	4,273
110	Lamb Weston Holdings Inc	Barclays Bank	97
185	Lamb Weston Holdings Inc	Citibank	95
(1,569)	Las Vegas Sands Corp	Barclays Bank	4,125
(496)	Las Vegas Sands Corp	Citibank	204
(3,875)	Las Vegas Sands Corp	Goldman Sachs	20,692
(184)	Lear Corp	Bank of America Merrill Lynch	(103)
(173)	Lear Corp	Barclays Bank	491
(307)	Lear Corp	BNP Paribas	(172)
(318)	Lear Corp	Citibank	903
(217)	Lear Corp	HSBC	896
97	Lennar Corp 'A'	Citibank	(326)
202	Lennar Corp 'A'	JP Morgan	(1,525)
279	Lennox International Inc	Barclays Bank	(695)
300	Lennox International Inc	BNP Paribas	(2,418)
105	Lennox International Inc	Citibank	(261)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
106	Lennox International Inc	Goldman Sachs	(854)
156	Lennox International Inc	HSBC	(551)
(1,056)	Liberty Broadband Corp 'C'	Barclays Bank	2,946
(254)	Liberty Broadband Corp 'C'	Goldman Sachs	803
(257)	Liberty Broadband Corp 'C'	HSBC	1,239
(3,087)	Liberty Global Plc 'A'	Barclays Bank	2,099
651	Liberty Global Plc 'C'	Bank of America Merrill Lynch	(749)
(3,855)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	Bank of America Merrill Lynch	17,926
(568)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	Barclays Bank	1,130
(250)	Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	Goldman Sachs	1,163
(32)	Linde Plc	Bank of America Merrill Lynch	456
(431)	Linde Plc	Barclays Bank	5,107
(340)	Linde Plc	BNP Paribas	4,848
(93)	Linde Plc	Citibank	1,102
(100)	Linde Plc	HSBC	1,113
(117)	Linde Plc	JP Morgan	1,302
(136)	Live Nation Entertainment Inc	Bank of America Merrill Lynch	24
(1,277)	Live Nation Entertainment Inc	Barclays Bank	5,798
(425)	Live Nation Entertainment Inc	Citibank	1,930
(380)	Live Nation Entertainment Inc	HSBC	(908)
430	LKQ Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,258)
1,268	LKQ Corp	Barclays Bank	(4,438)
1,280	LKQ Corp	BNP Paribas	(6,720)
2,373	LKQ Corp	Goldman Sachs	(12,458)
804	LKQ Corp	HSBC	(4,438)
(353)	Loews Corp	Bank of America Merrill Lynch	618
(327)	Loews Corp	Barclays Bank	670
(296)	Loews Corp	Citibank	607
(1,136)	Loews Corp	Goldman Sachs	1,988
(316)	Loews Corp	HSBC	689
266	Lowe's Cos Inc	Barclays Bank	(373)
651	Lowe's Cos Inc	BNP Paribas	430
188	Lowe's Cos Inc	Goldman Sachs	124
85	Lowe's Cos Inc	HSBC	(156)
(53)	LPL Financial Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	(244)
(211)	LPL Financial Holdings Inc	Barclays Bank	516
(347)	LPL Financial Holdings Inc	BNP Paribas	(1,600)
(164)	LPL Financial Holdings Inc	Citibank	382
(44)	LPL Financial Holdings Inc	Goldman Sachs	(203)
(88)	LPL Financial Holdings Inc	JP Morgan	(225)
(763)	Lucid Group Inc	BNP Paribas	(389)
250	Lululemon Athletica Inc	Barclays Bank	(7,925)
100	Lululemon Athletica Inc	BNP Paribas	(4,429)
233	LyondellBasell Industries NV 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,088)
1,327	LyondellBasell Industries NV 'A'	Barclays Bank	(5,856)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
897	LyondellBasell Industries NV 'A'	BNP Paribas	(4,189)
556	LyondellBasell Industries NV 'A'	Citibank	(2,218)
151	LyondellBasell Industries NV 'A'	Goldman Sachs	(705)
607	LyondellBasell Industries NV 'A'	HSBC	(3,836)
173	LyondellBasell Industries NV 'A'	JP Morgan	(1,012)
(333)	M&T Bank Corp	Barclays Bank	551
(1,086)	M&T Bank Corp	BNP Paribas	(8,069)
(162)	M&T Bank Corp	Citibank	(36)
(133)	M&T Bank Corp	Goldman Sachs	(988)
(82)	M&T Bank Corp	JP Morgan	(499)
583	Marathon Oil Corp	Barclays Bank	(635)
1,959	Marathon Oil Corp	BNP Paribas	(646)
940	Marathon Oil Corp	Goldman Sachs	(310)
1,691	Marathon Oil Corp	HSBC	(812)
(197)	Marathon Petroleum Corp	Citibank	1,048
(33)	Markel Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,381
(32)	Markel Group Inc	Barclays Bank	963
(18)	Markel Group Inc	BNP Paribas	753
(1)	Markel Group Inc	Goldman Sachs	42
(18)	Markel Group Inc	HSBC	810
(284)	MarketAxess Holdings Inc	Bank of America Merrill Lynch	4,987
(167)	MarketAxess Holdings Inc	Barclays Bank	1,338
(29)	MarketAxess Holdings Inc	BNP Paribas	509
(50)	MarketAxess Holdings Inc	Citibank	145
(135)	MarketAxess Holdings Inc	Goldman Sachs	2,371
(4)	MarketAxess Holdings Inc	HSBC	94
(695)	Marriott International Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	5,963
(1,357)	Marriott International Inc 'A'	Barclays Bank	10,530
(88)	Marriott International Inc 'A'	BNP Paribas	755
(128)	Marriott International Inc 'A'	Citibank	993
(646)	Marriott International Inc 'A'	Goldman Sachs	5,543
(152)	Marriott International Inc 'A'	HSBC	1,677
103	Marsh & McLennan Cos Inc	Barclays Bank	(756)
(81)	Martin Marietta Materials Inc	Barclays Bank	923
(153)	Martin Marietta Materials Inc	BNP Paribas	1,525
(255)	Martin Marietta Materials Inc	Citibank	2,526
(282)	Martin Marietta Materials Inc	Goldman Sachs	2,812
(193)	Martin Marietta Materials Inc	HSBC	342
(3,055)	Marvell Technology Inc	Barclays Bank	(47,383)
(346)	Marvell Technology Inc	Citibank	(5,366)
(1,942)	Marvell Technology Inc	HSBC	(40,665)
(221)	Masco Corp	Bank of America Merrill Lynch	645
(788)	Masco Corp	Barclays Bank	2,049
(283)	Masco Corp	HSBC	1,259
(156)	Masimo Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,175

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(188)	Masimo Corp	Barclays Bank	174
(121)	Masimo Corp	BNP Paribas	1,687
(181)	Match Group Inc	Barclays Bank	(76)
(754)	Match Group Inc	BNP Paribas	(1,478)
(1,141)	Match Group Inc	Goldman Sachs	(2,236)
(269)	McCormick & Co Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,622
(400)	McCormick & Co Inc	Barclays Bank	1,160
(1,251)	McCormick & Co Inc	BNP Paribas	7,544
(221)	McCormick & Co Inc	Goldman Sachs	1,333
(649)	McCormick & Co Inc	HSBC	2,252
160	McDonald's Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,885)
318	McDonald's Corp	Barclays Bank	(1,663)
215	McDonald's Corp	BNP Paribas	(2,533)
101	McDonald's Corp	Citibank	(528)
339	McDonald's Corp	Goldman Sachs	(3,993)
127	McKesson Corp	Barclays Bank	(1,504)
75	McKesson Corp	BNP Paribas	(492)
86	McKesson Corp	Citibank	(1,018)
30	McKesson Corp	Goldman Sachs	(197)
(1,669)	Medtronic Plc	Barclays Bank	1,306
(187)	Medtronic Plc	BNP Paribas	1,333
(614)	Medtronic Plc	Citibank	4,494
(265)	Medtronic Plc	Goldman Sachs	1,889
(14)	MercadoLibre Inc	Barclays Bank	1,383
(10)	MercadoLibre Inc	BNP Paribas	560
(35)	MercadoLibre Inc	Goldman Sachs	1,959
158	Meta Platforms Inc 'A'	HSBC	4,574
54	MetLife Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9)
3,017	MetLife Inc	Barclays Bank	(6,185)
1,881	MetLife Inc	Goldman Sachs	(301)
618	MetLife Inc	HSBC	(2,083)
202	MetLife Inc	JP Morgan	(681)
84	Mettler-Toledo International Inc	Bank of America Merrill Lynch	(7,064)
86	Mettler-Toledo International Inc	Barclays Bank	(7,316)
72	Mettler-Toledo International Inc	BNP Paribas	(6,054)
24	Mettler-Toledo International Inc	Citibank	(2,323)
120	Mettler-Toledo International Inc	Goldman Sachs	(10,091)
26	Mettler-Toledo International Inc	HSBC	(2,392)
371	MGM Resorts International	Bank of America Merrill Lynch	(1,302)
1,998	MGM Resorts International	Barclays Bank	(6,294)
364	MGM Resorts International	BNP Paribas	(1,278)
236	MGM Resorts International	Citibank	(235)
1,358	MGM Resorts International	Goldman Sachs	(4,767)
623	Microchip Technology Inc	Bank of America Merrill Lynch	486
1,812	Microchip Technology Inc	Barclays Bank	(4,732)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
1,339	Microchip Technology Inc	BNP Paribas	1,044
525	Microchip Technology Inc	Citibank	(1,591)
902	Microchip Technology Inc	Goldman Sachs	704
832	Microchip Technology Inc	HSBC	1,572
401	Microchip Technology Inc	JP Morgan	758
(261)	Micron Technology Inc	Barclays Bank	(634)
(477)	Micron Technology Inc	BNP Paribas	(1,918)
(721)	Micron Technology Inc	Citibank	(1,752)
(274)	Micron Technology Inc	HSBC	(2,134)
86	Microsoft Corp	Barclays Bank	308
425	Microsoft Corp	BNP Paribas	10,769
46	Microsoft Corp	Citibank	408
55	Microsoft Corp	Goldman Sachs	1,394
973	Microsoft Corp	JP Morgan	25,444
(130)	Moderna Inc	Barclays Bank	(202)
(265)	Moderna Inc	BNP Paribas	522
(606)	Moderna Inc	Citibank	(634)
(466)	Moderna Inc	Goldman Sachs	918
54	Molina Healthcare Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,221)
1,621	Molson Coors Beverage Co ' B '	HSBC	(5,122)
(421)	Mondelez International Inc ' A '	Barclays Bank	(138)
(133)	MongoDB Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,796)
(58)	MongoDB Inc	Barclays Bank	(806)
(70)	MongoDB Inc	Goldman Sachs	(1,471)
(65)	MongoDB Inc	HSBC	(3,267)
159	Monolithic Power Systems Inc	Barclays Bank	10,112
9	Monolithic Power Systems Inc	Citibank	572
616	Monster Beverage Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,109)
636	Monster Beverage Corp	Barclays Bank	(432)
346	Monster Beverage Corp	Goldman Sachs	(623)
814	Monster Beverage Corp	HSBC	(912)
374	Monster Beverage Corp	JP Morgan	(419)
70	Moody ' s Corp	Bank of America Merrill Lynch	88
49	Moody ' s Corp	Barclays Bank	(443)
72	Moody ' s Corp	BNP Paribas	90
99	Moody ' s Corp	Citibank	(630)
195	Moody ' s Corp	Goldman Sachs	244
329	Moody ' s Corp	HSBC	2,102
99	Moody ' s Corp	JP Morgan	633
417	Morgan Stanley	Bank of America Merrill Lynch	(163)
40	Morgan Stanley	Barclays Bank	12
45	Morgan Stanley	HSBC	(84)
(675)	Mosaic Co	Barclays Bank	2,329
(544)	Mosaic Co	Citibank	1,877
(348)	Mosaic Co	Goldman Sachs	1,416

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(232)	Mosaic Co	JP Morgan	1,227
(39)	Motorola Solutions Inc	Bank of America Merrill Lynch	280
(248)	Motorola Solutions Inc	Barclays Bank	1,720
(349)	Motorola Solutions Inc	BNP Paribas	2,502
(272)	Motorola Solutions Inc	Citibank	1,082
(543)	Motorola Solutions Inc	Goldman Sachs	3,893
(216)	Motorola Solutions Inc	JP Morgan	41
29	MSCI Inc	Bank of America Merrill Lynch	176
126	MSCI Inc	Barclays Bank	(352)
40	MSCI Inc	BNP Paribas	243
5	MSCI Inc	Citibank	(14)
47	MSCI Inc	Goldman Sachs	285
73	MSCI Inc	HSBC	(237)
(1,958)	Nasdaq Inc	Barclays Bank	1,860
(1,482)	Nasdaq Inc	BNP Paribas	978
(399)	Nasdaq Inc	Citibank	379
(1,355)	Nasdaq Inc	Goldman Sachs	894
(280)	Nasdaq Inc	HSBC	115
190	NetApp Inc	Bank of America Merrill Lynch	581
1,073	NetApp Inc	Barclays Bank	730
5,044	NetApp Inc	BNP Paribas	15,435
738	NetApp Inc	Goldman Sachs	2,258
233	NetApp Inc	JP Morgan	888
(46)	Netflix Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,682)
(57)	Netflix Inc	BNP Paribas	(3,324)
103	Neurocrine Biosciences Inc	Bank of America Merrill Lynch	(761)
150	Neurocrine Biosciences Inc	Barclays Bank	(411)
210	Neurocrine Biosciences Inc	Citibank	(575)
135	Neurocrine Biosciences Inc	Goldman Sachs	(998)
315	Neurocrine Biosciences Inc	HSBC	(2,249)
136	Neurocrine Biosciences Inc	JP Morgan	(971)
(2,109)	Newell Brands Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,708
(2,235)	Newell Brands Inc	Barclays Bank	1,028
(4,441)	Newell Brands Inc	BNP Paribas	3,597
(4,800)	Newell Brands Inc	Goldman Sachs	3,888
(1,346)	Newell Brands Inc	HSBC	2,248
(233)	Newmont Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,622
(580)	Newmont Corp	Barclays Bank	1,133
(473)	Newmont Corp	Citibank	256
(228)	Newmont Corp	Goldman Sachs	1,587
(1,333)	Newmont Corp	HSBC	10,877
870	News Corp 'A'	Barclays Bank	83
2,117	News Corp 'A'	Goldman Sachs	(307)
50	News Corp 'A'	HSBC	74
(346)	NextEra Energy Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,851

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(2,920)	NextEra Energy Inc	Barclays Bank	5,523
(1,950)	NextEra Energy Inc	BNP Paribas	10,432
(291)	NextEra Energy Inc	Citibank	695
(1,203)	NextEra Energy Inc	Goldman Sachs	6,436
(310)	NextEra Energy Inc	HSBC	1,200
73	NIKE Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(1,026)
739	NIKE Inc 'B'	BNP Paribas	(10,390)
579	NIKE Inc 'B'	Goldman Sachs	(8,141)
512	NIKE Inc 'B'	HSBC	(10,808)
680	Nordson Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,095
470	Nordson Corp	Barclays Bank	635
247	Nordson Corp	BNP Paribas	398
1,094	Nordson Corp	Goldman Sachs	1,761
50	Norfolk Southern Corp	Barclays Bank	(519)
118	Norfolk Southern Corp	HSBC	93
(282)	Northern Trust Corp	Bank of America Merrill Lynch	(321)
(1,001)	Northern Trust Corp	Barclays Bank	1,051
(660)	Northern Trust Corp	BNP Paribas	(752)
(293)	Northern Trust Corp	Citibank	328
(265)	Northern Trust Corp	Goldman Sachs	(302)
(67)	Novocure Ltd	Barclays Bank	506
(354)	Novocure Ltd	BNP Paribas	1,604
(170)	Novocure Ltd	Citibank	1,284
(310)	Novocure Ltd	Goldman Sachs	1,404
(158)	Novocure Ltd	HSBC	(618)
(7,112)	NRG Energy Inc	Barclays Bank	3,980
(1,935)	NRG Energy Inc	Citibank	1,219
110	Nucor Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,141)
624	Nucor Corp	Barclays Bank	(5,466)
271	Nucor Corp	BNP Paribas	(2,810)
272	Nucor Corp	Goldman Sachs	(2,821)
147	Nucor Corp	HSBC	(1,692)
94	NVIDIA Corp	Bank of America Merrill Lynch	10,091
223	NVIDIA Corp	Barclays Bank	16,122
60	NVIDIA Corp	Citibank	5,107
185	NVIDIA Corp	Goldman Sachs	19,860
41	NVIDIA Corp	JP Morgan	4,320
8	NVR Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,444)
27	NVR Inc	Barclays Bank	(2,519)
47	NVR Inc	BNP Paribas	(14,359)
41	NVR Inc	Goldman Sachs	(12,526)
9	NVR Inc	HSBC	(2,341)
12	NVR Inc	JP Morgan	(3,122)
56	NXP Semiconductors NV	Bank of America Merrill Lynch	729
416	NXP Semiconductors NV	Barclays Bank	1,489

