



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14期（決算日：2023年2月21日）

第15期（決算日：2023年3月22日）

第16期（決算日：2023年4月21日）

第17期（決算日：2023年5月22日）

第18期（決算日：2023年6月21日）

第19期（決算日：2023年7月21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、2023年2月21日に第14期、2023年3月22日に第15期、2023年4月21日に第16期、2023年5月22日に第17期、2023年6月21日に第18期、2023年7月21日に第19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/>

■設定以来の運用実績

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			
第 1 作 成 期	(設 定 日)	円	円	%	%	%	百万円
	2021年11月9日	10,000	—	—	—	—	0.1
第 2 作 成 期	1期(2022年1月21日)	8,708	0	△12.9	94.4	—	54
	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
第 3 作 成 期	8期(2022年8月22日)	8,575	0	5.7	95.8	—	53
	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

(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) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

(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14期	(期 首) 2023年1月23日	7,750	—	99.3	—
	1月末	8,057	4.0	98.8	—
	(期 末) 2023年2月21日	8,499	9.7	95.5	—
第15期	(期 首) 2023年2月21日	8,499	—	95.5	—
	2月末	8,466	△0.4	97.1	—
	(期 末) 2023年3月22日	8,029	△5.5	95.7	—
第16期	(期 首) 2023年3月22日	8,029	—	95.7	—
	3月末	8,248	2.7	98.1	—
	(期 末) 2023年4月21日	8,005	△0.3	96.3	—
第17期	(期 首) 2023年4月21日	8,005	—	96.3	—
	4月末	7,885	△1.5	96.4	—
	(期 末) 2023年5月22日	8,360	4.4	98.5	—
第18期	(期 首) 2023年5月22日	8,360	—	98.5	—
	5月末	8,575	2.6	99.1	—
	(期 末) 2023年6月21日	9,167	9.7	95.5	—
第19期	(期 首) 2023年6月21日	9,167	—	95.5	—
	6月末	9,227	0.7	98.8	—
	(期 末) 2023年7月21日	9,243	0.8	95.7	—

(注) 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19.3%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。



◆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)

- ・2023年3月下旬以降、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
- ・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、当作成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

◆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上昇基調で推移しました。

(為替)

金融不安が高まった2023年3月に、一時的に米ドルに対して円高が進行する局面が見られましたが、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6月末にかけて円安が進行しました。7月には、日本銀行の金融政策の変更に対する思惑から円高となりましたが、当作成期を通じてみると米ドルは対円で上昇しました。

◆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、アンシス（情報技術）、アルバマール（素材）、インフィニオンテクノロジーズ（情報技術）、BYD（一般消費財・サービス）、アプティブ（一般消費財・サービス）などでした。

◆収益分配

当作成期中の収益分配については、基準価額の水準等を勘案し、見送りとさせていただきます。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14期	第15期	第16期	第17期	第18期	第19期
	2023年1月24日～ 2023年2月21日	2023年2月22日～ 2023年3月22日	2023年3月23日～ 2023年4月21日	2023年4月22日～ 2023年5月22日	2023年5月23日～ 2023年6月21日	2023年6月22日～ 2023年7月21日
当期分配金 (対基準価額比率)	— —%	— —%	— —%	— —%	— —%	— —%
当期の収益	—	—	—	—	—	—
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	41	41	41	46	78	82

(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

(2023年 1月24日～2023年 7月21日)

項 目	第14期～第19期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信託報酬	円	%	(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、8,409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
(投信会社)	74	0.882	
(販売会社)	(36)	(0.432)	
(受託会社)	(36)	(0.432)	
(b) 売買委託手数料	4	0.043	(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
(株式)	(4)	(0.043)	
(c) 有価証券取引税	3	0.037	(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
(株式)	(3)	(0.037)	
(d) その他費用	3	0.040	(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
(保管費用)	(1)	(0.010)	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
(監査費用)	(0)	(0.003)	監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(印刷)	(2)	(0.027)	目論見書、運用報告書等の印刷・交付等に係る費用
(その他)	(0)	(0.000)	金融商品取引に要する諸費用
合 計	84	1.002	

