

運用報告書 (全体版)

第6期<決算日2023年9月25日>

A I (人工知能) 活用型世界株ファンド

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/海外/株式	
信託期間	2017年9月29日から2027年9月24日までです。	
運用方針	信託財産の成長を図ることを目的として、積極的な運用を行います。	
主要投資対象	A I*(人工知能)活用型世界株ファンド	A I (人工知能) 活用型世界株マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。 ※Artificial Intelligenceの略。人工的に作られた知能を持つシステム。
	A I (人工知能) 活用型世界株マザーファンド	日本を除く世界の株式 ^{※1} 、 ^{※2} を主要投資対象とします。 ※1 D R (預託証券) もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証券等を含みます。 ※2 株式のほかに、日本を除く世界の不動産投資信託 (R E I T) にも投資する場合があります。
運用方法	マザーファンドの運用にあたっては、アセットマネジメントOneが独自に開発したディープラーニングモデルを用いて、相対的に投資魅力度が高いと判断される銘柄を抽出します。モデルの解析結果に、ファンドマネジャーの判断によりテキストなどの非財務データや個別企業のファンダメンタルズ分析を融合させ、ポートフォリオを構築します。銘柄選定にあたっては、アセットマネジメントOne U.S.A.・インクの投資助言を活用します。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。 マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。実質的な組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。	
組入制限	マザーファンド受益証券の投資割合には、制限を設けません。株式への実質投資割合には、制限を設けません。外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。	
分配方針	決算日 (原則として9月23日。休業日の場合は翌営業日。) に、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益 (マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額 (以下「みなし配当等収益」といいます。) を含みます。) および売差益 (評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額) 等の中から、基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。	

愛称：ディープ^Aアイ^I

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「A I (人工知能) 活用型世界株ファンド」は、2023年9月25日に第6期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された

販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne 株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

<https://www.am-one.co.jp/>

A I (人工知能) 活用型世界株ファンド

■最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 証 券 比 率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税 込 分 配	み 金 期 騰 落 中 率				
2期 (2019年9月24日)	円 9,700	円 0	% △8.8	% 97.7	% -	% -	百万円 33,921
3期 (2020年9月23日)	10,452	0	7.8	97.1	-	1.2	22,469
4期 (2021年9月24日)	14,773	0	41.3	96.5	-	1.6	23,586
5期 (2022年9月26日)	14,800	0	0.2	98.5	-	0.2	25,503
6期 (2023年9月25日)	18,223	0	23.1	98.1	-	0.7	27,078

(注1) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注2) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注3) 当ファンドの運用方針に合った適切な指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を定めておりません。

(注4) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額		株 式 組 入 率 株 比	株 式 先 物 率 株 比	投 資 信 託 受 益 証 券、 組 入 証 券、 投 資 証 券 率
	円	騰 落 率 %			
(期 首) 2022 年 9 月 26 日	14,800	—	98.5	—	0.2
9 月 末	14,738	△0.4	98.1	—	0.2
10 月 末	16,121	8.9	98.3	—	0.5
11 月 末	15,707	6.1	98.1	—	1.0
12 月 末	14,676	△0.8	97.5	—	1.5
2023 年 1 月 末	15,192	2.6	97.1	—	1.8
2 月 末	15,597	5.4	97.5	—	1.6
3 月 末	15,623	5.6	96.6	—	1.2
4 月 末	15,870	7.2	97.6	—	1.3
5 月 末	16,717	13.0	97.6	—	1.1
6 月 末	18,135	22.5	98.2	—	0.8
7 月 末	18,267	23.4	98.7	—	0.2
8 月 末	18,687	26.3	97.8	—	0.7
(期 末) 2023 年 9 月 25 日	18,223	23.1	98.1	—	0.7

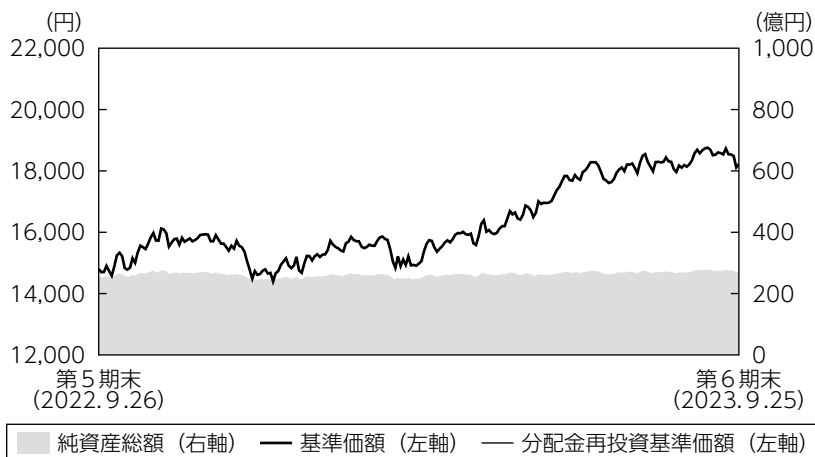
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「投資信託受益証券、投資証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2022年9月27日から2023年9月25日まで）

基準価額等の推移



第6期首：14,800円
第6期末：18,223円
(既払分配金0円)
騰落率：23.1%
(分配金再投資ベース)

- (注1) 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たもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注4) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

基準価額の主な変動要因

米国においてインフレ率のピークアウトにより金融政策引き締め終了観測が高まったことや、好調な景気動向を受けて景気後退懸念が後退したことなどを背景に株式市場が上昇したことに加えて、内外金利差拡大の長期化期待などを背景にして主要通貨に対して円安に進んだことがプラス要因となり、基準価額は上昇しました。

投資環境

外国株式市場は上昇しました。期初から2023年2月初にかけては米国のインフレ率がピークアウトしたことにより金融引き締め終了観測が高まったことなどをを受けて株式市場は上昇しました。2月中旬から5月頃までは米国の地銀経営破綻や債務上限問題に対する警戒感の高まりなどをを受けて概ね横ばいで推移しました。その後、景気後退懸念が後退したことなどから一時的に上昇しましたが、8月以降には金融引き締め長期化への懸念などから下落して期末を迎えました。

為替市場では主要通貨に対し円安が進みました。対米ドルでは、日銀の政策変更を受けて一時的に円高が進行したものの米国における長期金利の上昇などをを受けて期を通じては小幅に円安となりました。対ユーロや対ポンドは、ECB（欧州中央銀行）が利上げを継続したことにより欧州長期金利が上昇し日欧金利差が拡大したことなどから円安基調で推移しました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

A I（人工知能）活用型世界株マザーファンドの組入比率は期を通じて高位に維持するよう運用しました。

●A I（人工知能）活用型世界株マザーファンド

当ファンドは、ディープラーニングを活用した運用モデルによるスコアリングを基に定量的にレポートフォリオを構築し、これにファンドマネジャー判断によりテキスト解析やアナリスト情報を融合させ、ポートフォリオを構築しました。ディープラーニングによるモデルでは、国別では米国を、業種別では情報技術や一般消費財・サービスセクターの保有比率を高め維持しました。ファンドマネジャーの判断では、アマゾン・ドット・コム等のeコマース（電子商取引）関連銘柄に投資しました。

