



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。<br>株式への実質投資割合には、制限を設けません。<br>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。<br>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20期（決算日：2023年8月21日）  
第21期（決算日：2023年9月21日）  
第22期（決算日：2023年10月23日）  
第23期（決算日：2023年11月21日）  
第24期（決算日：2023年12月21日）  
第25期（決算日：2024年1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、2023年8月21日に第20期、2023年9月21日に第21期、2023年10月23日に第22期、2023年11月21日に第23期、2023年12月21日に第24期、2024年1月22日に第25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<br>分配金 | 期中<br>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  |
| 第4作成期 | 13期(2023年1月23日)  | 7,750      | 0         | 6.9    | 99.3   | —     | 46  |
|       | 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  |
| 第5作成期 | 19期(2023年7月21日)  | 9,243      | 0         | 0.8    | 95.7   | —     | 51  |
|       | 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  |

(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<br>組入比率 | 株 式<br>先物比率 |
|------|----------------------|---------|------|-------------|-------------|
|      |                      | 円       | 騰落率  |             |             |
| 第20期 | (期 首)<br>2023年7月21日  | 9,243   | —    | 95.7        | —           |
|      | 7月末                  | 9,367   | 1.3  | 98.3        | —           |
|      | (期 末)<br>2023年8月21日  | 8,777   | △5.0 | 95.5        | —           |
| 第21期 | (期 首)<br>2023年8月21日  | 8,777   | —    | 95.5        | —           |
|      | 8月末                  | 9,244   | 5.3  | 100.2       | —           |
|      | (期 末)<br>2023年9月21日  | 9,088   | 3.5  | 95.1        | —           |
| 第22期 | (期 首)<br>2023年9月21日  | 9,088   | —    | 95.1        | —           |
|      | 9月末                  | 9,027   | △0.7 | 97.2        | —           |
|      | (期 末)<br>2023年10月23日 | 8,428   | △7.3 | 93.6        | —           |
| 第23期 | (期 首)<br>2023年10月23日 | 8,428   | —    | 93.6        | —           |
|      | 10月末                 | 8,186   | △2.9 | 96.4        | —           |
|      | (期 末)<br>2023年11月21日 | 8,909   | 5.7  | 93.7        | —           |
| 第24期 | (期 首)<br>2023年11月21日 | 8,909   | —    | 93.7        | —           |
|      | 11月末                 | 8,890   | △0.2 | 96.1        | —           |
|      | (期 末)<br>2023年12月21日 | 9,009   | 1.1  | 96.4        | —           |
| 第25期 | (期 首)<br>2023年12月21日 | 9,009   | —    | 96.4        | —           |
|      | 12月末                 | 9,183   | 1.9  | 97.5        | —           |
|      | (期 末)<br>2024年1月22日  | 9,205   | 2.2  | 94.7        | —           |

(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△0.4%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」が横ばいとなったことから、当ファンドの基準価額もほぼ横ばいとなりました。

(上昇要因)

- ・2023年11月以降、米国のインフレ鈍化や米連邦準備制度理事会（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

(下落要因)

- ・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)

当作成期初から2023年10月末にかけて、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)

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、「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）、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。

## ◆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20期                      | 第21期                      | 第22期                       | 第23期                        | 第24期                        | 第25期                       |
|-----------|---------------------------|---------------------------|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|----------------------------|
|           | 2023年7月22日～<br>2023年8月21日 | 2023年8月22日～<br>2023年9月21日 | 2023年9月22日～<br>2023年10月23日 | 2023年10月24日～<br>2023年11月21日 | 2023年11月22日～<br>2023年12月21日 | 2023年12月22日～<br>2024年1月22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 | 82                        | 86                        | 86                         | 88                          | 91                          | 96                         |