(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

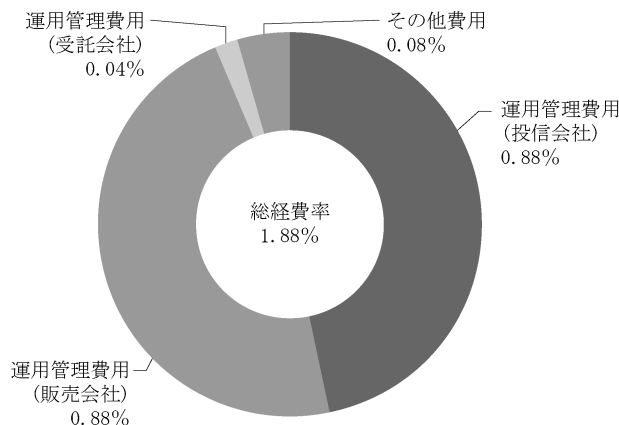
当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)は1.88%です。

(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

(2023年1月24日～2023年7月21日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	第14期～第19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 1,602	千円 2,680	千口 4,940	千円 8,369

(注) 単位未満は切り捨て。

■ 株式売買比率

(2023年1月24日～2023年7月21日)

親投資信託の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	第14期～第19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	48,782,737千円	
(b) 過去6ヶ月の平均組入株式時価総額	77,219,156千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.63	

(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～2023年7月21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

(2023年7月21日現在)

親投資信託残高

銘柄	第13期末	第19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 31,411	千口 28,072	千円 50,115

(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

(2023年7月21日現在)

項目	第19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 50,115	% 97.3
コール・ローン等、その他	1,409	2.7
投資信託財産総額	51,524	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、当作成期末における外貨建て純資産(71,580,283千円)の投資信託財産総額(82,456,670千円)に対する比率は86.8%です。

(注) 外貨建て資産は、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。1オフショア人民元=19.5146円、1米ドル=140.09円、1ユーロ=155.96円、1英ポンド=180.35円、1スイスフラン=161.69円、1スウェーデンクローナ=13.55円、1香港ドル=17.93円、100韓国ウォン=10.98円、1新台幣ドル=4.5013円。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第14期末	第15期末	第16期末	第17期末	第18期末	第19期末
	2023年2月21日現在	2023年3月22日現在	2023年4月21日現在	2023年5月22日現在	2023年6月21日現在	2023年7月21日現在
(A) 資 産	49,561,722円	46,802,872円	46,270,666円	48,042,857円	52,196,771円	51,524,224円
コール・ローン等	10,000	1,880	669	1,248	11,807	10,621
モビリティ・イノベーション・マザーファンド(評価額)	48,745,462	46,721,787	45,936,492	47,961,801	49,813,005	50,115,334
未 取 入 金	806,260	79,205	333,505	79,808	2,371,959	1,398,269
(B) 負 債	88,780	72,407	317,617	73,775	1,032,462	86,668
未 払 解 約 金	15,993	1,036	246,960	1,053	956,331	8,562
未 払 信 託 報 酬	70,438	69,067	68,379	70,378	73,677	75,587
そ の 他 未 払 費 用	2,349	2,304	2,278	2,344	2,454	2,519
(C) 純資産総額(A-B)	49,472,942	46,730,465	45,953,049	47,969,082	51,164,309	51,437,556
元 本	58,208,013	58,203,890	57,406,400	57,380,270	55,811,610	55,648,048
次 期 繰 越 損 益 金	△8,735,071	△11,473,425	△11,453,351	△9,411,188	△4,647,301	△4,210,492
(D) 受 益 権 総 口 数	58,208,013口	58,203,890口	57,406,400口	57,380,270口	55,811,610口	55,648,048口
1万口当たり基準価額(C/D)	8,499円	8,029円	8,005円	8,360円	9,167円	9,243円

(注) 当ファンドの第14期首元本額は60,220,777円、第14～19期中追加設定元本額は1,479,747円、第14～19期中一部解約元本額は6,052,476円です。

(注) 期末の1口当たり純資産額は、第14期0.8499円、第15期0.8029円、第16期0.8005円、第17期0.8360円、第18期0.9167円、第19期0.9243円です。