※運用状況については13ページをご参照ください。

分配金

当期の収益分配金につきましては基準価額水準および市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきます。なお、収益分配金に充てなかった収益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当期
	2022年9月27日 ～2023年9月25日
当期分配金（税引前）	－円
対基準価額比率	－%
当期の収益	－円
当期の収益以外	－円
翌期繰越分配対象額	8,222円

（注1）「当期の収益」および「当期の収益以外」は、小数点以下切捨てで算出しているためこれらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

（注2）当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金（税引前）」の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

（注3）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

今後の運用方針

●当ファンド

引き続き、A I（人工知能）活用型世界株マザーファンドの組入比率を高位に維持します。

●A I（人工知能）活用型世界株マザーファンド

引き続き、ディープラーニングを活用した運用モデルによるスコアリングを基に定量的にプレポートフォリオを構築し、これにファンドマネジャー判断によりテキスト解析やアナリスト情報を融合させ、ポートフォリオを構築していく方針です。

■1万口当たりの費用明細

項目	第6期		項目の概要
	(2022年9月27日 ～2023年9月25日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	258円	1.580%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は16,330円です。
(投信会社)	(125)	(0.768)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各种書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(125)	(0.768)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(7)	(0.044)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	11	0.067	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	(10)	(0.064)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.001)	
(投資証券)	(0)	(0.002)	
(c) 有価証券取引税	8	0.047	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(8)	(0.047)	
(投資証券)	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	7	0.040	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保管費用)	(6)	(0.036)	保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用
(監査費用)	(0)	(0.003)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
(その他)	(0)	(0.002)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	283	1.734	

(注1) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

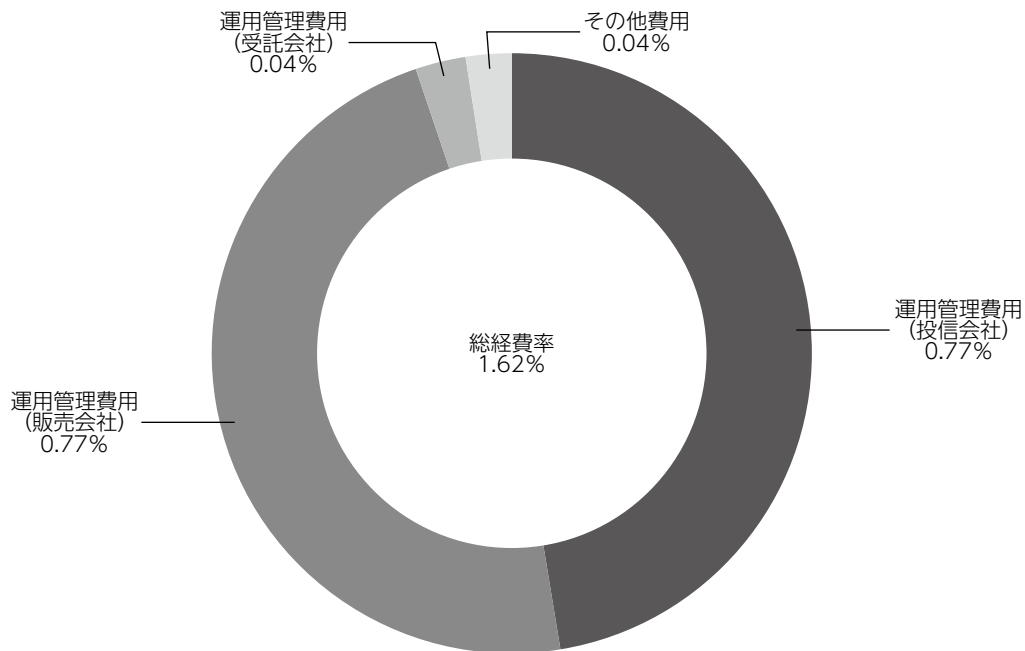
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(参考情報)

◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.62%です。



(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、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を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2022年9月27日から2023年9月25日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
A I（人工知能）活用型世界株マザーファンド	千□ 160,750	千円 299,719	千□ 2,566,143	千円 4,613,490

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	A I（人工知能）活用型世界株マザーファンド
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	98,227,213千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	25,765,793千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	3.81

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2022年9月27日から2023年9月25日まで）

期中の利害関係人との取引等はありません。

(注) 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

■組入資産の明細

親投資信託残高

	期首（前期末）	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
A I（人工知能）活用型世界株マザーファンド	千□ 15,910,216	千□ 13,504,824	千円 26,988,041

■投資信託財産の構成

2023年9月25日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
A I (人工知能) 活用型世界株マザーファンド	26,988,041	98.6
コール・ローン等、その他	389,537	1.4
投資信託財産総額	27,377,578	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2023年9月25日現在、A I (人工知能) 活用型世界株マザーファンドは26,869,734千円、99.6%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2023年9月25日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=148.50円、1カナダ・ドル=110.19円、1オーストラリア・ドル=95.62円、1香港・ドル=19.00円、1シンガポール・ドル=108.78円、1ニュージーランド・ドル=88.51円、1台湾・ドル=4.617円、1イギリス・ポンド=181.84円、1イスラエル・シェケル=38.976円、1スイス・フラン=163.60円、1トルコ・リラ=5.468円、1デンマーク・クローネ=21.22円、1ノルウェー・クローネ=13.81円、1スウェーデン・クローナ=13.36円、1メキシコ・ペソ=8.645円、1インド・ルピー=1.80円、100韓国・ウォン=11.16円、1南アフリカ・ランド=7.92円、1ポーランド・ズロチ=34.346円、1ユーロ=158.23円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年9月25日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	27,377,578,311円
コール・ローン等	389,537,049
A I (人工知能) 活用型世界株マザーファンド(評価額)	26,988,041,262
(B) 負 債	298,951,723
未 払 解 約 金	87,938,678
未 払 信 託 報 酬	210,603,614
そ の 他 未 払 費 用	409,431
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	27,078,626,588
元 本	14,859,785,510
次 期 繰 越 損 益 金	12,218,841,078
(D) 受 益 権 総 口 数	14,859,785,510口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,223円

(注) 期首における元本額は17,232,630,876円、当期中における追加設定元本額は3,011,739,366円、同解約元本額は5,384,584,732円です。

■損益の状況

当期 自2022年9月27日 至2023年9月25日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△106,174円
受 取 利 息	17,736
支 払 利 息	△123,910
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	4,996,669,454
売 買 益	5,876,068,413
売 買 損	△879,398,959
(C) 信 託 報 酬 等	△415,841,831
(D) 当 期 繰 越 損 益 金(A+B+C)	4,580,721,449
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	3,144,217,398
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	4,493,902,231
(配 当 等 相 当 額)	(2,550,990,943)
(売 買 損 益 相 当 額)	(1,942,911,288)
(G) 合 計(D+E+F)	12,218,841,078
次 期 繰 越 損 益 金(G)	12,218,841,078
追 加 信 託 差 損 益 金	4,493,902,231
(配 当 等 相 当 額)	(2,558,901,315)
(売 買 損 益 相 当 額)	(1,935,000,916)
分 配 準 備 積 立 金	7,724,938,847

