

運用報告書 (全体版)

第2期<決算日2019年9月24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成果が得られる権利を表示する証券および証券を含みます。 ※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リ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.・イギリス、アセットマネジメントOne シンガポール・プライベート・リミテッド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。) および売買益 (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

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、2019年9月24日に第2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

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

A I (人工知能) 活用型世界株ファンド

■設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額 (分配落)	税 込 金 期 騰 落 中 率			株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	投 資 証 券 組 入 比 率	純 資 産 総 額
		円	円	%				
(設 定 日) 2017年9月29日	10,000	円	円	%	%	%	%	百万円 9,151
1期 (2018年9月25日)	10,641	0	0	6.4	95.7	—	1.5	50,844
2期 (2019年9月24日)	9,700	0	0	△8.8	97.7	—	—	33,921

(注1) 設定日の基準価額は設定当初の金額、純資産総額は設定当初の元本額を表示しております。

(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。

(注4) 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5) △ (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	騰 落 率	株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	投 資 証 券 組 入 比 率
(期 首) 2018年9月25日	10,641	—	95.7	—	1.5
9 月 末	10,687	0.4	95.8	—	1.5
10 月 末	9,586	△9.9	96.2	—	1.6
11 月 末	9,834	△7.6	97.2	—	1.5
12 月 末	8,857	△16.8	96.0	—	3.0
2019年1月末	9,360	△12.0	96.3	—	2.9
2 月 末	9,853	△7.4	96.2	—	2.8
3 月 末	9,863	△7.3	96.7	—	1.7
4 月 末	10,123	△4.9	96.7	—	1.6
5 月 末	9,453	△11.2	96.7	—	1.7
6 月 末	9,784	△8.1	97.2	—	0.5
7 月 末	9,961	△6.4	97.1	—	0.5
8 月 末	9,373	△11.9	97.6	—	0.4
(期 末) 2019年9月24日	9,700	△8.8	97.7	—	—

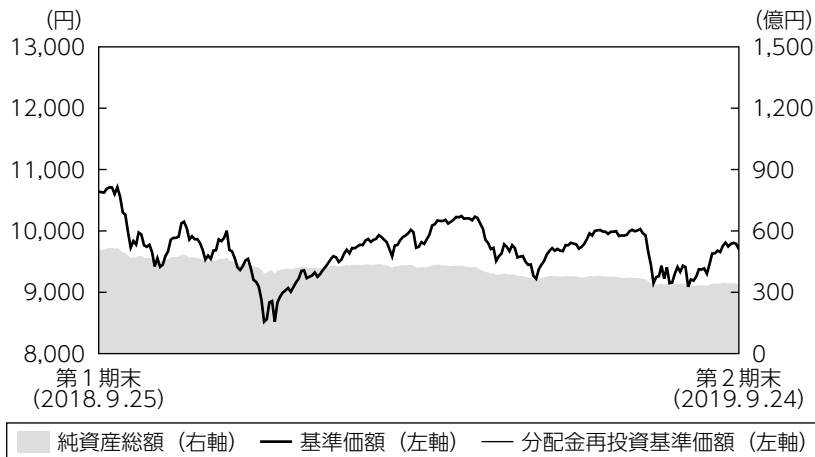
(注1) 騰落率は期首比です。

(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（2018年9月26日から2019年9月24日まで）

基準価額等の推移



- (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はありません。
- (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

期初から2018年12月末にかけ、F R B（米連邦準備理事会）の利上げ等により世界的に株価が下落し、為替市場でも主要通貨に対して円高が進んだため、基準価額は大きく下落しました。その後2019年4月にかけ、米国の利上げ休止観測などから株価は反発したため基準価額も下落分の大部分を戻しましたが、5月以降は米中貿易摩擦の動向に株価が振られ、為替市場も米金利の低下から円高基調となったため、基準価額は大きな振幅を伴いながら下落しました。

投資環境

期初から2018年12月末にかけ、F R B が利上げを決定したことなどにより、世界的に株価は下落しました。2019年1月から4月末にかけ、パウエルF R B 議長が利上げ休止を示唆したことが好感され株価は反発、さらに欧米企業の良好な決算が続いたことなどもあり株価は上昇基調を辿りました。その後、米中貿易摩擦の動向に振らされレンジ相場となりました。

期初から2018年12月末にかけ、世界的な景気減速を巡る懸念に伴うリスク回避を背景に、米ドルは円に対して下落しました。その後、米ドルが円に対して上昇する局面はあったものの、米中貿易摩擦の長期化懸念や、米金利低下幅の拡大などから期末にかけてドルは対円で下落基調となりました。また、ユーロも欧州政治情勢を巡る不透明感が増したことから円に対して下落しました。

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、国別で米国、中国や英国の銘柄を、業種別では情報技術や一般消費財・サービスの銘柄を中心に投資しました。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12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
	2018年9月26日 ～2019年9月24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	351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2期		項目の概要
	(2018年9月26日 ～2019年9月24日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	150円	1.551%	(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9,699円です。
(投信会社)	(73)	(0.754)	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)	(73)	(0.754)	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)	(4)	(0.043)	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	5	0.055	(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)	(5)	(0.055)	
(投資証券)	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	14	0.148	(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)	(14)	(0.148)	
(投資証券)	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	4	0.043	(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)	(3)	(0.034)	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)	(1)	(0.006)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	174	1.797	