■ 損益の状況

項 目	第14期	第15期	第16期	第17期	第18期	第19期
	2023年1月24日～ 2023年2月21日	2023年2月22日～ 2023年3月22日	2023年3月23日～ 2023年4月21日	2023年4月22日～ 2023年5月22日	2023年5月23日～ 2023年6月21日	2023年6月22日～ 2023年7月21日
(A) 有価証券売買損益	4,425,052円	△ 2,665,972円	△ 66,379円	2,109,264円	4,580,377円	498,646円
売 買 益	4,563,048	1,413	16,991	2,111,988	4,718,077	506,696
売 買 損	△ 137,996	△ 2,667,385	△ 83,370	△ 2,724	△ 137,700	△ 8,050
(B) 信託報酬等	△ 72,787	△ 71,371	△ 70,657	△ 72,722	△ 76,131	△ 78,111
(C) 当期損益金(A+B)	4,352,265	△ 2,737,343	△ 137,036	2,036,542	4,504,246	420,535
(D) 前期繰越損益金	△ 9,257,954	△ 4,888,638	△ 7,491,026	△ 7,604,025	△ 5,403,585	△ 887,795
(E) 追加信託差損益金	△ 3,829,382	△ 3,847,444	△ 3,825,289	△ 3,843,705	△ 3,747,962	△ 3,743,232
(配当等相当額)	(47,457)	(48,125)	(48,332)	(49,050)	(48,287)	(52,503)
(売買損益相当額)	(△ 3,876,839)	(△ 3,895,569)	(△ 3,873,621)	(△ 3,892,755)	(△ 3,796,249)	(△ 3,795,735)
(F) 計(C+D+E)	△ 8,735,071	△ 11,473,425	△ 11,453,351	△ 9,411,188	△ 4,647,301	△ 4,210,492
(G) 収益分配金	0	0	0	0	0	0
次期繰越損益金(F+G)	△ 8,735,071	△ 11,473,425	△ 11,453,351	△ 9,411,188	△ 4,647,301	△ 4,210,492
追加信託差損益金	△ 3,829,382	△ 3,847,444	△ 3,825,289	△ 3,843,705	△ 3,747,962	△ 3,743,232
(配当等相当額)	(47,468)	(48,228)	(48,558)	(49,175)	(48,786)	(52,707)
(売買損益相当額)	(△ 3,876,850)	(△ 3,895,672)	(△ 3,873,847)	(△ 3,892,880)	(△ 3,796,748)	(△ 3,795,939)
分配準備積立金	193,169	192,499	191,479	217,879	390,100	406,829
繰越損益金	△ 5,098,858	△ 7,818,480	△ 7,819,541	△ 5,785,362	△ 1,289,439	△ 874,089

(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14期計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,872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(47,468円)および分配準備積立金(189,297円)より分配対象収益は240,637円(10,000口当たり41円)ですが、当計算期間に分配した金額はありません。

(注) 第15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(48,228円)および分配準備積立金(192,499円)より分配対象収益は240,727円(10,000口当たり41円)ですが、当計算期間に分配した金額はありません。

(注) 第16期計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,387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(48,558円)および分配準備積立金(189,092円)より分配対象収益は240,037円(10,000口当たり41円)ですが、当計算期間に分配した金額はありません。

(注) 第17期計算期間末における費用控除後の配当等収益(27,002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(49,175円)および分配準備積立金(190,877円)より分配対象収益は267,054円(10,000口当たり46円)ですが、当計算期間に分配した金額はありません。

(注) 第18期計算期間末における費用控除後の配当等収益(178,635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(48,786円)および分配準備積立金(211,465円)より分配対象収益は438,886円(10,000口当たり78円)ですが、当計算期間に分配した金額はありません。

(注) 第19期計算期間末における費用控除後の配当等収益(21,734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(52,707円)および分配準備積立金(385,095円)より分配対象収益は459,536円(10,000口当たり82円)ですが、当計算期間に分配した金額はありません。

(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

当作成期の分配金はございません。

(参考情報) 親投資信託の組入資産の明細

(2023年7月21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(45,481,928千口)の内容です。

国内株式

銘柄	第13期末	第19期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
電気機器 (30.9%)			
ファナック	59.8	341.3	1,611,618
太陽誘電	300.9	294.3	1,254,895
輸送用機器 (52.9%)			
デンソー	269.5	166	1,590,446
いすゞ自動車	—	672	1,204,896
スズキ	250.8	389.7	2,113,732
陸運業 (16.2%)			
東日本旅客鉄道	236.1	194.4	1,503,295
合計	株数・金額	1,117	2,057 9,278,883
	銘柄数<比率>	5	6 <11.4%>