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 分配金の計算過程

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	443,121,001円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	3,972,569,197
(c) 収 益 調 整 金	4,493,902,231
(d) 分 配 準 備 積 立 金	3,309,248,649
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	12,218,841,078
(f) 1万口当たり当期分配対象額	8,222.76
(g) 分 配 金	0
(h) 1万口当たり分配金	0

■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては基準価額水準および市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきます。

A I (人工知能) 活用型世界株マザーファンド

運用報告書

第6期 (決算日 2023年9月25日)

(計算期間 2022年9月27日～2023年9月25日)

A I (人工知能) 活用型世界株マザーファンドの第6期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2017年9月29日から無期限です。
運用方針	信託財産の成長を図ることを目的として、積極的な運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界の株式 ^{*1} 、 ^{*2} を主要投資対象とします。 ※1 DR (預託証券) もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。 ※2 株式のほかに、日本を除く世界の不動産投資信託 (REIT) にも投資する場合があります。
主な組入制限	株式への投資割合には、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。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		株式組入率 比	株式先物率 比	投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率	純資産額 総
	期騰	落中率				
2期(2019年9月24日)	円 9,999	% △7.6	% 98.1	% -	% -	百万円 33,768
3期(2020年9月23日)	10,950	9.5	97.4	-	1.2	22,397
4期(2021年9月24日)	15,706	43.4	97.0	-	1.6	23,474
5期(2022年9月26日)	15,979	1.7	98.8	-	0.2	25,423
6期(2023年9月25日)	19,984	25.1	98.4	-	0.7	26,988

(注1) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注2) 当ファンドの運用方針に合った適切な指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を定めておりません。

(注3) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

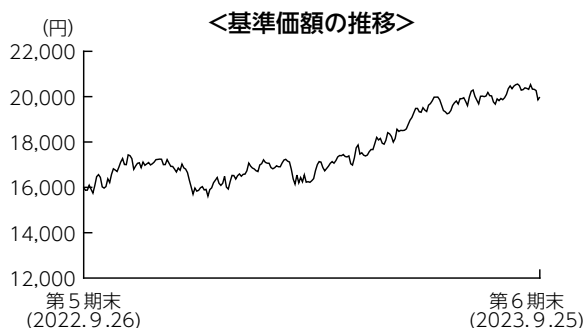
■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額		株 式 組 入 率 株 比	株 式 先 物 率 株 比	投 資 信 託 受 益 証 券 投 入 証 比 組 入 比 率
	円	騰 落 率 %			
(期 首) 2022 年 9 月 26 日	15,979	—	98.8	—	0.2
9 月 末	15,915	△0.4	98.8	—	0.2
10 月 末	17,433	9.1	98.5	—	0.5
11 月 末	17,006	6.4	98.0	—	1.0
12 月 末	15,910	△0.4	97.4	—	1.5
2023 年 1 月 末	16,491	3.2	97.1	—	1.8
2 月 末	16,950	6.1	97.0	—	1.6
3 月 末	17,006	6.4	97.3	—	1.2
4 月 末	17,296	8.2	98.0	—	1.3
5 月 末	18,243	14.2	97.9	—	1.1
6 月 末	19,817	24.0	98.5	—	0.8
7 月 末	19,986	25.1	99.1	—	0.2
8 月 末	20,474	28.1	98.2	—	0.7
(期 末) 2023 年 9 月 25 日	19,984	25.1	98.4	—	0.7

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2022年9月27日から2023年9月25日まで）



基準価額の推移

当期末の基準価額は19,984円となり、前期末比で25.1%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

米国においてインフレ率のピークアウトにより金融引き締め終了観測が高まったことや、堅調な景気動向を受けて景気後退懸念が後退したことなどを背景に株式市場が上昇したことに加えて、内外金利差拡大の長期化期待などを背景にして主要通貨に対して円安に進んだことがプラス要因となり、基準価額は上昇しました。

投資環境

外国株式市場は上昇しました。期初から2023年2月初にかけては米国のインフレ率がピークアウトしたことにより金融引き締め終了観測が高まったことなどをを受けて株式市場は上昇しました。2月中旬から5月頃までは米国の地銀経営破綻や債務上限問題に対する警戒感の高まりなどをを受けて概ね横ばいで推移しました。その後、景気後退懸念が後退したことなどから一時的に上昇しましたが、8月以降には金融引き締め長期化への懸念などから下落して期末を迎えました。

為替市場では主要通貨に対し円安が進みました。対米ドルでは、日銀の政策変更を受けて一時的に円高が進行したものの米国における長期金利の上昇などをを受けて期を通じては円安となりました。対ユーロや対ポンドは、ECB（欧州中央銀行）が利上げを継続したことにより欧州長期金利が上昇し日欧金利差が拡大したことなどから円安基調で推移しました。

ポートフォリオについて

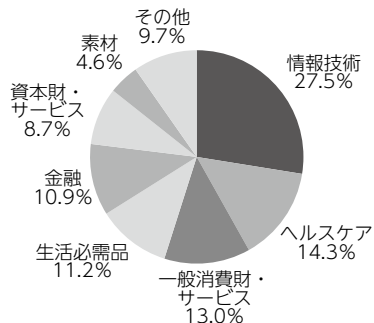
当ファンドは、ディープラーニングを活用した運用モデルによるスコアリングを基に定量的にプレポートフォリオを構築し、これにファンドマネジャー判断によりテキスト解析やアナリスト情報を融合させ、ポートフォリオを構築しました。ディープラーニングによるモデルでは、国別では米国を、業種別では情報技術や一般消費財・サービスセクターの保有比率を高め維持しました。ファンドマネジャーの判断では、アマゾン・ドット・コム等のeコマース（電子商取引）関連銘柄に投資しました。

【運用状況】 2023年9月25日現在

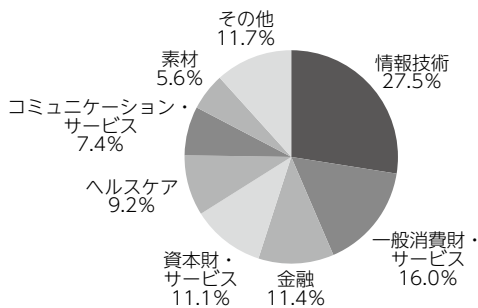
- (注1) 比率は純資産総額に対する割合です。
 (注2) 業種は各決算日時点でのG I C S（世界産業分類基準）によるものです。
 (注3) 国別配分は、発行国（地域）を表示しています。
 (注4) 上位8位以下がある場合はその他に含めて集計しています。
 (注5) 現金等はその他として表示しています。