(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。

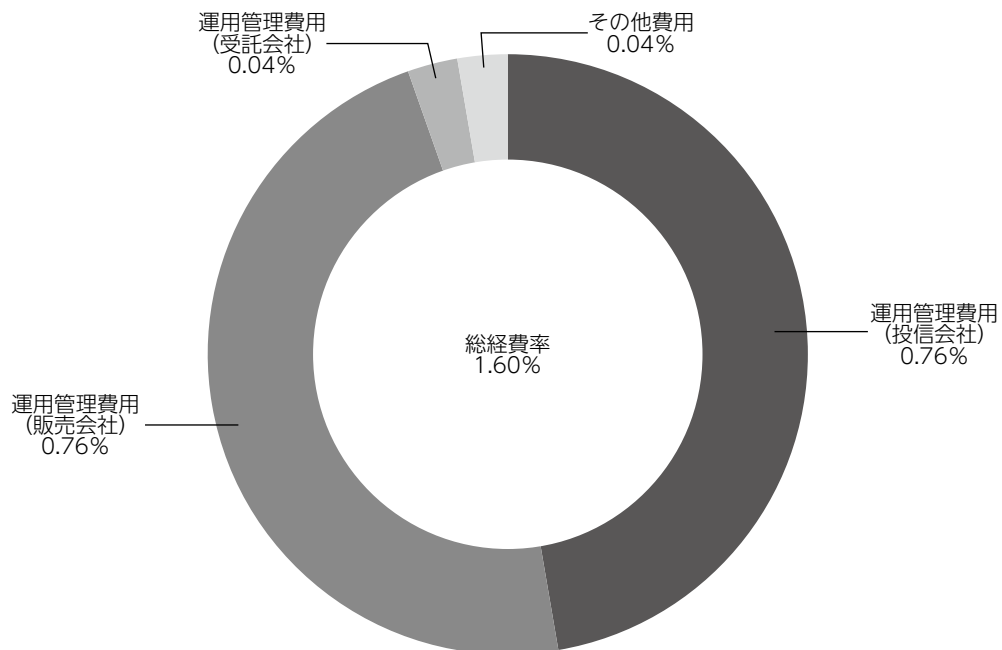
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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1.60%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（2018年9月26日から2019年9月24日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
A I（人工知能）活用型世界株マザーファンド	506,347	550,000	13,510,422	13,530,000

■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	146,954,531千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	40,050,511千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	3.66

(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（2018年9月26日から2019年9月24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
	千□	千□	千円
A I（人工知能）活用型世界株マザーファンド	46,776,473	33,772,399	33,769,022

■投資信託財産の構成

2019年9月24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	33,769,022	98.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	650,686	1.9
投 資 信 託 財 産 総 額	34,419,708	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、2019年9月24日現在、A I (人工知能) 活用型世界株マザーファンドは33,450,744千円、98.6%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、2019年9月24日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=107.69円、1カナダ・ドル=81.21円、1オーストラリア・ドル=72.94円、1香港・ドル=13.74円、1シンガポール・ドル=78.17円、1ニュージーランド・ドル=67.75円、1台湾・ドル=3.47円、1イギリス・ポンド=133.90円、1イスラエル・シェケル=30.65円、1スイス・フラン=108.72円、1デンマーク・クローネ=15.85円、1ノルウェー・クローネ=11.90円、1スウェーデン・クローナ=11.08円、1メキシコ・ペソ=5.53円、1インド・ルピー=1.53円、1ブラジル・レアル=25.85円、100韓国・ウォン=9.04円、1南アフリカ・ランド=7.24円、1ポーランド・ズロチ=26.97円、1ユーロ=118.33円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年9月24日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	34,419,708,395円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	500,686,060
A I (人工知能) 活用型世界株マザーファンド(評価額)	33,769,022,335
未 収 入 金	150,000,000
(B) 負 債	498,359,761
未 払 解 約 金	203,261,162
未 払 信 託 報 酬	294,563,709
そ の 他 未 払 費 用	534,890
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	33,921,348,634
元 本	34,969,635,568
次 期 繰 越 損 益 金	△1,048,286,934
(D) 受 益 権 総 口 数	34,969,635,568口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	9,700円

(注) 期首における元本額は47,780,066,261円、当期中における追加設定元本額は5,284,854,128円、同解約元本額は18,095,284,821円です。

■損益の状況

当期 自2018年9月26日 至2019年9月24日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△188,195円
受 取 利 息	46,836
支 払 利 息	△235,031
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△2,331,241,616
売 買 損 益	1,171,040,855
買 入 損 益	△3,502,282,471
(C) 信 託 報 酬	△638,497,104
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△2,969,926,915
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	765,824,409
(F) 追 加 信 託 差 損 益	1,155,815,572
(配 当 等 相 当 額)	(158,512,103)
(売 買 損 益 相 当 額)	(997,303,469)
(G) 合 計(D+E+F)	△1,048,286,934
次 期 繰 越 損 益 金(G)	△1,048,286,934
追 加 信 託 差 損 益 金	1,155,815,572
(配 当 等 相 当 額)	(168,309,284)
(売 買 損 益 相 当 額)	(987,506,288)
分 配 準 備 積 立 金	1,061,394,733
繰 越 損 益 金	△3,265,497,239

(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	295,570,324円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収 益 調 整 金	168,309,284
(d) 分 配 準 備 積 立 金	765,824,409
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	1,229,704,017
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	351.65
(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。

《お知らせ》

- 当ファンドが投資対象とする「A I（人工知能）活用型世界株マザーファンド」において、アセットマネジメントOneインターナショナル・リミテッドが担う株式リサーチ業務をアセットマネジメントOne U.S.A.・インクへ移管することに伴い、アセットマネジメントOneインターナショナル・リミテッドを削除する所要の約款変更を行いました。

（A I（人工知能）活用型世界株マザーファンド：2019年6月26日）

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2期 (決算日 2019年9月24日)

(計算期間 2018年9月26日～2019年9月24日)

A I (人工知能) 活用型世界株マザーファンドの第2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。

■設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比	投 資 証 券 組 入 比 率	純 資 産 額
	期 騰	中 落 率				
(設 定 日) 2017年9月29日	円 10,000	% -	% -	% -	% -	百万円 9,000
1期(2018年9月25日)	10,822	8.2	96.1	-	1.6	50,620
2期(2019年9月24日)	9,999	△7.6	98.1	-	-	33,768