(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13期末	第19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	743	25,307	3,545,302	ソフトウェア・サービス
ALBEMARLE CORPORATION	688	1,032	23,035	3,227,003	素材
POWER INTEGRATIONS, INC.	679	818	7,516	1,053,003	半導体・半導体製造装置
AMPHENOL CORPORATION	1,419	1,388	11,704	1,639,630	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DIODES INC	438	—	—	—	半導体・半導体製造装置
EMERSON ELECTRIC CO	—	936	8,604	1,205,389	資本財
NVIDIA CORPORATION	344	285	12,987	1,819,392	半導体・半導体製造装置
PLUG POWER INC	5,845	—	—	—	資本財

銘柄	第13期末	第19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		
MAGNA INTERNATIONAL INC.	1,624	—	—	—	自動車・自動車部品	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATI	1,549	819	7,974	1,117,081	半導体・半導体製造装置	
QUALCOMM INC	452	742	8,965	1,256,029	半導体・半導体製造装置	
REGAL-BELOIT CORPORATION	738	—	—	—	資本財	
ROPER TECHNOLOGIES INC	191	187	9,042	1,266,740	資本財	
SEMTECH CORPORATION	2,423	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
TRIMBLE INC.	2,500	2,445	12,808	1,794,379	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	1,262	13,234	1,853,999	ソフトウェア・サービス	
VISTEON CORPORATION	904	863	13,399	1,877,109	自動車・自動車部品	
NXP SEMICONDUCTORS NV	440	430	9,125	1,278,422	半導体・半導体製造装置	
TE CONNECTIVITY LIMITED	894	1,000	14,200	1,989,392	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
GENERAL MOTORS CO.	2,635	2,207	8,666	1,214,115	自動車・自動車部品	
APTIV PLC	1,628	1,435	15,592	2,184,309	自動車・自動車部品	
EATON CORP PLC	913	724	15,276	2,140,044	資本財	
TWILIO INC.	1,666	1,629	10,238	1,434,341	ソフトウェア・サービス	
HUBBELL INCORPORATED	626	311	10,538	1,476,408	資本財	
CNH INDUSTRIAL NV	11,571	3,895	6,057	848,580	資本財	
ZUORA INC - CLASS A	6,572	8,234	8,736	1,223,961	ソフトウェア・サービス	
UBER TECHNOLOGIES INC	3,635	2,710	12,623	1,768,458	運輸	
MOBILEYE GLOBAL INC-A	—	2,682	11,012	1,542,809	自動車・自動車部品	
WOLFSPEED INC	731	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
MP MATERIALS CORP	5,681	3,637	8,780	1,230,055	素材	
MARVELL TECHNOLOGY INC	1,399	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
LUMENTUM HOLDINGS INC	2,049	1,598	8,385	1,174,786	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ALPHABET INC.	836	698	8,352	1,170,104	メディア・娯楽	
小計	株数・金額	63,979	42,723	302,168	42,330,850	
	銘柄数〈比率〉	32	26	—	<52.1%>	
(ユーロ・・・ドイツ)				千ユーロ		
DHL GROUP	1,362	2,436	11,274	1,758,356	運輸	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	781	984	7,041	1,098,204	自動車・自動車部品	

