



BNY MELLON

INVESTMENT MANAGEMENT

モビリティ・イノベーション・ ファンド (予想分配金提示型)

●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/内外/株式	
信託期間	2028年1月21日まで	
運用方針	「モビリティ・イノベーション・マザーファンド」受益証券への投資を通じて、日本を含む世界の金融商品取引所等に上場している自動車関連企業の株式（DR（預託証券）を含みます。）を実質的な主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。	
主要運用対象	モビリティ・イノベーション・マザーファンド (予想分配金提示型) (ベビーファンド)	「モビリティ・イノベーション・マザーファンド」の受益証券を主要投資対象とします。
	モビリティ・イノベーション・マザーファンド (マザーファンド)	日本を含む世界の金融商品取引所等に上場している自動車関連企業の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とします。
組入制限	ベビーファンドの組入上限比率	マザーファンドの受益証券への投資割合には、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。 外貨建資産の実質投資割合には、制限を設けません。
	マザーファンドの組入上限比率	株式への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産の投資割合には、制限を設けません。
分配方針	毎決算時（原則として、毎月21日、休業日の場合は翌営業日）に、原則として基準価額水準等を勘案して委託者が決定します。なお、各計算期末の前営業日の基準価額（支払済み分配金（1万円当たり、税引前）累計額は加算しません。）に応じて、提示された金額の分配を行うことを目指します。ただし、委託者の判断により分配を行わない場合もあります（分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります）。	

追加型投信/内外/株式

運用報告書（全体版）

第26期(決算日：2024年2月21日)
第27期(決算日：2024年3月21日)
第28期(決算日：2024年4月22日)
第29期(決算日：2024年5月21日)
第30期(決算日：2024年6月21日)
第31期(決算日：2024年7月22日)

受益者のみなさまへ

平素は、格別のお引立てにあずかり厚く御礼申し上げます。

さて、「モビリティ・イノベーション・ファンド（予想分配金提示型）」は、2024年2月21日に第26期、2024年3月21日に第27期、2024年4月22日に第28期、2024年5月21日に第29期、2024年6月21日に第30期、2024年7月22日に第31期決算を行いました。ここに、作成期中の運用状況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。

BNY Mellon・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社

東京都千代田区丸の内1丁目8番3号

丸の内トラストタワー本館

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

電話番号：03-6756-4600（代表）

受付時間：営業日の9：00～17：00

ホームページ <https://www.bnymellonam.jp/>

■最近5作成期の運用実績

決算期	基準価額			株式組入比率	株式先物比率	純資産総額	
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率				
	円	円	%	%	%	百万円	
第2作成期	2期(2022年2月21日)	8,343	0	△4.2	97.5	—	51
	3期(2022年3月22日)	8,488	0	1.7	95.4	—	52
	4期(2022年4月21日)	8,540	0	0.6	95.7	—	52
	5期(2022年5月23日)	7,636	0	△10.6	98.9	—	48
	6期(2022年6月21日)	7,502	0	△1.8	97.7	—	47
	7期(2022年7月21日)	8,110	0	8.1	98.6	—	51
	8期(2022年8月22日)	8,575	0	5.7	95.8	—	53
第3作成期	9期(2022年9月21日)	8,118	0	△5.3	94.4	—	50
	10期(2022年10月21日)	7,834	0	△3.5	96.3	—	48
	11期(2022年11月21日)	8,206	0	4.7	96.0	—	50
	12期(2022年12月21日)	7,251	0	△11.6	97.6	—	43
	13期(2023年1月23日)	7,750	0	6.9	99.3	—	46
第4作成期	14期(2023年2月21日)	8,499	0	9.7	95.5	—	49
	15期(2023年3月22日)	8,029	0	△5.5	95.7	—	46
	16期(2023年4月21日)	8,005	0	△0.3	96.3	—	45
	17期(2023年5月22日)	8,360	0	4.4	98.5	—	47
	18期(2023年6月21日)	9,167	0	9.7	95.5	—	51
	19期(2023年7月21日)	9,243	0	0.8	95.7	—	51
第5作成期	20期(2023年8月21日)	8,777	0	△5.0	95.5	—	47
	21期(2023年9月21日)	9,088	0	3.5	95.1	—	48
	22期(2023年10月23日)	8,428	0	△7.3	93.6	—	44
	23期(2023年11月21日)	8,909	0	5.7	93.7	—	46
	24期(2023年12月21日)	9,009	0	1.1	96.4	—	45
	25期(2024年1月22日)	9,205	0	2.2	94.7	—	44
第6作成期	26期(2024年2月21日)	9,479	0	3.0	95.0	—	44
	27期(2024年3月21日)	10,129	0	6.9	94.5	—	46
	28期(2024年4月22日)	9,838	0	△2.9	93.8	—	41
	29期(2024年5月21日)	10,690	100	9.7	94.7	—	43
	30期(2024年6月21日)	10,612	100	0.2	95.3	—	40
	31期(2024年7月22日)	10,356	100	△1.5	93.8	—	36

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

(注) 当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数がないため、ベンチマークおよび参考指数などは設定しておりません。

■当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基 準 価 額		株 式 組入比率	株 式 先物比率
		円	騰落率		
第26期	(期 首) 2024年1月22日	9,205	—	94.7	—
	1月末	9,296	1.0	98.5	—
	(期 末) 2024年2月21日	9,479	3.0	95.0	—
第27期	(期 首) 2024年2月21日	9,479	—	95.0	—
	2月末	9,711	2.4	98.5	—
	(期 末) 2024年3月21日	10,129	6.9	94.5	—
第28期	(期 首) 2024年3月21日	10,129	—	94.5	—
	3月末	10,196	0.7	97.9	—
	(期 末) 2024年4月22日	9,838	△2.9	93.8	—
第29期	(期 首) 2024年4月22日	9,838	—	93.8	—
	4月末	10,458	6.3	97.7	—
	(期 末) 2024年5月21日	10,790	9.7	94.7	—
第30期	(期 首) 2024年5月21日	10,690	—	94.7	—
	5月末	10,514	△1.6	98.6	—
	(期 末) 2024年6月21日	10,712	0.2	95.3	—
第31期	(期 首) 2024年6月21日	10,612	—	95.3	—
	6月末	10,647	0.3	98.3	—
	(期 末) 2024年7月22日	10,456	△1.5	93.8	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