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
123	NXP Semiconductors NV	BNP Paribas	1,601
185	NXP Semiconductors NV	Citibank	380
281	NXP Semiconductors NV	Goldman Sachs	3,659
278	NXP Semiconductors NV	HSBC	3,586
132	NXP Semiconductors NV	JP Morgan	1,703
(171)	Occidental Petroleum Corp	Barclays Bank	192
(671)	Occidental Petroleum Corp	HSBC	698
(461)	Okta Inc	Barclays Bank	(559)
(1,059)	Okta Inc	BNP Paribas	(13,153)
(926)	Okta Inc	Goldman Sachs	(11,501)
86	Old Dominion Freight Line Inc	BNP Paribas	166
319	Old Dominion Freight Line Inc	Goldman Sachs	616
406	Old Dominion Freight Line Inc	HSBC	(1,311)
441	Omnicom Group Inc	Citibank	(1,169)
1,086	Omnicom Group Inc	HSBC	(1,987)
387	Omnicom Group Inc	JP Morgan	(708)
(128)	ON Semiconductor Corp	Barclays Bank	193
(1,332)	ONEOK Inc	Barclays Bank	2,145
118	Oracle Corp	Bank of America Merrill Lynch	923
378	Oracle Corp	Barclays Bank	1,567
479	Oracle Corp	BNP Paribas	3,746
796	Oracle Corp	Citibank	2,731
747	Oracle Corp	Goldman Sachs	5,842
47	O'Reilly Automotive Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,581)
94	O'Reilly Automotive Inc	Barclays Bank	(3,549)
215	O'Reilly Automotive Inc	BNP Paribas	(11,806)
155	O'Reilly Automotive Inc	Goldman Sachs	(8,511)
52	O'Reilly Automotive Inc	HSBC	(2,926)
14	O'Reilly Automotive Inc	JP Morgan	(788)
1,090	Otis Worldwide Corp	Barclays Bank	(4,567)
3,327	Otis Worldwide Corp	BNP Paribas	(15,371)
284	Otis Worldwide Corp	Citibank	(843)
839	Otis Worldwide Corp	Goldman Sachs	(3,876)
318	Otis Worldwide Corp	HSBC	(1,867)
769	Ovintiv Inc	Bank of America Merrill Lynch	(492)
831	Ovintiv Inc	Barclays Bank	(1,994)
959	Ovintiv Inc	BNP Paribas	(614)
1,080	Ovintiv Inc	HSBC	(2,344)
546	Ovintiv Inc	JP Morgan	(1,185)
962	Owens Corning	Barclays Bank	(1,991)
248	Owens Corning	BNP Paribas	82
216	Owens Corning	Citibank	(447)
572	Owens Corning	Goldman Sachs	189
363	Owens Corning	HSBC	603
(383)	PACCAR Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,084

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(442)	PACCAR Inc	BNP Paribas	1,251
(669)	PACCAR Inc	Goldman Sachs	1,893
(395)	Packaging Corp of America	Barclays Bank	1,813
(483)	Packaging Corp of America	BNP Paribas	2,879
(486)	Packaging Corp of America	Citibank	2,231
(7,910)	Palantir Technologies Inc 'A'	Barclays Bank	(19,380)
(5,611)	Palantir Technologies Inc 'A'	Citibank	(13,747)
208	Palo Alto Networks Inc	Barclays Bank	4,738
303	Palo Alto Networks Inc	BNP Paribas	6,633
63	Palo Alto Networks Inc	Citibank	151
160	Palo Alto Networks Inc	Goldman Sachs	3,502
209	Palo Alto Networks Inc	JP Morgan	4,884
(552)	Paramount Global 'B'	Bank of America Merrill Lynch	108
(2,576)	Paramount Global 'B'	Barclays Bank	(1,610)
(3,776)	Paramount Global 'B'	BNP Paribas	736
(2,451)	Paramount Global 'B'	HSBC	3,370
165	Parker-Hannifin Corp	BNP Paribas	(289)
234	Paychex Inc	Bank of America Merrill Lynch	(531)
1,970	Paychex Inc	Barclays Bank	(8,057)
206	Paychex Inc	BNP Paribas	(468)
133	Paychex Inc	Citibank	(544)
848	Paychex Inc	Goldman Sachs	(1,925)
92	Paychex Inc	HSBC	(40)
111	Paycom Software Inc	Barclays Bank	(1,036)
31	Paycom Software Inc	Citibank	(289)
(312)	Paylocity Holding Corp	BNP Paribas	(883)
(53)	Paylocity Holding Corp	Citibank	95
(49)	Paylocity Holding Corp	Goldman Sachs	(139)
(213)	Paylocity Holding Corp	HSBC	275
(48)	Paylocity Holding Corp	JP Morgan	62
557	PayPal Holdings Inc	Barclays Bank	(123)
150	PayPal Holdings Inc	HSBC	(1,907)
215	PayPal Holdings Inc	JP Morgan	(2,733)
1	Pebblebrook Hotel Trust (REIT)	BNP Paribas	-
(1,134)	Pentair Plc	Bank of America Merrill Lynch	3,402
(2,295)	Pentair Plc	Barclays Bank	7,023
(1,338)	Pentair Plc	BNP Paribas	4,014
(187)	Pentair Plc	Citibank	572
(244)	Pentair Plc	Goldman Sachs	732
(457)	Pentair Plc	HSBC	1,115
(189)	Pentair Plc	JP Morgan	461
1,085	PepsiCo Inc	Bank of America Merrill Lynch	(13,096)
2,276	PepsiCo Inc	Barclays Bank	(6,582)
84	PepsiCo Inc	BNP Paribas	(1,014)
329	PepsiCo Inc	Citibank	(1,461)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
454	PepsiCo Inc	Goldman Sachs	(5,480)
81	PepsiCo Inc	HSBC	(903)
(448)	Pfizer Inc	Barclays Bank	699
(154)	Pfizer Inc	BNP Paribas	(5)
(475)	Pfizer Inc	Goldman Sachs	(14)
(685)	Pfizer Inc	HSBC	1,014
(139)	PG&E Corp	Bank of America Merrill Lynch	42
(3,137)	PG&E Corp	BNP Paribas	941
(678)	PG&E Corp	Citibank	(176)
(3,207)	PG&E Corp	Goldman Sachs	962
(199)	Phillips 66	Bank of America Merrill Lynch	466
(811)	Phillips 66	Barclays Bank	2,984
(116)	Phillips 66	BNP Paribas	271
(254)	Phillips 66	Citibank	935
491	Pinterest Inc 'A'	Barclays Bank	322
1,492	Pinterest Inc 'A'	BNP Paribas	2,783
1,339	Pinterest Inc 'A'	Citibank	26
427	Pinterest Inc 'A'	Goldman Sachs	796
1,272	Pinterest Inc 'A'	JP Morgan	2,957
(112)	Pioneer Natural Resources Co	Barclays Bank	1,074
(117)	Pioneer Natural Resources Co	BNP Paribas	624
(14,390)	Plug Power Inc	Barclays Bank	3,604
(12,620)	Plug Power Inc	BNP Paribas	(9,213)
(6,831)	Plug Power Inc	Goldman Sachs	(4,987)
(372)	Plug Power Inc	HSBC	264
(80)	PNC Financial Services Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	(263)
(488)	PNC Financial Services Group Inc	Barclays Bank	1,260
(1,908)	PNC Financial Services Group Inc	BNP Paribas	(6,277)
(620)	PNC Financial Services Group Inc	Citibank	1,734
(798)	PNC Financial Services Group Inc	Goldman Sachs	(2,625)
(924)	PNC Financial Services Group Inc	HSBC	28
(97)	Pool Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,955
(287)	Pool Corp	Barclays Bank	4,691
(150)	Pool Corp	BNP Paribas	3,022
(129)	Pool Corp	Citibank	2,669
(70)	Pool Corp	Goldman Sachs	1,411
(163)	Pool Corp	HSBC	5,081
(270)	PPG Industries Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,346
(443)	PPG Industries Inc	Barclays Bank	3,004
(75)	PPG Industries Inc	Citibank	134
(122)	PPG Industries Inc	Goldman Sachs	1,060
50	Procter & Gamble Co	Bank of America Merrill Lynch	(698)
848	Procter & Gamble Co	Barclays Bank	(5,498)
2,179	Procter & Gamble Co	BNP Paribas	(30,419)
60	Procter & Gamble Co	Citibank	(427)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
1,594	Procter & Gamble Co	Goldman Sachs	(22,252)
(172)	Progressive Corp	Bank of America Merrill Lynch	717
(1,004)	Progressive Corp	Barclays Bank	5,992
(2,318)	Progressive Corp	BNP Paribas	9,666
(330)	Progressive Corp	Citibank	2,574
(779)	Progressive Corp	Goldman Sachs	3,248
(763)	Progressive Corp	HSBC	4,776
(179)	PTC Inc	Barclays Bank	291
(88)	PTC Inc	BNP Paribas	(205)
(423)	Public Service Enterprise Group Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,349
(1,167)	Public Service Enterprise Group Inc	Barclays Bank	3,349
(422)	Public Service Enterprise Group Inc	BNP Paribas	1,346
(976)	Public Service Enterprise Group Inc	HSBC	4,031
981	PulteGroup Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,158)
937	PulteGroup Inc	Barclays Bank	(796)
1,588	PulteGroup Inc	BNP Paribas	(3,494)
674	PulteGroup Inc	Citibank	(180)
691	Qorvo Inc	Barclays Bank	1,781
243	Qorvo Inc	Citibank	(443)
265	Qorvo Inc	Goldman Sachs	1,379
97	QUALCOMM Inc	Bank of America Merrill Lynch	700
89	QUALCOMM Inc	Barclays Bank	732
1,146	QUALCOMM Inc	BNP Paribas	8,274
358	QUALCOMM Inc	Goldman Sachs	2,585
230	QUALCOMM Inc	HSBC	1,194
197	QUALCOMM Inc	JP Morgan	1,022
(261)	Quanta Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,305)
(99)	Quanta Services Inc	Barclays Bank	(873)
(193)	Quanta Services Inc	BNP Paribas	(965)
98	Quest Diagnostics Inc	BNP Paribas	77
955	Quest Diagnostics Inc	Goldman Sachs	754
(234)	Raymond James Financial Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,252)
(606)	Raymond James Financial Inc	Barclays Bank	(812)
(320)	Raymond James Financial Inc	BNP Paribas	(1,712)
(119)	Raymond James Financial Inc	Goldman Sachs	(637)
(27)	Regeneron Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	516
(40)	Regeneron Pharmaceuticals Inc	BNP Paribas	764
(37)	Regeneron Pharmaceuticals Inc	Citibank	727
(39)	Regeneron Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	745
(54)	Regeneron Pharmaceuticals Inc	HSBC	1,095
(1,491)	Regions Financial Corp	Barclays Bank	149
203	Reliance Steel & Aluminum Co	Barclays Bank	(2,513)
1,620	Reliance Steel & Aluminum Co	BNP Paribas	(13,932)
(75)	Repligen Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,274)
(211)	Repligen Corp	Barclays Bank	(426)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(367)	Repligen Corp	BNP Paribas	(6,232)
(306)	Repligen Corp	Goldman Sachs	(5,196)
(315)	Republic Services Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,811
(953)	Republic Services Inc	Barclays Bank	1,439
(1,286)	Republic Services Inc	BNP Paribas	7,394
(84)	Republic Services Inc	Citibank	(83)
(2,430)	Republic Services Inc	Goldman Sachs	13,972
(88)	Republic Services Inc	HSBC	333
124	ResMed Inc	Goldman Sachs	(2,961)
77	ResMed Inc	JP Morgan	(1,855)
(120)	Revvity Inc	Bank of America Merrill Lynch	13
(2,001)	Revvity Inc	Barclays Bank	10,225
(1,717)	Revvity Inc	BNP Paribas	189
(165)	Revvity Inc	HSBC	2,124
(2,120)	Rivian Automotive Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,773)
(3,848)	Rivian Automotive Inc 'A'	BNP Paribas	(4,925)
(1,937)	Rivian Automotive Inc 'A'	Citibank	(949)
(2,005)	Rivian Automotive Inc 'A'	Goldman Sachs	(2,566)
(131)	Robert Half International Inc	Barclays Bank	367
(129)	Robert Half International Inc	Citibank	361
(221)	ROBLOX Corp 'A'	BNP Paribas	(309)
(363)	ROBLOX Corp 'A'	Goldman Sachs	(508)
37	Rockwell Automation Inc	Barclays Bank	(36)
87	Rockwell Automation Inc	Goldman Sachs	639
64	Rockwell Automation Inc	JP Morgan	238
189	Roku Inc	Goldman Sachs	620
298	Roku Inc	HSBC	558
2,829	Rollins Inc	Bank of America Merrill Lynch	(9,435)
543	Rollins Inc	Barclays Bank	(920)
389	Rollins Inc	BNP Paribas	(1,297)
990	Rollins Inc	Citibank	(1,678)
1,200	Rollins Inc	Goldman Sachs	(4,002)
239	Rollins Inc	HSBC	(639)
(79)	Roper Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	778
(104)	Roper Technologies Inc	Barclays Bank	74
(339)	Roper Technologies Inc	BNP Paribas	3,339
(298)	Roper Technologies Inc	Citibank	618
(143)	Roper Technologies Inc	Goldman Sachs	1,409
(343)	Roper Technologies Inc	HSBC	2,133
(652)	Ross Stores Inc	Barclays Bank	1,408
(269)	Ross Stores Inc	BNP Paribas	519
(45)	Ross Stores Inc	HSBC	107
(562)	Royalty Pharma Plc 'A'	Barclays Bank	410
(454)	Royalty Pharma Plc 'A'	BNP Paribas	763
(2,529)	Royalty Pharma Plc 'A'	Goldman Sachs	4,249

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(2,182)	RPM International Inc	Barclays Bank	44
(412)	RPM International Inc	BNP Paribas	416
(758)	RPM International Inc	Goldman Sachs	766
(245)	RPM International Inc	HSBC	196
38	S&P Global Inc	Citibank	(399)
36	S&P Global Inc	JP Morgan	240
(596)	Salesforce Inc	Barclays Bank	(4,905)
(957)	Salesforce Inc	BNP Paribas	(16,317)
(37)	Salesforce Inc	HSBC	(832)
(1,269)	Schlumberger NV	Barclays Bank	2,757
(1,008)	Schlumberger NV	Citibank	2,642
(1,559)	Sea Ltd ADR	Barclays Bank	6,562
(2,607)	Sea Ltd ADR	BNP Paribas	78,419
(15)	Sea Ltd ADR	Goldman Sachs	373
(536)	Seagate Technology Holdings Plc	Barclays Bank	2,080
(575)	Seagate Technology Holdings Plc	BNP Paribas	1,144
(398)	Seagate Technology Holdings Plc	Citibank	575
(236)	Seagate Technology Holdings Plc	Goldman Sachs	470
(916)	Sealed Air Corp	Bank of America Merrill Lynch	4,030
(695)	Sealed Air Corp	BNP Paribas	3,058
(249)	Sealed Air Corp	Citibank	309
(633)	Sealed Air Corp	Goldman Sachs	2,785
(426)	Sealed Air Corp	HSBC	2,126
242	SEI Investments Co	Bank of America Merrill Lynch	(407)
405	SEI Investments Co	Barclays Bank	(421)
174	SEI Investments Co	Goldman Sachs	(292)
377	SEI Investments Co	HSBC	(780)
(66)	Sempra Energy	Barclays Bank	182
(151)	Sempra Energy	BNP Paribas	1,089
(1,113)	Sensata Technologies Holding Plc	Barclays Bank	(106)
(475)	Sensata Technologies Holding Plc	Goldman Sachs	(406)
85	ServiceNow Inc	Bank of America Merrill Lynch	6,987
644	ServiceNow Inc	Barclays Bank	21,864
13	ServiceNow Inc	Goldman Sachs	1,069
66	ServiceNow Inc	HSBC	7,019
(476)	Sherwin-Williams Co	Barclays Bank	2,099
(199)	Sherwin-Williams Co	BNP Paribas	74
(183)	Sherwin-Williams Co	Goldman Sachs	68
(301)	Sherwin-Williams Co	HSBC	1,415
(71)	Sherwin-Williams Co	JP Morgan	334
13,448	Sirius XM Holdings Inc	Barclays Bank	672
(75)	Skyworks Solutions Inc	Goldman Sachs	(361)
(237)	Skyworks Solutions Inc	HSBC	223
(552)	Snap Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(707)
(4,502)	Snap Inc 'A'	Barclays Bank	(286)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(1,879)	Snap Inc 'A'	BNP Paribas	(2,405)
(844)	Snap Inc 'A'	Goldman Sachs	(1,080)
203	Snap-on Inc	Bank of America Merrill Lynch	(983)
419	Snap-on Inc	Barclays Bank	(3,507)
403	Snap-on Inc	BNP Paribas	(1,951)
60	Snap-on Inc	Citibank	(502)
165	Snap-on Inc	Goldman Sachs	(799)
192	Snap-on Inc	HSBC	(1,332)
44	Snap-on Inc	JP Morgan	(305)
(411)	Snowflake Inc 'A'	Barclays Bank	2,085
(508)	Snowflake Inc 'A'	BNP Paribas	3,327
(114)	Snowflake Inc 'A'	Citibank	(782)
(133)	Snowflake Inc 'A'	Goldman Sachs	871
(160)	Snowflake Inc 'A'	HSBC	(813)
(56)	SolarEdge Technologies Inc	Barclays Bank	625
(462)	SolarEdge Technologies Inc	BNP Paribas	9,060
(82)	SolarEdge Technologies Inc	Citibank	674
(178)	SolarEdge Technologies Inc	Goldman Sachs	3,491
(93)	SolarEdge Technologies Inc	HSBC	369
(66)	SolarEdge Technologies Inc	JP Morgan	262
(709)	Southwest Airlines Co	Bank of America Merrill Lynch	(603)
(2,363)	Southwest Airlines Co	Barclays Bank	(1,164)
(2,143)	Southwest Airlines Co	BNP Paribas	(1,822)
(3,029)	Southwest Airlines Co	Citibank	(1,927)
(1,751)	Southwest Airlines Co	Goldman Sachs	(1,488)
(38,622)	Spectrum Brands Holdings Inc	JP Morgan	43,257
1,192	Splunk Inc	Barclays Bank	426
1,105	Splunk Inc	BNP Paribas	11,370
279	Splunk Inc	Citibank	47
237	Splunk Inc	Goldman Sachs	2,439
486	Splunk Inc	HSBC	6,435
174	SS&C Technologies Holdingsg Inc	HSBC	(284)
(286)	Stanley Black & Decker Inc	Bank of America Merrill Lynch	666
(2,055)	Stanley Black & Decker Inc	Barclays Bank	10,254
(1,021)	Stanley Black & Decker Inc	BNP Paribas	2,379
(119)	Stanley Black & Decker Inc	Citibank	594
(662)	Stanley Black & Decker Inc	Goldman Sachs	1,542
(189)	Stanley Black & Decker Inc	HSBC	1,408
1,439	Starbucks Corp	Barclays Bank	(8,073)
974	Starbucks Corp	BNP Paribas	(9,107)
1,838	Starbucks Corp	Citibank	(6,928)
529	Starbucks Corp	Goldman Sachs	(4,946)
431	Starbucks Corp	HSBC	(4,258)
205	Starbucks Corp	JP Morgan	(2,025)
522	State Street Corp	Bank of America Merrill Lynch	251