銘柄		第13期末 株数	第19期末			業種等
			株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
INFINEON TECHNOLOGIES AG		5,883	5,230	19,216	2,996,957	半導体・半導体製造装置
KION GROUP AG		1,511	1,478	5,220	814,173	資本財
KNORR-BREMSE AG		896	1,284	7,969	1,242,856	資本財
小計	株数・金額	10,434	11,413	50,721	7,910,549	
	銘柄数〈比率〉	5	5	—	<9.7%〉	
(ユーロ・・・フランス)						
SCHNEIDER ELECTRIC SE		1,119	706	11,331	1,767,327	資本財
ALSTOM		—	3,227	8,801	1,372,699	資本財
DASSAULT SYSTEMES SE		—	2,320	9,445	1,473,182	ソフトウェア・サービス
MICHELIN (CGDE)		4,276	4,524	12,795	1,995,658	自動車・自動車部品
小計	株数・金額	5,395	10,780	42,375	6,608,867	
	銘柄数〈比率〉	2	4	—	<8.1%〉	
(ユーロ・・・オランダ)						
STMICROELECTRONICS N.V.		2,532	1,638	7,572	1,181,062	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	1,638	7,572	1,181,062	
	銘柄数〈比率〉	2	1	—	<1.5%〉	
ユーロ計	株数・金額	18,929	23,831	100,669	15,700,480	
	銘柄数〈比率〉	9	10	—	<19.3%〉	
(スイス)				千スイスフラン		
LANDIS+GYR GROUP AG		1,229	999	7,603	1,229,365	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	999	7,603	1,229,365	
	銘柄数〈比率〉	1	1	—	<1.5%〉	
(スウェーデン)				千スウェーデンクローナ		
EPIROC AB-A		5,565	5,444	108,719	1,473,151	資本財
小計	株数・金額	5,565	5,444	108,719	1,473,151	
	銘柄数〈比率〉	1	1	—	<1.8%〉	
(香港)				千香港ドル		
BYD COMPANY LIMITED		4,470	5,120	136,601	2,449,266	自動車・自動車部品

銘柄		第13期末		第19期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
MEITUAN-CLASS B		百株 —	百株 5,478	千香港ドル 69,406	千円 1,244,454	消費者サービス
小計	株数・金額	4,470	10,598	206,007	3,693,720	
	銘柄数〈比率〉	1	2	—	<4.5%〉	
(韓国)				千韓国ウォン		
LG CHEM LTD.		—	287	19,686,215	2,161,546	素材
SAMSUNG SDI CO., LTD.		320	225	15,433,050	1,694,548	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	512	35,119,265	3,856,095	
	銘柄数〈比率〉	2	2	—	<4.7%〉	
(台湾)				千新台幣ドル		
CHROMA ATE INC.		—	12,240	328,032	1,476,570	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	12,240	328,032	1,476,570	
	銘柄数〈比率〉	1	1	—	<1.8%〉	
(中国オフショア)				千オフショア人民元		
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A		1,551	1,664	36,796	718,063	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	1,664	36,796	718,063	
	銘柄数〈比率〉	2	1	—	<0.9%〉	
合計	株数・金額	124,224	98,014	—	70,478,298	
	銘柄数〈比率〉	49	44	—	<86.8%〉	

(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5期（2023年1月23日決算）〔計算期間：2022年1月22日～2023年1月23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。

■設定以来の運用実績

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			
(設定日) 2018年1月22日	円 10,000	% —	% —	% —	百万円 10
1期(2019年1月21日)	7,879	△21.2	98.3	—	226,981
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

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

(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) 2022年1月21日	16,361	% —	% 97.9	% —
1月末	15,491	△5.3	98.9	—
2月末	15,734	△3.8	95.3	—
3月末	16,932	3.5	97.9	—
4月末	15,134	△7.5	97.3	—
5月末	15,341	△6.2	99.0	—
6月末	14,568	△11.0	97.8	—
7月末	15,682	△4.2	99.0	—
8月末	15,626	△4.5	98.1	—
9月末	14,406	△11.9	95.0	—
10月末	15,553	△4.9	97.5	—
11月末	15,237	△6.9	97.5	—
12月末	13,852	△15.3	98.1	—
(期 末) 2023年1月23日	14,849	△9.2	99.4	—

(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おりません。

■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△9.2%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。

(上昇要因)

- ・2022年7月から8月半ばにかけて、米連邦準備制度理事会（FRB）の利上げペース鈍化期待が広がり、世界株式市場が上昇したこと
- ・期初から2022年10月半ばにかけて世界の中央銀行がインフレ対処のために金融引締めを進める一方、日本銀行は緩和的な金融政策を継続する姿勢を示し、米ドルなどの外貨が対円で上昇したこと

(下落要因)

- ・期初から2022年6月半ばにかけて、ウクライナ情勢の悪化に加えて、米国のインフレ高進を背景にFRBが金融引き締め姿勢を一段と強める中で長期金利が上昇し、世界株式市場が下落したこと
- ・2022年8月半ばから9月末にかけて、インフレ圧力を背景にFRBが大幅な利上げを継続する姿勢を示したことに加え、英国で財政悪化懸念が台頭し世界株式市場が下落したこと