(注) 当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数がないため、ベンチマークおよび参考指数などは設定しておりません。

◆基準価額の推移

当作成期の基準価額の期中騰落率は15.7%（分配金再投資ベース）となりました。なお、当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数がないため、ベンチマークおよび参考指数などは設定しておりません。



(注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に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。作成期首の値が基準価額と同一になるように指数化しております。

(注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様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、各個人のおお客様の損益の状況を示すものではありません。

◆基準価額の主な変動要因

「モビリティ・イノベーション・マザーファンド」が上昇したことから、当ファンドの基準価額も上昇しました。

(上昇要因)

- ・2024年1月から4月中頃まで、生成AI（人工知能）に関する株式市場の期待が高まり、関連企業の株価が堅調に推移したことや、為替市場において、円安ドル高傾向が継続したこと

(下落要因)

- ・2024年4月後半、米国のインフレ圧力が根強く、米連邦準備制度理事会（FRB）の年内利下げ期待が低下したことで株式市場が軟調となったこと
- ・2024年7月後半、株式市場の過熱感の高まりや米大統領選の混乱などを受けて株式市場が反落したことや、為替市場において円高ドル安傾向となったこと

◆投資環境

(世界株式市況)

株式市場は米国経済のソフトランディング期待が高まる中、上昇基調で推移しました。2024年2月以降は生成AIに関連して、企業が好調な決算や先行きに対して強気な見通しを示したことから、半導体関連や生成AI関連の銘柄が株式市場を牽引しました。その後、米国のインフレ圧力は根強く、FRBの年内利下げ期待が低下したことで株式市場下押し材料となり、4月の株式市場は上値が重くなりましたが、欧州中央銀行（ECB）の利下げや、引き続き生成AI関連に対する市場の注目や期待を背景に株式市場は上昇しました。7月に入るとFRBの利下げに対する期待が高まったことで更に株式市場は上昇しましたが、その後は市場の過熱感や米大統領選の混乱などを受けて株式市場は反落しました。

(為替)

米ドル円相場は、2024年1月以降、粘着性の強い米インフレを背景にFRBの早期利下げ観測が後退し、米ドルが対円で上昇しました。3月には日銀のマイナス金利解除の思惑からドル高が一時修正されたものの、日銀が緩和的な金融政策を維持する方針を表明したため、円安傾向が継続しました。その後もFRBの利下げ開始時期が後退するとの警戒感から概してドル高円安傾向は続き、一時1ドル161円台の水準となりました。7月には政府・日銀による為替介入の観測もあり、1ドル157円台で期末を迎えました。

◆当ファンドのポートフォリオ

当ファンドは、「モビリティ・イノベーション・マザーファンド」受益証券への投資を行いました。

「モビリティ・イノベーション・マザーファンド」では、自動車関連企業の中から、①自動運転車、②EV（電気自動車）、③車のIT化、および④車の共有（シェアリング）に着目し、これらの中でも特に投資妙味が高いと考える銘柄を組み入れています。

地域・国別では米国を中心に欧州や日本などに投資を行っています。また、企業規模の面では大型株を中心に、中型株や小型株にも投資しています。

当作成期末の組入上位銘柄は、インフィニオンテクノロジーズ（情報技術）、エヌビディア（情報技術）、アンシス（情報技術）、テキサス・インスツルメンツ（情報技術）、アナログ・デバイセズ（情報技術）などでした。

◆収益分配

当作成期中の収益分配については、基準価額水準等を勘案し、1万口当たり300円（税込み）をお支払いいたしました。

分配に充てなかった収益につきましては、信託財産に留保し、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

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項 目	第26期	第27期	第28期	第29期	第30期	第31期
	2024年1月23日～ 2024年2月21日	2024年2月22日～ 2024年3月21日	2024年3月22日～ 2024年4月22日	2024年4月23日～ 2024年5月21日	2024年5月22日～ 2024年6月21日	2024年6月22日～ 2024年7月22日
当期分配金 (対基準価額比率)	— —%	— —%	— —%	100 0.927%	100 0.934%	100 0.956%
当期の収益	—	—	—	7	22	—
当期の収益以外	—	—	—	92	77	100
翌期繰越分配対象額	166	816	816	1,375	1,298	1,198

(注) 対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、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合計が当期分配金と一致しない場合があります。

◆今後の運用方針

<当ファンド>

引き続きファンドの基本方針に則り、マザーファンドへの投資を行います。

<モビリティ・イノベーション・マザーファンド>

自動車関連企業の中から、①自動運転車、②EV（電気自動車）、③車のIT化、および④車の共有（シェアリング）に着目し、これらの中でも特に投資妙味が高いと考える企業に引き続き投資を行うことで、信託財産の成長を目指します。

■ 1 万口当たりの費用明細

(2024年 1月23日～2024年 7月22日)

項 目	第26期～第31期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信託報酬 (投信会社) (販売会社) (受託会社)	円 91 (44) (44) (2)	% 0.894 (0.438) (0.438) (0.019)	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率 作成期間の平均基準価額は、10,137円です。 信託財産の運用指図、法定開示書類の作成、基準価額の算出等の対価 購入後の情報提供、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 および事務手続き等の対価 信託財産の保管・管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料 (株式)	4 (4)	0.038 (0.038)	(b) 売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(c) 有価証券取引税 (株式)	1 (1)	0.015 (0.015)	(c) 有価証券取引税＝作成期間の有価証券取引税÷作成期間の平均受益権口数 ※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
(d) その他費用 (保管費用) (監査費用) (印刷) (その他)	4 (1) (0) (3) (0)	0.039 (0.009) (0.003) (0.027) (0.000)	(d) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数 海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移 転等に要する費用 監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 目論見書、運用報告書等の印刷・交付等に係る費用 金融商品取引に要する諸費用
合 計	100	0.986	

(注) 作成期間の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含む)は、追加・解約により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。