(注1) 設定日の基準価額は設定当初の金額、純資産総額は設定当初の元本額を表示しております。

(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)。

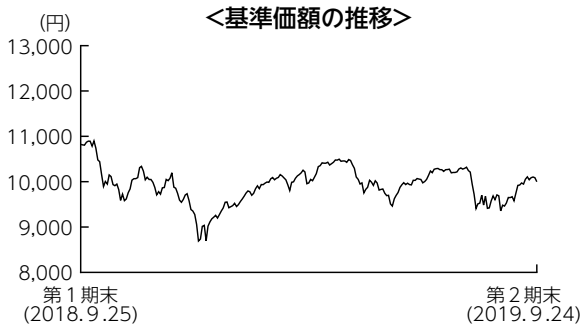
■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比	投 資 証 券 組 入 比 率
	円	騰 落 率 %			
(期 首) 2018 年 9 月 25 日	10,822	—	96.1	—	1.6
9 月 末	10,870	0.4	96.3	—	1.5
10 月 末	9,758	△9.8	96.7	—	1.6
11 月 末	10,023	△7.4	97.2	—	1.5
12 月 末	9,037	△16.5	96.0	—	3.0
2019 年 1 月 末	9,562	△11.6	96.1	—	2.9
2 月 末	10,076	△6.9	96.4	—	2.8
3 月 末	10,098	△6.7	97.1	—	1.7
4 月 末	10,375	△4.1	97.2	—	1.6
5 月 末	9,700	△10.4	96.7	—	1.7
6 月 末	10,050	△7.1	97.6	—	0.5
7 月 末	10,246	△5.3	97.6	—	0.5
8 月 末	9,651	△10.8	97.6	—	0.4
(期 末) 2019 年 9 月 24 日	9,999	△7.6	98.1	—	—

(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（2018年9月26日から2019年9月24日まで）



基準価額の推移

当ファンドの基準価額は9,999円となり、前期末比で7.6%下落しました。

基準価額の主な変動要因

期初から2018年12月末にかけ、F R B（米連邦準備理事会）の利上げ等により世界的に株価が下落し、為替市場でも主要通貨に対して円高が進んだため、基準価額は大きく下落しました。その後2019年4月にかけ、米国の利上げ休止観測などから株価は反発したため基準価額も下落分の大部分を戻しましたが、5月以降は米中貿易摩擦の動向に株価が振られ、為替市場も米金利の低下から円高基調となったため、基準価額は大きな振幅を伴いながら下落しました。

投資環境

期初から2018年12月末にかけ、F R Bが利上げを決定したことなどにより、世界的に株価は下落しました。2019年1月から4月末にかけ、パウエルF R B議長が利上げ休止を示唆したことが好感され株価は反発、さらに欧米企業の良好な決算が続いたことなどもあり株価は上昇基調を辿りました。その後、米中貿易摩擦の動向に振られレンジ相場となりました。

期初から2018年12月末にかけ、世界的な景気減速を巡る懸念に伴うリスク回避を背景に、米ドルは円に対して下落しました。その後、米ドルが円に対して上昇する局面はあったものの、米中貿易摩擦の長期化懸念や、米金利低下幅の拡大などから期末にかけてドルは対円で下落基調となりました。また、ユーロも欧州政治情勢を巡る不透明感が増したことから円に対して下落しました。

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、国別で米国、中国や英国の銘柄を、業種別では情報技術や一般消費財・サービスの銘柄を中心に投資しました。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】

(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。なお、5%未満については、「その他」として集計しています。

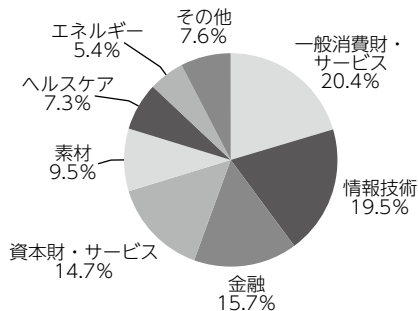
(注3) 国別配分は、発行国（地域）を表示しています。

(注4) 国別配分・通貨別配分については、上位11位以下をその他に含めて集計しています。

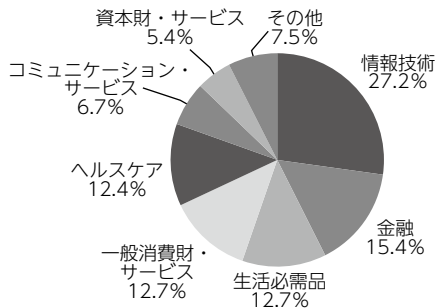
(注5) 現金等はその他として表示しています。なお、その他は未払金等の発生によりマイナスになることがあります。