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
668	State Street Corp	Barclays Bank	(13)
46	State Street Corp	Goldman Sachs	22
316	State Street Corp	HSBC	(186)
193	Steel Dynamics Inc	Barclays Bank	(368)
2,203	Steel Dynamics Inc	BNP Paribas	(15,179)
(285)	STERIS Plc	Barclays Bank	2,579
(313)	STERIS Plc	BNP Paribas	4,056
(416)	STERIS Plc	Goldman Sachs	5,391
(188)	STERIS Plc	HSBC	(1,671)
83	Stryker Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,576)
210	Stryker Corp	Citibank	(3,410)
207	Stryker Corp	Goldman Sachs	(3,931)
16	Stryker Corp	JP Morgan	(293)
654	Synchrony Financial	Bank of America Merrill Lynch	2,040
273	Synchrony Financial	Barclays Bank	202
529	Synchrony Financial	BNP Paribas	1,650
977	Synchrony Financial	Citibank	723
232	Synchrony Financial	Goldman Sachs	724
442	Synchrony Financial	HSBC	1,631
136	Synchrony Financial	JP Morgan	502
193	Synopsys Inc	Bank of America Merrill Lynch	16,787
219	Synopsys Inc	Barclays Bank	11,691
1,228	Synopsys Inc	Citibank	71,936
64	Synopsys Inc	Goldman Sachs	5,567
89	Synopsys Inc	HSBC	7,878
(772)	Sysco Corp	Barclays Bank	1,389
(873)	Sysco Corp	BNP Paribas	4,077
(834)	Sysco Corp	Citibank	875
(954)	Sysco Corp	Goldman Sachs	4,455
(762)	Sysco Corp	HSBC	4,801
(159)	Sysco Corp	JP Morgan	1,002
(121)	T Rowe Price Group Inc	Barclays Bank	(496)
(146)	Take-Two Interactive Software Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,851)
(2,446)	Take-Two Interactive Software Inc	Barclays Bank	(703)
(763)	Take-Two Interactive Software Inc	BNP Paribas	(9,675)
(582)	Take-Two Interactive Software Inc	Citibank	(410)
(934)	Take-Two Interactive Software Inc	Goldman Sachs	(11,843)
(184)	Take-Two Interactive Software Inc	HSBC	(2,219)
(650)	Targa Resources Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,937
(1,726)	Targa Resources Corp	Barclays Bank	5,049
(1,537)	Targa Resources Corp	BNP Paribas	4,580
(1,183)	Targa Resources Corp	Goldman Sachs	3,525
(152)	Targa Resources Corp	HSBC	524
(74)	Target Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,974
(530)	Target Corp	Barclays Bank	6,955

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(127)	Target Corp	Citibank	2,289
(501)	Target Corp	Goldman Sachs	13,367
(545)	TE Connectivity Ltd	Barclays Bank	1,150
(286)	TE Connectivity Ltd	BNP Paribas	(146)
(1,001)	TE Connectivity Ltd	Citibank	2,112
(167)	TE Connectivity Ltd	Goldman Sachs	(85)
(89)	TE Connectivity Ltd	HSBC	(114)
(119)	Teledyne Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	2,752
(629)	Teledyne Technologies Inc	Barclays Bank	18,474
(449)	Teledyne Technologies Inc	BNP Paribas	10,385
(30)	Teledyne Technologies Inc	Citibank	881
(273)	Teledyne Technologies Inc	Goldman Sachs	6,314
(92)	Teledyne Technologies Inc	HSBC	2,016
(206)	Teleflex Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,383
(421)	Teleflex Inc	Barclays Bank	5,662
(66)	Teleflex Inc	BNP Paribas	1,084
(254)	Teleflex Inc	Goldman Sachs	4,171
(150)	Teleflex Inc	HSBC	4,093
(95)	Teleflex Inc	JP Morgan	2,593
156	Teradyne Inc	Barclays Bank	593
222	Teradyne Inc	Citibank	258
(356)	Tesla Inc	Bank of America Merrill Lynch	(11,997)
(326)	Tesla Inc	BNP Paribas	(10,986)
(203)	Tesla Inc	Citibank	(2,270)
(163)	Tesla Inc	Goldman Sachs	(5,493)
(86)	Tesla Inc	HSBC	(2,430)
81	Texas Instruments Inc	Bank of America Merrill Lynch	756
481	Texas Instruments Inc	Barclays Bank	1,794
214	Texas Instruments Inc	BNP Paribas	1,997
167	Texas Instruments Inc	Citibank	623
562	Texas Instruments Inc	Goldman Sachs	5,243
57	Texas Instruments Inc	JP Morgan	591
(57)	Thermo Fisher Scientific Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,164
(540)	Thermo Fisher Scientific Inc	Barclays Bank	11,382
(48)	Thermo Fisher Scientific Inc	BNP Paribas	980
(47)	Thermo Fisher Scientific Inc	Citibank	1,211
(76)	Thermo Fisher Scientific Inc	Goldman Sachs	1,552
(56)	Thermo Fisher Scientific Inc	HSBC	2,202
(17)	Thermo Fisher Scientific Inc	JP Morgan	668
135	TJX Cos Inc	Bank of America Merrill Lynch	(424)
760	TJX Cos Inc	Barclays Bank	(1,557)
307	TJX Cos Inc	BNP Paribas	(964)
726	TJX Cos Inc	Citibank	(239)
544	TJX Cos Inc	Goldman Sachs	(1,708)
542	TJX Cos Inc	HSBC	(1,220)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
134	TJX Cos Inc	JP Morgan	(302)
(267)	T-Mobile US Inc	Bank of America Merrill Lynch	1,866
(393)	T-Mobile US Inc	Barclays Bank	1,560
(1,178)	T-Mobile US Inc	BNP Paribas	8,234
(1,247)	T-Mobile US Inc	Goldman Sachs	8,717
(521)	T-Mobile US Inc	HSBC	3,413
(597)	Toast Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,319)
(4,444)	Toast Inc 'A'	Barclays Bank	(1,511)
(289)	Toast Inc 'A'	BNP Paribas	(639)
(547)	Toast Inc 'A'	Goldman Sachs	(1,209)
1,013	Toro Co	BNP Paribas	(6,696)
(326)	Tractor Supply Co	Barclays Bank	3,069
(93)	Tractor Supply Co	BNP Paribas	1,861
(101)	Tractor Supply Co	Citibank	201
(58)	Tractor Supply Co	Goldman Sachs	1,161
(165)	Trade Desk Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(954)
(463)	Trade Desk Inc 'A'	HSBC	(2,357)
(422)	Tradeweb Markets Inc 'A'	Goldman Sachs	2,351
(69)	Trane Technologies Plc	Barclays Bank	166
(213)	Trane Technologies Plc	Citibank	1,056
(145)	TransUnion	Bank of America Merrill Lynch	(508)
(186)	TransUnion	Barclays Bank	7
(1,751)	TransUnion	BNP Paribas	(6,129)
(551)	TransUnion	Goldman Sachs	(1,929)
(218)	TransUnion	HSBC	(1,537)
(288)	Travelers Cos Inc	HSBC	3,168
1,209	Trimble Inc	BNP Paribas	(762)
(359)	Truist Financial Corp	Barclays Bank	(29)
(953)	Truist Financial Corp	BNP Paribas	(2,659)
(709)	Truist Financial Corp	Goldman Sachs	(1,978)
(894)	Truist Financial Corp	HSBC	(1,708)
(208)	Twilio Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(4,039)
(223)	Twilio Inc 'A'	Barclays Bank	(2,027)
(1,438)	Twilio Inc 'A'	BNP Paribas	(27,926)
(1,441)	Twilio Inc 'A'	Goldman Sachs	(27,984)
(167)	Twilio Inc 'A'	HSBC	(1,997)
(1)	Tyler Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4)
(693)	Tyler Technologies Inc	Barclays Bank	499
(398)	Tyler Technologies Inc	BNP Paribas	(1,401)
(30)	Tyler Technologies Inc	Citibank	-
(308)	Tyler Technologies Inc	Goldman Sachs	(1,084)
(967)	Tyson Foods Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(1,557)
(2,069)	Tyson Foods Inc 'A'	Barclays Bank	881
(894)	Tyson Foods Inc 'A'	BNP Paribas	(1,439)
(5,199)	Tyson Foods Inc 'A'	Citibank	(2,978)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(513)	Uber Technologies Inc	Barclays Bank	(214)
568	UGI Corp	Bank of America Merrill Lynch	(358)
719	UGI Corp	Barclays Bank	(518)
5,093	UGI Corp	BNP Paribas	(3,209)
1,952	UGI Corp	Goldman Sachs	(1,230)
497	UGI Corp	JP Morgan	(1,223)
1,027	U-Haul Holding Co	Barclays Bank	(8,945)
61	U-Haul Holding Co	BNP Paribas	(246)
333	U-Haul Holding Co	Goldman Sachs	(1,345)
8	Ulta Salon Cosmetics & Fragrance Inc	Bank of America Merrill Lynch	(803)
330	Ulta Salon Cosmetics & Fragrance Inc	Barclays Bank	(21,496)
12	Ulta Salon Cosmetics & Fragrance Inc	BNP Paribas	(1,205)
127	Ulta Salon Cosmetics & Fragrance Inc	Goldman Sachs	(12,755)
(304)	Union Pacific Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,088
(667)	Union Pacific Corp	Barclays Bank	2,042
(772)	Union Pacific Corp	BNP Paribas	5,304
(815)	Union Pacific Corp	Citibank	2,419
(391)	Union Pacific Corp	Goldman Sachs	2,686
(133)	Union Pacific Corp	HSBC	954
171	United Parcel Service Inc 'B'	Bank of America Merrill Lynch	(233)
74	United Parcel Service Inc 'B'	Barclays Bank	(297)
149	United Parcel Service Inc 'B'	BNP Paribas	(203)
106	United Parcel Service Inc 'B'	Citibank	(426)
1,496	United Parcel Service Inc 'B'	Goldman Sachs	(2,035)
368	United Parcel Service Inc 'B'	HSBC	(2,539)
203	United Parcel Service Inc 'B'	JP Morgan	(1,401)
119	United Rentals Inc	BNP Paribas	176
190	United Rentals Inc	HSBC	(471)
(141)	United Therapeutics Corp	BNP Paribas	795
(174)	United Therapeutics Corp	JP Morgan	296
(71)	UnitedHealth Group Inc	Barclays Bank	144
(104)	UnitedHealth Group Inc	Citibank	211
(58)	UnitedHealth Group Inc	Goldman Sachs	480
(25)	UnitedHealth Group Inc	HSBC	351
(2,365)	Unity Software Inc	Barclays Bank	2,152
(1,099)	Unity Software Inc	BNP Paribas	824
(1,048)	Unity Software Inc	Citibank	(1,486)
149	Universal Health Services Inc 'B'	BNP Paribas	(1,287)
(373)	US Bancorp	Bank of America Merrill Lynch	(190)
(1,065)	US Bancorp	Barclays Bank	665
(1,243)	US Bancorp	BNP Paribas	(634)
(338)	US Bancorp	Citibank	116
(1,316)	US Bancorp	Goldman Sachs	(671)
(278)	US Bancorp	HSBC	(117)
(56)	Vail Resorts Inc	BNP Paribas	152

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(160)	Vail Resorts Inc	Goldman Sachs	434
(163)	Valero Energy Corp	BNP Paribas	800
(80)	Valero Energy Corp	Goldman Sachs	393
56	Veeva Systems Inc 'A'	Bank of America Merrill Lynch	(637)
703	Veeva Systems Inc 'A'	Barclays Bank	(105)
104	Veeva Systems Inc 'A'	BNP Paribas	(1,182)
144	Veeva Systems Inc 'A'	Citibank	(22)
305	Veeva Systems Inc 'A'	Goldman Sachs	(3,468)
162	Veeva Systems Inc 'A'	HSBC	(1,996)
240	Veeva Systems Inc 'A'	JP Morgan	(2,957)
187	VeriSign Inc	Bank of America Merrill Lynch	(264)
1,591	VeriSign Inc	Barclays Bank	(4,808)
584	VeriSign Inc	BNP Paribas	(823)
174	VeriSign Inc	Citibank	(133)
1,017	VeriSign Inc	Goldman Sachs	(1,434)
176	VeriSign Inc	HSBC	847
132	VeriSign Inc	JP Morgan	635
60	Verisk Analytics Inc	Barclays Bank	(8)
166	Verisk Analytics Inc	BNP Paribas	518
56	Verisk Analytics Inc	HSBC	447
(2,118)	Verizon Communications Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,156
(627)	Verizon Communications Inc	Barclays Bank	426
(2,925)	Verizon Communications Inc	BNP Paribas	4,358
(934)	Verizon Communications Inc	Citibank	635
(2,839)	Verizon Communications Inc	Goldman Sachs	4,230
(1,232)	Verizon Communications Inc	HSBC	3,142
104	Vertex Pharmaceuticals Inc	Bank of America Merrill Lynch	(2,548)
444	Vertex Pharmaceuticals Inc	Barclays Bank	(4,297)
657	Vertex Pharmaceuticals Inc	BNP Paribas	(16,097)
171	Vertex Pharmaceuticals Inc	Citibank	(2,522)
110	Vertex Pharmaceuticals Inc	Goldman Sachs	(2,695)
309	Vertex Pharmaceuticals Inc	HSBC	(6,161)
(445)	VF Corp	Bank of America Merrill Lynch	1,940
(2,548)	VF Corp	Barclays Bank	1,569
(907)	VF Corp	BNP Paribas	3,955
(820)	VF Corp	Goldman Sachs	3,575
1,022	Viatris Inc	Barclays Bank	(368)
1,071	Visa Inc 'A'	Barclays Bank	(10,444)
126	Visa Inc 'A'	BNP Paribas	(1,952)
73	Visa Inc 'A'	Citibank	(1,019)
210	Visa Inc 'A'	JP Morgan	(3,131)
(466)	Vulcan Materials Co	Barclays Bank	1,118
(81)	Vulcan Materials Co	Citibank	194
(27)	Vulcan Materials Co	HSBC	(55)
(1,079)	W R Berkley Corp	Bank of America Merrill Lynch	2,892

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(672)	W R Berkley Corp	Barclays Bank	1,364
(1,104)	W R Berkley Corp	BNP Paribas	2,959
(780)	W R Berkley Corp	Goldman Sachs	2,090
(938)	W R Berkley Corp	HSBC	2,223
(965)	Walgreens Boots Alliance Inc	Barclays Bank	51
(1,133)	Walgreens Boots Alliance Inc	Citibank	888
260	Walmart Inc	Barclays Bank	(384)
231	Walmart Inc	BNP Paribas	(1,545)
184	Walmart Inc	Citibank	(405)
700	Walmart Inc	JP Morgan	(5,271)
(37)	Walt Disney Co	Bank of America Merrill Lynch	195
(300)	Walt Disney Co	Barclays Bank	1,269
(1,715)	Walt Disney Co	BNP Paribas	9,038
(415)	Walt Disney Co	HSBC	6,383
(2,219)	Warner Bros Discovery Inc	Bank of America Merrill Lynch	3,018
(4,083)	Warner Bros Discovery Inc	Barclays Bank	2,899
(5,762)	Warner Bros Discovery Inc	BNP Paribas	7,836
(5,188)	Warner Bros Discovery Inc	Goldman Sachs	7,056
(1,157)	Warner Bros Discovery Inc	JP Morgan	2,326
(87)	Waste Connections Inc	Bank of America Merrill Lynch	567
(1,592)	Waste Connections Inc	Barclays Bank	3,502
(947)	Waste Connections Inc	BNP Paribas	6,174
(207)	Waste Connections Inc	Citibank	455
(729)	Waste Connections Inc	Goldman Sachs	4,753
(220)	Waste Connections Inc	HSBC	1,058
(1,909)	Waste Management Inc	Bank of America Merrill Lynch	12,237
(437)	Waste Management Inc	Barclays Bank	608
(539)	Waste Management Inc	BNP Paribas	3,455
(213)	Waste Management Inc	Citibank	1
(652)	Waste Management Inc	Goldman Sachs	4,179
(603)	Waste Management Inc	HSBC	4,137
33	Waters Corp	Bank of America Merrill Lynch	(751)
740	Waters Corp	Barclays Bank	(12,772)
69	Waters Corp	BNP Paribas	(1,570)
302	Waters Corp	Goldman Sachs	(6,871)
193	Waters Corp	HSBC	(8,868)
(552)	Webster Financial Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,430)
(725)	Webster Financial Corp	Barclays Bank	397
(262)	Webster Financial Corp	BNP Paribas	(679)
(834)	Webster Financial Corp	Citibank	854
(260)	Webster Financial Corp	HSBC	(725)
(1,634)	Wells Fargo & Co	Barclays Bank	1,585
117	West Pharmaceutical Services Inc	Barclays Bank	(2,221)
56	West Pharmaceutical Services Inc	BNP Paribas	(1,301)
61	West Pharmaceutical Services Inc	Goldman Sachs	(1,418)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
7	West Pharmaceutical Services Inc	HSBC	(246)
(1,004)	Western Digital Corp	Bank of America Merrill Lynch	(2,159)
(159)	Western Digital Corp	Barclays Bank	(84)
(1,435)	Western Digital Corp	BNP Paribas	(3,085)
(230)	Western Digital Corp	Citibank	(122)
(247)	Western Digital Corp	Goldman Sachs	(531)
(460)	Western Digital Corp	HSBC	(2,171)
723	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	Bank of America Merrill Lynch	(4,150)
660	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	Barclays Bank	(3,749)
1,703	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	BNP Paribas	(9,775)
393	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	Goldman Sachs	(2,256)
435	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	HSBC	(2,941)
150	Westlake Corp	Bank of America Merrill Lynch	(1,469)
333	Westlake Corp	Barclays Bank	(1,769)
866	Westlake Corp	BNP Paribas	(8,478)
472	Westlake Corp	Citibank	(4,552)
85	Westlake Corp	Goldman Sachs	(832)
88	Westlake Corp	JP Morgan	(1,155)
(1,805)	Westrock Co	HSBC	271
1,084	Whirlpool Corp	Barclays Bank	(2,862)
196	Whirlpool Corp	BNP Paribas	(490)
(2,447)	Williams Cos Inc	Barclays Bank	896
(6,917)	Williams Cos Inc	BNP Paribas	4,289
(344)	Williams Cos Inc	Citibank	90
(3,821)	Williams Cos Inc	Goldman Sachs	2,369
(509)	Williams Cos Inc	HSBC	550
(116)	Willis Towers Watson Plc	BNP Paribas	1,353
(297)	Wix.com Ltd	Barclays Bank	927
(283)	Wolfspeed Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,869)
(1,537)	Wolfspeed Inc	Barclays Bank	(3,435)
(1,005)	Wolfspeed Inc	BNP Paribas	(6,638)
(756)	Wolfspeed Inc	Citibank	(1,690)
(2,887)	Wolfspeed Inc	Goldman Sachs	(19,069)
(293)	Wolfspeed Inc	HSBC	(2,126)
(158)	Wolfspeed Inc	JP Morgan	(1,146)
280	Workday Inc 'A'	Barclays Bank	3,483
397	Workday Inc 'A'	BNP Paribas	9,286
545	Workday Inc 'A'	Goldman Sachs	12,748
236	Workday Inc 'A'	HSBC	6,903
174	WW Grainger Inc	Barclays Bank	(1,853)
23	WW Grainger Inc	BNP Paribas	(472)
19	WW Grainger Inc	Citibank	(127)
25	WW Grainger Inc	Goldman Sachs	(513)
388	WW Grainger Inc	HSBC	(11,004)
12	WW Grainger Inc	JP Morgan	(340)