(注) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数点以下第3位未満は四捨五入してあります。

(参考情報)

○総経費率

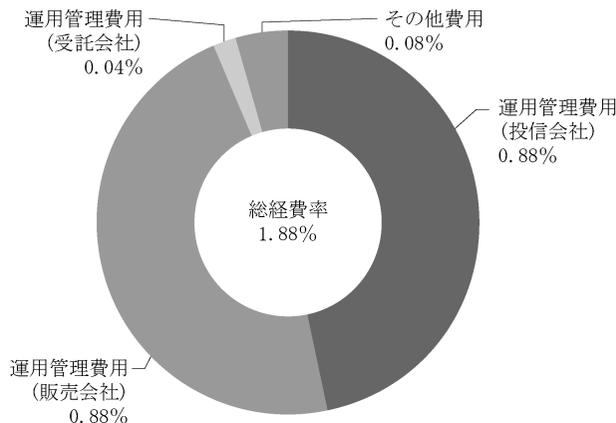
当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)は1.88%です。

(注) 各費用は、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) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 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は異なります。



■ 売買及び取引の状況

(2024年1月23日～2024年7月22日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	第26期～第31期			
	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
モビリティ・イノベーション・マザーファンド	千口 5,351	千円 10,582	千口 12,922	千円 26,166

(注) 単位未満は切り捨て。

■ 株式売買比率

(2024年1月23日～2024年7月22日)

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	第26期～第31期	
	モビリティ・イノベーション・マザーファンド	
(a) 過去6ヶ月の株式売買金額	52,989,956千円	
(b) 過去6ヶ月の平均組入株式時価総額	77,438,968千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.68	

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

■ 利害関係人との取引状況等

(2024年1月23日～2024年7月22日)

該当事項はございません。

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

(2024年7月22日現在)

親投資信託残高

銘柄	第25期末	第31期末	
	口数	口数	評価額
モビリティ・イノベーション・マザーファンド	千口 24,422	千口 16,851	千円 35,184

(注) 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

■ 投資信託財産の構成

(2024年7月22日現在)

項目	第31期末	
	評価額	比率
モビリティ・イノベーション・マザーファンド	千円 35,184	% 94.3
コール・ローン等、その他	2,121	5.7
投資信託財産総額	37,305	100.0

(注) 金額の単位未満は切り捨て。

(注) モビリティ・イノベーション・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産(68,507,677千円)の投資信託財産総額(78,235,372千円)に対する比率は87.6%です。

(注) 外貨建て資産は、当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。1オフショア人民元=21.6116円、1米ドル=157.54円、1ユーロ=171.62円、1英ポンド=203.67円、1スイスフラン=177.33円、1スウェーデンクローナ=14.79円、1香港ドル=20.17円、1新台幣ドル=4.8086円、1インドルピー=1.89円。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第26期末	第27期末	第28期末	第29期末	第30期末	第31期末
	2024年2月21日現在	2024年3月21日現在	2024年4月22日現在	2024年5月21日現在	2024年6月21日現在	2024年7月22日現在
(A) 資 産	45,860,890円	46,719,309円	41,557,220円	43,588,094円	40,513,517円	37,305,508円
コール・ローン等	1,773	2,959	143	122	9,679	41,166
モビリティ・イノベーション・マザーファンド(評価額)	42,914,863	45,119,306	39,557,104	41,688,081	38,713,515	35,184,094
未 収 入 金	2,944,254	1,597,044	1,999,973	1,899,891	1,790,323	2,080,248
(B) 負 債	1,279,623	66,860	71,732	466,190	441,515	439,500
未 払 収 益 分 配 金	—	—	—	403,398	377,600	355,987
未 払 解 約 金	1,210,456	—	113	13	2	21,028
未 払 信 託 報 酬	66,942	64,708	69,309	60,753	61,846	60,468
そ の 他 未 払 費 用	2,225	2,152	2,310	2,026	2,067	2,017
(C) 純資産総額(A-B)	44,581,267	46,652,449	41,485,488	43,121,904	40,072,002	36,866,008
元 本	47,034,055	46,056,152	42,167,479	40,339,869	37,760,075	35,598,704
次 期 繰 越 損 益 金	△2,452,788	596,297	△681,991	2,782,035	2,311,927	1,267,304
(D) 受 益 権 総 口 数	47,034,055口	46,056,152口	42,167,479口	40,339,869口	37,760,075口	35,598,704口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,479円	10,129円	9,838円	10,690円	10,612円	10,356円

(注) 当ファンドの第26期首元本額は48,738,421円、第26～31期中追加設定元本額は1,480,792円、第26～31期中一部解約元本額は14,620,509円です。

(注) 期末の1口当たり純資産額は、第26期0.9479円、第27期1.0129円、第28期0.9838円、第29期1.0690円、第30期1.0612円、第31期1.0356円です。