○業種別配分

期首（前期末）

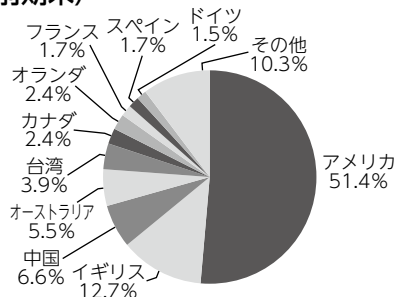


期末

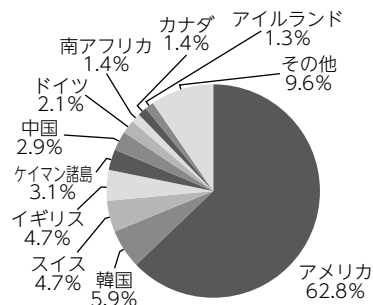


○国別配分

期首（前期末）

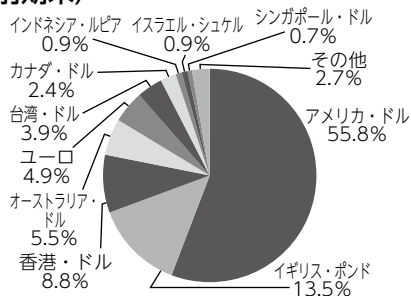


期末

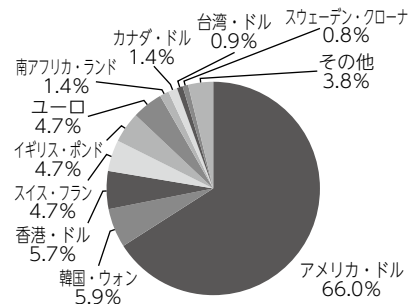


○通貨別配分

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	
	金 額	比 率
(a) 売買委託手数料 (株 式) (投 資 証 券)	5円 (5) (0)	0.055% (0.055) (0.000)
(b) 有価証券取引税 (株 式) (投 資 証 券)	15 (15) (0)	0.148 (0.148) (0.000)
(c) その他費用 (保 管 費 用) (そ の 他)	4 (3) (1)	0.040 (0.034) (0.006)
合 計	24	0.244

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。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(9,929円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については4ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

■ 売買及び取引の状況 (2018年9月26日から2019年9月24日まで)

(1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ア メ リ カ	百株 62,905.86 (680)	千アメリカ・ドル 349,381 (-)	百株 83,011.47	千アメリカ・ドル 381,296
	カ ナ ダ	百株 5,930.48 (-)	千カナダ・ドル 13,564 (-)	百株 6,548.22	千カナダ・ドル 20,170
	オーストラリア	百株 13,297.24 (-)	千オーストラリア・ドル 8,583 (-)	百株 98,559.71	千オーストラリア・ドル 41,343
	香 港	百株 446,571 (-)	千香港・ドル 324,413 (-)	百株 815,365	千香港・ドル 445,453
	シンガポール	百株 16,757 (-)	千シンガポール・ドル 6,928 (-)	百株 47,447	千シンガポール・ドル 8,992
	ニュージーランド	百株 10,331.97 (-)	千ニュージーランド・ドル 4,391 (-)	百株 10,331.97	千ニュージーランド・ドル 3,942
	台 湾	百株 78,030 (△8,292)	千台湾・ドル 269,763 (△8,291)	百株 324,928	千台湾・ドル 678,972
	イ ギ リ ス	百株 76,957.18 (-)	千イギリス・ポンド 43,070 (-)	百株 252,231.03	千イギリス・ポンド 73,601
	イスラエル	百株 (-)	千イスラエル・シケル (-)	百株 6,471.57	千イスラエル・シケル 13,190

		買 付		売 付		
		株 数	金 額	株 数	金 額	
外	ス イ ス	百株 2,239.79 (151.29)	千スイス・フラン 25,199 (-)	百株 1,267.15	千スイス・フラン 12,586	
	デ ン マ ー ク	百株 113.1 (-)	千デンマーク・クローネ 11,596 (-)	百株 -	千デンマーク・クローネ -	
	ノ ル ウ ェ ー	百株 2,789.65 (-)	千ノルウェー・クローネ 30,492 (-)	百株 3,089.39	千ノルウェー・クローネ 45,230	
	ス ウ ェ ー デ ン	百株 1,370.51 (-)	千スウェーデン・クローナ 26,804 (-)	百株 181.86	千スウェーデン・クローナ 1,561	
	メ キ シ コ	百株 83,232 (-)	千メキシコ・ペソ 236,776 (-)	百株 80,560	千メキシコ・ペソ 184,108	
	フ ィ リ ピ ン	百株 5,500 (-)	千フィリピン・ペソ 81,360 (-)	百株 5,500	千フィリピン・ペソ 69,663	
	イ ン ド	百株 14,643.7 (-)	千インド・ルピー 417,925 (-)	百株 14,643.7	千インド・ルピー 380,810	
	イ ン ド ネ シ ア	百株 -	千インドネシア・ルピア -	百株 151,827	千インドネシア・ルピア 60,381,271	
	ブ ラ ジ ル	百株 10,415 (-)	千ブラジル・レアル 31,896 (-)	百株 7,913	千ブラジル・レアル 29,032	
	韓 国	百株 6,792.64 (-)	千韓国・ウォン 22,451,620 (-)	百株 82.31	千韓国・ウォン 796,371	
	南 ア フ リ カ	百株 14,066.55 (-)	千南アフリカ・ランド 147,332 (-)	百株 8,870.32	千南アフリカ・ランド 77,842	
国	ユ	オ ラ ン ダ	百株 1,032.81 (-)	千ユーロ 4,978 (-)	百株 1,046.08	千ユーロ 4,868
		ベ ル ギ ー	百株 321.73 (-)	千ユーロ 1,587 (-)	百株 321.73	千ユーロ 1,567
	イ	フ ラ ン ス	百株 10,155.79 (-)	千ユーロ 10,638 (△51)	百株 9,810.27	千ユーロ 14,168
		ド イ ツ	百株 1,252.54 (-)	千ユーロ 7,921 (-)	百株 1,960.33	千ユーロ 6,362
		ポ ル ト ガ ル	百株 65,200.91 (-)	千ユーロ 1,570 (-)	百株 65,200.91	千ユーロ 1,581
		ス ペ イ ン	百株 15,738.37 (-)	千ユーロ 7,056 (-)	百株 27,506.48	千ユーロ 9,966
		イ タ リ ア	百株 26,635.74 (-)	千ユーロ 8,492 (-)	百株 23,617.6	千ユーロ 7,865
		ク	フ ィ ン ラ ン ド	百株 9,927.52 (-)	千ユーロ 6,539 (-)	百株 9,927.52