（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7月22日～2024年1月22日)

| 項 目                 | 第20期～第25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<br>作成期間の平均基準価額は、8,982円です。<br>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 |
| (a) 信託報酬<br>(投信会社)  | 82<br>(40) | 0.909<br>(0.445) |   |
| (a) 信託報酬<br>(販売会社)  | (40)       | (0.445)          | 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<br>および事務手続き等の対価                                     |
| (a) 信託報酬<br>(受託会社)  | (2)        | (0.019)          | 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         | 2          | 0.018            | (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<br>※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              |
| (b) 売買委託手数料<br>(株式) | (2)        | (0.018)          |   |
| (c) 有価証券取引税         | 2          | 0.026            | (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<br>※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) 有価証券取引税<br>(株式) | (2)        | (0.026)          |   |
| (d) その他費用           | 4          | 0.042            | (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   |
| (d) その他費用<br>(保管費用) | (1)        | (0.011)          | 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<br>転等に要する費用   |
| (d) その他費用<br>(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   |
| (d) その他費用<br>(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   |
| (d) その他費用<br>(その他)  | (0)        | (0.001)          | 金融商品取引に要する諸費用   |
| 合 計                 | 90         | 0.995            |   |

(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

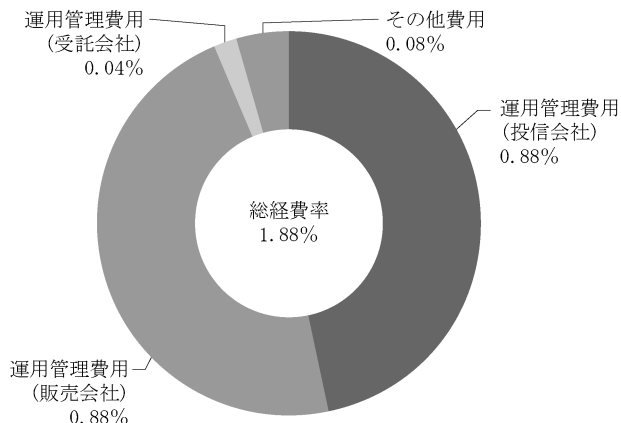
当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)は1.88%です。

(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7月22日～2024年1月22日)

### 親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘柄                    | 第20期～第25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<br>4,370 | 千円<br>7,536 | 千口<br>8,021 | 千円<br>14,087 |

(注) 単位未満は切り捨て。

## ■ 株式売買比率

(2023年7月22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                   | 第20期～第25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     | 40,521,577千円          |  |
| (b) 過去6ヶ月の平均組入株式時価総額 | 74,830,154千円          |  |
| (c) 売買高比率 (a) / (b)  | 0.54                  |  |

(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7月22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)

### 親投資信託残高

| 銘柄                    | 第19期末        | 第25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<br>28,072 | 千口<br>24,422 | 千円<br>43,730 |

(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1月22日現在)

| 項目                    | 第25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<br>43,730 | %<br>96.8 |
| コール・ローン等、その他          | 1,434        | 3.2       |
| 投資信託財産総額              | 45,164       | 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(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、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新台湾ドル=4.7174円。