■ 損益の状況

項 目	第26期	第27期	第28期	第29期	第30期	第31期
	2024年1月23日～ 2024年2月21日	2024年2月22日～ 2024年3月21日	2024年3月22日～ 2024年4月22日	2024年4月23日～ 2024年5月21日	2024年5月22日～ 2024年6月21日	2024年6月22日～ 2024年7月22日
(A) 有価証券売買損益	1,351,464円	3,059,644円	△ 1,156,657円	3,896,514円	147,156円	△ 494,362円
売 買 損 益	1,409,057	3,091,261	39,029	3,961,740	164,707	108,172
売 買 損 益	△ 57,593	△ 31,617	△ 1,195,686	△ 65,226	△ 17,551	△ 602,534
(B) 信託報酬等	△ 69,167	△ 66,860	△ 71,619	△ 62,779	△ 63,913	△ 62,485
(C) 当期損益金(A+B)	1,282,297	2,922,784	△ 1,228,276	3,833,735	83,243	△ 556,847
(D) 前期繰越損益金	△ 551,636	713,125	3,388,409	2,062,739	5,053,845	4,451,437
(E) 追加信託差損益金 (配当等相当額)	△ 3,183,449	△ 3,109,612	△ 2,842,124	△ 2,711,041	△ 2,447,561	△ 2,271,299
(配当等相当額)	(51,209)	(52,506)	(52,794)	(56,661)	(141,010)	(170,605)
(売買損益相当額)	(△ 3,234,658)	(△ 3,162,118)	(△ 2,894,918)	(△ 2,767,702)	(△ 2,588,571)	(△ 2,441,904)
(F) 計(C+D+E)	△ 2,452,788	596,297	△ 681,991	3,185,433	2,689,527	1,623,291
(G) 収益分配金	0	0	0	△ 403,398	△ 377,600	△ 355,987
次期繰越損益金(F+G)	△ 2,452,788	596,297	△ 681,991	2,782,035	2,311,927	1,267,304
追加信託差損益金	△ 3,183,449	△ 3,109,612	△ 2,842,124	△ 2,711,041	△ 2,447,561	△ 2,271,299
(配当等相当額)	(51,228)	(52,643)	(53,051)	(56,688)	(143,177)	(170,946)
(売買損益相当額)	(△ 3,234,677)	(△ 3,162,255)	(△ 2,895,175)	(△ 2,767,729)	(△ 2,590,738)	(△ 2,442,245)
分配準備積立金	730,661	3,705,909	3,388,409	5,493,076	4,759,488	4,095,450
繰越損益金	—	—	△ 1,228,276	—	—	△ 556,847

(注) 損益の状況の中で(A)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

(注) 損益の状況の中で(B)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) 損益の状況の中で(E)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) 第26期計算期間末における費用控除後の配当等収益(8,942円)、費用控除後の有価証券売買等損益額(321,276円)、信託約款に規定する収益調整金(51,228円)および分配準備積立金(400,443円)より分配対象収益は781,889円(10,000口当たり166円)ですが、当計算期間に分配した金額はありません。

(注) 第27期計算期間末における費用控除後の配当等収益(29,030円)、費用控除後の有価証券等損益額(2,963,754円)、信託約款に規定する収益調整金(52,643円)および分配準備積立金(713,125円)より分配対象収益は3,758,552円(10,000口当たり816円)ですが、当計算期間に分配した金額はありません。

(注) 第28期計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(53,051円)および分配準備積立金(3,388,409円)より分配対象収益は3,441,460円(10,000口当たり816円)ですが、当計算期間に分配した金額はありません。

(注) 第29期計算期間末における費用控除後の配当等収益(20,487円)、費用控除後の有価証券売買等損益額(2,640,352円)、信託約款に規定する収益調整金(56,688円)および分配準備積立金(3,235,635円)より分配対象収益は5,953,162円(10,000口当たり1,475円)であり、うち403,398円(10,000口当たり100円)を分配金額としております。

(注) 第30期計算期間末における費用控除後の配当等収益(69,082円)、費用控除後の有価証券売買等損益額(14,161円)、信託約款に規定する収益調整金(143,177円)および分配準備積立金(5,053,845円)より分配対象収益は5,280,265円(10,000口当たり1,398円)であり、うち377,600円(10,000口当たり100円)を分配金額としております。

(注) 第31期計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後の有価証券売買等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(170,946円)および分配準備積立金(4,451,437円)より分配対象収益は4,622,383円(10,000口当たり1,298円)であり、うち355,987円(10,000口当たり100円)を分配金額としております。

(注) 運用の指図にかかる権限を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額：信託財産に属する親投資信託の受益証券の時価総額に、年0.34%を乗じて得た額

■ 分配金のお知らせ

	第26期	第27期	第28期	第29期	第30期	第31期
1万円当たり分配金(税込み)	0円	0円	0円	100円	100円	100円

◇分配金をお支払いする場合

分配金は原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

◇分配金を再投資する場合

分配金は、各決算日の基準価額に基づいて、税引後無手数料でみなさまの口座に繰り入れて再投資いたしました。

■ お知らせ

該当事項はございません。

(参考情報) 親投資信託の組入資産の明細

(2024年7月22日現在)

<モビリティ・イノベーション・マザーファンド>

下記は、モビリティ・イノベーション・マザーファンド全体(37,040,181千口)の内容です。

国内株式

銘柄	第25期末	第31期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
機械 (22.2%)			
クボタ	606.6	375.9	843,895
ダイフク	—	368.8	1,027,661
電気機器 (—%)			
ファナック	376.5	—	—
輸送用機器 (62.3%)			
デンソー	864.4	793.2	1,963,170
いすゞ自動車	648	—	—
スズキ	319.3	1,160.1	2,123,563
シマノ	—	45.7	1,168,092
陸運業 (15.5%)			
東日本旅客鉄道	108.3	469.2	1,304,141
合計	株数・金額 2,923	3,212	8,430,523
	銘柄数<比率>	6	6<10.9%>

(注) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

(注) 評価額欄の< >内は、このファンドが組み入れている親投資信託の純資産総額に対する評価額の比率。

(注) 評価額の単位未満は切り捨て。

(注) —印は組み入れなし。

外国株式

銘柄	第25期末	第31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	千米ドル	千円	
ANALOG DEVICES INC	—	607	14,055	2,214,287	半導体・半導体製造装置
ANSYS, INC.	625	564	17,750	2,796,453	ソフトウェア・サービス
POWER INTEGRATIONS, INC.	952	859	6,177	973,172	半導体・半導体製造装置
AMPHENOL CORPORATION	1,276	2,062	13,273	2,091,163	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DEERE & CO	295	360	13,641	2,149,088	資本財
EMERSON ELECTRIC CO	1,166	465	5,383	848,046	資本財