○業種別配分

期首（前期末）

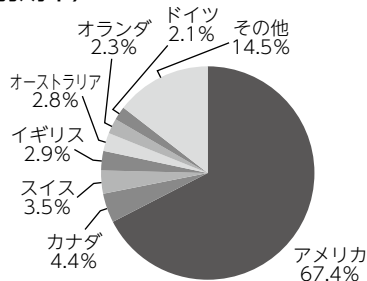


期末

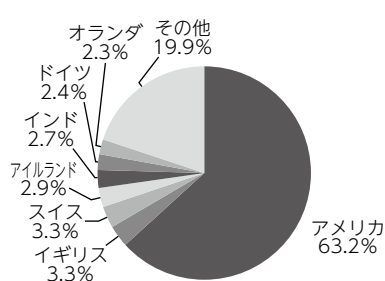


○国別配分

期首（前期末）

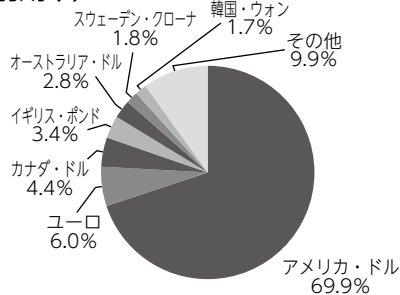


期末

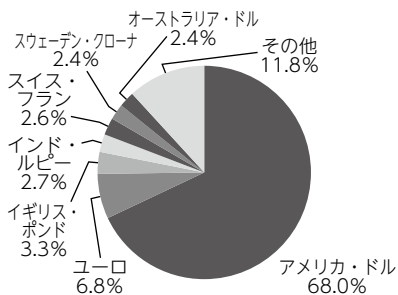


○通貨別配分

期首（前期末）



期末



今後の運用方針

引き続き、ディープラーニングを活用した運用モデルによるスコアリングを基に定量的にプレポートフォリオを構築し、これにファンドマネジャー判断によりテキスト解析やアナリスト情報を融合させ、ポートフォリオを構築していく方針です。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売買委託手数料 (株 式) (投資信託受益証券) (投 資 証 券)	12円 (11) (0) (0)	0.067% (0.064) (0.001) (0.002)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(b) 有価証券取引税 (株 式) (投 資 証 券)	8 (8) (0)	0.047 (0.047) (0.000)	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	7 (6) (0)	0.037 (0.035) (0.002)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	27	0.152	
期中の平均基準価額は17,776円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■ 売買及び取引の状況 (2022年9月27日から2023年9月25日まで)

(1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	ア メ リ カ	20,361.24 (17.7)	千アメリカ・ドル 211,078 (△27)	21,255.27	千アメリカ・ドル 233,007
	カ ナ ダ	3,860.94 (-)	千カナダ・ドル 20,339 (-)	5,916.74	千カナダ・ドル 29,055
	オーストラリア	20,248.01 (-)	千オーストラリア・ドル 27,225 (-)	21,352.98	千オーストラリア・ドル 31,303
	香 港	72,705 (8.1)	千香港・ドル 54,265 (-)	61,890.1	千香港・ドル 54,394
国	シンガポール	3,169 (-)	千シンガポール・ドル 1,222 (-)	2,041.3	千シンガポール・ドル 363
	ニュージーランド	683.54 (-)	千ニュージーランド・ドル 1,640 (-)	1,722.2	千ニュージーランド・ドル 2,332
	台 湾	3,040 (-)	千台湾・ドル 52,837 (△742)	12,160	千台湾・ドル 29,701

		買 付		売 付		
		株 数	金 額	株 数	金 額	
外	イ ギ リ ス	百株 6,480.81 (-)	千イギリス・ポンド 5,082 (-)	百株 4,848.64	千イギリス・ポンド 5,729	
	イ ス ラ エ ル	百株 1,442.18 (-)	千イスラエル・シケル 9,784 (-)	百株 1,445.89	千イスラエル・シケル 10,480	
	ス イ ス	百株 1,246.45 (-)	千スイス・フラン 7,166 (-)	百株 644.34	千スイス・フラン 5,727	
	デ ン マ ー ク	百株 219.46 (154.05)	千デンマーク・クローネ 36,928 (-)	百株 299.59	千デンマーク・クローネ 38,581	
	ノ ル ウ ェ ー	百株 2,395.17 (-)	千ノルウェー・クローネ 28,702 (-)	百株 2,353.57	千ノルウェー・クローネ 38,956	
	ス ウ ェ ー デ ン	百株 3,583.79 (-)	千スウェーデン・クローナ 59,504 (-)	百株 3,416.92	千スウェーデン・クローナ 53,447	
	メ キ シ コ	百株 5,299 (-)	千メキシコ・ペソ 53,759 (-)	百株 7,302	千メキシコ・ペソ 86,570	
	イ ン ド	百株 4,042.54 (-)	千インド・ルピー 686,794 (-)	百株 892.06	千インド・ルピー 310,376	
	韓 国	百株 852.07 (-)	千韓国・ウォン 6,110,919 (-)	百株 1,794.29	千韓国・ウォン 6,226,630	
	南 ア フ リ カ	百株 7,048.88 (-)	千南アフリカ・ランド 50,550 (-)	百株 5,319.02	千南アフリカ・ランド 31,620	
	タ イ	百株 11,566 (-)	千タイ・バーツ 66,191 (-)	百株 11,566	千タイ・バーツ 64,411	
国	ポ ー ラ ン ド	百株 627.6 (-)	千ポーランド・ズロチ 7,486 (-)	百株 683.73	千ポーランド・ズロチ 11,324	
	ユ ー ロ ー 圏	オ ラ ン ダ	百株 2,124.51 (-)	千ユーロ 9,642 (-)	百株 2,170.51	千ユーロ 10,606
		フ ラ ン ス	百株 556.98 (-)	千ユーロ 816 (-)	百株 61.71	千ユーロ 1,118
		ド イ ツ	百株 1,321.63 (-)	千ユーロ 8,542 (-)	百株 1,429.94	千ユーロ 8,945
		ポ ル ト ガ ル	百株 (-)	千ユーロ (-)	百株 411.42	千ユーロ 848
		ス ベ イ ン	百株 258.87 (-)	千ユーロ 177 (-)	百株 -	千ユーロ -
		フ ィ ン ラ ン ド	百株 631.52 (-)	千ユーロ 3,213 (-)	百株 631.52	千ユーロ 3,125
		オ ー ス ト リ ア	百株 1,538.51 (-)	千ユーロ 6,247 (△58)	百株 1,041.26	千ユーロ 4,428

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) () 内は、株式分割、増資割当および合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(2) 投資信託受益証券、投資証券