(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) 投資証券

	買 付		売 付	
	□ 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
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	47.379	1,685	47.379	1,701
	(-)	(-)	(-)	(-)
LEXINGTON REALTY TRUST	208.744	1,816	208.744	1,865
	(-)	(-)	(-)	(-)
SITE CENTERS CORP	147.412	1,912	147.412	1,929
	(-)	(-)	(-)	(-)
MEDICAL PROPERTIES TRUST	106.082	1,797	106.082	1,935
	(-)	(-)	(-)	(-)
VEREIT INC	395.036	3,070	395.036	3,584
	(-)	(-)	(-)	(-)
SABRA HEALTH CARE REIT INC	0.63	14	155.44	2,874
	(-)	(-)	(-)	(-)
PARK HOTELS & RESORTS INC	65.646	1,826	170.914	4,821
	(-)	(-)	(-)	(-)
COLONY CAPITAL INC	292.661	1,590	292.661	1,507
	(-)	(-)	(-)	(-)

(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	146,954,531千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	40,050,511千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	3.66

(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 (2018年9月26日から2019年9月24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		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	46.02	21.94	3,916	421,816	インターネット販売・通信販売
INTL BUSINESS MACHINES CORP	—	235	3,338	359,538	情報技術サービス
AMGEN INC	—	194.36	3,843	413,924	バイオテクノロジー
AMERICAN EXPRESS CO	—	462.39	5,467	588,773	消費者金融
JONES LANG LASALLE INC	—	121.67	1,671	179,977	不動産管理・開発
ANSYS INC	—	93.88	2,034	219,112	ソフトウェア
APPLE INC	827.21	253.93	5,553	598,105	コンピュータ・周辺機器
APPLIED MATERIALS INC	—	846.18	4,379	471,663	半導体・半導体製造装置
ASPEN TECHNOLOGY INC	314.67	—	—	—	ソフトウェア
AUTOZONE INC	—	21.04	2,413	259,945	専門小売り
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	—	19.99	415	44,768	各種金融サービス
VERIZON COMM INC	—	39.89	240	25,864	各種電気通信サービス
BEST BUY CO INC	—	272.09	1,834	197,520	専門小売り
YUM! BRANDS INC	654.76	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	—	27.86	1,967	211,880	ライフサイエンス・ツール/サービス
CARDINAL HEALTH INC	—	355.16	1,675	180,411	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	—	142.46	1,544	166,363	ソフトウェア
JPMORGAN CHASE & CO	—	111.75	1,328	143,064	銀行
CINTAS CORP	—	49.37	1,257	135,388	商業サービス・用品
CISCO SYSTEMS INC	—	866.21	4,280	461,000	通信機器
COMCAST CORP-CL A	—	1,270.37	5,871	632,249	メディア
MOODY'S CORP	—	183.26	3,947	425,058	資本市場
THE WALT DISNEY CO	—	19.41	257	27,687	娯楽
EBAY INC	—	970.48	3,905	420,552	インターネット販売・通信販売
BANK OF AMERICA CORP	—	140.95	416	44,808	銀行
CITIGROUP INC	—	846.11	5,884	633,722	銀行
EASTMAN CHEMICAL CO	419.32	—	—	—	化学
CADENCE DESIGN SYS INC	—	315	2,078	223,785	ソフトウェア
ESTEE LAUDER COS INC/THE	—	51.65	996	107,350	パーソナル用品
EXXON MOBIL CORP	—	99.63	718	77,389	石油・ガス・消耗燃料
FAIR ISAAC CORP	152.37	—	—	—	ソフトウェア
GENTEX CORP	1,525.53	—	—	—	自動車部品
GILEAD SCIENCES INC	—	678.76	4,461	480,457	バイオテクノロジー
GRACO INC	764.62	—	—	—	機械
WW GRAINGER INC	107.6	—	—	—	商社・流通業
F5 NETWORKS INC	194.84	—	—	—	通信機器
UNUM GROUP	—	480.18	1,422	153,166	保険
HOME DEPOT INC	457.51	5.66	128	13,790	専門小売り
BIOGEN INC	—	99.78	2,394	257,844	バイオテクノロジー
ILLINOIS TOOL WORKS	503.76	—	—	—	機械
INTUIT INC	—	142.47	3,832	412,715	ソフトウェア
INTEL CORP	1,961.93	626.61	3,189	343,471	半導体・半導体製造装置
JOHNSON & JOHNSON	—	489.46	6,448	694,400	医薬品
KROGER CO	—	750	1,929	207,734	食品・生活必需品小売り
LAM RESEARCH CORP	—	36.27	864	93,054	半導体・半導体製造装置
MCDONALD'S CORPORATION	—	150.15	3,176	342,052	ホテル・レストラン・レジャー
EVEREST RE GROUP LTD	—	64.24	1,702	183,327	保険
MANPOWERGROUP INC	376.3	166.29	1,394	150,210	専門サービス
METLIFE INC	—	463.67	2,213	238,328	保険