銘柄	第25期末	第31期末			業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千米ドル	千円		
NVIDIA CORPORATION	275	1,757	20,721	3,264,406	半導体・半導体製造装置	
JABIL INC	—	682	7,540	1,187,910	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	1,061	732	6,959	1,096,409	ソフトウェア・サービス	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATI	790	1,700	12,335	1,943,363	半導体・半導体製造装置	
QUALCOMM INC	716	443	8,259	1,301,265	半導体・半導体製造装置	
ROPER TECHNOLOGIES INC	156	118	6,735	1,061,137	資本財	
TEXAS INSTRUMENTS INC	533	717	14,295	2,252,062	半導体・半導体製造装置	
TRIMBLE INC.	2,358	1,958	10,964	1,727,342	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
VISTEON CORPORATION	1,132	1,092	11,788	1,857,203	自動車・自動車部品	
NXP SEMICONDUCTORS NV	415	501	13,517	2,129,554	半導体・半導体製造装置	
TE CONNECTIVITY LIMITED	790	713	10,749	1,693,471	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
APTIV PLC	1,071	—	—	—	自動車・自動車部品	
EATON CORP PLC	556	296	9,240	1,455,677	資本財	
TWILIO INC.	1,571	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
HUBBELL INCORPORATED	258	233	8,647	1,362,379	資本財	
ZUORA INC - CLASS A	9,466	8,543	7,893	1,243,584	ソフトウェア・サービス	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	554	265	8,093	1,275,071	ソフトウェア・サービス	
UBER TECHNOLOGIES INC	2,391	1,958	13,184	2,077,157	運輸	
MOBILEYE GLOBAL INC-A	3,690	3,613	8,914	1,404,460	自動車・自動車部品	
ARCHER AVIATION INC-A	—	4,983	2,312	364,266	資本財	
LUMENTUM HOLDINGS INC	1,233	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ALPHABET INC.	673	507	9,103	1,434,166	メディア・娯楽	
小 計	株 数 ・ 金 額	34,014	35,740	261,540	41,203,103	
	銘柄数 〈 比率 〉	25	25	—	< 53.3% >	
(ユーロ・・・ドイツ)			千ユーロ			
DHL GROUP	1,544	1,598	6,369	1,093,106	運輸	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	1,153	916	5,825	999,784	自動車・自動車部品	
SIEMENS AG-REG	—	486	8,285	1,422,003	資本財	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	4,747	6,133	20,301	3,484,226	半導体・半導体製造装置	
KION GROUP AG	2,080	951	3,702	635,385	資本財	
KNORR-BREMSE AG	1,302	808	5,941	1,019,759	資本財	

銘柄		第25期末		第31期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
DR ING HC F PORSCHE AG		百株 —	百株 657	千ユーロ 4,709	千円 808,267	自動車・自動車部品
小計	株数・金額	10,828	11,552	55,136	9,462,534	
	銘柄数〈比率〉	5	7	—	<12.2%〉	
(ユーロ・・・イタリア)						
PRYSMIAN SPA		—	1,064	6,502	1,115,994	資本財
PIRELLI&C. S. P. A.		—	12,541	7,156	1,228,141	自動車・自動車部品
小計	株数・金額	—	13,606	13,658	2,344,136	
	銘柄数〈比率〉	—	2	—	<3.0%〉	
(ユーロ・・・フランス)						
SCHNEIDER ELECTRIC SE		467	285	6,364	1,092,269	資本財
DASSAULT SYSTEMES SE		2,798	1,608	5,543	951,383	ソフトウェア・サービス
MICHELIN (CGDE)		3,807	860	2,980	511,549	自動車・自動車部品
小計	株数・金額	7,072	2,755	14,888	2,555,202	
	銘柄数〈比率〉	3	3	—	<3.3%〉	
(ユーロ・・・オランダ)						
STMICROELECTRONICS N. V.		1,579	2,217	8,154	1,399,530	半導体・半導体製造装置
小計	株数・金額	1,579	2,217	8,154	1,399,530	
	銘柄数〈比率〉	1	1	—	<1.8%〉	
ユーロ計	株数・金額	19,480	30,131	91,838	15,761,403	
	銘柄数〈比率〉	9	13	—	<20.4%〉	
(イギリス)						
ANGLO AMERICAN PLC		3,883	1,548	3,477	708,231	素材
DOWLAIS GROUP PLC		54,678	62,825	4,312	878,422	自動車・自動車部品
小計	株数・金額	58,562	64,373	7,790	1,586,653	
	銘柄数〈比率〉	2	2	—	<2.1%〉	
(スイス)						
LANDIS+GYR GROUP AG		1,020	921	7,222	1,280,686	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
小計	株数・金額	1,020	921	7,222	1,280,686	
	銘柄数〈比率〉	1	1	—	<1.7%〉	

銘柄		第25期末	第31期末		業種等	
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(スウェーデン)		百株	百株	千スウェーデンクローナ	千円	
EPIROC AB-A		5,006	2,468	50,253	743,253	資本財
小計	株数・金額	5,006	2,468	50,253	743,253	
	銘柄数〈比率〉	1	1	—	<1.0%〉	
(香港)				千香港ドル		
BYD COMPANY LIMITED		4,700	3,190	77,517	1,563,517	自動車・自動車部品
MEITUAN-CLASS B		5,282	4,974	58,444	1,178,825	消費者サービス
小計	株数・金額	9,982	8,164	135,961	2,742,343	
	銘柄数〈比率〉	2	2	—	<3.5%〉	
(韓国)				千韓国ウォン		
SAMSUNG SDI CO., LTD.		127	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
小計	株数・金額	127	—	—	—	
	銘柄数〈比率〉	1	—	—	<—%〉	
(台湾)				千新台湾ドル		
CHROMA ATE INC.		8,300	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DELTA ELECTRONICS INC		—	10,120	403,788	1,941,654	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
小計	株数・金額	8,300	10,120	403,788	1,941,654	
	銘柄数〈比率〉	1	1	—	<2.5%〉	
(インド)				千インドルピー		
ZOMATO LTD		—	24,179	529,260	1,000,301	一般消費財・サービス流通・小売り
小計	株数・金額	—	24,179	529,260	1,000,301	
	銘柄数〈比率〉	—	1	—	<1.3%〉	
(中国オフショア)				千オフショア人民元		
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A		—	3,193	60,491	1,307,328	資本財
小計	株数・金額	—	3,193	60,491	1,307,328	
	銘柄数〈比率〉	—	1	—	<1.7%〉	
合計	株数・金額	136,494	179,291	—	67,566,728	
	銘柄数〈比率〉	42	47	—	<87.4%〉	