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
EQUINIX INC	—	—	0.708	408
	(—)	(—)	(—)	(—)
CUBESMART	2.187	103	2.187	98
	(—)	(—)	(—)	(—)
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	38.07	860	38.07	848
	(—)	(—)	(—)	(—)
オーストラリア	千□	千オーストラリア・ドル	千□	千オーストラリア・ドル
GPT GROUP	345.205	1,479	—	—
	(—)	(—)	(—)	(—)
STOCKLAND	164.449	627	—	—
	(—)	(—)	(—)	(—)
GOODMAN GROUP	81.331	1,602	81.331	1,608
	(—)	(—)	(—)	(—)
CHARTER HALL GROUP	124.2	1,563	124.2	1,586
	(—)	(—)	(—)	(—)
メキシコ	千□	千メキシコ・ペソ	千□	千メキシコ・ペソ
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	830.4	19,723	830.4	20,807
	(—)	(—)	(—)	(—)
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	146.4	18,469	146.4	20,229
	(—)	(—)	(—)	(—)
ユーロ (スペイン)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	43.627	396	43.627	398
	(—)	(—)	(—)	(—)

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) () 内は、合併、分割等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	98,227,213千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	25,765,793千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	3.81

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等 (2022年9月27日から2023年9月25日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

(注) 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

■組入資産の明細

(1) 外国株式

銘柄	期首(前期末)	当 期		末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
AMAZON.COM INC	364.14	302.83	3,910	580,655		大規模小売り
INTL BUSINESS MACHINES CORP	96.78	67.87	997	148,066		情報技術サービス
ADOBE INC	—	49.63	2,545	378,010		ソフトウェア
CHUBB LTD	114.62	—	—	—		保険
AMGEN INC	44.86	—	—	—		バイオテクノロジー
AFLAC INC	—	24.2	184	27,423		保険
AMERICAN INTL GROUP	—	234.6	1,444	214,533		保険
VALERO ENERGY CORP	22.41	—	—	—		石油・ガス・消耗燃料
APPLE INC	678.76	548.82	9,592	1,424,534		コンピュータ・周辺機器
APPLIED MATERIALS INC	—	104.93	1,428	212,181		半導体・半導体製造装置
ARROW ELECTRONICS INC	—	70.83	898	133,413		電子装置・機器・部品
AUTODESK INC	5.68	—	—	—		ソフトウェア
AUTOMATIC DATA PROCESSING	94.37	—	—	—		専門サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	10.88	12.72	458	68,031		金融サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	—	45.48	194	28,838		資本市場
BORGWARNER INC	70.78	—	—	—		自動車用部品
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	8.77	—	—	—		ライフサイエンス・ツール/サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	162.9	—	—	—		医薬品
UNITED RENTALS INC	2.64	—	—	—		商社・流通業
AMPHENOL CORP	57.53	57.53	479	71,190		電子装置・機器・部品
CSX CORP	535.08	—	—	—		陸上運輸
CATERPILLAR INC	4.36	43.92	1,199	178,093		機械
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	—	52	714	106,100		ソフトウェア
JPMORGAN CHASE & CO	17.43	222.82	3,247	482,202		銀行
CISCO SYSTEMS INC	—	267.88	1,435	213,102		通信機器
COCA-COLA CO/THE	456.9	—	—	—		飲料
COMERICA INC	122.83	—	—	—		銀行
COMCAST CORP-CL A	72.45	561.8	2,544	377,925		メディア
AVIS BUDGET GROUP INC	33.23	—	—	—		陸上運輸
MANHATTAN ASSOCIATES INC	72.72	51.25	996	147,988		ソフトウェア
DR HORTON INC	—	102.57	1,121	166,481		家庭用耐久財
TARGET CORP	90.55	—	—	—		生活必需品流通・小売り
DEERE & CO	—	42.14	1,604	238,340		機械
DECKERS OUTDOOR CORP	—	16.75	855	126,997		繊維・アパレル・贅沢品
EATON CORP PLC	—	79.36	1,687	250,618		電気設備
CADENCE DESIGN SYS INC	103.22	—	—	—		ソフトウェア
EMERSON ELECTRIC CO	44.64	117.35	1,139	169,211		電気設備
EOG RESOURCES INC	141.23	81.9	1,004	149,132		石油・ガス・消耗燃料
ESTEE LAUDER COS INC/THE	80.16	—	—	—		パーソナルケア用品
EXXON MOBIL CORP	75.38	57.07	655	97,410		石油・ガス・消耗燃料
NEXTERA ENERGY INC	89.13	—	—	—		電力
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	25.58	—	—	—		資本市場
FAIR ISAAC CORP	15.08	—	—	—		ソフトウェア
MACY'S INC	215.49	—	—	—		大規模小売り
DENTSPLY SIRONA INC	—	39.5	133	19,873		ヘルスケア機器・用品

銘柄	期首(前期末)	当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
GENERAL DYNAMICS CORP	84.53	—	—	—	—	航空宇宙・防衛
GENUINE PARTS CO	68.17	—	—	—	—	販売
GARTNER INC	37.23	28.99	1,032	153,370	—	情報技術サービス
MCKESSON CORP	29.09	—	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
NVIDIA CORP	18.11	92.34	3,842	570,576	—	半導体・半導体製造装置
HARLEY-DAVIDSON INC	51.91	—	—	—	—	自動車
HERSHEY FOODS CORP	42.47	—	—	—	—	食品
UNUM GROUP	—	207.15	1,034	153,685	—	保険
HOME DEPOT INC	45.94	29.5	901	133,932	—	専門小売り
ILLINOIS TOOL WORKS	—	72.35	1,689	250,882	—	機械
TRANE TECHNOLOGIES PLC	—	38.76	776	115,376	—	建設関連製品
JABIL CIRCUIT INC	172.2	69.84	751	111,594	—	電子装置・機器・部品
JOHNSON & JOHNSON	35.56	47.67	765	113,617	—	医薬品
KLA CORPORATION	49.92	23.55	1,064	158,009	—	半導体・半導体製造装置
KROGER CO	313.68	280	1,278	189,854	—	生活必需品流通・小売り
LAM RESEARCH CORP	36.71	9.78	605	89,915	—	半導体・半導体製造装置
LANDSTAR SYSTEM	—	51.44	933	138,614	—	陸上運輸
LENNAR CORP	—	87.09	988	146,788	—	家庭用耐久財
ELI LILLY & CO	—	39.73	2,187	324,813	—	医薬品
LOUISIANA-PACIFIC CORP	15.41	—	—	—	—	紙製品・林産品
MGIC INVT CORP	711.56	—	—	—	—	金融サービス
CVS HEALTH CORP	131.38	—	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MERCK & CO.INC.	216.11	165.62	1,761	261,538	—	医薬品
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	—	65.26	612	90,912	—	半導体・半導体製造装置
MICROSOFT CORP	294.32	258.5	8,194	1,216,914	—	ソフトウェア
MOTOROLA SOLUTIONS INC	23.63	—	—	—	—	通信機器
NETAPP INC	145.37	123.62	939	139,554	—	コンピュータ・周辺機器
NVR INC	—	1.68	1,001	148,754	—	家庭用耐久財
TAPESTRY INC	288.29	235.6	679	100,866	—	繊維・アパレル・贅沢品
WELLS FARGO & CO	—	21.72	89	13,298	—	銀行
NUCOR CORP	—	82.45	1,262	187,489	—	金属・鉱業
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	—	20.19	1,889	280,638	—	専門小売り
PAYCHEX INC	124.8	—	—	—	—	専門サービス
PEPSICO INC	156.23	—	—	—	—	飲料
PVH CORP	—	117.7	886	131,717	—	繊維・アパレル・贅沢品
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	—	76.87	1,714	254,638	—	石油・ガス・消耗燃料
COSTCO WHOLESALE CORP	15.57	—	—	—	—	生活必需品流通・小売り
PROCTER & GAMBLE CO	209.24	193.78	2,937	436,191	—	家庭用品
PULTE GROUP INC	41.44	86.76	641	95,263	—	家庭用耐久財
RELIANCE STEEL & ALUMINUM CO	—	36.18	948	140,781	—	金属・鉱業
AUTONATION INC	5.56	—	—	—	—	専門小売り
ROCKWELL AUTOMATION INC	45.82	—	—	—	—	電気設備
BOOKING HOLDINGS INC	—	7.45	2,281	338,816	—	ホテル・レストラン・レジャー
ELEVANCE HEALTH INC	27.06	—	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	—	50.29	1,280	190,189	—	化学
SNAP-ON INC	49.95	—	—	—	—	機械
SOUTHERN CO	135.03	—	—	—	—	電力