保有高	銘柄	取引相手	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
	米国(続き)		
(671)	Wynn Resorts Ltd	Barclays Bank	7,314
(411)	Wynn Resorts Ltd	BNP Paribas	3,370
(440)	Wynn Resorts Ltd	Goldman Sachs	3,608
(93)	Wynn Resorts Ltd	JP Morgan	1,418
143	Xylem Inc	Bank of America Merrill Lynch	(569)
978	Xylem Inc	Barclays Bank	(2,571)
221	Xylem Inc	BNP Paribas	(880)
343	Xylem Inc	Citibank	(424)
225	Xylem Inc	JP Morgan	(1,435)
3,107	Yum! Brands Inc	Barclays Bank	(23,458)
1,157	Yum! Brands Inc	BNP Paribas	(12,056)
1,404	Yum! Brands Inc	Citibank	(9,007)
2,121	Yum! Brands Inc	Goldman Sachs	(22,101)
206	Yum! Brands Inc	HSBC	(1,889)
274	Yum! Brands Inc	JP Morgan	(2,513)
(34)	Zebra Technologies Corp 'A'	Bank of America Merrill Lynch	270
(37)	Zebra Technologies Corp 'A'	Barclays Bank	(51)
(86)	Zebra Technologies Corp 'A'	BNP Paribas	684
(175)	Zebra Technologies Corp 'A'	Citibank	890
(152)	Zebra Technologies Corp 'A'	Goldman Sachs	1,208
(30)	Zebra Technologies Corp 'A'	HSBC	453
(455)	Zillow Group Inc 'C'	Bank of America Merrill Lynch	150
(242)	Zillow Group Inc 'C'	BNP Paribas	80
(234)	Zillow Group Inc 'C'	Goldman Sachs	77
552	Zimmer Biomet Holdings Inc	Barclays Bank	(5,702)
163	Zimmer Biomet Holdings Inc	BNP Paribas	(1,936)
67	Zimmer Biomet Holdings Inc	HSBC	(838)
106	Zoetis Inc	BNP Paribas	(2,549)
80	Zoetis Inc	Goldman Sachs	(1,924)
216	Zoetis Inc	HSBC	(5,415)
214	Zoom Video Communications Inc 'A'	HSBC	469
(1,461)	ZoomInfo Technologies Inc	Bank of America Merrill Lynch	(4,697)
(751)	ZoomInfo Technologies Inc	Barclays Bank	199
(6,403)	ZoomInfo Technologies Inc	BNP Paribas	(20,586)
(1,761)	ZoomInfo Technologies Inc	Goldman Sachs	(5,662)
(116)	Zscaler Inc	Bank of America Merrill Lynch	(1,611)
(173)	Zscaler Inc	Barclays Bank	(1,206)
			<u>412,849</u>
合計(基礎となるエクスポージャー総額 - 274,989,187米ドル)			<u>1,346,272</u>

0.5米ドル未満の金額は端数切捨てによりゼロとして表示されている。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現純評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
金融デリバティブ商品						
スワップ						
CCIRS	USD 1,250,000	ファンドは0.537%の固定金利を受け取り、USD12ヶ月SOFRの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/10/2030	(232,807)	(232,807)
CCIRS	THB 18,644,000	ファンドは2.135%の固定金利を受け取り、THB 3ヶ月THORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2028	(3,437)	(3,431)
CCIRS	THB 19,272,000	ファンドは2.354%の固定金利を受け取り、THB 3ヶ月THORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2028	2,212	2,218
CCIRS	THB 78,271,000	ファンドは2.505%の固定金利を受け取り、THB 3ヶ月THORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2028	25,035	25,060
CCIRS	EUR 451,000	ファンドは2.884%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2028	(13)	(1,620)
CCIRS	EUR 480,000	ファンドは2.910%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2028	(1,113)	(1,107)
CCIRS	EUR 680,000	ファンドは3.018%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2028	1,644	1,981
CCIRS	USD 804,000	ファンドは3.057%の固定金利を受け取り、USD12ヶ月SOFRの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2028	(11,695)	(11,838)
CCIRS	EUR 2,424,000	ファンドは3.127%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2028	28,516	19,891
CCIRS	CAD 656,000	ファンドは3.231%の固定金利を受け取り、CAD 3ヶ月CDORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2033	(15,512)	(17,117)
CCIRS	SEK 71,084,000	ファンドは3.234%の固定金利を受け取り、SEK 3ヶ月STIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2028	98,693	69,701
CCIRS	CAD 420,000	ファンドは3.245%の固定金利を受け取り、CAD 3ヶ月CDORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2033	(7,892)	(10,600)
CCIRS	USD 486,000	ファンドは3.248%の固定金利を受け取り、USD12ヶ月SOFRの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2028	(3,004)	(2,999)
CCIRS	EUR 556,000	ファンドは3.400%の固定金利を受け取り、EUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2028	11,912	11,918
CCIRS	USD 80,000	ファンドは3.673%の固定金利を受け取り、USD12ヶ月SOFRの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2028	1,418	1,035
CCIRS	CAD 16,835,000	ファンドは3.734%の固定金利を受け取り、CAD 3ヶ月CDORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2033	71,036	77,130
CCIRS	USD 444,000	ファンドは3.744%の固定金利を受け取り、USD12ヶ月SOFRの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2028	7,494	7,158
CCIRS	GBP 9,184,000	ファンドは3.779%の固定金利を受け取り、GBP12ヶ月SONIAの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2028	(275,355)	(302,434)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現純評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CCIRS	GBP 687,000	ファンドは3.817%の固定金利を受け取り、GBP12ヶ月SONIAの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2028	(20,484)	(21,214)
CCIRS	AUD 383,000	ファンドは3.964%の固定金利を受け取り、AUD 6ヶ月BBSWの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2033	(2,797)	(2,793)
CCIRS	AUD 124,000	ファンドは4.016%の固定金利を受け取り、AUD 6ヶ月BBSWの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2033	(693)	(561)
CCIRS	GBP 574,000	ファンドは4.087%の固定金利を受け取り、GBP12ヶ月SONIAの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2028	(8,110)	(9,460)
CCIRS	AUD 764,000	ファンドは4.118%の固定金利を受け取り、AUD 6ヶ月BBSWの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2033	704	695
CCIRS	HKD 37,381,028	ファンドは4.130%の固定金利を受け取り、HKD 3ヶ月HIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2028	94,295	94,349
CCIRS	HKD 8,460,020	ファンドは4.140%の固定金利を受け取り、HKD 3ヶ月HIBORの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2028	21,829	21,841
CCIRS	GBP 469,000	ファンドは4.498%の固定金利を受け取り、GBP12ヶ月SONIAの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2028	2,547	2,553
CCIRS	ZAR 7,806,000	ファンドは8.355%の固定金利を受け取り、ZAR 3ヶ月JIBARの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2028	(18,123)	(18,118)
CCIRS	ZAR 10,331,000	ファンドは8.385%の固定金利を受け取り、ZAR 3ヶ月JIBARの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2028	(23,376)	(23,370)
CCIRS	ZAR 7,000,000	ファンドは8.515%の固定金利を受け取り、ZAR 3ヶ月JIBARの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2028	(14,051)	(14,046)
CCIRS	ZAR 8,967,000	ファンドは9.360%の固定金利を受け取り、ZAR 3ヶ月JIBARの変動金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2028	(3,107)	(3,102)
CCIRS	AUD 690,000	ファンドはAUD 6ヶ月BBSWの変動金利を受け取り、3.608%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2028	4,326	4,331
CCIRS	AUD 155,000	ファンドはAUD 6ヶ月BBSWの変動金利を受け取り、3.717%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2028	536	483
CCIRS	AUD 1,396,000	ファンドはAUD 6ヶ月BBSWの変動金利を受け取り、3.811%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2028	654	529
CCIRS	CAD 1,540,000	ファンドはCAD 3ヶ月CDORの変動金利を受け取り、3.110%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2028	28,613	31,680
CCIRS	CAD 600,000	ファンドはCAD 3ヶ月CDORの変動金利を受け取り、3.192%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2028	8,727	10,729
CCIRS	CAD 860,000	ファンドはCAD 3ヶ月CDORの変動金利を受け取り、3.620%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2028	8,651	3,301

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現純評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CCIRS	CAD 30,002,000	ファンドはCAD 3ヶ月CDORの変動金利を受け取り、3.690%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2028	27,925	46,272
CCIRS	CNY 2,291,000	ファンドはCNY 3ヶ月CNRRの変動金利を受け取り、3.010%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2028	(7,386)	(7,382)
CCIRS	EUR 261,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、2.938%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2033	(471)	(466)
CCIRS	EUR 289,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、2.973%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2033	(1,593)	(1,452)
CCIRS	EUR 224,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、3.016%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2033	(1,999)	(1,995)
CCIRS	EUR 398,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、3.034%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2033	(4,242)	(4,234)
CCIRS	EUR 1,275,000	ファンドはEUR 6ヶ月EURIBORの変動金利を受け取り、3.220%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2033	(34,852)	(35,131)
CCIRS	GBP 236,000	ファンドはGBP12ヶ月SONIAの変動金利を受け取り、3.623%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2033	9,654	10,156
CCIRS	GBP 4,845,500	ファンドはGBP12ヶ月SONIAの変動金利を受け取り、3.632%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2033	165,583	204,359
CCIRS	GBP 300,000	ファンドはGBP12ヶ月SONIAの変動金利を受け取り、3.681%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2033	11,218	11,224
CCIRS	GBP 305,000	ファンドはGBP12ヶ月SONIAの変動金利を受け取り、3.886%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2033	4,745	5,290
CCIRS	GBP 255,000	ファンドはGBP12ヶ月SONIAの変動金利を受け取り、4.186%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2033	(3,061)	(3,055)
CCIRS	INR 408,824,890	ファンドはINR 6ヶ月MIBORの変動金利を受け取り、6.665%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2028	(137,462)	(137,407)
CCIRS KRW	1,092,749,000	ファンドはKRW 3ヶ月KWDCDの変動金利を受け取り、3.032%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2028	8,579	8,588
CCIRS	KRW 36,724,000	ファンドはKRW 3ヶ月KWDCDの変動金利を受け取り、3.055%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2028	260	260
CCIRS	KRW 668,300,000	ファンドはKRW 3ヶ月KWDCDの変動金利を受け取り、3.182%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2028	1,775	1,781
CCIRS	MXN 10,532,000	ファンドはMXN 1ヶ月TIIEの変動金利を受け取り、8.075%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	13/9/2028	3,498	3,505
CCIRS	MXN 7,610,000	ファンドはMXN 1ヶ月TIIEの変動金利を受け取り、8.185%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	13/9/2028	673	678

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現純評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
CCIRS	MXN 10,644,000	ファンドはMXN 1ヶ月TIIIEの変動金利を受け取り、8.880%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	13/9/2028	(15,452)	(15,445)
CCIRS	PLN 7,465,196	ファンドはPLN 6ヶ月WIBORの変動金利を受け取り、5.878%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2028	(48,414)	(48,395)
CCIRS	SEK 32,360,000	ファンドはSEK 3ヶ月STIBORの変動金利を受け取り、3.244%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2033	(108,946)	(94,327)
CCIRS	SEK 8,931,000	ファンドはSEK 3ヶ月STIBORの変動金利を受け取り、3.357%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2028	(17,309)	(13,340)
CCIRS	SGD 48,000	ファンドはSGD 6ヶ月SORAの変動金利を受け取り、2.880%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2028	6	7
CCIRS	USD 1,250,000	ファンドはUSD12ヶ月FEDLの変動金利を受け取り、0.555%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/10/2030	(10,057)	230,616
CCIRS	USD 424,000	ファンドはUSD12ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、3.032%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2033	10,104	10,112
CCIRS	USD 212,000	ファンドはUSD12ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、3.132%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2033	3,236	3,282
CCIRS	USD 433,000	ファンドはUSD12ヶ月SOFRの変動金利を受け取り、3.269%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	20/9/2033	1,755	1,763
TRS	KRW 1,046,384,625	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、KOSPI 200 Index Futuresを支払う	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2023	(41,714)	(41,714)
TRS	KRW 3,297,789,900	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、KOSPI 200 Index Futuresを支払う	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2023	(133,328)	(133,328)
TRS	KRW 1,008,923,175	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、KOSPI 200 Index Futuresを支払う	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2023	(69,939)	(69,939)
TRS	KRW 468,893,700	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、KOSPI 200 Index Futuresを支払う	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2023	(29,841)	(29,841)
TRS	KRW 237,493,125	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、KOSPI 200 Index Futuresを支払う	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2023	(12,625)	(12,625)
TRS	KRW 248,125,350	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、KOSPI 200 Index Futuresを支払う	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2023	(4,615)	(4,615)
TRS	KRW 573,010,375	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、KOSPI 200 Index Futuresを支払う	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2023	(15,249)	(15,249)
TRS	KRW 325,675,400	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、KOSPI 200 Index Futuresを支払う	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2023	(10,039)	(10,039)
TRS	KRW 407,094,250	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、KOSPI 200 Index Futuresを支払う	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2023	(12,549)	(12,549)

種類	想定金額	摘要	取引相手	満期日	未実現純評価 益/(損) (米ドル)	時価 (米ドル)
TRS	KRW 1,178,957,500	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、KOSPI 200 Index Futuresを支払う	Bank of America Merrill Lynch	8/6/2023	(5,683)	(5,683)
TRS	BRL 1,457,428	ファンドはIbovespa Index Futuresを受け取り、0.000%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	14/6/2023	13,663	13,663
TRS	BRL 2,166,429	ファンドはIbovespa Index Futuresを受け取り、0.000%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	14/6/2023	24,379	24,379
TRS	BRL 2,339,414	ファンドはIbovespa Index Futuresを受け取り、0.000%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	14/6/2023	(9,706)	(9,706)
TRS	THB 117,498,810	ファンドはSET50 Index Futuresを受け取り、0.000%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	29/6/2023	(145,155)	(145,155)
TRS	THB 90,605,268	ファンドはSET50 Index Futuresを受け取り、0.000%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	29/6/2023	(124,545)	(124,545)
TRS	THB 7,655,919	ファンドはSET50 Index Futuresを受け取り、0.000%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	29/6/2023	(2,816)	(2,816)
TRS	TWD 24,633,989	ファンドはTAIEX Index Futuresを受け取り、0.000%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/6/2023	56,848	56,848
TRS	TWD 43,862,963	ファンドはTAIEX Index Futuresを受け取り、0.000%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/6/2023	74,963	74,963
TRS	TWD 25,846,400	ファンドはTAIEX Index Futuresを受け取り、0.000%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/6/2023	17,392	17,392
TRS	TWD 26,187,236	ファンドはTAIEX Index Futuresを受け取り、0.000%の固定金利を支払う	Bank of America Merrill Lynch	21/6/2023	6,299	6,299
TRS	PLN 4,373,880	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、WIG20 Index Futuresを支払う	HSBC	16/6/2023	(83,382)	(83,382)
TRS	PLN 713,172	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、WIG20 Index Futuresを支払う	HSBC	16/6/2023	(13,094)	(13,094)
TRS	PLN 277,593	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、WIG20 Index Futuresを支払う	HSBC	16/6/2023	(7,044)	(7,044)
TRS	PLN 721,209	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、WIG20 Index Futuresを支払う	HSBC	16/6/2023	(20,250)	(20,250)
TRS	PLN 580,751	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、WIG20 Index Futuresを支払う	HSBC	16/6/2023	977	977
TRS	PLN 506,790	ファンドは0.000%の固定金利を受け取り、WIG20 Index Futuresを支払う	HSBC	16/6/2023	1,664	1,664
合計(基礎となるエクスポージャー総額 - 123,595,460米ドル)					(910,349)	(660,159)