(注) 邦貨換算金額は、当作成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) 邦貨換算金額欄の〈 〉内は、このファンドが組み入れている親投資信託の純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

(注) 株数・評価額の単位未満は切り捨て。

(注) —印は組み入れなし。

モビリティ・イノベーション・マザーファンド

第6期（2024年1月22日決算）〔計算期間：2023年1月24日～2024年1月22日〕

法令・諸規則に基づき、当マザーファンド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。

商品分類	親投資信託
信託期間	無期限
運用方針	信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要運用対象	日本を含む世界の金融商品取引所等に上場している自動車関連企業の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とします。
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 組入比率	株式 先物比率	純資産 総額
	円	期中 騰落率			
2期(2020年1月21日)	9,904	25.7	98.8	—	170,453
3期(2021年1月21日)	15,283	54.3	98.1	—	116,306
4期(2022年1月21日)	16,361	7.1	97.9	—	96,622
5期(2023年1月23日)	14,849	△9.2	99.4	—	74,897
6期(2024年1月22日)	17,906	20.6	97.2	—	75,253

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

(注) 当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数がないため、ベンチマークおよび参考指数などは設定しておりません。

■当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		株 式 組入比率	株 式 先物比率
	円	騰落率		
(期 首) 2023年1月23日	14,849	% —	% 99.4	% —
1月末	15,445	4.0	98.8	—
2月末	16,243	9.4	97.1	—
3月末	15,850	6.7	98.1	—
4月末	15,174	2.2	96.3	—
5月末	16,529	11.3	99.1	—
6月末	17,805	19.9	98.8	—
7月末	18,105	21.9	98.3	—
8月末	17,890	20.5	100.2	—
9月末	17,484	17.7	97.2	—
10月末	15,857	6.8	96.4	—
11月末	17,240	16.1	96.0	—
12月末	17,836	20.1	97.5	—
(期 末) 2024年1月22日	17,906	20.6	97.2	—

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

(注) 当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数がないため、ベンチマークおよび参考指数などは設定していません。

■基準価額の動きと主な変動要因

当期の基準価額の期中騰落率は20.6%となりました。なお、当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数がないため、ベンチマークおよび参考指数などは設定していません。

(上昇要因)

- ・2023年4月から7月末にかけて、インフレ鎮静化を背景とした米連邦準備制度理事会（FRB）の利上げ停止期待や、AI（人工知能）関連などハイテク関連銘柄への今後の成長期待が高まるなかで世界株式市場が上昇したこと
- ・2023年11月以降、米国のインフレ鈍化やFRBの金融緩和政策への転換期待などから世界株式市場が上昇したこと
- ・日本銀行が緩和的な金融政策を継続する姿勢を示す中で、期を通じてみると米ドルが対円で上昇したこと

(下落要因)

- ・2023年3月上旬に、米国の金融機関の経営破綻が欧州にまで連鎖するなど金融システム不安が広がったことで世界株式市場が下落したことに加え、円高が進行したこと
- ・2023年7月末から10月末にかけて、米国の長期金利が上昇する中で、世界株式市場が下落したこと



■投資環境

(世界株式市況)

2023年3月に米国の金融機関の経営破綻が欧州にまで連鎖するなど金融システム不安が広がったことで一時下落しましたが、各国金融当局による対応を受けて過度な懸念が後退したことから上昇に転じました。その後はインフレ鎮静化を背景としたFRBの利上げ停止期待や、AI関連などハイテク関連銘柄への今後の成長期待が高まるなか2023年7月末にかけて上昇基調で推移しました。2023年7月末から10月末にかけては、米国債需給バランスの悪化や、より高い金利がより長く続くとの見方が広がる中で米国の長期金利が上昇し、世界株式市場は下落しました。その後は、米国のインフレ鈍化やFRBの金融緩和政策への転換期待などから長期金利が低下に転じ、世界株式市場は上昇しました。

(為替)

金融不安の高まりや、日銀の金融政策の変更に対する思惑から一時的に円高になる場面も見られましたが、日本銀行が緩和的な金融政策を継続する姿勢を示す中で2023年11月中旬にかけて円安米ドル高が進展しました。その後年末にかけては、米国のインフレ鈍化が示され、またパウエルFRB議長が利下げを示唆する発言を行ったことに加えて、日銀総裁の発言からマイナス金利政策解除への思惑が高まり円高米ドル安となりました。年明け後は、力強い経済指標が発表されるなど米国の利下げペースに対する思惑が後退する中で、再度円安米ドル高となりました。

■当ファンドのポートフォリオ

当ファンドは、自動車関連企業の中から、①自動運転車、②EV（電気自動車）、③車のIT化、および④車の共有（シェアリング）に着目し、これらの中でも特に投資妙味が高いと考える銘柄を組み入れています。

地域・国別では米国を中心に欧州や日本などに投資を行っています。また、企業規模の面では大型株を中心に、中型株や小型株にも投資しています。

期末の組入上位銘柄は、アンシス（情報技術）、インフィニオンテクノロジーズ（情報技術）、エヌビディア（情報技術）、クラウドストライク・ホールディングス（情報技術）、ウーバー・テクノロジーズ（資本財・サービス）などでした。

■今後の運用方針

自動車関連企業の中から、①自動運転車、②EV（電気自動車）、③車のIT化、および④車の共有（シェアリング）に着目し、これらの中でも特に投資妙味が高いと考える企業に引き続き投資を行うことで、信託財産の成長を目指します。

■ 1 万口当たりの費用明細

(2023年1月24日～2024年1月22日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売買委託手数料 (株式)	円 10 (10)	% 0.062 (0.062)	(a) 売買委託手数料＝各期中の売買委託手数料÷各期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 期中の平均基準価額は、16,788円です。
(b) 有価証券取引税 (株式)	11 (11)	0.064 (0.064)	(b) 有価証券取引税＝各期中の有価証券取引税÷各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)	4 (4) (0)	0.023 (0.021) (0.002)	(c) その他費用＝各期中のその他費用÷各期中の平均受益権口数 海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の 移転等に要する費用 金融商品取引に要する諸費用
合 計	25	0.149	