銘柄	期首(前期末)	当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
CHEVRON CORP	16.64	-	-	-	-	石油・ガス・消耗燃料
STEEL DYNAMICS INC	90.6	96.42	974	144,758		金属・鉱業
STRYKER CORP	-	44.22	1,261	187,333		ヘルスケア機器・用品
TEXAS INSTRUMENTS INC	16.71	-	-	-	-	半導体・半導体製造装置
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	28	-	-	-	-	ライフサイエンス・ツール/サービス
TOLL BROTHERS INC	-	117.22	868	128,934		家庭用耐久財
TRACTOR SUPPLY CO	52.39	-	-	-	-	専門小売り
UNION PACIFIC CORP	106.73	-	-	-	-	陸上運輸
UNITEDHEALTH GROUP INC	48.1	9.12	461	68,542		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
WALMART INC	-	169.39	2,750	408,381		生活必需品流通・小売り
LKQ CORP	203.05	-	-	-	-	販売
TJX COMPANIES INC	-	248.26	2,213	328,702		専門小売り
ZIONS BANCORP NA	180.86	-	-	-	-	銀行
CELANESE CORP	98.36	-	-	-	-	化学
EXPEDIA GROUP INC	65.39	-	-	-	-	ホテル・レストラン・レジャー
MASTERCARD INC	88.41	73.51	2,956	439,072		金融サービス
OWENS CORNING	119.36	71.82	968	143,778		建設関連製品
DISCOVER FINANCIAL	108.59	-	-	-	-	消費者金融
TE CONNECTIVITY LTD	116.46	101.18	1,244	184,870		電子装置・機器・部品
LULULEMON ATHLETICA INC	20.21	-	-	-	-	繊維・アパレル・贅沢品
ULTA BEAUTY INC	25.31	-	-	-	-	専門小売り
VISA INC	152.84	10.77	253	37,597		金融サービス
MARATHON PETROLEUM CORP	54.04	139.64	2,142	318,222		石油・ガス・消耗燃料
VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	-	139	206	30,611		大規模小売り
EPAM SYSTEMS INC	1.24	-	-	-	-	情報技術サービス
VERISK ANALYTICS INC	-	40.46	978	145,371		専門サービス
NXP SEMICONDUCTOR NV	-	19.15	376	55,962		半導体・半導体製造装置
CBOE GLOBAL MARKETS INC	-	72.92	1,145	170,117		資本市場
DOLLAR GENERAL CORP	83.66	-	-	-	-	生活必需品流通・小売り
TESLA INC	90.98	87.43	2,140	317,936		自動車
GENERAL MOTORS CO	-	231.14	753	111,828		自動車
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	48.15	-	-	-	-	資本市場
META PLATFORMS INC	28.74	47.8	1,429	212,295		インタラクティブ・メディアおよびサービス
TAYLOR MORRISON HOME CORP-A	-	203.93	878	130,522		家庭用耐久財
POPULAR INC	130.47	-	-	-	-	銀行
ABBVIE INC	95.64	-	-	-	-	バイオテクノロジー
CDW CORP	29.88	-	-	-	-	電子装置・機器・部品
BROADCOM INC	40	24.55	2,035	302,255		半導体・半導体製造装置
SMARTSHEET INC	177.64	-	-	-	-	ソフトウェア
CIGNA GROUP	43.56	-	-	-	-	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
FERGUSON PLC	-	68.4	1,029	152,929		商社・流通業
FNF GROUP	260.3	-	-	-	-	保険
LINDE PLC	-	51.27	1,912	283,949		化学
SYNCHRONY FINANCIAL	337.43	-	-	-	-	消費者金融
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	68.11	-	-	-	-	電子装置・機器・部品
HELLO GROUP INC ADR	-	916	648	96,306		インタラクティブ・メディアおよびサービス
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	37.5	-	-	-	-	化学

銘柄	株数	期首(前期末)	当期		業種等	
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
ALPHABET INC-CL A	199.33	327.09	4,260	632,661	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	—	585.5	996	147,983	コンピュータ・周辺機器	
PAYPAL HOLDINGS INC	104.51	—	—	—	金融サービス	
ALPHABET INC-CL C	114.97	162.71	2,135	317,131	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
CHEMOURS CO	95.07	—	—	—	化学	
VISTRA CORP	—	319.26	1,060	157,496	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	11,132.1 101銘柄	10,255.77 82銘柄	123,532 —	18,344,511 <68.0%>	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円		
CANADIAN NATL RAILWAY CO	116.58	—	—	—	陸上運輸	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	355.36	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品	
FINNING INTERNATIONAL INC	—	275.7	1,112	122,580	商社・流通業	
IMPERIAL OIL LTD	—	53.91	424	46,792	石油・ガス・消耗燃料	
MAGNA INTERNATIONAL INC	178.78	—	—	—	自動車用部品	
ENERPLUS CORP	814.16	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	808.82	211.97	419	46,270	金融サービス	
NUTRIEN LTD	195.67	—	—	—	化学	
IA FINANCIAL CORP INC	—	49.39	430	47,402	保険	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	177.4	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,646.77 7銘柄	590.97 4銘柄	2,387 —	263,045 <1.0%>	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円		
BHP GROUP LTD	878.45	—	—	—	金属・鉱業	
AMPOL LTD	462.96	446.74	1,492	142,675	石油・ガス・消耗燃料	
RIO TINTO LIMITED	173.98	—	—	—	金属・鉱業	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	—	339.08	1,398	133,744	建設資材	
BLUESCOPE STEEL LTD	—	723.92	1,392	133,112	金属・鉱業	
WHITEHAVEN COAL LTD	1,257.08	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	—	157.76	394	37,757	銀行	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,772.47 4銘柄	1,667.5 4銘柄	4,677 —	447,290 <1.7%>	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円		
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	—	7,760	3,429	65,168	石油・ガス・消耗燃料	
TENCENT HOLDINGS LTD	81	130	4,076	77,459	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
BAIDU INC	150	—	—	—	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	—	6,060	1,878	35,693	自動車	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	—	5,000	5,840	110,960	医薬品	
SITC INTERNATIONAL CO LTD	2,760	—	—	—	海上運輸	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	122	—	—	—	大規模小売り	
NETEASE INC	629	655	10,604	201,484	娯楽	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	5,040	—	—	—	自動車	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	8,782 6銘柄	19,605 5銘柄	25,829 —	490,765 <1.8%>	
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円		
SINGAPORE TECH ENG	—	3,169	1,213	132,029	航空宇宙・防衛	
BEST WORLD INTERNATIONAL LTD	2,041.3	—	—	—	パーソナルケア用品	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,041.3 1銘柄	3,169 1銘柄	1,213 —	132,029 <0.5%>	