CCIRS: 中央決済機関で決済される金利スワップ

TRS: トータル・リターン・スワップ

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

契約数	契約通貨	契約 / 摘要	満期日	基礎となる エクスポ ージャー総額 (米ドル)	未実現純評価益 / (損) (米ドル)
金融デリバティブ商品					
先物取引					
(29)	EUR	Amsterdam Index Futures June 2023	2023年6月	4,664,220	38,984
(25)	AUD	Australian 10 Year Bond Futures June 2023	2023年6月	1,942,286	(15,740)
78	EUR	CAC 40 Index Futures June 2023	2023年6月	5,934,852	(150,772)
(246)	CAD	Canadian 10 Year Bond Futures September 2023	2023年9月	22,236,717	21,974
(20)	EUR	DAX Index Futures June 2023	2023年6月	8,427,749	14,521
15	USD	E-Mini S&P 500 Index Futures June 2023	2023年6月	3,145,500	48,065
(89)	EUR	Euro Bund Futures June 2023	2023年6月	12,896,485	(118,090)
(75)	GBP	FTSE 100 Index Futures June 2023	2023年6月	6,951,115	263,205
122	USD	FTSE China A50 Futures June 2023	2023年6月	1,495,842	(33,327)
84	EUR	FTSE MIB Index Futures June 2023	2023年6月	11,774,184	(242,577)
17	ZAR	FTSE/JSE Top 40 Index Futures June 2023	2023年6月	607,428	7,596
(43)	EUR	IBEX 35 Index Futures June 2023	2023年6月	4,178,105	43,004
(15)	JPY	Japan 10 Year Bond Futures June 2023	2023年6月	15,902,686	(87,340)
(66)	USD	MSCI Hong Kong Index Futures June 2023	2023年6月	3,930,960	312,183
(11)	SGD	MSCI Singapore Index Futures June 2023	2023年6月	231,042	4,266
(54)	SEK	OMX Stockholm 30 Index Futures June 2023	2023年6月	1,118,050	4,996
(30)	CAD	S&P/TSX 60 Index Futures June 2023	2023年6月	5,200,690	106,717
(36)	USD	SGX NIFTY 50 Futures June 2023	2023年6月	1,343,808	(12,328)
(6)	AUD	SPI 200 Index Futures June 2023	2023年6月	690,014	10,118
6	CHF	Swiss Market Index Futures June 2023	2023年6月	742,431	(3,523)
124	JPY	Topix Index Futures June 2023	2023年6月	18,808,119	1,209,842
210	GBP	UK Long Gilt Bond Futures September 2023	2023年9月	25,078,235	282,167
297	USD	US Treasury 10 Year Note Futures September 2023	2023年9月	33,983,297	257,804
合計					1,961,745

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
金融デリバティブ商品						
未決済先渡為替予約						
AUD	922,000	USD	616,958	Deutsche Bank	21/6/2023	(19,166)
AUD	430,000	USD	288,648	JP Morgan	21/6/2023	(9,851)
BRL	446,000	USD	89,273	BNP Paribas	21/6/2023	(1,650)
BRL	6,101,000	USD	1,159,700	Goldman Sachs	21/6/2023	38,937
BRL	2,941,000	USD	576,360	JP Morgan	21/6/2023	1,445
BRL	207,000	USD	41,618	Standard Chartered Bank	21/6/2023	(950)
BRL	449,000	USD	89,435	BNP Paribas	19/7/2023	(1,679)
BRL	208,000	USD	41,553	Goldman Sachs	19/7/2023	(900)
BRL	909,000	USD	177,216	HSBC	19/7/2023	446
BRL	666,000	USD	130,623	JP Morgan	19/7/2023	(455)
BRL	2,818,000	USD	551,016	Morgan Stanley	19/7/2023	(246)
BRL	4,182,000	USD	821,127	Barclays Bank	16/8/2023	(8,103)
BRL	209,000	USD	41,521	Citibank	16/8/2023	(889)
CAD	103,000	USD	75,221	Bank of America Merrill Lynch	21/6/2023	439
CAD	833,000	USD	613,796	Barclays Bank	21/6/2023	(1,913)
CAD	309,000	USD	224,971	BNP Paribas	21/6/2023	2,007
CAD	698,000	USD	524,493	JP Morgan	21/6/2023	(11,774)
CAD	6,288,000	USD	4,618,680	Morgan Stanley	21/6/2023	196
CAD	3,398,000	USD	2,528,992	Barclays Bank	19/7/2023	(31,258)
CAD	698,000	USD	524,762	JP Morgan	19/7/2023	(11,691)
CAD	282,000	USD	207,525	Morgan Stanley	19/7/2023	(238)
CAD	580,000	USD	429,171	Standard Chartered Bank	19/7/2023	(2,836)
CAD	4,281,000	USD	3,206,194	HSBC	16/8/2023	(57,426)
CHF	341,000	EUR	347,276	Bank of America Merrill Lynch	21/6/2023	3,239
CHF	215,000	EUR	219,376	Morgan Stanley	21/6/2023	1,595
CHF	653,000	USD	736,577	Barclays Bank	21/6/2023	(19,510)
CLP	156,567,000	USD	191,222	BNP Paribas	22/6/2023	1,475
CLP	233,676,000	USD	286,987	Morgan Stanley	22/6/2023	614
CLP	67,409,000	USD	83,106	HSBC	19/7/2023	(444)
CNH	1,388,000	USD	201,493	Bank of America Merrill Lynch	21/6/2023	(6,476)
CNH	1,086,000	USD	158,279	Barclays Bank	21/6/2023	(5,694)
CNH	9,114,000	USD	1,319,098	BNP Paribas	21/6/2023	(38,567)
CNH	29,155,000	USD	4,212,698	JP Morgan	21/6/2023	(116,375)
CNH	1,385,000	USD	201,513	Bank of America Merrill Lynch	19/7/2023	(6,463)
CNH	1,083,000	USD	158,204	Barclays Bank	19/7/2023	(5,685)
CNH	8,689,000	USD	1,260,443	BNP Paribas	19/7/2023	(36,766)
CNH	8,776,000	USD	1,273,481	JP Morgan	19/7/2023	(37,551)
CNH	403,000	USD	58,432	Societe Generale	19/7/2023	(1,678)
CNH	2,913,000	USD	420,973	UBS	19/7/2023	(10,733)
CNH	1,436,000	USD	203,708	BNP Paribas	16/8/2023	(995)
CNH	3,003,000	USD	428,861	JP Morgan	16/8/2023	(4,942)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
CNH	2,906,000	USD	420,907	Morgan Stanley	16/8/2023	(10,682)
EUR	309,448	CHF	307,000	HSBC	21/6/2023	(6,340)
EUR	708,008	CHF	698,000	Morgan Stanley	21/6/2023	(9,665)
EUR	89,224	NOK	1,012,000	Bank of America Merrill Lynch	21/6/2023	4,585
EUR	226,000	USD	249,341	Australia and New Zealand Banking	21/6/2023	(7,761)
EUR	3,538,000	USD	3,799,413	Barclays Bank	21/6/2023	(17,508)
EUR	564,000	USD	619,937	BNP Paribas	21/6/2023	(17,055)
EUR	149,000	USD	164,495	Citibank	21/6/2023	(5,223)
EUR	1,291,000	USD	1,381,028	JP Morgan	21/6/2023	(1,029)
EUR	255,000	USD	279,553	Morgan Stanley	21/6/2023	(6,974)
EUR	225,000	USD	248,627	Barclays Bank	19/7/2023	(7,723)
EUR	563,000	USD	619,731	BNP Paribas	19/7/2023	(16,935)
EUR	149,000	USD	164,742	Citibank	19/7/2023	(5,210)
EUR	4,104,627	USD	4,505,451	HSBC	19/7/2023	(110,682)
EUR	750,000	USD	832,257	JP Morgan	19/7/2023	(29,242)
EUR	270,000	USD	296,577	Bank of America Merrill Lynch	16/8/2023	(7,040)
EUR	4,355,226	USD	4,808,431	UBS	16/8/2023	(138,053)
GBP	934,000	USD	1,160,357	Bank of America Merrill Lynch	21/6/2023	(3,682)
GBP	213,000	USD	265,805	Barclays Bank	21/6/2023	(2,024)
GBP	101,000	USD	125,809	BNP Paribas	21/6/2023	(729)
GBP	275,000	USD	341,259	Deutsche Bank	21/6/2023	(696)
GBP	2,939,000	USD	3,584,349	JP Morgan	21/6/2023	55,338
GBP	1,547,000	USD	1,925,698	Barclays Bank	19/7/2023	(8,796)
GBP	101,000	USD	125,865	BNP Paribas	19/7/2023	(715)
GBP	274,000	USD	340,202	Deutsche Bank	19/7/2023	(687)
GBP	652,000	USD	814,639	JP Morgan	19/7/2023	(6,739)
GBP	301,000	USD	377,656	Standard Chartered Bank	19/7/2023	(4,684)
GBP	274,000	USD	340,354	Deutsche Bank	16/8/2023	(692)
GBP	301,000	USD	377,799	HSBC	16/8/2023	(4,667)
GBP	347,000	USD	431,751	JP Morgan	16/8/2023	(1,596)
GBP	1,971,000	USD	2,490,066	Standard Chartered Bank	16/8/2023	(46,732)
HUF	42,496,000	USD	123,230	Barclays Bank	21/6/2023	(1,613)
HUF	104,000,000	USD	299,997	BNP Paribas	21/6/2023	(2,366)
HUF	234,834,000	USD	683,260	JP Morgan	21/6/2023	(11,203)
HUF	191,987,000	USD	532,842	UBS	21/6/2023	16,594
HUF	451,948,000	USD	1,273,318	Bank of America Merrill Lynch	19/7/2023	10,378
HUF	42,835,000	USD	123,234	Goldman Sachs	19/7/2023	(1,567)
HUF	296,654,000	USD	852,018	Morgan Stanley	16/8/2023	(15,273)
INR	34,406,000	USD	415,519	BNP Paribas	21/6/2023	322
INR	6,468,000	USD	77,744	Citibank	21/6/2023	430
INR	597,358,000	USD	7,249,402	Deutsche Bank	21/6/2023	(29,571)
INR	10,885,000	USD	132,373	JP Morgan	21/6/2023	(814)
INR	599,988,000	USD	7,275,404	Goldman Sachs	19/7/2023	(32,420)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現純評価益 /(損) (米ドル)	
INR	518,290,000	USD	6,282,798		HSBC	17/8/2023	(34,459)
JPY	17,597,000	USD	131,747	Bank of America Merrill Lynch		21/6/2023	(5,835)
JPY	118,074,000	USD	887,840	Barclays Bank		21/6/2023	(42,989)
JPY	45,122,000	USD	335,273	Deutsche Bank		21/6/2023	(12,413)
JPY	38,910,000	USD	298,334	Goldman Sachs		21/6/2023	(19,922)
JPY	23,098,000	USD	173,598	JP Morgan		21/6/2023	(8,326)
JPY	32,577,000	USD	248,790	Morgan Stanley		21/6/2023	(15,692)
JPY	21,087,000	USD	161,124	Standard Chartered Bank		21/6/2023	(10,241)
JPY	117,526,000	USD	887,513	Barclays Bank		19/7/2023	(42,894)
JPY	10,338,000	USD	77,300	Citibank		19/7/2023	(3,004)
JPY	161,502,000	USD	1,185,209	JP Morgan		19/7/2023	(24,548)
JPY	52,350,000	USD	393,680	Standard Chartered Bank		19/7/2023	(17,458)
JPY	32,135,000	USD	234,978	Barclays Bank		16/8/2023	(3,018)
JPY	15,774,000	USD	114,441	JP Morgan		16/8/2023	(580)
JPY	191,176,000	USD	1,416,168	Societe Generale		16/8/2023	(36,202)
JPY	20,350,000	USD	153,108	Standard Chartered Bank		16/8/2023	(6,215)
KRW	305,592,000	USD	229,934	Bank of America Merrill Lynch		21/6/2023	940
KRW	233,931,000	USD	182,212	Barclays Bank		21/6/2023	(5,478)
KRW	316,996,000	USD	241,221	HSBC		21/6/2023	(1,731)
KRW	94,444,000	USD	71,878	Morgan Stanley		21/6/2023	(525)
KRW	74,941,000	USD	56,279	Standard Chartered Bank		21/6/2023	339
KRW	621,345,000	USD	471,029	HSBC		19/7/2023	(867)
KRW	74,786,000	USD	56,266	UBS		19/7/2023	323
KRW	315,774,000	USD	241,141	HSBC		16/8/2023	(1,769)
KRW	74,675,000	USD	56,281	Morgan Stanley		16/8/2023	326
MXN	21,889,000	USD	1,188,182	Deutsche Bank		21/6/2023	45,300
MXN	14,547,000	USD	776,751	Goldman Sachs		21/6/2023	42,997
MXN	4,733,000	USD	263,367	JP Morgan		21/6/2023	3,345
MXN	13,465,000	USD	733,465	Morgan Stanley		21/6/2023	25,311
MXN	1,717,000	USD	95,391	Standard Chartered Bank		21/6/2023	1,365
MXN	1,370,000	USD	76,810	Goldman Sachs		19/7/2023	(42)
MXN	29,837,000	USD	1,617,742	HSBC		19/7/2023	54,195
MXN	4,758,000	USD	263,293	JP Morgan		19/7/2023	3,325
MXN	1,727,000	USD	95,393	Standard Chartered Bank		19/7/2023	1,381
MXN	4,264,000	USD	235,842	Barclays Bank		16/8/2023	1,816
MXN	1,378,000	USD	76,846	Goldman Sachs		16/8/2023	(42)
MXN	22,838,000	USD	1,259,647	HSBC		16/8/2023	13,253
MXN	1,736,000	USD	95,375	Standard Chartered Bank		16/8/2023	1,383
NOK	4,895,000	USD	473,403	Citibank		21/6/2023	(34,256)
NOK	2,079,000	USD	191,228	Goldman Sachs		21/6/2023	(4,713)
NOK	3,243,000	USD	302,216	Morgan Stanley		21/6/2023	(11,276)
NOK	4,378,000	USD	423,610	Citibank		19/7/2023	(30,324)
NOK	5,314,000	USD	493,215	Goldman Sachs		19/7/2023	(15,846)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
NOK	2,073,000	USD	191,057	Goldman Sachs	16/8/2023	(4,599)
NZD	1,064,000	USD	667,699	Bank of America Merrill Lynch	21/6/2023	(29,679)
NZD	165,000	USD	103,549	Barclays Bank	21/6/2023	(4,608)
NZD	871,000	USD	540,841	Deutsche Bank	21/6/2023	(18,552)
NZD	6,288,000	USD	3,892,714	Goldman Sachs	21/6/2023	(122,158)
NZD	3,299,000	USD	2,030,542	Morgan Stanley	21/6/2023	(52,319)
NZD	286,000	USD	179,775	Standard Chartered Bank	21/6/2023	(8,277)
NZD	5,798,000	USD	3,587,246	Australia and New Zealand Banking	19/7/2023	(110,855)
NZD	1,064,000	USD	667,618	Bank of America Merrill Lynch	19/7/2023	(29,660)
NZD	165,000	USD	103,520	Barclays Bank	19/7/2023	(4,588)
NZD	766,000	USD	465,645	Goldman Sachs	19/7/2023	(6,364)
NZD	3,212,000	USD	1,977,100	Morgan Stanley	19/7/2023	(51,235)
NZD	633,000	USD	395,856	Bank of America Merrill Lynch	16/8/2023	(16,361)
NZD	165,000	USD	103,478	Barclays Bank	16/8/2023	(4,558)
NZD	766,000	USD	465,584	Goldman Sachs	16/8/2023	(6,353)
NZD	8,316,000	USD	5,209,759	Morgan Stanley	16/8/2023	(224,165)
PLN	250,000	USD	56,505	Barclays Bank	21/6/2023	2,279
PLN	912,000	USD	218,645	Citibank	21/6/2023	(4,201)
PLN	380,000	USD	91,303	JP Morgan	21/6/2023	(1,952)
PLN	4,810,000	USD	1,120,211	Morgan Stanley	21/6/2023	10,792
PLN	2,690,000	USD	624,329	UBS	21/6/2023	8,187
PLN	3,448,000	USD	801,531	Goldman Sachs	19/7/2023	7,993
PLN	190,000	USD	45,582	JP Morgan	19/7/2023	(973)
PLN	2,110,000	USD	500,693	Morgan Stanley	19/7/2023	(5,306)
PLN	1,161,000	USD	273,809	UBS	19/7/2023	(1,229)
PLN	2,241,000	USD	537,043	Barclays Bank	16/8/2023	(11,638)
PLN	914,000	USD	218,455	Goldman Sachs	16/8/2023	(4,167)
PLN	1,199,000	USD	282,207	Morgan Stanley	16/8/2023	(1,101)
SEK	17,179,000	USD	1,663,189	Goldman Sachs	21/6/2023	(81,092)
SEK	1,895,000	USD	183,136	HSBC	21/6/2023	(8,617)
SEK	1,237,000	USD	114,928	JP Morgan	21/6/2023	(1,007)
SEK	5,252,000	USD	502,764	Morgan Stanley	21/6/2023	(19,083)
SEK	2,134,000	USD	198,571	BNP Paribas	19/7/2023	(1,749)
SEK	2,500,000	USD	237,366	Citibank	19/7/2023	(6,788)
SEK	509,000	USD	50,197	Morgan Stanley	19/7/2023	(3,251)
SEK	3,307,000	USD	323,652	Societe Generale	19/7/2023	(18,643)
SEK	2,131,000	USD	198,577	BNP Paribas	16/8/2023	(1,748)
SEK	2,500,000	USD	237,683	Citibank	16/8/2023	(6,771)
SGD	101,000	USD	75,982	Australia and New Zealand Banking	21/6/2023	(1,337)
SGD	2,058,000	USD	1,545,753	Goldman Sachs	21/6/2023	(24,765)
SGD	2,055,000	USD	1,545,229	Goldman Sachs	19/7/2023	(24,884)
THB	9,748,000	USD	285,087	Barclays Bank	21/6/2023	(4,442)
THB	12,113,000	USD	356,943	Deutsche Bank	21/6/2023	(8,209)
THB	12,633,000	USD	371,092	Goldman Sachs	21/6/2023	(7,388)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
THB	91,038,000	USD	2,658,044	Morgan Stanley	21/6/2023	(37,057)
THB	48,965,000	USD	1,442,925	Standard Chartered Bank	21/6/2023	(33,222)
THB	7,746,000	USD	223,337	UBS	21/6/2023	(330)
THB	4,123,000	USD	122,145	Deutsche Bank	19/7/2023	(3,109)
THB	14,957,000	USD	438,953	Goldman Sachs	19/7/2023	(7,126)
THB	7,722,000	USD	223,283	HSBC	19/7/2023	(339)
THB	124,171,000	USD	3,659,986	JP Morgan	19/7/2023	(75,011)
THB	7,955,000	USD	234,598	Societe Generale	19/7/2023	(4,927)
THB	8,308,000	USD	242,357	Standard Chartered Bank	19/7/2023	(2,494)
THB	140,657,000	USD	4,218,444	BNP Paribas	16/8/2023	(146,047)
THB	4,630,000	USD	134,699	Goldman Sachs	16/8/2023	(648)
THB	7,699,000	USD	223,236	HSBC	16/8/2023	(329)
THB	8,285,000	USD	242,251	Standard Chartered Bank	16/8/2023	(2,379)
TWD	4,280,000	USD	142,593	Bank of America Merrill Lynch	21/6/2023	(3,255)
TWD	12,658,000	USD	418,045	BNP Paribas	21/6/2023	(5,954)
TWD	2,404,000	USD	79,550	JP Morgan	21/6/2023	(1,286)
TWD	37,825,000	USD	1,264,416	Morgan Stanley	21/6/2023	(32,993)
TWD	9,952,000	USD	327,999	Standard Chartered Bank	21/6/2023	(4,004)
TWD	1,276,000	USD	41,727	Barclays Bank	19/7/2023	(76)
TWD	1,272,000	USD	41,723	HSBC	16/8/2023	(75)
USD	1,655,327	AUD	2,506,000	Bank of America Merrill Lynch	21/6/2023	30,525
USD	695,339	AUD	1,041,000	Barclays Bank	21/6/2023	20,392
USD	686,925	AUD	1,016,000	Deutsche Bank	21/6/2023	28,185
USD	72,029	AUD	107,000	JP Morgan	21/6/2023	2,654
USD	4,249,993	AUD	6,330,000	Morgan Stanley	21/6/2023	145,846
USD	73,528	AUD	110,000	Standard Chartered Bank	21/6/2023	2,208
USD	811,248	AUD	1,243,000	Bank of America Merrill Lynch	19/7/2023	4,485
USD	301,606	AUD	461,000	Barclays Bank	19/7/2023	2,396
USD	5,361,586	AUD	8,009,000	Morgan Stanley	19/7/2023	163,380
USD	72,115	AUD	107,000	Standard Chartered Bank	19/7/2023	2,667
USD	810,827	AUD	1,241,000	Bank of America Merrill Lynch	16/8/2023	4,537
USD	301,929	AUD	461,000	Barclays Bank	16/8/2023	2,413
USD	291,714	AUD	438,000	Morgan Stanley	16/8/2023	7,141
USD	5,268,647	AUD	7,763,000	Standard Chartered Bank	16/8/2023	224,948
USD	162,250	BRL	823,000	Bank of America Merrill Lynch	21/6/2023	559
USD	53,900	BRL	290,000	Barclays Bank	21/6/2023	(3,075)
USD	101,132	BRL	506,000	BNP Paribas	21/6/2023	1,720
USD	621,749	BRL	3,233,000	Goldman Sachs	21/6/2023	(13,424)
USD	232,883	BRL	1,254,000	JP Morgan	21/6/2023	(13,485)
USD	381,694	BRL	1,904,000	Standard Chartered Bank	21/6/2023	7,624
USD	100,938	BRL	508,000	BNP Paribas	19/7/2023	1,651