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を各期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数点以下第3位未満は四捨五入してあります。

■ 売買及び取引の状況
株式

(2023年1月24日～2024年1月22日)

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国内	上場	千株	千円	千株	千円
		2,216 (627)	5,986,160 (-)	1,038	5,764,523
外 国	アメリカ	百株 14,426 (-)	千米ドル 108,150 (△221)	百株 44,392	千米ドル 198,920
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	3,157	14,937	2,763	12,474
	フランス	7,410	23,266	5,732	19,982
	オランダ	718	5,235	2,238	11,529
	イギリス	110,133 (16,715)	千英ポンド 21,266 (1,781)	34,855 (33,431)	千英ポンド 10,785 (1,781)
	スイス	174 (-)	千スイスフラン 1,134 (△224)	383	千スイスフラン 3,016
	スウェーデン	597	千スウェーデンクローナ 11,266	1,156	千スウェーデンクローナ 24,194
	香港	6,855	千香港ドル 98,915	1,343	千香港ドル 27,420
	韓国	287	千韓国ウォン 20,361,980	11,862	千韓国ウォン 35,429,595
	台湾	14,560	千新台幣ドル 260,147	12,370	千新台幣ドル 568,260
	中国オフショア	- (756)	- (-)	12,992	千オフショア人民元 101,816

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) 単位未満は切り捨て。

(注) ()内は株式分割、予約権行使、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。

■株式売買比率

(2023年1月24日～2024年1月22日)

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	89,522,090千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	76,024,655千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.17

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

■利害関係人との取引状況等

(2023年1月24日～2024年1月22日)

該当事項はございません。

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

(2024年1月22日現在)

国内株式

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
機械 (14.3%)			
クボタ	—	606.6	1,329,060
電気機器 (17.4%)			
ファナック	59.8	376.5	1,613,302
太陽誘電	300.9	—	—
輸送用機器 (58.4%)			
デンソー	269.5	864.4	1,986,823
いすゞ自動車	—	648	1,336,176
スズキ	250.8	319.3	2,093,330
陸運業 (9.9%)			
東日本旅客鉄道	236.1	108.3	916,759
合 計	株数・金額	1,117	2,923 9,275,452
	銘柄数<比率>	5	6 <12.3%>

(注) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

(注) 評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注) 評価額の単位未満は切り捨て。

(注) —印は組み入れなし。

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	千米ドル	千円	
ANSYS, INC.	828	625	21,073	3,123,110	ソフトウェア・サービス
ALBEMARLE CORPORATION	688	—	—	—	素材
POWER INTEGRATIONS, INC.	679	952	7,834	1,161,057	半導体・半導体製造装置
AMPHENOL CORPORATION	1,419	1,276	12,464	1,847,210	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DEERE & CO	—	295	11,296	1,674,177	資本財
DIODES INC	438	—	—	—	半導体・半導体製造装置
EMERSON ELECTRIC CO	—	1,166	11,067	1,640,267	資本財
NVIDIA CORPORATION	344	275	16,365	2,425,437	半導体・半導体製造装置
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	—	1,061	12,773	1,893,045	ソフトウェア・サービス
PLUG POWER INC	5,845	—	—	—	資本財
MAGNA INTERNATIONAL INC.	1,624	—	—	—	自動車・自動車部品
ON SEMICONDUCTOR CORPORATI	1,549	790	5,837	865,096	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	452	716	10,882	1,612,781	半導体・半導体製造装置
REGAL-BELOIT CORPORATION	738	—	—	—	資本財
ROPER TECHNOLOGIES INC	191	156	8,610	1,276,031	資本財
SEMTECH CORPORATION	2,423	—	—	—	半導体・半導体製造装置
TEXAS INSTRUMENTS INC	—	533	9,272	1,374,193	半導体・半導体製造装置
TRIMBLE INC.	2,500	2,358	11,794	1,747,872	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SKYWORKS SOLUTIONS INC	774	—	—	—	半導体・半導体製造装置
SPLUNK INC	1,291	—	—	—	ソフトウェア・サービス
VISTEON CORPORATION	904	1,132	13,192	1,955,176	自動車・自動車部品
NXP SEMICONDUCTORS NV	440	415	9,065	1,343,497	半導体・半導体製造装置
TE CONNECTIVITY LIMITED	894	790	10,476	1,552,596	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GENERAL MOTORS CO.	2,635	—	—	—	自動車・自動車部品
APTIV PLC	1,628	1,071	8,461	1,253,952	自動車・自動車部品
EATON CORP PLC	913	556	13,604	2,016,136	資本財
TWILIO INC.	1,666	1,571	11,527	1,708,309	ソフトウェア・サービス
HUBBELL INCORPORATED	626	258	8,529	1,264,034	資本財
CNH INDUSTRIAL NV	11,571	—	—	—	資本財
ZUORA INC - CLASS A	6,572	9,466	8,112	1,202,277	ソフトウェア・サービス
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	—	554	16,106	2,387,007	ソフトウェア・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC	3,635	2,391	15,573	2,308,006	運輸
MOBILEYE GLOBAL INC-A	—	3,690	10,458	1,550,001	自動車・自動車部品