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ニュージーランド) FLETCHER BUILDING LTD	百株 1,038.66	百株 -	千ニュージーランド・ドル -	千円 -	建設関連製品
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,038.66 1銘柄	- -銘柄	- -	- < - % >
(台湾) MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD CATCHER TECHNOLOGY CO LTD MEDIATEK INC CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD TAIWAN SEMICONDUCTOR	百株 - - 530 12,110 570	百株 1,600 1,440 480 - 570	千台湾・ドル 27,360 25,992 35,808 - 29,754	千円 126,334 120,018 165,343 - 137,389	コンピュータ・周辺機器 コンピュータ・周辺機器 半導体・半導体製造装置 銀行 半導体・半導体製造装置
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	13,210 3銘柄	4,090 4銘柄	118,914 -	549,085 < 2.0 % >
(イギリス) BARRATT DEVELOPMENTS PLC DIAGEO PLC BAE SYSTEMS PLC BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC NEXT PLC COMPASS GROUP PLC RECKITT BENCKISER GROUP PLC SAGE GROUP PLC(THE) SMITHS GROUP PLC ASTRAZENECA PLC HIKMA PHARMACEUTICALS PLC FERGUSON PLC MELROSE INDUSTRIES PLC	百株 - 87.71 1,150.26 274.66 - 462.63 133.27 - - 104.78 - 79.71 -	百株 294.44 87.71 - - 88.24 442.3 - 846.63 471.02 - 325.35 - 1,369.5	千イギリス・ポンド 137 276 - - 643 892 - 866 781 - 684 - 640	千円 25,035 50,295 - - 117,100 162,222 - 157,646 142,136 - 124,416 - 116,545	家庭用耐久財 飲料 航空宇宙・防衛 タバコ 大規模小売り ホテル・レストラン・レジャー 家庭用品 ソフトウェア コンプロマリット 医薬品 医薬品 商社・流通業 航空宇宙・防衛
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	2,293.02 7銘柄	3,925.19 8銘柄	4,924 -	895,400 < 3.3 % >
(イスラエル) ISRAEL CORP LTD/THE	百株 3.71	百株 -	千イスラエル・シケル -	千円 -	化学
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	3.71 1銘柄	- -銘柄	- -	- < - % >
(スイス) NESTLE SA-REGISTERED ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN NOVARTIS AG-REG SHS ABB LTD HOLCIM LTD	百株 16.67 82.82 - - -	百株 7.21 - 257.59 266.2 170.6	千スイス・フラン 77 - 2,368 858 990	千円 12,609 - 387,451 140,493 161,990	食品 医薬品 医薬品 電気設備 建設資材
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	99.49 2銘柄	701.6 4銘柄	4,294 -	702,544 < 2.6 % >
(デンマーク) A P MOLLER A/S NOVO NORDISK A/S-B	百株 - 239.66	百株 5.48 308.1	千デンマーク・クローネ 6,915 19,761	千円 146,752 419,339	海上運輸 医薬品
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	239.66 1銘柄	313.58 2銘柄	26,677 -	566,092 < 2.1 % >
(ノルウェー) EQUINOR ASA YARA INTERNATIONAL ASA	百株 212.88 249.41	百株 - -	千ノルウェー・クローネ - -	千円 - -	石油・ガス・消耗燃料 化学

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ノルウェー) DNB BANK ASA	百株 -	百株 503.89	千ノルウェー・クローネ 10,964	千円 151,421	銀行
小 計	株 数 銘 柄 数 < 比 率 >	462.29 2銘柄	503.89 1銘柄	10,964 -	151,421 <0.6%>
(スウェーデン) SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A SWEDBANK AB VOLVO AB-B SHS NORDEA BANK ABP	百株 404.78 580.49 679.85 1,232.17	百株 899.18 562.67 527.16 1,075.15	千スウェーデン・クローナ 11,770 11,495 12,069 13,241	千円 157,250 153,577 161,246 176,907	銀行 銀行 機械 銀行
小 計	株 数 銘 柄 数 < 比 率 >	2,897.29 4銘柄	3,064.16 4銘柄	48,576 -	648,981 <2.4%>
(メキシコ) GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV ARCA CONTINENTAL SAB DE CV GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENTRO	百株 1,332 1,488 63	百株 880 - -	千メキシコ・ペソ 12,901 - -	千円 111,545 - -	銀行 飲料 運送インフラ
小 計	株 数 銘 柄 数 < 比 率 >	2,883 3銘柄	880 1銘柄	12,901 -	111,545 <0.4%>
(インド) MAHINDRA & MAHINDRA LTD DR REDDYS LABORATORIES LTD ITC LTD TORRENT PHARMACEUTICALS LTD BAJAJ AUTO LTD	百株 - - - - -	百株 572.87 143.41 1,886.96 389.27 157.97	千インド・ルピー 92,068 79,120 83,611 72,030 79,001	千円 165,723 142,416 150,500 129,654 142,202	自動車 医薬品 タバコ 医薬品 自動車
小 計	株 数 銘 柄 数 < 比 率 >	- 1銘柄	3,150.48 5銘柄	405,832 -	730,497 <2.7%>
(韓国) DB INSURANCE CO LTD KT&G CORP LG UPLUS CORP KIA CORPORATION KB FINANCIAL GROUP INC WOORI FINANCIAL GROUP INC DOOSAN BOBCAT INC	百株 201.14 - 758.85 - 242.2 931.53 -	百株 - 110.9 758.85 118.79 - - 202.96	千韓国・ウォン - 968,157 790,721 952,695 - - 1,116,280	千円 - 108,046 88,244 106,320 - - 124,576	保険 タバコ 各種電気通信サービス 自動車 銀行 銀行 機械
小 計	株 数 銘 柄 数 < 比 率 >	2,133.72 4銘柄	1,191.5 4銘柄	3,827,854 -	427,188 <1.6%>
(南アフリカ) EXXARO RESOURCES LTD FIRSTRAND LTD NASPERS LTD	百株 709.85 - -	百株 - 2,388.42 51.29	千南アフリカ・ランド - 15,622 15,987	千円 - 123,731 126,618	石油・ガス・消耗燃料 金融サービス 大規模小売り
小 計	株 数 銘 柄 数 < 比 率 >	709.85 1銘柄	2,439.71 2銘柄	31,609 -	250,350 <0.9%>
(ポーランド) DINO POLSKA SA	百株 56.13	百株 -	千ポーランド・ズロチ -	千円 -	生活必需品流通・小売り
小 計	株 数 銘 柄 数 < 比 率 >	56.13 1銘柄	- 1銘柄	- -	- <- %>
(ユーロ圏・オランダ) BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES NV RANDSTAD NV	百株 - -	百株 17.87 153.16	千ユーロ 163 783	千円 25,793 124,032	半導体・半導体製造装置 専門サービス