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
USD	119,766	BRL	601,000	Citibank	19/7/2023	2,302
USD	162,074	BRL	827,000	Goldman Sachs	19/7/2023	439
USD	261,895	BRL	1,313,000	Standard Chartered Bank	19/7/2023	5,273
USD	119,723	BRL	604,000	Citibank	16/8/2023	2,299
USD	162,017	BRL	831,000	Goldman Sachs	16/8/2023	462
USD	261,848	BRL	1,320,000	Standard Chartered Bank	16/8/2023	5,227
USD	1,456,952	CAD	1,980,000	BNP Paribas	21/6/2023	2,535
USD	1,902,142	CAD	2,563,000	Goldman Sachs	21/6/2023	19,480
USD	544,673	CAD	734,000	JP Morgan	21/6/2023	5,510
USD	223,763	CAD	304,000	Morgan Stanley	21/6/2023	459
USD	169,370	CAD	230,000	BNP Paribas	19/7/2023	306
USD	755,615	CAD	1,017,000	Goldman Sachs	19/7/2023	8,059
USD	544,279	CAD	733,000	JP Morgan	19/7/2023	5,480
USD	223,922	CAD	304,000	Morgan Stanley	19/7/2023	464
USD	168,745	CAD	229,000	BNP Paribas	16/8/2023	311
USD	329,900	CAD	445,000	Goldman Sachs	16/8/2023	2,593
USD	543,839	CAD	732,000	JP Morgan	16/8/2023	5,437
USD	224,064	CAD	304,000	Morgan Stanley	16/8/2023	466
USD	531,126	CHF	489,000	Goldman Sachs	21/6/2023	(5,850)
USD	86,154	CLP	69,001,000	Bank of America Merrill Lynch	22/6/2023	1,230
USD	185,373	CLP	151,075,000	Barclays Bank	22/6/2023	(564)
USD	389,128	CLP	309,985,000	BNP Paribas	22/6/2023	7,609
USD	107,550	CLP	88,402,000	Goldman Sachs	22/6/2023	(1,252)
USD	78,494	CLP	65,394,000	JP Morgan	22/6/2023	(1,991)
USD	1,030,410	CLP	830,586,000	Morgan Stanley	22/6/2023	8,153
USD	211,480	CLP	171,227,000	Bank of America Merrill Lynch	19/7/2023	1,508
USD	158,546	CLP	129,016,000	Barclays Bank	19/7/2023	336
USD	1,108,935	CLP	894,251,000	Morgan Stanley	19/7/2023	12,331
USD	211,517	CLP	171,889,000	Barclays Bank	16/8/2023	1,425
USD	342,199	CLP	273,841,000	Citibank	16/8/2023	7,497
USD	841,767	CLP	679,714,000	HSBC	16/8/2023	10,987
USD	102,177	CNH	701,000	Bank of America Merrill Lynch	21/6/2023	3,685
USD	2,788,630	CNH	18,986,000	BNP Paribas	21/6/2023	121,068
USD	2,438,305	CNH	16,792,000	HSBC	21/6/2023	79,003
USD	314,357	CNH	2,151,000	Morgan Stanley	21/6/2023	12,138
USD	3,098,410	CNH	21,186,000	Morgan Stanley	19/7/2023	114,772
USD	737,390	CNH	5,070,000	Morgan Stanley	16/8/2023	21,683
USD	550,965	EUR	508,000	Bank of America Merrill Lynch	21/6/2023	7,944
USD	1,323,358	EUR	1,205,000	Barclays Bank	21/6/2023	35,286
USD	675,498	EUR	629,000	Deutsche Bank	21/6/2023	3,136
USD	22,851	EUR	21,000	Goldman Sachs	21/6/2023	403
USD	786,948	EUR	727,000	Morgan Stanley	21/6/2023	9,830
USD	78,785	EUR	74,000	Standard Chartered Bank	21/6/2023	(317)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
USD	1,323,126	EUR	1,203,000	Barclays Bank	19/7/2023	35,089
USD	787,095	EUR	726,000	Morgan Stanley	19/7/2023	9,776
USD	427,572	EUR	397,000	Barclays Bank	16/8/2023	1,844
USD	787,151	EUR	725,000	Morgan Stanley	16/8/2023	9,689
USD	851,033	GBP	687,000	BNP Paribas	21/6/2023	246
USD	241,221	GBP	199,000	Morgan Stanley	21/6/2023	(5,223)
USD	874,641	GBP	701,000	Standard Chartered Bank	21/6/2023	6,516
USD	520,521	HKD	4,071,000	HSBC	21/6/2023	605
USD	766,312	HUF	271,141,000	Barclays Bank	21/6/2023	(9,650)
USD	166,216	HUF	57,212,000	Goldman Sachs	21/6/2023	2,484
USD	136,766	HUF	46,794,000	UBS	21/6/2023	2,849
USD	253,797	HUF	89,989,000	Barclays Bank	19/7/2023	(1,805)
USD	99,410	HUF	35,000,000	BNP Paribas	19/7/2023	(3)
USD	166,171	HUF	57,636,000	Goldman Sachs	19/7/2023	2,464
USD	312,754	HUF	108,635,000	UBS	19/7/2023	4,191
USD	98,754	HUF	35,000,000	Barclays Bank	16/8/2023	32
USD	174,828	HUF	61,500,000	UBS	16/8/2023	1,361
USD	189,131	INR	15,496,000	Bank of America Merrill Lynch	21/6/2023	1,842
USD	388,183	INR	32,165,862	BNP Paribas	21/6/2023	(582)
USD	389,766	INR	31,998,000	HSBC	21/6/2023	3,028
USD	436,259	INR	35,872,000	Morgan Stanley	21/6/2023	2,701
USD	678,970	INR	56,068,138	Standard Chartered Bank	21/6/2023	1,315
USD	478,217	INR	39,311,000	BNP Paribas	19/7/2023	3,660
USD	677,006	INR	56,010,000	HSBC	19/7/2023	859
USD	198,048	INR	16,256,000	Morgan Stanley	19/7/2023	1,807
USD	135,709	INR	11,185,000	UBS	19/7/2023	685
USD	338,426	INR	28,144,000	HSBC	17/8/2023	(869)
USD	135,699	INR	11,201,000	Morgan Stanley	17/8/2023	663
USD	85,664	JPY	11,024,000	Goldman Sachs	21/6/2023	6,784
USD	221,061	JPY	29,529,000	JP Morgan	21/6/2023	9,773
USD	133,857	JPY	18,658,000	Standard Chartered Bank	21/6/2023	354
USD	624,736	JPY	82,632,000	Bank of America Merrill Lynch	19/7/2023	30,888
USD	133,825	JPY	18,570,000	Standard Chartered Bank	19/7/2023	369
USD	133,807	JPY	18,485,000	Standard Chartered Bank	16/8/2023	377
USD	666,325	KRW	874,308,672	Bank of America Merrill Lynch	21/6/2023	5,788
USD	3,526,932	KRW	4,574,565,612	JP Morgan	21/6/2023	70,857
USD	952,549	KRW	1,255,629,865	Morgan Stanley	21/6/2023	3,924
USD	65,971	KRW	87,564,851	Standard Chartered Bank	21/6/2023	(184)
USD	306,908	KRW	409,759,000	Bank of America Merrill Lynch	19/7/2023	(3,152)
USD	369,151	KRW	487,130,000	BNP Paribas	19/7/2023	546
USD	51,511	KRW	66,617,000	Societe Generale	19/7/2023	1,103
USD	3,951,242	KRW	5,217,381,000	Standard Chartered Bank	19/7/2023	3,322

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
USD	220,616	KRW	290,279,000	UBS	19/7/2023	966
USD	4,456,764	KRW	5,866,697,000	BNP Paribas	16/8/2023	9,532
USD	44,755	KRW	59,156,000	Standard Chartered Bank	16/8/2023	(88)
USD	220,584	KRW	289,739,000	UBS	16/8/2023	948
USD	578,808	MXN	10,561,000	Barclays Bank	21/6/2023	(16,322)
USD	117,614	MXN	2,158,000	Citibank	21/6/2023	(3,993)
USD	287,360	MXN	5,207,000	Goldman Sachs	21/6/2023	(6,064)
USD	491,037	MXN	9,029,000	JP Morgan	21/6/2023	(17,763)
USD	432,382	MXN	7,949,000	JP Morgan	19/7/2023	(13,047)
USD	307,261	NOK	3,283,000	Bank of America Merrill Lynch	21/6/2023	12,731
USD	147,088	NOK	1,536,000	BNP Paribas	21/6/2023	9,288
USD	232,531	NOK	2,464,000	Citibank	21/6/2023	11,476
USD	190,332	NOK	1,976,000	Goldman Sachs	21/6/2023	13,058
USD	4,657,680	NOK	48,434,000	Morgan Stanley	21/6/2023	312,498
USD	298,450	NOK	3,210,000	Bank of America Merrill Lynch	19/7/2023	10,088
USD	232,442	NOK	2,460,000	Citibank	19/7/2023	11,455
USD	4,714,032	NOK	49,555,000	Goldman Sachs	19/7/2023	262,392
USD	189,321	NOK	1,996,000	Morgan Stanley	19/7/2023	10,016
USD	212,402	NOK	2,265,000	Bank of America Merrill Lynch	16/8/2023	8,675
USD	86,130	NOK	942,000	Citibank	16/8/2023	1,401
USD	4,376,052	NOK	45,845,000	JP Morgan	16/8/2023	252,488
USD	374,446	NZD	600,000	Citibank	21/6/2023	14,660
USD	359,249	NZD	576,000	JP Morgan	21/6/2023	13,855
USD	454,881	NZD	734,000	Morgan Stanley	21/6/2023	14,743
USD	103,223	NZD	167,000	Standard Chartered Bank	21/6/2023	3,083
USD	374,375	NZD	600,000	Citibank	19/7/2023	14,624
USD	224,748	NZD	361,000	Morgan Stanley	19/7/2023	8,297
USD	60,116	NZD	98,000	Standard Chartered Bank	19/7/2023	1,357
USD	447,931	PLN	1,919,000	Goldman Sachs	21/6/2023	(3,295)
USD	346,923	PLN	1,548,000	HSBC	21/6/2023	(17,068)
USD	735,569	PLN	3,074,000	Morgan Stanley	21/6/2023	12,762
USD	282,547	PLN	1,178,000	BNP Paribas	19/7/2023	5,976
USD	131,201	PLN	549,000	Goldman Sachs	19/7/2023	2,306
USD	636,054	PLN	2,677,000	Morgan Stanley	19/7/2023	7,547
USD	282,607	PLN	1,180,000	BNP Paribas	16/8/2023	5,955
USD	140,241	PLN	592,000	Morgan Stanley	16/8/2023	1,446
USD	1,483,118	SEK	15,404,000	Bank of America Merrill Lynch	21/6/2023	64,488
USD	42,548	SEK	462,000	Citibank	21/6/2023	-
USD	371,560	SEK	3,801,000	Deutsche Bank	21/6/2023	21,507
USD	458,897	SEK	4,731,000	Goldman Sachs	21/6/2023	23,196
USD	481,416	SEK	4,920,000	JP Morgan	21/6/2023	28,309
USD	42,521	SEK	461,000	Citibank	19/7/2023	2
USD	458,746	SEK	4,723,000	Goldman Sachs	19/7/2023	23,137

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
USD	695,425	SEK	7,225,000	HSBC	19/7/2023	29,053
USD	42,489	SEK	460,000	Citibank	16/8/2023	2
USD	796,435	SEK	8,055,000	Morgan Stanley	16/8/2023	52,437
USD	341,088	SGD	452,000	Bank of America Merrill Lynch	21/6/2023	7,032
USD	497,772	SGD	667,000	Barclays Bank	21/6/2023	4,819
USD	2,691,837	SGD	3,566,000	BNP Paribas	21/6/2023	56,344
USD	164,910	SGD	219,000	HSBC	21/6/2023	3,056
USD	359,352	SGD	482,000	JP Morgan	21/6/2023	3,124
USD	3,692,553	SGD	4,950,000	Morgan Stanley	21/6/2023	34,201
USD	558,677	SGD	755,000	Standard Chartered Bank	21/6/2023	686
USD	259,904	SGD	351,000	Barclays Bank	19/7/2023	225
USD	2,773,433	SGD	3,670,000	BNP Paribas	19/7/2023	58,269
USD	4,681,164	SGD	6,218,000	Citibank	19/7/2023	80,920
USD	442,471	SGD	592,000	JP Morgan	19/7/2023	4,495
USD	259,468	SGD	350,000	Barclays Bank	16/8/2023	241
USD	233,977	SGD	314,000	BNP Paribas	16/8/2023	1,414
USD	5,928,369	SGD	7,830,000	Citibank	16/8/2023	129,087
USD	237,175	SGD	318,000	JP Morgan	16/8/2023	1,649
USD	455,144	THB	15,824,000	Barclays Bank	21/6/2023	(429)
USD	118,494	THB	4,007,000	Goldman Sachs	21/6/2023	3,133
USD	156,536	THB	5,316,000	UBS	21/6/2023	3,488
USD	106,303	THB	3,587,000	HSBC	19/7/2023	2,742
USD	168,678	THB	5,709,000	UBS	19/7/2023	3,852
USD	106,243	THB	3,576,000	UBS	16/8/2023	2,709
USD	1,830,160	TWD	55,901,000	BNP Paribas	21/6/2023	10,259
USD	7,470,800	TWD	225,917,000	Goldman Sachs	21/6/2023	115,893
USD	527,303	TWD	16,115,000	Standard Chartered Bank	21/6/2023	2,666
USD	6,448,617	TWD	194,716,000	Bank of America Merrill Lynch	19/7/2023	92,758
USD	81,236	TWD	2,446,000	Citibank	19/7/2023	1,395
USD	845,451	TWD	25,735,000	HSBC	19/7/2023	5,419
USD	294,747	TWD	8,965,000	Standard Chartered Bank	19/7/2023	2,114
USD	65,493	TWD	1,990,000	HSBC	16/8/2023	336
USD	294,834	TWD	8,938,000	Standard Chartered Bank	16/8/2023	2,184
USD	7,288,266	TWD	221,425,000	UBS	16/8/2023	38,330
USD	190,905	ZAR	3,423,000	Barclays Bank	21/6/2023	17,319
USD	466,711	ZAR	9,025,000	Goldman Sachs	21/6/2023	9,038
USD	1,027,048	ZAR	18,961,000	Morgan Stanley	21/6/2023	65,503
USD	326,524	ZAR	6,275,000	Goldman Sachs	19/7/2023	9,199
USD	1,276,477	ZAR	23,837,000	Morgan Stanley	19/7/2023	71,048
USD	268,371	ZAR	5,226,000	Goldman Sachs	16/8/2023	4,844
USD	616,883	ZAR	11,646,000	Morgan Stanley	16/8/2023	29,619
ZAR	2,300,000	USD	125,404	Deutsche Bank	21/6/2023	(8,767)
ZAR	4,818,000	USD	249,511	Goldman Sachs	21/6/2023	(5,182)
ZAR	5,095,000	USD	277,648	Morgan Stanley	21/6/2023	(19,272)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
ZAR	7,633,000	USD	420,828	Standard Chartered Bank	21/6/2023	(33,745)
ZAR	2,305,000	USD	125,339	Deutsche Bank	19/7/2023	(8,776)
ZAR	4,830,000	USD	249,360	Goldman Sachs	19/7/2023	(5,108)
ZAR	3,373,000	USD	183,368	Morgan Stanley	19/7/2023	(12,796)
ZAR	7,651,000	USD	420,750	Standard Chartered Bank	19/7/2023	(33,842)
ZAR	4,845,000	USD	249,343	Goldman Sachs	16/8/2023	(5,027)
						931,002
ヘッジを使用した豪ドル建投資証券クラス						
AUD	50,513,376	USD	34,124,270	State Street Bank & Trust Company	15/6/2023	(1,380,807)
USD	700,349	AUD	1,048,148	State Street Bank & Trust Company	15/6/2023	20,924
						(1,359,883)
ヘッジを使用したブラジル・リアル建投資証券クラス						
BRL	19,240	USD	3,806	State Street Bank & Trust Company	2/6/2023	(15)
BRL	19,342	USD	3,814	State Street Bank & Trust Company	5/7/2023	(23)
USD	3,814	BRL	19,240	State Street Bank & Trust Company	2/6/2023	23
						(15)
ヘッジを使用したスイス・フラン建投資証券クラス						
CHF	439,094	USD	495,746	State Street Bank & Trust Company	15/6/2023	(13,914)
USD	11,807	CHF	10,561	State Street Bank & Trust Company	15/6/2023	217
						(13,697)
ヘッジを使用したユーロ建投資証券クラス						
EUR	4,278,617	USD	4,717,766	State Street Bank & Trust Company	15/6/2023	(145,831)
USD	284,219	EUR	259,851	State Street Bank & Trust Company	15/6/2023	6,552
						(139,279)
ヘッジを使用した英債券建投資証券クラス						
GBP	478,842	USD	606,198	State Street Bank & Trust Company	15/6/2023	(13,272)
USD	62,597	GBP	50,291	State Street Bank & Trust Company	15/6/2023	320
						(12,952)
ヘッジを使用した日本円建投資証券クラス						
JPY	11,705,901,589	USD	87,017,269	State Street Bank & Trust Company	15/6/2023	(3,337,116)
USD	4,480,599	JPY	606,442,125	State Street Bank & Trust Company	15/6/2023	145,421
						(3,191,695)