銘柄	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	
MERCK & CO.INC.	-	595.33	5,022	540,841	医薬品
MICROSOFT CORP	-	689.2	9,589	1,032,696	ソフトウェア
NETEASE INC-ADR	-	83.4	2,224	239,532	娯楽
NVR INC	-	5.08	1,779	191,636	家庭用耐久財
ORACLE CORP	-	699.54	3,778	406,951	ソフトウェア
PFIZER INC	2,219.61	-	-	-	医薬品
PROCTER & GAMBLE CO	-	532.86	6,565	707,081	家庭用品
PULTE GROUP INC	-	512.49	1,827	196,807	家庭用耐久財
KFORCE INC	872.57	-	-	-	専門サービス
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	-	131.7	1,702	183,383	情報技術サービス
ACCENTURE PLC-CL A	-	217.34	4,191	451,348	情報技術サービス
BOOKING HOLDINGS INC	-	25.07	5,037	542,498	インターネット販売・通信販売
POOL CORP	210.75	-	-	-	販売
SEI INVESTMENTS CO	613.36	-	-	-	資本市場
AMERISOURCEBERGEN CORP	421.27	-	-	-	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	-	178.11	1,017	109,559	保険
AT&T INC	-	57.22	215	23,169	各種電気通信サービス
CHEVRON CORP	-	134.28	1,677	180,613	石油・ガス・消耗燃料
STARBUCKS CORP	-	588.03	5,339	575,053	ホテル・レストラン・レジャー
SYNOPSYS INC	-	168.15	2,305	248,279	ソフトウェア
SYSCO CORP	-	300.31	2,363	254,518	食品・生活必需品小売り
TEXAS INSTRUMENTS INC	-	366.52	4,683	504,315	半導体・半導体製造装置
UNITEDHEALTH GROUP INC	252.95	127.1	2,907	313,126	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
VISHAY INTERTECHNOLOGY INC	1,638.4	-	-	-	電子装置・機器・部品
WALMART INC	-	366.1	4,306	463,720	食品・生活必需品小売り
WASTE MANAGEMENT INC	809.64	-	-	-	商業サービス・用品
PENSKE AUTOMOTIVE GROUP	693.44	-	-	-	専門小売り
WHIRLPOOL CORP	-	111.31	1,663	179,133	家庭用耐久財
WILEY (JOHN) & SONS -CL A	622.78	-	-	-	メディア
TJX COMPANIES INC	680	-	-	-	専門小売り
GAZPROM PAO ADR	11,249.59	-	-	-	石油・ガス・消耗燃料
WESTLAKE CHEMICAL CORP	364.85	-	-	-	化学
LAS VEGAS SANDS CORP	798.7	-	-	-	ホテル・レストラン・レジャー
LAZARD LTD	820.84	-	-	-	資本市場
MORNINGSTAR INC	256.64	-	-	-	資本市場
MASTERCARD INC	428.04	116.27	3,175	342,014	情報技術サービス
EVERCORE PARTNERS INC	354.58	-	-	-	資本市場
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	275.43	-	-	-	情報技術サービス
MERCADOLIBRE INC	159.68	-	-	-	インターネット販売・通信販売
MSCI INC	209.27	100.17	2,263	243,749	資本市場
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	-	348.56	2,509	270,262	タバコ
VISA INC	-	38.99	681	73,441	情報技術サービス
KEURIG DR PEPPER INC	1,565.14	-	-	-	飲料
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	656.05	-	-	-	化学
ALLISON TRANSMISSION HOLDINGS INC	709.05	-	-	-	機械
CIT GROUP INC	-	316.1	1,446	155,736	銀行
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	687.06	230.59	1,612	173,651	情報技術サービス
TESLA INC	136.36	-	-	-	自動車
GENERAL MOTORS CO	-	340	1,266	136,352	自動車
ALLY FINANCIAL INC	-	522.65	1,764	190,071	消費者金融
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	-	210.92	1,781	191,864	資本市場
VOYA FINANCIAL INC	-	294.16	1,622	174,736	各種金融サービス

銘柄	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	
FACEBOOK INC	-	88.51	1,653	178,070	インタラクティブ・メディアおよびサービス
ARTISAN PARTNERS ASSET MANAGEMENT INC	1,206.04	-	-	-	資本市場
ABBVIE INC	877.18	234.98	1,713	184,549	バイオテクノロジー
CDW CORP	424.68	164.77	1,966	211,757	電子装置・機器・部品
ATKORE INTERNATIONAL GROUP INC	1,389.27	-	-	-	電気設備
SCIENCE APPLICATIONS INTERNATIONAL	398.03	-	-	-	情報技術サービス
NEW MEDIA INVESTMENT GROUP INC	2,528.4	-	-	-	メディア
DELL TECHNOLOGIES INC	-	36.03	190	20,541	コンピュータ・周辺機器
XEROX HOLDINGS CORP	-	459.81	1,371	147,709	コンピュータ・周辺機器
TRINSEO SA	474.78	-	-	-	化学
ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	-	3.85	68	7,337	インターネット販売・通信販売
SYNCHRONY FINANCIAL	-	451.42	1,540	165,868	消費者金融
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	-	1,546.93	2,227	239,888	コンピュータ・周辺機器
PAYPAL HOLDINGS INC	-	286.87	3,015	324,716	情報技術サービス
ALPHABET INC-CL C	-	18.97	2,340	252,097	インタラクティブ・メディアおよびサービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	43,310.87 47銘柄	23,885.26 80銘柄	206,806 -	22,270,965 <66.0%>
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
NORBORD INC	1,016.97	-	-	-	紙製品・林産品
QUEBECOR INC-B	-	132.01	405	32,965	メディア
WESTON (GEORGE) LTD	-	199.64	2,237	181,696	食品・生活必需品小売り
B2GOLD CORP	-	2,758.46	1,277	103,718	金属・鉱業
CI FINANCIAL CORP	2,152.32	-	-	-	資本市場
TFI INTERNATIONAL INC	996.97	458.41	1,829	148,537	陸運・鉄道
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,166.26 3銘柄	3,548.52 4銘柄	5,749 -	466,918 <1.4%>
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
RIO TINTO LIMITED	834.97	-	-	-	金属・鉱業
CSR LIMITED	11,028.49	-	-	-	建設資材
ST BARBARA LTD	8,487.46	-	-	-	金属・鉱業
REGIS RESOURCES LTD	7,753.06	-	-	-	金属・鉱業
CIMIC GROUP LTD	1,035.31	-	-	-	建設・土木
QANTAS AIRWAYS LIMITED	8,815.38	-	-	-	旅客航空輸送業
MAYNE PHARMA GROUP LTD	44,812.1	-	-	-	医薬品
WHITEHAVEN COAL LTD	2,495.7	-	-	-	石油・ガス・消耗燃料
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	85,262.47 8銘柄	- 1銘柄	- -	- <-%>
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	-	2,895	13,331	183,174	建設資材
CNOOC LTD	-	6,170	7,663	105,291	石油・ガス・消耗燃料
CITIC LTD	22,990	-	-	-	コンプロマリット
LENOVO GROUP LTD	40,940	-	-	-	コンピュータ・周辺機器
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	53,900	-	-	-	石油・ガス・消耗燃料
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	-	3,300	2,247	30,877	ガス
TINGYI HOLDING CORP	-	11,600	12,922	177,553	食品
CHINA MENGNIU DAIRY CO	-	4,290	12,655	173,886	食品
TENCENT HOLDINGS LTD	-	67	2,249	30,913	インタラクティブ・メディアおよびサービス
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	-	8,575	13,908	191,104	石油・ガス・消耗燃料
BANK OF COMMUNICATIONS	-	13,970	7,236	99,428	銀行
CHINA CONSTRUCTION BANK	50,430	-	-	-	銀行
BANK OF CHINA LTD	88,640	-	-	-	銀行
SHUI ON LAND LTD	-	20,000	3,240	44,517	不動産管理・開発