銘 柄	期 首(前期末)		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	396.88	-	-	-	生活必需品流通・小売り
ASML HOLDING NV	13.85	25.07	1,391	220,238	半導体・半導体製造装置
WOLTERS KLUWER-CVA	109.46	-	-	-	専門サービス
STMICROELECTRONICS NV	302.31	97.09	390	61,864	半導体・半導体製造装置
NN GROUP NV	110.53	-	-	-	保険
ABN AMRO BANK NV	-	593.84	774	122,622	銀行
小 計	株 数 銘 柄 数<比 率>	933.03 5銘柄	887.03 5銘柄	3,504 -	554,550 <2.1%>
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
PERNOD-RICARD	56.68	-	-	-	飲料
SANOFI	120.85	115.82	1,182	187,110	医薬品
ENGIE	-	556.98	833	131,826	総合公益事業
小 計	株 数 銘 柄 数<比 率>	177.53 2銘柄	672.8 2銘柄	2,015 -	318,936 <1.2%>
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
MERCK KGAA	60.35	-	-	-	医薬品
SAP SE	-	77.47	968	153,299	ソフトウェア
BAYER AG	359.5	-	-	-	医薬品
MERCEDES-BENZ GROUP AG	-	138.01	929	147,030	自動車
HEIDELBERG MATERIALS AG	-	127.7	914	144,634	建設資材
INFINEON TECHNOLOGIES AG	409.41	399.11	1,253	198,263	半導体・半導体製造装置
SCOUT24 SE	21.34	-	-	-	インタラクティブ・メディアおよびサービス
小 計	株 数 銘 柄 数<比 率>	850.6 4銘柄	742.29 4銘柄	4,065 -	643,227 <2.4%>
(ユーロ…ポルトガル)	百株	百株	千ユーロ	千円	
JERONIMO MARTINS	411.42	-	-	-	生活必需品流通・小売り
小 計	株 数 銘 柄 数<比 率>	411.42 1銘柄	- -銘柄	- -	- <- %>
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	-	258.87	193	30,581	銀行
小 計	株 数 銘 柄 数<比 率>	- -銘柄	258.87 1銘柄	193 -	30,581 <0.1%>
(ユーロ…オーストリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ERSTE GROUP BANK AG	-	286.53	930	147,165	銀行
BAWAG GROUP AG	-	210.72	919	145,438	銀行
小 計	株 数 銘 柄 数<比 率>	- -銘柄	497.25 2銘柄	1,849 -	292,604 <1.1%>
合 計	株 数 銘 柄 数<比 率>	55,774.04 161銘柄	58,606.59 145銘柄	- -	26,550,651 <98.4%>

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) < >内は、期末の純資産総額に対する株式評価額の比率です。

(注3) 金額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

(2) 外国投資信託受益証券、投資証券

銘	柄	期首(前期末)	当期		末
		□ 数	□ 数	外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)		千□	千□	千アメリカ・ドル	千円
EQUINIX INC		0.708	-	-	-
小計	□ 数 ・ 金額 銘 柄 数<比 率>	0.708	-	-	-
		1銘柄<0.2%>	-銘柄<-%>	-	-
(オーストラリア)		千□	千□	千オーストラリア・ドル	千円
GPT GROUP		-	345.205	1,370	131,043
STOCKLAND		-	164.449	641	61,325
小計	□ 数 ・ 金額 銘 柄 数<比 率>	-	509.654	2,011	192,369
		-銘柄<-%>	2銘柄<0.7%>	-	-
合計	□ 数 ・ 金額 銘 柄 数<比 率>	0.708	509.654	-	192,369
		1銘柄<0.2%>	2銘柄<0.7%>	-	-

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 比率は、期末の純資産総額に対する投資信託受益証券評価額の比率です。

(注3) 金額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

■投資信託財産の構成

2023年9月25日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	26,550,651千円	98.4%
投資信託受益証券・投資証券	192,369	0.7
コール・ローン等、その他	245,511	0.9
投資信託財産総額	26,988,532	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、26,869,734千円、99.6%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2023年9月25日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=148.50円、1カナダ・ドル=110.19円、1オーストラリア・ドル=95.62円、1香港・ドル=19.00円、1シンガポール・ドル=108.78円、1ニュージーランド・ドル=88.51円、1台湾・ドル=4.617円、1イギリス・ポンド=181.84円、1イスラエル・シェケル=38.976円、1スイス・フラン=163.60円、1トルコ・リラ=5.468円、1デンマーク・クローネ=21.22円、1ノルウェー・クローネ=13.81円、1スウェーデン・クローナ=13.36円、1メキシコ・ペソ=8.645円、1インド・ルピー=1.80円、100韓国・ウォン=11.16円、1南アフリカ・ランド=7.92円、1ポーランド・ズロチ=34.346円、1ユーロ=158.23円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年9月25日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	26,988,532,465円
コール・ローン等	206,140,318
株 式(評価額)	26,550,651,016
投資信託受益証券(評価額)	192,369,746
未 収 配 当 金	39,371,385
(B) 負 債	-
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	26,988,532,465
元 本	13,504,824,491
次 期 繰 越 損 益 金	13,483,707,974
(D) 受 益 権 総 口 数	13,504,824,491口
1万口当たり基準価額(C/D)	19,984円

(注1) 期首元本額 15,910,216,983円
追加設定元本額 160,750,872円
一部解約元本額 2,566,143,364円

(注2) 期末における元本の内訳
A1(人工知能)活用型世界株ファンド 13,504,824,491円
期末元本合計 13,504,824,491円

■損益の状況

当期 自2022年9月27日 至2023年9月25日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	536,885,505円
受 取 配 当 金	528,907,416
受 取 利 息	7,928,669
そ の 他 収 益 金	129,480
支 払 利 息	△80,060
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	5,351,926,822
売 買 益	7,593,347,038
売 買 損	△2,241,420,216
(C) そ の 他 費 用	△9,937,786
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	5,878,874,541
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	9,513,211,941
(F) 解 約 差 損 益 金	△2,047,346,636
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	138,968,128
(H) 合 計(D+E+F+G)	13,483,707,974
次 期 繰 越 損 益 金(H)	13,483,707,974

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
(注2) (F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。