通貨	買予約	通貨	売予約	取引相手	期日	未実現純評価益 /(損) (米ドル)
ヘッジを使用したニュージーランド・ドル建投資証券クラス						
NZD	237	USD	149	State Street Bank & Trust Company	15/6/2023	(8)
USD	3	NZD	6	State Street Bank & Trust Company	15/6/2023	-
						(8)
ヘッジを使用したスウェーデン・クローナ建投資証券クラス						
SEK	37,246	USD	3,484	State Street Bank & Trust Company	15/6/2023	(55)
USD	182	SEK	1,946	State Street Bank & Trust Company	15/6/2023	3
						(52)
合計(基礎となるエクスポージャー総額 - 437,026,445米ドル)						(3,786,579)

業種別内訳 2023年5月31日現在

	純資産比率 (%)
政府	87.07
投資有価証券 - 時価	87.07
その他の純資産	12.93
	100.00

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ブラックロック・ICS・USTレジャーリー・ファンド

要約損益計算書（未監査）

2023年3月31日に終了した会計期間

	注記	2023年3月31日に 終了した会計期間	2022年3月31日に 終了した会計期間
		千米ドル	千米ドル
営業収益		326,622	10,338
金融商品に係る純利益		-	60
投資収益合計		326,622	10,398
営業費用		(12,402)	(7,431)
純営業利益		314,220	2,967
財務費用：			
支払利息または類似の費用		(12)	-
償還可能投資証券保有者への分配金	5	(304,937)	(2,866)
財務費用合計		(304,949)	(2,866)
純利益		9,271	101
償還可能投資証券保有者に帰属する純資産の増加		9,271	101

本要約損益計算書に計上された損益以外で当会計期間に認識された損益はない。

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ブラックロック・ICS・USTレジャーリー・ファンド

償還可能投資証券保有者に帰属する要約純資産変動計算書（未監査）

2023年3月31日に終了した会計期間

	2023年3月31日に 終了した会計期間	2022年3月31日に 終了した会計期間
	千米ドル	千米ドル
期首純資産	21,521,671	17,759,497
償還可能投資証券保有者に帰属する純資産の増加	9,271	101
投資証券取引：		
償還可能投資証券の発行	80,936,575	80,956,417
償還可能投資証券の買戻	(84,126,043)	(78,939,310)
分配金再投資額	121,567	336
投資証券取引による純資産の（減少）/増加	(3,067,901)	2,017,443
期末純資産	18,463,041	19,777,041

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ブラックロック・ICS・USTレジャー・ファンド
要約貸借対照表（未監査）
2023年3月31日現在

	注記	2023年3月31日現在	2022年9月30日現在
		千米ドル	千米ドル
流動資産			
現金		788,282	859,380
未収金		15,146	4,985
損益を通じて公正価値で測定する金融資産	4	17,731,697	20,755,918
流動資産合計		18,535,125	21,620,283
流動負債			
未払金		72,084	98,612
流動負債合計		72,084	98,612
償還可能投資証券保有者に帰属する純資産	8	18,463,041	21,521,671

添付の注記は、これらの財務書類の不可分の一部である。

ブラックロック・ICS・USTレジャー・ファンド

投資有価証券明細表 2023年3月31日現在(未監査)

保有高	通貨	銘柄	公正価値 (千米ドル)	純資産比率 (%)
債券				
国債(2022年9月30日:40.40%)				
米国(2022年9月30日:40.40%)				
1,250,000,000	USD	US Cash Management Bill, 4.69%, 17/04/2023 ¹	1,247,725	6.76
50,000,000	USD	US Treasury, FRN, 4.77%, 31/10/2023	50,028	0.27
300,000,000	USD	US Treasury, FRN, 4.72%, 31/01/2024	299,873	1.63
124,360,000	USD	US Treasury Bill, 2.15%, 18/05/2023 ¹	124,034	0.67
5,000	USD	US Treasury Bill, 0.00%, 30/05/2023 ¹	5	-
3,000,000	USD	US Treasury Bill, 3.47%, 10/08/2023 ¹	2,964	0.02
20,000	USD	US Treasury Bill, 4.93%, 25/01/2024 ¹	19	-
50,000	USD	US Treasury Bill, 5.01%, 22/02/2024 ¹	48	-
米国合計			1,724,696	9.35
国債に対する投資合計			1,724,696	9.35
債券に対する投資合計			1,724,696	9.35

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 ² (2022年9月30日:56.04%)						
カナダ(2022年9月30日:0.00%)						
375,000,000	USD	BanN of Nova Scotia (The)	4.80%	03/04/2023	375,000	2.03
722,000,000	USD	Royal BanN of Canada	4.79%	03/04/2023	722,000	3.91
700,000,000	USD	TD Securities (USA) LLC	4.80%	03/04/2023	700,000	3.79
カナダ合計					1,797,000	9.73
フランス(2022年9月30日:0.00%)						
2,350,000,000	USD	BNP Paribas SA	4.80%	03/04/2023	2,350,000	12.73
145,000,000	USD	BNP Paribas SA	4.80%	03/04/2023	145,000	0.79
420,000,000	USD	Credit Agricole SA	4.80%	03/04/2023	420,000	2.27
165,000,000	USD	Credit Agricole SA	4.80%	03/04/2023	165,000	0.89
1,175,000,000	USD	Natixis SA	4.80%	03/04/2023	1,175,000	6.36
1,500,000,000	USD	Societe Generale SA	4.70%	03/04/2023	1,500,000	8.12
1,200,000,000	USD	Societe Generale SA	4.80%	03/04/2023	1,200,000	6.50
フランス合計					6,955,000	37.66
英国(2022年9月30日:0.00%)						
700,000,000	USD	Barclays Capital, Inc.	4.74%	03/04/2023	700,000	3.79
1,000,000,000	USD	HSBC Securities (USA), Inc.	4.79%	03/04/2023	1,000,000	5.42
英国合計					1,700,000	9.21

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 ² (2022年9月30日:56.04%)(続き)						
米国(2022年9月30日:56.04%)						
500,000,000	USD	Bofa Securities Inc.	4.80%	03/04/2023	500,000	2.71
125,000,000	USD	Bofa Securities Inc.	4.80%	03/04/2023	125,000	0.68
425,000,000	USD	Citigroup Global Markets, Inc.	4.80%	03/04/2023	425,000	2.30
5,000,000	USD	Citigroup Global Markets, Inc.	4.80%	03/04/2023	5,000	0.03
1,591,667,765	USD	Fixed Income Clearing Corp. JPM	4.80%	03/04/2023	1,591,668	8.62
408,333,333	USD	Fixed Income Clearing Corp. JPM	4.80%	03/04/2023	408,333	2.21
2,500,000,000	USD	Wells Fargo Securities LLC	4.80%	03/04/2023	2,500,000	13.54
米国合計					5,555,001	30.09
リバースレポ取引に対する投資合計					16,007,001	86.69
損益を通じて公正価値で測定する金融資産合計					17,731,697	96.04
現金					788,282	4.27
その他の資産および負債					(56,938)	(0.31)
償還可能投資証券保有者に帰属する純資産					18,463,041	100.00
資産合計額の内訳						資産合計に 対する割合 (%)
公認の証券取引所に上場されている譲渡可能な有価証券						1.90
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						93.76
その他の資産						4.34
資産合計						100.00

¹ レートは期末現在の割引率または割引率のレンジである。

² 担保として保有する有価証券は16,288,453,000米ドルであった。

2 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】(2024年1月末現在)

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

資産総額	9,675,389,548円
負債総額	3,349,116円
純資産総額(-)	9,672,040,432円
発行済数量	11,557,225,818口
1 単位当たり純資産額(/)	0.8369円

(参考情報)

「スタイル・アドバンテージ・マザー・ポートフォリオ（円）」

資産総額	9,677,264,866円
負債総額	2,418,877円
純資産総額(-)	9,674,845,989円
発行済数量	10,976,051,672口
1 単位当たり純資産額(/)	0.8815円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

- 1 受益証券の名義書換え等
該当事項はありません。
- 2 受益者名簿の閉鎖の時期
受益者名簿は作成していません。
- 3 投資者に対する特典
該当事項はありません。
- 4 内国投資信託受益証券の譲渡制限の内容
ファンド受益証券の譲渡制限は設けておりません。
- 5 受益証券の再発行
投資者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。
- 6 受益権の譲渡
投資者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該投資者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
の申請のある場合には、の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。
の振替について、委託会社は、当該投資者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。
- 7 受益権の譲渡の対抗要件
受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。
- 8 受益権の再分割
委託会社は、受益権の再分割を行いません。ただし、受託会社と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。
- 9 償還金
償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている投資者（償還日以前において換金が行われた受益権にかかる投資者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で購入代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として投資者とします。）に支払います。なお、当該投資者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託会社がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。また、受益証券を保有している投資者に対しては、償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日から受益証券と引き換えに当該投資者に支払います。

10 質権口記載または記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額等

資本金 3,120百万円

発行する株式の総数 36,000株

発行済株式の総数 15,000株

直近5カ年における主な資本金の額の増減 該当事項はありません。

(2) 委託会社の機構

経営の意思決定機構

<株主総会>

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

<取締役会>

取締役により構成され、当社の業務執行を決定し、その執行について監督します。

<エグゼクティブ委員会他各委員会>

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

運用の意思決定機構

投資委員会

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

運用担当部署

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

ポートフォリオ・マネジャー

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

リスク管理

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

委託会社の運用する証券投資信託は2024年1月末現在、以下の通りです(親投資信託を除きます。)

種類	本数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	199	11,982,887
単位型株式投資信託	77	502,893
合計	276	12,485,780

3【委託会社等の経理状況】

1．財務諸表の作成方法について

委託会社であるブラックロック・ジャパン株式会社(以下「当社」という。)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(1963年大蔵省令第59号。)第2条及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」(2007年8月6日内閣府令第52号。)に基づいて作成しております。

2．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第37期事業年度(自2023年1月1日 至2023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36期 (2022年12月31日現在)	第37期 (2023年12月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	18,002	19,222
立替金	50	42
前払費用	260	153
未収入金	2	2
未収委託者報酬	1,751	2,178
未収運用受託報酬	2,880	2,712
未収収益	2	1,839
為替予約	-	1
その他流動資産	-	-
流動資産計	23,520	26,153
固定資産		
有形固定資産		
建物附属設備	1	500
器具備品	1	432
有形固定資産計	1,297	932
無形固定資産		
ソフトウェア	12	12
無形固定資産計	12	12
投資その他の資産		
投資有価証券	39	22
長期差入保証金	1,125	812
前払年金費用	1,084	1,142
長期前払費用	9	6
繰延税金資産	898	732
投資その他の資産計	3,156	2,717
固定資産計	4,465	3,662
資産合計	27,986	29,815

	第36期 (2022年12月31日現在)	第37期 (2023年12月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	143	144
未払金	2	
未払収益分配金	4	5
未払償還金	70	70
未払手数料	421	432
その他未払金	1,995	69
未払費用	2	
未払消費税等	172	192
未払法人税等	384	1,472
為替予約	4	-
前受金	276	254
賞与引当金	1,778	1,902
役員賞与引当金	149	146
早期退職慰労引当金	326	176
流動負債計	6,355	5,814
固定負債		
退職給付引当金	92	101
資産除去債務	961	963
固定負債計	1,053	1,064
負債合計	7,409	6,879
純資産の部		
株主資本		
資本金	3,120	3,120
資本剰余金		
資本準備金	3,001	3,001
その他資本剰余金	3,846	3,846
資本剰余金合計	6,847	6,847
利益剰余金		
利益準備金	336	336
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	10,276	12,632
利益剰余金合計	10,612	12,968
株主資本合計	20,580	22,936
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	3	0
評価・換算差額等合計	3	0
純資産合計	20,576	22,936
負債・純資産合計	27,986	29,815

(2)【損益計算書】

(単位：百万円)

		第36期 (自 2022年 1月 1日 至 2022年12月31日)	第37期 (自 2023年 1月 1日 至 2023年12月31日)
営業収益			
委託者報酬		6,484	6,885
運用受託報酬	1	8,687	8,621
その他営業収益	1	16,110	18,148
営業収益計		31,281	33,655
営業費用			
支払手数料		1,551	1,597
広告宣伝費		188	152
調査費			
調査費		360	357
委託調査費	1	4,677	4,651
調査費計		5,037	5,009
委託計算費		106	117
営業雑経費			
通信費		86	88
印刷費		87	87
諸会費		47	44
営業雑経費計		222	220
営業費用計		7,106	7,097
一般管理費			
給料			
役員報酬		915	694
給料・手当		5,934	5,875
賞与		2,360	2,563
給料計		9,209	9,133
退職給付費用		463	489
福利厚生費		1,109	1,185
事務委託費	1	3,699	4,562
交際費		34	69
寄付金		1	-
旅費交通費		123	193
租税公課		285	294
不動産賃借料		901	904
水道光熱費		76	82
固定資産減価償却費		441	473
資産除去債務利息費用		0	2
事務過誤取引損		3	3
諸経費		431	484
一般管理費計		16,782	17,878
営業利益		7,392	8,678

	第36期 (自 2022年 1月 1日 至 2022年12月31日)	第37期 (自 2023年 1月 1日 至 2023年12月31日)
営業外収益		
為替差益	53	-
その他	3	0
営業外収益計	57	0
営業外費用		
有価証券売却損	2	0
為替差損	-	16
固定資産除却損	-	4
その他	0	0
営業外費用計	2	23
経常利益	7,448	8,656
特別利益		
特別利益計	-	-
特別損失		
特別退職金	362	203
特別損失計	362	203
税引前当期純利益	7,085	8,453
法人税、住民税及び事業税	2,485	2,633
法人税等調整額	5	163
当期純利益	4,605	5,656

(3) 【株主資本等変動計算書】

第36期（自 2022年1月1日 至 2022年12月31日）

(単位：百万円)

	株主資本							評価・換算差額等		純資産 合計	
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金		評価・換算 差額等合計
		資本 準備金	その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計	利益 準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計				
2022年1月1日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	9,470	9,807	19,775	3	3	19,778
当期変動額											
剰余金の配当						3,800	3,800	3,800			3,800
当期純利益						4,605	4,605	4,605			4,605
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）									7	7	7
当期変動額合計	-	-	-	-	-	805	805	805	7	7	798
2022年12月31日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	10,276	10,612	20,580	3	3	20,576

第37期（自 2023年1月1日 至 2023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				
2023年1月1日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	10,276	10,612	20,580	3	3	20,576
当期変動額											
剰余金の配当						3,300	3,300	3,300			3,300
当期純利益						5,656	5,656	5,656			5,656
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）									3	3	3
当期変動額合計	-	-	-	-	-	2,356	2,356	2,356	3	3	2,359
2023年12月31日残高	3,120	3,001	3,846	6,847	336	12,632	12,968	22,936	0	0	22,936

注 記 事 項

【重要な会計方針】

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

有価証券

その他有価証券

時価のあるもの

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

2. デリバティブ取引等の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

3. 固定資産の減価償却方法

(1) 有形固定資産

定額法により償却しております。なお、主な耐用年数は建物附属設備6～18年、器具備品3～15年であります。

(2) 無形固定資産

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

4. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金の計上方法

債権の貸倒損失に備えるため、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 退職給付引当金の計上方法

旧退職金制度

適格退職年金制度移行日現在在籍していた従業員については、旧退職金制度に基づく給付額を保証しているため、期末現在の当該給付額と年金制度に基づく給付額との差額を引当て計上しております。

確定拠出年金制度

確定拠出年金制度（DC）による退職年金制度を有しております。

確定給付年金制度

キャッシュ・バランス型の年金制度（CB）の退職年金制度を有しております。CBには、一定の利回り保証を付しており、これの将来の支払に備えるため、確定給付型の会計基準に準じた会計処理方法により引当金を計上しております。