銘柄	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	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	14,395	—	—	—	不動産管理・開発
IND & COMM BK OF CHINA - H	54,960	39,490	20,771	285,403	銀行
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	—	2,640	16,711	229,611	繊維・アパレル・贅沢品
CHINA RAILWAY GROUP LTD	42,420	—	—	—	建設・土木
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	—	10,000	8,570	117,751	食品
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	—	4,134	12,484	171,539	保険
ASIA CEMENT CHINA HOLDINGS CORP	—	3,000	2,925	40,189	建設資材
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	—	10,000	1,800	24,732	建設・土木
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	84,200	—	—	—	銀行
SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD	—	5,000	2,565	35,243	建設・土木
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	61,050	—	—	—	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	513,925 10銘柄	145,131 16銘柄	141,282 —	1,941,220 <5.7%>
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円	
GENTING SINGAPORE LTD	39,029	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
BEST WORLD INTERNATIONAL LTD	—	8,339	1,134	88,652	パーソナル用品
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	39,029 1銘柄	8,339 1銘柄	1,134 —	88,652 <0.3%>
(台湾)	百株	百株	千台湾・ドル	千円	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	—	1,920	43,776	151,902	半導体・半導体製造装置
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	10,200	—	—	—	コンピュータ・周辺機器
AU OPTRONICS CORP	76,780	—	—	—	電子装置・機器・部品
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	66,240	—	—	—	資本市場
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	113,990	—	—	—	保険
RUENTEX INDUSTRIES LTD	20,730	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
UNITED MICROELECTRONICS CORP	—	30,830	42,237	146,562	半導体・半導体製造装置
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	287,940 5銘柄	32,750 2銘柄	86,013 —	298,465 <0.9%>
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
BHP GROUP PLC	—	684.41	1,205	161,400	金属・鉱業
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	5,533.82	—	—	—	家庭用耐久財
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIR	4,202.69	—	—	—	旅客航空輸送業
AVIVA PLC	1,840.98	—	—	—	保険
DIAGEO PLC	—	569.75	1,850	247,750	飲料
SPECTRIS PLC	—	561.63	1,365	182,816	電子装置・機器・部品
ANGLO AMERICAN PLC	2,222.86	347.42	649	87,028	金属・鉱業
COMPASS GROUP PLC	—	742.07	1,506	201,707	ホテル・レストラン・レジャー
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	12,368.27	—	—	—	保険
PEARSON PLC	—	1,617.07	1,379	184,739	メディア
PERSIMMON PLC	1,152.12	—	—	—	家庭用耐久財
VODAFONE GROUP PLC	33,218.62	—	—	—	無線通信サービス
REDROW PLC	5,242.73	—	—	—	家庭用耐久財
ROTORK PLC	—	2,500	783	104,944	機械
SAGE GROUP PLC(THE)	—	1,147.7	772	103,486	ソフトウェア
LLOYDS BANKING GROUP PLC	93,131.77	—	—	—	銀行
TAYLOR WIMPLEY PLC	17,020.82	—	—	—	家庭用耐久財
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	2,422.27	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
WH SMITH PLC	1,339.45	—	—	—	専門小売り
RIGHTMOVE PLC	—	2,069	1,108	148,437	インタラクティブ・メディアおよびサービス
AUTO TRADER GROUP PLC	6,608.45	—	—	—	インタラクティブ・メディアおよびサービス
INTERMEDIATE CAPITAL GROUP PLC	—	791.95	1,141	152,806	資本市場
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	186,304.85 13銘柄	11,031 10銘柄	11,763 —	1,575,117 <4.7%>