■投資環境

(世界株式市況)

期初から2022年6月半ばにかけて、ウクライナ情勢の悪化に加えて、米国のインフレ高進を背景に米国金融当局が引き締め姿勢を一段と強める中で長期金利が上昇し、世界株式市場は下落基調で推移しました。その後利上げペースの鈍化期待が広がり、8月半ばにかけて反発しましたが、インフレ圧力を背景にFRBが大幅な利上げを継続する姿勢を示したことに加え、英国で財政悪化懸念が台頭したことから、世界株式市場は9月末にかけて下落しました。その後はトラス英国首相の辞任が投資家の買い安心感につながった場面が見られたものの、グローバル景気や金融政策の先行きをにらみ上値の重い展開となりました。

(為替)

急ピッチで金融引き締めを行う米国に対して、日本では強固な金融緩和姿勢が維持されるなど、日米金融政策の方向性の違いから、10月半ばにかけて米ドルは円に対して上昇しました。しかし、その後は政府・日本銀行によるドル売り・円買いの為替介入、米国での利上げペース鈍化観測、日本銀行による長期金利の変動許容幅の拡大などから一転して米ドルは対円で下落しました。

■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）、CNHインダストリアル（資本財・サービス）、シュナイダーエレクトリック（資本財・サービス）、MPマテリアルズ（素材）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

(2022年1月22日～2023年1月23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 7 (7)	% 0.046 (0.046)	(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、15,296円です。
(b) 有価証券取引税 (株式)	2 (2)	0.016 (0.016)	(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)	3 (3) (0)	0.022 (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	12	0.084	

(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

(2022年1月22日～2023年1月23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
		359	2,725,937	386	709,883
外国	アメリカ	百株	千米ドル	百株	千米ドル
		10,787 (2,312)	98,833 (△50)	22,697 (－)	178,173 (106)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	6,655	21,184	5,424	26,760
	フランス	4,276	10,655	4,957	15,317
	オランダ	－	－	2,480	11,827
	スイス	－ (123)	千スイスフラン － (303)	2,729 (－)	千スイスフラン 7,548 (568)
	スウェーデン	5,647	千スウェーデンクローナ 108,006	81	千スウェーデンクローナ 1,597
	香港	4,520	千香港ドル 101,723	65,466	千香港ドル 121,893
	韓国	2,504	千韓国ウォン 7,062,252	440	千韓国ウォン 7,047,996
台湾	－	千新台幣ドル －	240 (－)	千新台幣ドル 24,093 (9,776)	
中国オフショア	5,553	千オフショア人民元 106,011	5,389	千オフショア人民元 40,645	

(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

(2022年1月22日～2023年1月23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	62,289,265千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	81,895,385千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.76

(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

(2022年1月22日～2023年1月23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

(2023年1月23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	
電気機器 (36.4%)				
アンリツ	357.8	—	—	
ファナック	—	59.8	1,312,909	
太陽誘電	312.4	300.9	1,351,041	
輸送用機器 (40.0%)				
デンソー	279.9	269.5	1,820,203	
スズキ	—	250.8	1,104,774	
陸運業 (23.6%)				
東日本旅客鉄道	193.9	236.1	1,731,557	
合 計	株 数 ・ 金 額	1,144	1,117	7,320,484
	銘柄数 < 比率 >	4	5	< 9.8% >