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	
		百株	百株	千米ドル	千円	
WOLFSPEED INC		731	—	—	—	半導体・半導体製造装置
MP MATERIALS CORP		5,681	—	—	—	素材
MARVELL TECHNOLOGY INC		1,399	—	—	—	半導体・半導体製造装置
LUMENTUM HOLDINGS INC		2,049	1,233	6,636	983,521	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ALPHABET INC.		836	673	9,970	1,477,564	メディア・娯楽
小 計	株 数 ・ 金 額	63,979	34,014	280,987	41,642,363	
	銘柄数〈比率〉	32	25	—	<55.3%>	
(ユーロ・・・ドイツ)				千ユーロ		
DHL GROUP		1,362	1,544	6,752	1,090,648	運輸
MERCEDES-BENZ GROUP AG		781	1,153	6,819	1,101,536	自動車・自動車部品
INFINEON TECHNOLOGIES AG		5,883	4,747	16,230	2,621,473	半導体・半導体製造装置
KION GROUP AG		1,511	2,080	8,141	1,315,009	資本財
KNORR-BREMSE AG		896	1,302	7,132	1,152,119	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額	10,434	10,828	45,076	7,280,788	
	銘柄数〈比率〉	5	5	—	<9.7%>	
(ユーロ・・・フランス)						
SCHNEIDER ELECTRIC SE		1,119	467	8,298	1,340,370	資本財
DASSAULT SYSTEMES SE		—	2,798	12,913	2,085,856	ソフトウェア・サービス
MICHELIN (CGDE)		4,276	3,807	11,638	1,879,868	自動車・自動車部品
小 計	株 数 ・ 金 額	5,395	7,072	32,851	5,306,095	
	銘柄数〈比率〉	2	3	—	<7.1%>	
(ユーロ・・・オランダ)						
STMICROELECTRONICS N.V.		2,532	1,579	6,400	1,033,854	半導体・半導体製造装置
ALFEN N.V.		566	—	—	—	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額	3,099	1,579	6,400	1,033,854	
	銘柄数〈比率〉	2	1	—	<1.4%>	
ユーロ計	株 数 ・ 金 額	18,929	19,480	84,328	13,620,738	
	銘柄数〈比率〉	9	9	—	<18.1%>	
(イギリス)				千英ポンド		
ANGLO AMERICAN PLC		—	3,883	6,887	1,297,262	素材
DOWLAIS GROUP PLC		—	54,678	4,917	926,271	自動車・自動車部品
小 計	株 数 ・ 金 額	—	58,562	11,805	2,223,533	
	銘柄数〈比率〉	—	2	—	<3.0%>	

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	
(スイス)		百株	百株	千スイスフラン	千円	
LANDIS+GYR GROUP AG		1,229	1,020	7,175	1,224,717	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
小 計	株 数 ・ 金 額	1,229	1,020	7,175	1,224,717	
	銘柄数〈比率〉	1	1	—	<1.6%〉	
(スウェーデン)				千スウェーデンクローナ		
EPIROC AB-A		5,565	5,006	94,245	1,334,518	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額	5,565	5,006	94,245	1,334,518	
	銘柄数〈比率〉	1	1	—	<1.8%〉	
(香港)				千香港ドル		
BYD COMPANY LIMITED		4,470	4,700	91,932	1,742,111	自動車・自動車部品
MEITUAN-CLASS B		—	5,282	36,260	687,144	消費者サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	4,470	9,982	128,192	2,429,256	
	銘柄数〈比率〉	1	2	—	<3.2%〉	
(韓国)				千韓国ウォン		
SAMSUNG SDI CO., LTD.		320	127	4,780,842	531,151	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HANON SYSTEMS		11,382	—	—	—	自動車・自動車部品
小 計	株 数 ・ 金 額	11,702	127	4,780,842	531,151	
	銘柄数〈比率〉	2	1	—	<0.7%〉	
(台湾)				千新台幣ドル		
CHROMA ATE INC.		—	8,300	175,545	828,115	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MEDIATEK INC		6,110	—	—	—	半導体・半導体製造装置
小 計	株 数 ・ 金 額	6,110	8,300	175,545	828,115	
	銘柄数〈比率〉	1	1	—	<1.1%〉	
(中国オフショア)				千オフショア人民元		
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A		1,551	—	—	—	資本財
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A		10,684	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
小 計	株 数 ・ 金 額	12,236	—	—	—	
	銘柄数〈比率〉	2	—	—	<—%〉	
合 計	株 数 ・ 金 額	124,224	136,494	—	63,834,395	
	銘柄数〈比率〉	49	42	—	<84.8%〉	

(注) 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) 邦貨換算金額欄の〈 〉内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

(注) 株数・評価額の単位未満は切り捨て。

(注) —印は組み入れなし。

■投資信託財産の構成

(2024年1月22日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	73,109,848	95.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,502,751	4.6
投 資 信 託 財 産 総 額	76,612,599	100.0

(注) 金額の単位未満は切り捨て。

(注) 当期末における外貨建て純資産(65,209,325千円)の投資信託財産総額(76,612,599千円)に対する比率は85.1%です。

(注) 外貨建て資産は、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。1米ドル=148.20円、1ユーロ=161.52円、1英ポンド=188.35円、1スイスフラン=170.68円、1スウェーデンクローナ=14.16円、1香港ドル=18.95円、100韓国ウォン=11.11円、1新台幣ドル=4.7174円。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年1月22日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	76,612,599,027円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,859,015,860
株 式 (評 価 額)	73,109,848,728
未 収 入 金	623,396,911
未 収 配 当 金	20,337,528
(B) 負 債	1,358,981,353
未 払 金	351,955,749
未 払 解 約 金	1,006,991,616
そ の 他 未 払 費 用	33,988
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	75,253,617,674
元 本	42,026,740,530
次 期 繰 越 損 益 金	33,226,877,144
(D) 受 益 権 総 口 数	42,026,740,530口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,906円

(注) 当親ファンドの期首元本額は50,440,250,775円、期中追加設定元本額は234,357,955円、期中一部解約元本額は8,647,868,200円です。

(注) 当親ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は、モビリティ・イノベーション・ファンド42,002,318,097円、モビリティ・イノベーション・ファンド(予想分配金提示型)24,422,433円です。

(注) 期末の1口当たり純資産額は1.7906円です。

■損益の状況 (2023年1月24日～2024年1月22日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	872,411,643円
受 取 配 当 金	816,230,650
受 取 利 息	56,009,196
そ の 他 収 益 金	171,797
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	13,791,583,089
売 買 益	25,537,809,369
売 買 損	△11,746,226,280
(C) 保 管 費 用 等	△ 17,604,131
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	14,646,390,601
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	24,456,798,975
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	140,297,022
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 6,016,609,454
(H) 計 (D + E + F + G)	33,226,877,144
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	33,226,877,144

(注) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(G)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。

■お知らせ

約款変更のお知らせ

外国為替予約取引の利用目的を明確化する約款変更を行いました。(2023年10月21日付)