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当期までの期間に帰属させる方法については、ポイント基準によっております。

過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（9年）による定額法により費用処理しております。

数理計算上の差異は各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（9年）による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理または費用から控除することとしております。

(3) 賞与引当金の計上方法

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

(4) 役員賞与引当金の計上方法

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

(5) 早期退職慰労引当金の計上方法

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

5. 外貨建の資産又は負債の本邦通貨への換算基準

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

6. 収益及び費用の計上基準

当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬、その他営業収益を稼得しております。委託者報酬、運用受託報酬には成功報酬が含まれる場合があります。当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主要な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。

委託者報酬：当社は投資信託の信託約款に基づき、投資信託の運用について履行義務を負っております。委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産価額に対する一定割合として計算され、投資信託の運用期間にわたり収益認識しております。

運用受託報酬：当社は顧客との投資一任契約及び投資助言契約に基づき運用及び助言について履行義務を負っております。運用受託報酬は、対象顧客との投資一任契約等に基づき純資産価額に対する一定割合として計算され、対象口座の運用期間にわたり収益認識しております。

その他営業収益：当社はグループ会社との契約に基づき委託された業務について履行義務を負っております。グループ会社から受領する収益は、当社のグループ会社との契約で定められた算式に基づき、当社がグループ会社にオフショアファンド関連のサービス等を提供する期間にわたり月次で収益認識しております。

成功報酬：成功報酬は対象となるファンドまたは口座の運用益に対する一定割合、もしくは特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として計算されます。当該報酬は契約上支払われることが確定した時点で収益認識しております。

7. その他計算書類作成のための基本となる重要な事項

グループ通算制度

当社は、親会社であるブラックロック・ジャパン・ホールディングス合同会社を通算親会社とするグループ通算制度を適用しております。

（会計方針の変更）

（時価の算定に関する会計基準等の適用）

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。）を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計基準を将来にわたって適用することとしております。なお、財務諸表に与える影響はありません。

（追加情報）**（グループ通算制度の適用）**

当社は、当事業年度から、連結納税制度からグループ通算制度へ移行しております。これに伴い、法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示については、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号2021年8月12日。以下「実務対応報告第42号」という。）に従っております。また、実務対応報告第42号第32項(1)に基づき、実務対応報告第42号の適用に伴う会計方針の変更による影響はないものとみなしております。

（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 (2022年12月31日)	当事業年度 (2023年12月31日)
建物附属設備	2,488 百万円	2,737 百万円
器具備品	1,662 百万円	1,482 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 (2022年12月31日)	当事業年度 (2023年12月31日)
未収収益	186 百万円	302 百万円
その他未払金	1,982 百万円	53 百万円
未払費用	55 百万円	52 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行と当座貸越契約及びグループ会社と貸出コミットメント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 (2022年12月31日)	当事業年度 (2023年12月31日)
当座貸越極度額及び貸出コミットメントの総額	1,000 百万円	3,500 百万円
借入実行残高	-	-
差引額	1,000 百万円	3,500 百万円

（損益計算書関係）

1 関係会社との営業収益及び営業費用

各科目に含まれているものは次のとおりであります。

	前事業年度 (自 2022年 1月 1日 至 2022年12月31日)	当事業年度 (自 2023年 1月 1日 至 2023年12月31日)
運用受託報酬	224 百万円	282 百万円
その他営業収益	6,692 百万円	6,983 百万円
委託調査費	1,869 百万円	1,196 百万円
事務委託費	1,351 百万円	1,619 百万円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 2022年1月1日 至 2022年12月31日）

1. 発行済株式に関する事項

	前事業年度期首	増加	減少	前事業年度末
普通株式（株）	15,000	-	-	15,000

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

該当事項はありません。

4. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

当事業年度（自 2023年1月1日 至 2023年12月31日）

1. 発行済株式に関する事項

	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	15,000	-	-	15,000

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 新株予約権及び自己新株予約権に関する事項

該当事項はありません。

4. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
2023年3月30日 株主総会決議	普通株式	3,300	220,000	2022年12月31日	2023年3月31日

（リース取引関係）

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに掛かる未経過リース料は以下のとおりであります。

	前事業年度	当事業年度
	(自 2022年 1月 1日 至 2022年12月31日)	(自 2023年 1月 1日 至 2023年12月31日)
1年以内	726 百万円	522 百万円
1年超	1,938 百万円	1,413 百万円
合計	2,665 百万円	1,936 百万円

（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グループ会社からの長期借入及び銀行借入による方針であります。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

営業債務である未払手数料及び未払費用はその全てが1年以内の支払期日となっております。

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、金額的重要性が低いものについては含めておりません。

前事業年度（2022年12月31日）

	(単位：百万円)		
	貸借対照表計上額	時価	差額
長期差入保証金	1,125	1,077	47

当事業年度（2023年12月31日）

	(単位：百万円)		
	貸借対照表計上額	時価	差額
長期差入保証金	812	791	21

(注1) 現金・預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未収収益、未収入金、未払手数料、未払費用、その他未払金は、短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記述を省略しています。

(注2) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

(注3) 金銭債権の決算日後の償還予定額

前事業年度（2022年12月31日）

	1年以内 (百万円)	1年超 5年以内 (百万円)	5年超 10年以内 (百万円)	10年超 (百万円)
(1) 現金・預金	18,002	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	1,751	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	2,880	-	-	-
(4) 未収収益	570	-	-	-
合計	23,206	-	-	-

当事業年度（2023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	19,222	-	-	-
(2) 未収委託者報酬	2,178	-	-	-
(3) 未収運用受託報酬	2,712	-	-	-
(4) 未収収益	1,839	-	-	-
合計	25,953	-	-	-

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

レベル3の時価：重要な観察できないインプットを使用して算定した時価

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

時価をもって貸借対照表計上額としない金融資産及び金融負債

前事業年度（2022年12月31日）

(単位：百万円)

	レベル1	レベル2	レベル3	合計
長期差入保証金	-	1,077	-	1,077

当事業年度（2023年12月31日）

(単位：百万円)

	レベル1	レベル2	レベル3	合計
長期差入保証金	-	791	-	791

(注) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

長期差入保証金の時価について、そのうち事務所敷金については、事務所の敷金を合理的に見積もった返済期日までの期間を基にしたインターバンク市場で取引されている円金利スワップレートで現在価値に割り引いて算定しているため、レベル2の時価に分類しております。また従業員社宅敷金については、平均残存勤務期間を基にしたインターバンク市場で取引されている円金利スワップレートで現在価値に割り引いて算定しているため、レベル2の時価に分類しております。

(退職給付関係)

前事業年度 (自 2022年1月1日 至 2022年12月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、旧パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社で設けられていた、旧退職金制度を引き続き有しています。当社は、2009年12月2日に旧ブラックロック・ジャパン株式会社との合併に伴い、旧ブラックロック・ジャパン株式会社における退職年金制度(確定拠出年金制度及び確定給付年金制度)を承継しました。また、2011年1月1日付で旧パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社から引き継いだ適格退職年金制度はキャッシュ・バランス型の確定給付年金制度に移行しました。従って、2011年1月1日以降、からの三つの制度を有しています。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位:百万円)

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位:百万円)

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

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

(単位：百万円)

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2022年 1月 1日 至 2022年12月31日)
勤務費用	392
利息費用	17
期待運用収益	3
数理計算上の差異の費用処理額	27
過去勤務費用の処理額	3
確定給付制度に係る退職給付費用合計	375
特別退職金	362
合計	738

(注) 特別退職金は、特別損失の「特別退職金」に含めて計上しております。

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	前事業年度 (2022年12月31日)
合同運用	100%
合計	100%

合同運用による年金資産の主な商品分類ごとの比率は、債券88%、株式11%及びその他1%となっております。

長期期待運用収益率の算定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (自 2022年 1月 1日 至 2022年12月31日)
割引率	1.3%
長期期待運用収益率	0.1%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、87百万円であります。

当事業年度（自 2023年1月1日 至 2023年12月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、旧パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社で設けられていた、旧退職金制度を引き続き有しています。当社は、2009年12月2日に旧ブラックロック・ジャパン株式会社との合併に伴い、旧ブラックロック・ジャパン株式会社における退職年金制度（確定拠出年金制度及び確定給付年金制度）を承継しました。また、2011年1月1日付で旧パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社から引き継いだ適格退職年金制度はキャッシュ・バランス型の確定給付年金制度に移行しました。従って、2011年1月1日以降、からの三つの制度を有しています。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：百万円)

	当事業年度 (自 2023年 1月 1日 至 2023年12月31日)
退職給付債務の期首残高	2,803
勤務費用	421
利息費用	35
数理計算上の差異の発生額	1
退職給付の支払額	427
過去勤務費用の発生額	-
退職給付債務の期末残高	2,834

(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 2023年 1月 1日 至 2023年12月31日)
年金資産の期首残高	3,368
期待運用収益	97
数理計算上の差異の発生額	9
事業主からの拠出額	452
退職給付の支払額	427
年金資産の期末残高	3,500

(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 (2023年12月31日)
積立型制度の退職給付債務	2,733
年金資産	3,500
	767
非積立型制度の退職給付債務	101
未積立退職給付債務	666
未認識数理計算上の差異	401
未認識過去勤務費用	25
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,041
退職給付引当金	101
前払年金費用	1,142
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,041

(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 2023年 1月 1日 至 2023年12月31日)
勤務費用	421
利息費用	35
期待運用収益	97
数理計算上の差異の費用処理額	47
過去勤務費用の処理額	3
確定給付制度に係る退職給付費用合計	402
特別退職金	203
合計	605

(注) 特別退職金は、特別損失の「特別退職金」に含めて計上しております。

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	当事業年度 (2023年12月31日)
合同運用	100%
合計	100%

合同運用による年金資産の主な商品分類ごとの比率は、債券87%、株式12%及びその他1%となっております。

長期期待運用収益率の算定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

	当事業年度 (自 2023年 1月 1日 至 2023年12月31日)
割引率	1.3%
長期期待運用収益率	2.9%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、87百万円でありました。

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	（単位：百万円）	
	前事業年度 (2022年12月31日)	当事業年度 (2023年12月31日)
繰延税金資産		
未払費用	140	192
賞与引当金	544	582
資産除去債務	294	295
未払事業税	83	89
早期退職慰労引当金	99	54
退職給付引当金	28	30
有形固定資産	0	-
その他	121	0
繰延税金資産合計	1,312	1,244
繰延税金負債		
退職給付引当金	331	349
資産除去債務に対応する除去費用	82	44
その他	-	117
繰延税金負債合計	414	512
繰延税金資産の純額	898	732

（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 (2022年12月31日)	当事業年度 (2023年12月31日)
固定資産 - 繰延税金資産	898	732

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 (2022年12月31日)	当事業年度 (2022年12月31日)
	法定実効税率	30.6 %
（調整）		
交際費等永久に損金に算入されない項目	3.9	2.5
その他	0.4	0.1
税効果会計適用後の法人税等の負担率	35.0 %	33.0 %

(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

使用見込期間を合理的に見積り、割引率は0.16%～0.72%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。

3. 当該資産除去債務の総額の増減

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

(単位：百万円)

	前事業年度 (自 2022年 1月 1日 至 2022年12月31日)	当事業年度 (自 2023年 1月 1日 至 2023年12月31日)
期首残高	784	961
見積りの変更による増加額	176	-
時の経過による調整額	0	2
期末残高	961	963

(収益認識関係)

1. 顧客との契約から生じる収益を分解した情報

	前事業年度 (自 2022年 1月 1日 至 2022年12月31日)	当事業年度 (自 2023年 1月 1日 至 2023年12月31日)
委託者報酬	6,484 百万円	6,885 百万円
運用受託報酬	7,644 百万円	8,526 百万円
成功報酬 (注)	1,042 百万円	95 百万円
その他営業収益	16,110 百万円	18,148 百万円
合計	31,281 百万円	33,655 百万円

(注) 成功報酬は、損益計算書において運用受託報酬に含めて表示しております。

2. 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

(重要な会計方針) 6. 収益及び費用の計上基準に記載のとおりです。

3. 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに会計期間末において存在する顧客との契約から当会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報重要性が乏しいため、記載を省略しています。

(セグメント情報等)

前事業年度（自 2022年1月1日 至 2022年12月31日）

1. セグメント情報

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

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：百万円)

	委託者報酬	運用受託報酬	その他	合計
外部顧客営業収益	6,484	8,687	16,110	31,281

(2) 地域ごとの情報

売上高

(単位：百万円)

日本	北米	その他	合計
14,721	13,745	2,813	31,281

(注) 売上高は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める主要な顧客は以下のとおりです。

(単位：百万円)

相手先	営業収益	関連するセグメント名
ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク	6,917	投資運用業
ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	4,287	投資運用業

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度（自 2023年1月1日 至 2023年12月31日）

1. セグメント情報

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

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

（単位：百万円）

	委託者報酬	運用受託報酬	その他	合計
外部顧客営業収益	6,885	8,621	18,148	33,655

(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
15,053	14,702	3,899	33,655

（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	7,266	投資運用業
ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	5,097	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

計算書類提出会社と関連当事者との取引

(1) 計算書類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 2022年1月1日 至 2022年12月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社	ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク	米国 ニューヨーク州	73 百万 米ドル	投資 顧問業	(被所有) 間接 100	投資顧問 契約の 再委任等	運用受託報酬	224	未収収益	186
							受入手数料	6,692		
							委託調査費	1,869	未払費用	55
							事務委託費	1,351		
親会社	ブラックロック・ジャパン・ホールディングス合同会社	日本 東京都	1万円	持株会社	(被所有) 直接 100	株式の 保有等	連結法人税の 個別帰属額	1,982	その他未払金	1,982

当事業年度（自 2023年1月1日 至 2023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	1,190 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	282	未収収益	302
							受入手数料	6,983		
							委託調査費	1,196	未払費用	52
							事務委託費	1,619		
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	通算税効果額	53	その他未払金	53

(2) 計算書類提出会社の子会社及び関連会社等

前事業年度（自 2022年1月1日 至 2022年12月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2023年1月1日 至 2023年12月31日）

該当事項はありません。

(3) 計算書類提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び計算書類提出会社のその他の関係会社の子会社等

前事業年度（自 2022年1月1日 至 2022年12月31日）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社を持つ会社	ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ	米国 カリフォルニア州	1,000 米ドル	投資 顧問業	なし	投資顧問 契約の 再委任等	受入手数料	4,287	未収収益	180
							委託調査費	35		
							事務委託費	12		

当事業年度（自 2023年1月1日 至 2023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	5,097	未収収益	886
							委託調査費	11		
							事務委託費	24		

- (注) 1. 上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておりません。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
- (1) 運用受託報酬については、一般取引条件と同様に決定しております。
- (2) 受入手数料については、一般取引条件と同様に決定しております。
- (3) 委託調査費については、一般取引条件と同様に決定しております。
- (4) 事務委託費については、一般取引条件と同様に決定しております。

2. 親会社に関する注記

(1) 親会社情報

ブラックロック・インク（ニューヨーク証券取引所に上場）
 ブラックロック・ホールドコ・2・インク（非上場）
 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・インターナショナル・ホールディングス・インク（非上場）
 ビーアール・ジャージー・インターナショナル・ホールディングス・L.P.（非上場）
 ブラックロック・シンガポール・ホールドコ・ピーティーイー・リミテッド（非上場）
 ブラックロック・エイチケー・ホールドコ・リミテッド（非上場）
 ブラックロック・ルクス・フィンコ・エスエーアールエル（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 2022年 1月 1日 至 2022年12月31日)	当事業年度 (自 2023年 1月 1日 至 2023年12月31日)
1株当たり純資産額	1,371,780 円 88 銭	1,529,103 円 11 銭
1株当たり当期純利益金額	307,029 円 07 銭	377,073 円 92 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 2022年 1月 1日 至 2022年12月31日)	当事業年度 (自 2023年 1月 1日 至 2023年12月31日)
当期純利益 (百万円)	4,605	5,656
普通株主に帰属しない金額 (百万円)	-	-
普通株式に係る当期純利益 (百万円)	4,605	5,656
普通株式の期中平均株式数 (株)	15,000	15,000

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

- ・名称 三井住友信託銀行株式会社
- ・資本金の額 342,037百万円（2023年3月末現在）
- ・事業の内容 銀行法に基づき、銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

<参考：再信託受託会社の概要>

- ・名称 株式会社日本カストディ銀行
- ・資本金の額 51,000百万円（2023年3月末現在）
- ・事業の内容 銀行法に基づき、銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。
- ・再信託の目的 原信託契約にかかる信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

(2) 販売会社

名称	資本金の額（百万円） （2023年3月末現在）	事業の内容
野村證券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500	

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

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

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【その他】

1 交付目論見書の表紙等に、以下の事項を記載します。

(1) 委託会社等の情報

委託会社名

金融商品取引業者登録番号

設立年月日

資本金

当該委託会社が運用する投資信託財産の合計純資産総額

「ファンドの運用の指図を行う者である。」旨

(2) 受託会社に関する情報

受託会社名および「ファンドの財産の保管および管理を行う者である。」旨

(3) 詳細情報の入手方法

詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載します。

委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間等

請求目論見書の入手方法および投資信託約款が請求目論見書に添付されている旨

(4) 交付目論見書の使用開始日

(5) 届出の効力に関する事項

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

届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法

届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日

(6) その他の記載事項

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

投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨

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

「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載

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

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

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

独立監査人の監査報告書

2024年3月4日

ブラックロック・ジャパン株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ

東京事務所

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

監査意見

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ブラックロック・ジャパン株式会社の2023年12月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

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

財務諸表に対する経営者及び監査役の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

-
- (注) 1. 上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2024年3月29日

ブラックロック・ジャパン株式会社
取締役会御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 鶴田 光夫指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 奈良 将太郎

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているブラックロック・スタイル・アドバンテージ・ポートフォリオ（円/年1回決算コース）の2023年1月17日から2024年1月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ブラックロック・スタイル・アドバンテージ・ポートフォリオ（円/年1回決算コース）の2024年1月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。