## ■資産、負債、元本及び基準価額の状況

| 項 目                        | 第20期末        | 第21期末        | 第22期末         | 第23期末         | 第24期末         | 第25期末        |
|----------------------------|--------------|--------------|---------------|---------------|---------------|--------------|
|                            | 2023年8月21日現在 | 2023年9月21日現在 | 2023年10月23日現在 | 2023年11月21日現在 | 2023年12月21日現在 | 2024年1月22日現在 |
| (A) 資 産                    | 47,962,087円  | 48,750,045円  | 44,682,061円   | 47,215,573円   | 47,117,701円   | 45,164,942円  |
| コール・ローン等                   | 15,207       | 2,501        | 337           | 4,557         | 254           | 614          |
| モビリティ・イノベーション・マザーファンド(評価額) | 46,550,032   | 46,779,407   | 43,381,695    | 45,599,735    | 43,858,237    | 43,730,808   |
| 未 収 入 金                    | 1,396,848    | 1,968,137    | 1,300,029     | 1,611,281     | 3,259,210     | 1,433,520    |
| (B) 負 債                    | 91,527       | 729,316      | 76,440        | 373,257       | 1,973,392     | 299,911      |
| 未 払 解 約 金                  | 11,850       | 651,557      | 345           | 306,810       | 1,902,478     | 227,340      |
| 未 払 信 託 報 酬                | 77,106       | 75,248       | 73,636        | 64,304        | 68,628        | 70,228       |
| そ の 他 未 払 費 用              | 2,571        | 2,511        | 2,459         | 2,143         | 2,286         | 2,343        |
| (C) 純資産総額(A-B)             | 47,870,560   | 48,020,729   | 44,605,621    | 46,842,316    | 45,144,309    | 44,865,031   |
| 元 本                        | 54,540,356   | 52,839,253   | 52,923,190    | 52,580,443    | 50,107,964    | 48,738,421   |
| 次 期 繰 越 損 益 金              | △6,669,796   | △4,818,524   | △8,317,569    | △5,738,127    | △4,963,655    | △3,873,390   |
| (D) 受 益 権 総 口 数            | 54,540,356口  | 52,839,253口  | 52,923,190口   | 52,580,443口   | 50,107,964口   | 48,738,421口  |
| 1万口当たり基準価額(C/D)            | 8,777円       | 9,088円       | 8,428円        | 8,909円        | 9,009円        | 9,205円       |

(注) 当ファンドの第20期首元本額は55,648,048円、第20～25期中追加設定元本額は630,298円、第20～25期中一部解約元本額は7,539,925円です。

(注) 期末の1口当たり純資産額は、第20期0.8777円、第21期0.9088円、第22期0.8428円、第23期0.8909円、第24期0.9009円、第25期0.9205円です。



## ■ 損益の状況

| 項 目            | 第20期                      | 第21期                      | 第22期                       | 第23期                        | 第24期                        | 第25期                       |
|----------------|---------------------------|---------------------------|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|----------------------------|
|                | 2023年7月22日～<br>2023年8月21日 | 2023年8月22日～<br>2023年9月21日 | 2023年9月22日～<br>2023年10月23日 | 2023年10月24日～<br>2023年11月21日 | 2023年11月22日～<br>2023年12月21日 | 2023年12月22日～<br>2024年1月22日 |
| (A) 有価証券売買損益   | △ 2,464,402円              | 1,713,570円                | △ 3,414,109円               | 2,592,400円                  | 575,927円                    | 1,027,501円                 |
| 売 買 益          | 12,338                    | 1,790,758                 | 57                         | 2,616,533                   | 628,435                     | 1,034,844                  |
| 売 買 損          | △ 2,476,740               | △ 77,188                  | △ 3,414,166                | △ 24,133                    | △ 52,508                    | △ 7,343                    |
| (B) 信託報酬等      | △ 79,677                  | △ 77,759                  | △ 76,095                   | △ 66,447                    | △ 70,914                    | △ 72,581                   |
| (C) 当期損益金(A+B) | △ 2,544,079               | 1,635,811                 | △ 3,490,204                | 2,525,953                   | 505,013                     | 954,204                    |
| (D) 前期繰越損益金    | △ 457,183                 | △ 2,898,084               | △ 1,262,203                | △ 4,712,251                 | △ 2,079,626                 | △ 1,529,429                |
| (E) 追加信託差損益金   | △ 3,668,534               | △ 3,556,251               | △ 3,565,162                | △ 3,551,829                 | △ 3,389,042                 | △ 3,298,881                |
| (配当等相当額)       | ( 52,334)                 | ( 52,072)                 | ( 52,876)                  | ( 53,528)                   | ( 51,752)                   | ( 50,938)                  |
| (売買損益相当額)      | (△ 3,720,868)             | (△ 3,608,323)             | (△ 3,618,038)              | (△ 3,605,357)               | (△ 3,440,794)               | (△ 3,349,819)              |
| (F) 計(C+D+E)   | △ 6,669,796               | △ 4,818,524               | △ 8,317,569                | △ 5,738,127                 | △ 4,963,655                 | △ 3,873,390                |
| (G) 収益分配金      | 0                         | 0                         | 0                          | 0                           | 0                           | 0                          |
| 次期繰越損益金(F+G)   | △ 6,669,796               | △ 4,818,524               | △ 8,317,569                | △ 5,738,127                 | △ 4,963,655                 | △ 3,873,390                |
| 追加信託差損益金       | △ 3,668,534               | △ 3,556,251               | △ 3,565,162                | △ 3,551,829                 | △ 3,389,042                 | △ 3,298,881                |
| (配当等相当額)       | ( 52,437)                 | ( 52,125)                 | ( 53,071)                  | ( 53,542)                   | ( 51,795)                   | ( 50,976)                  |
| (売買損益相当額)      | (△ 3,720,971)             | (△ 3,608,376)             | (△ 3,618,233)              | (△ 3,605,371)               | (△ 3,440,837)               | (△ 3,349,857)              |
| 分配準備積立金        | 398,058                   | 406,245                   | 406,227                    | 411,307                     | 409,054                     | 417,043                    |
| 繰越損益金          | △ 3,399,320               | △ 1,668,518               | △ 5,158,634                | △ 2,597,605                 | △ 1,983,667                 | △ 991,552                  |