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額	期末	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イスラエル) ISRAEL CHEMICALS LTD	百株 6,471.57	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>	— —	— —	— —	<-%>
(スイス) NESTLE SA-REGISTERED ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN NOVARTIS AG-REG SHS	百株 — — —	百株 583.51 195.15 345.27	千スイス・フラン 6,250 5,520 2,957	千円 679,560 600,220 321,510	食品 医薬品 医薬品
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	— —	1,123.93 3銘柄	14,728 —	1,601,292 <4.7%>
(デンマーク) CARLSBERG AS-B	百株 —	百株 113.1	千デンマーク・クローネ 11,226	千円 177,936	飲料
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	— —	113.1 1銘柄	11,226 —	177,936 <0.5%>
(ノルウェー) SALMAR ASA	百株 299.74	百株 —	千ノルウェー・クローネ —	千円 —	食品
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	— —	— —	— —	<-%>
(スウェーデン) ASSA ABLOY AB-B	百株 —	百株 1,188.65	千スウェーデン・クローナ 25,853	千円 286,452	建設関連製品
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	— —	1,188.65 1銘柄	25,853 —	286,452 <0.8%>
(メキシコ) GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENTRO	百株 —	百株 2,672	千メキシコ・ペソ 31,216	千円 172,629	運送インフラ
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	— —	2,672 1銘柄	31,216 —	172,629 <0.5%>
(インドネシア) BUKIT ASAM TBK PT	百株 151,827	百株 —	千インドネシア・ルピア —	千円 —	石油・ガス・消耗燃料
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	— —	— —	— —	<-%>
(ブラジル) JBS SA	百株 —	百株 2,502	千ブラジル・レアル 7,681	千円 198,557	食品
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	— —	2,502 1銘柄	7,681 —	198,557 <0.6%>
(韓国) CHEIL WORLDWIDE INC NCSOFT CORPORATION LG UPLUS CORP POSCO INTERNATIONAL CORP SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD INDUSTRIAL BANK OF KOREA SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD HANA FINANCIAL GROUP KB FINANCIAL GROUP INC BGF RETAIL CO LTD	百株 — — — — — — — — — —	百株 640 36.83 1,415.78 300 598.93 1,400 1,618.76 119.34 532.26 48.43	千韓国・ウォン 1,577,600 1,922,526 1,946,697 594,000 2,566,415 1,890,000 7,980,486 433,800 2,331,298 939,542	千円 142,615 173,796 175,981 53,697 232,003 170,856 721,436 39,215 210,749 84,934	メディア 娯楽 各種電気通信サービス 商社・流通業 銀行 銀行 コンピュータ・周辺機器 銀行 銀行 食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	— —	6,710.33 10銘柄	22,182,367 —	2,005,285 <5.9%>
(南アフリカ) AVI LTD BARLOWORLD LTD EXXARO RESOURCES LTD KUMBA IRON ORE LTD	百株 — — — —	百株 2,650.47 700 1,434.05 411.71	千南アフリカ・ランド 21,892 8,157 18,773 16,010	千円 158,504 59,062 135,917 115,913	食品 商社・流通業 石油・ガス・消耗燃料 金属・鉱業
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	— —	5,196.23 4銘柄	64,833 —	469,398 <1.4%>

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額	期末	
			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	
RANDSTAD NV	—	267.18	1,208	143,059	専門サービス
WOLTERS KLUWER-CVA	611.92	331.47	2,130	252,046	専門サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	598.65	3,339	395,105	
		1銘柄	2銘柄	<1.2%>	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
EIFFAGE	326.07	—	—	—	建設・土木
PEUGEOT SA	1,388.47	—	—	—	自動車
REXEL SA	—	2,060.06	2,060	243,766	商社・流通業
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,060.06	2,060	243,766	
		2銘柄	1銘柄	<0.7%>	
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ADIDAS AG	—	66.09	1,800	213,028	繊維・アパレル・贅沢品
CONTINENTAL AG	155.74	120	1,416	167,555	自動車部品
ALLIANZ SE	—	57.63	1,217	144,058	保険
INFINEON TECHNOLOGIES AG	1,635.77	840	1,435	169,849	半導体・半導体製造装置
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,083.72	5,869	694,492	
		2銘柄	4銘柄	<2.1%>	
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円	
MAPFRE SA	11,768.11	—	—	—	保険
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	—	—	—	
		1銘柄	—銘柄	<—%>	
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ENEL SPA	—	3,018.14	2,013	238,245	電力
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,018.14	2,013	238,245	
		—銘柄	1銘柄	<0.7%>	
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	250,951.59	—	33,124,505	
		96銘柄	142銘柄	<98.1%>	

(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) 外国投資証券

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	□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
SABRA HEALTH CARE REIT INC	—	154.81	—	—	—
PARK HOTELS & RESORTS INC	—	105.268	—	—	—
合計	□数・金額 銘柄数<比率>	260.078	—	—	—
		2銘柄<1.6%>	—銘柄<—%>	—	—

(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投資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

2019年9月24日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	33,124,505	97.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	793,706	2.3
投 資 信 託 財 産 総 額	33,918,212	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、33,450,744千円、98.6%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、2019年9月24日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=107.69円、1カナダ・ドル=81.21円、1オーストラリア・ドル=72.94円、1香港・ドル=13.74円、1シンガポール・ドル=78.17円、1ニュージーランド・ドル=67.75円、1台湾・ドル=3.47円、1イギリス・ポンド=133.90円、1イスラエル・シェケル=30.65円、1スイス・フラン=108.72円、1デンマーク・クローネ=15.85円、1ノルウェー・クローネ=11.90円、1スウェーデン・クローナ=11.08円、1メキシコ・ペソ=5.53円、1インド・ルピー=1.53円、1ブラジル・レアル=25.85円、100韓国・ウォン=9.04円、1南アフリカ・ランド=7.24円、1ポーランド・ズロチ=26.97円、1ユーロ=118.33円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2019年9月24日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	33,918,212,174円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	747,358,515
株 式(評価額)	33,124,505,212
未 収 配 当 金	46,348,447
(B) 負 債	150,000,000
未 払 解 約 金	150,000,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	33,768,212,174
元 本	33,772,399,575
次 期 繰 越 損 益 金	△4,187,401
(D) 受 益 権 総 口 数	33,772,399,575口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,999円

(注1) 期首元本額 46,776,473,813円
追加設定元本額 506,347,771円
一部解約元本額 13,510,422,009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 33,772,399,575円
期末元本合計 33,772,399,575円

《お知らせ》

■アセットマネジメントOneインターナショナル・リミテッドが担う株式リサーチ業務をアセットマネジメントOne U.S.A.・インクへ移管することに伴い、アセットマネジメントOneインターナショナル・リミテッドを削除する所要の約款変更を行いました。

(2019年6月26日)

■損益の状況

当期 自2018年9月26日 至2019年9月24日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	1,090,121,904円
受 取 配 当 金	1,087,351,022
受 取 利 息	3,108,737
支 払 利 息	△337,855
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△4,946,096,025
売 買 損 益	5,300,839,862
売 買 損 益	△10,246,935,887
(C) そ の 他 費 用	△16,665,949
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△3,872,640,070
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	3,844,378,431
(F) 解 約 差 損 益 金	△19,577,991
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	43,652,229
(H) 合 計(D+E+F+G)	△4,187,401
次 期 繰 越 損 益 金(H)	△4,187,401

(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。