(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.	860	828	21,255	2,748,293	ソフトウェア・サービス
ALBEMARLE CORPORATION	—	688	17,104	2,211,587	素材
POWER INTEGRATIONS, INC.	—	679	5,753	743,893	半導体・半導体製造装置
AMPHENOL CORPORATION	1,005	1,419	11,078	1,432,493	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DIODES INC	1,787	438	3,797	491,020	半導体・半導体製造装置
NVIDIA CORPORATION	1,304	344	6,152	795,471	半導体・半導体製造装置
PLUG POWER INC	5,246	5,845	9,293	1,201,711	資本財
MAGNA INTERNATIONAL INC.	2,908	1,624	10,379	1,342,091	自動車・自動車部品
ON SEMICONDUCTOR CORPORATI	2,497	1,549	10,264	1,327,161	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	842	452	5,567	719,813	半導体・半導体製造装置
REGAL-BELOIT CORPORATION	—	738	9,955	1,287,207	資本財
ROPER TECHNOLOGIES INC	199	191	8,476	1,096,045	資本財
ROCKWELL AUTOMATION INC	528	—	—	—	資本財
SEMTECH CORPORATION	3,176	2,423	7,884	1,019,485	半導体・半導体製造装置
TRIMBLE INC.	—	2,500	13,950	1,803,779	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SKYWORKS SOLUTIONS INC	804	774	7,979	1,031,725	半導体・半導体製造装置
SPLUNK INC	1,340	1,291	11,699	1,512,730	ソフトウェア・サービス
VISTEON CORPORATION	1,413	904	13,282	1,717,443	自動車・自動車部品
NXP SEMICONDUCTORS NV	457	440	7,417	959,022	半導体・半導体製造装置
TESLA INC.	111	—	—	—	自動車・自動車部品
TE CONNECTIVITY LIMITED	541	894	10,938	1,414,325	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GENERAL MOTORS CO.	1,626	2,635	9,316	1,204,645	自動車・自動車部品
APTIV PLC	1,156	1,628	16,953	2,192,112	自動車・自動車部品
EATON CORP PLC	1,050	913	14,208	1,837,136	資本財
TWILIO INC.	871	1,666	9,039	1,168,856	ソフトウェア・サービス
HUBBELL INCORPORATED	784	626	14,068	1,819,005	資本財
CNH INDUSTRIAL NV	13,759	11,571	19,693	2,546,415	資本財
ZUORA INC - CLASS A	6,826	6,572	4,423	571,954	ソフトウェア・サービス
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	343	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LYFT INC-A	3,147	—	—	—	運輸
UBER TECHNOLOGIES INC	3,105	3,635	11,038	1,427,301	運輸
WOLFSPEED INC	1,028	731	5,848	756,237	半導体・半導体製造装置
MP MATERIALS CORP	7,540	5,681	17,163	2,219,253	素材

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	
MARVELL TECHNOLOGY INC	百株 3,504	百株 1,399	千米ドル 5,525	千円 714,391	半導体・半導体製造装置
LUMENTUM HOLDINGS INC	1,939	2,049	12,056	1,558,942	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
EVERBRIDGE INC	1,748	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ALPHABET INC.	118	836	8,308	1,074,256	メディア・娯楽
小 計	株 数 ・ 金 額	73,577	63,979	339,874	43,945,812
	銘柄数〈比率〉	33	32	—	<58.7%>
(ユーロ・・・ドイツ)			千ユーロ		
DEUTSCHE POST AG-REG	—	1,362	5,423	763,046	運輸
MERCEDES-BENZ GROUP AG	2,120	781	5,138	722,897	自動車・自動車部品
SIEMENS AG	835	—	—	—	資本財
INFINEON TECHNOLOGIES AG	4,218	5,883	18,316	2,576,702	半導体・半導体製造装置
KION GROUP AG	957	1,511	5,488	772,080	資本財
KNORR-BREMSE AG	—	896	5,307	746,672	資本財
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	1,071	—	—	—	自動車・自動車部品
小 計	株 数 ・ 金 額	9,203	10,434	39,674	5,581,399
	銘柄数〈比率〉	5	5	—	<7.5%>
(ユーロ・・・フランス)					
SCHNEIDER ELECTRIC SE	1,288	1,119	16,052	2,258,267	資本財
PLASTIC OMNIUM	1,091	—	—	—	自動車・自動車部品
ALSTOM	3,696	—	—	—	資本財
MICHELIN (CGDE)	—	4,276	12,097	1,701,901	自動車・自動車部品
小 計	株 数 ・ 金 額	6,076	5,395	28,150	3,960,169
	銘柄数〈比率〉	3	2	—	<5.3%>
(ユーロ・・・オランダ)					
STMICROELECTRONICS N. V.	4,497	2,532	9,639	1,356,055	半導体・半導体製造装置
ALFEN BEHEER B. V.	1,083	566	4,662	655,859	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額	5,580	3,099	14,301	2,011,915
	銘柄数〈比率〉	2	2	—	<2.7%>
ユーロ計	株 数 ・ 金 額	20,860	18,929	82,125	11,553,483
	銘柄数〈比率〉	10	9	—	<15.4%>
(スイス)			千スイスフラン		
ABB LTD.	2,558	—	—	—	資本財

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	
LANDIS+GYR GROUP AG		百株 1,277	百株 1,229	千スイスフラン 8,848	千円 1,244,971	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
小 計	株 数 ・ 金 額	3,835	1,229	8,848	1,244,971	
	銘柄数〈比率〉	2	1	—	<1.7%>	
(スウェーデン) EPIROC AB-A		—	5,565	千スウェーデンクローナ 118,387	1,492,864	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額	—	5,565	118,387	1,492,864	
	銘柄数〈比率〉	—	1	—	<2.0%>	
(香港) GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LIMITED BYD COMPANY LIMITED XPENG INC - CLASS A SHARES		59,880 — 5,536	— 4,470 —	千香港ドル — 101,200 —	— 1,671,837 —	自動車・自動車部品 自動車・自動車部品 自動車・自動車部品
小 計	株 数 ・ 金 額	65,416	4,470	101,200	1,671,837	
	銘柄数〈比率〉	2	1	—	<2.2%>	
(韓国) SAMSUNG SDI CO., LTD. HANON SYSTEMS		329 9,309	320 11,382	千韓国ウォン 19,868,043 9,970,649	2,090,118 1,048,912	テクノロジー・ハードウェアおよび機器 自動車・自動車部品
小 計	株 数 ・ 金 額	9,639	11,702	29,838,692	3,139,030	
	銘柄数〈比率〉	2	2	—	<4.2%>	
(台湾) MEDIATEK INC		6,350	6,110	千新台幣ドル 423,423	1,802,554	半導体・半導体製造装置
小 計	株 数 ・ 金 額	6,350	6,110	423,423	1,802,554	
	銘柄数〈比率〉	1	1	—	<2.4%>	
(中国オフショア) CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A		— 12,071	1,551 10,684	千オフショア人民元 70,120 47,675	1,337,809 909,585	資本財 テクノロジー・ハードウェアおよび機器
小 計	株 数 ・ 金 額	12,071	12,236	117,796	2,247,394	
	銘柄数〈比率〉	1	2	—	<3.0%>	
合 計	株 数 ・ 金 額	191,750	124,224	—	67,097,948	
	銘柄数〈比率〉	51	49	—	<89.6%>	

(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

(2023年1月23日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	74,418,432	98.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,384,781	1.8
投 資 信 託 財 産 総 額	75,803,213	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(67,476,501千円)の投資信託財産総額(75,803,213千円)に対する比率は89.0%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オプショア人民元=19.0787円、1米ドル=129.30円、1ユーロ=140.68円、1スイスフラン=140.70円、1スウェーデンクローナ=12.61円、1オーストラリアドル=90.30円、1香港ドル=16.52円、100韓国ウォン=10.52円、1新台幣ドル=4.2571円。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年1月23日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	75,803,213,232円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,382,278,692
株 式 (評 価 額)	74,418,432,815
未 収 配 当 金	2,501,725
(B) 負 債	906,163,482
未 払 解 約 金	906,134,606
そ の 他 未 払 費 用	28,876
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	74,897,049,750
元 本	50,440,250,775
次 期 繰 越 損 益 金	24,456,798,975
(D) 受 益 権 総 口 数	50,440,250,775口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,849円

(注) 当親ファンドの期首元本額は59,055,279,336円、期中追加設定元本額は193,221,783円、期中一部解約元本額は8,808,250,344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50,408,839,726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)31,411,049円です。

(注) 期末の1口当たり純資産額は1,4849円です。

■損益の状況 (2022年1月22日～2023年1月23日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	800,937,747円
受 取 配 当 金	782,059,474
受 取 利 息	18,845,476
そ の 他 収 益 金	32,797
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 9,462,258,790
売 買 益	15,287,974,389
売 買 損	△24,750,233,179
(C) 保 管 費 用 等	△ 18,797,404
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 8,680,118,447
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	37,567,334,273
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	106,040,979
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 4,536,457,830
(H) 計 (D + E + F + G)	24,456,798,975
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	24,456,798,975

(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

デリバティブ取引等にかかる投資制限に関する条項の新設を行ったため、約款に所要の変更を行いました。(2022年10月21日付)