(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20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(52,437円)および分配準備積立金(398,058円)より分配対象収益は450,495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) 第21期計算期間末における費用控除後の配当等収益(21,869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(52,125円)および分配準備積立金(384,376円)より分配対象収益は458,370円(10,000口当たり86円)ですが、当計算期間に分配した金額はありません。

(注) 第22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(53,071円)および分配準備積立金(406,227円)より分配対象収益は459,298円(10,000口当たり86円)ですが、当計算期間に分配した金額はありません。

(注) 第23期計算期間末における費用控除後の配当等収益(8,510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(53,542円)および分配準備積立金(402,797円)より分配対象収益は464,849円(10,000口当たり88円)ですが、当計算期間に分配した金額はありません。

(注) 第24期計算期間末における費用控除後の配当等収益(17,813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(51,795円)および分配準備積立金(391,241円)より分配対象収益は460,849円(10,000口当たり91円)ですが、当計算期間に分配した金額はありません。

(注) 第25期計算期間末における費用控除後の配当等収益(19,727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(50,976円)および分配準備積立金(397,316円)より分配対象収益は468,019円(10,000口当たり96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。

## ■ お知らせ

マザーファンドの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)

# 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。<br>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<br>組入比率 | 株式<br>先物比率 | 純資産<br>総額 |
|----------------|--------|-----------|------------|------------|-----------|
|                | 円      | 期中<br>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<br>組入比率 | 株 式<br>先物比率 |
|---------------------|---------|--------|-------------|-------------|
|                     | 円       | 騰落率    |             |             |
| (期 首)<br>2023年1月23日 | 14,849  | %<br>— | %<br>99.4   | %<br>—      |
| 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)<br>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<br><br>(株式)              | 円<br>10<br><br>(10)     | %<br>0.062<br><br>(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<br>※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<br>期中の平均基準価額は、16,788円です。           |
| (b) 有価証券取引税<br><br>(株式)              | 11<br><br>(11)          | 0.064<br><br>(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<br>※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<br><br>(保管費用)<br><br>(その他) | 4<br><br>(4)<br><br>(0) | 0.023<br><br>(0.021)<br><br>(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<br><br>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<br>移転等に要する費用<br><br>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<br>(627)      | 5,986,160<br>(-)           | 1,038                | 5,764,523                  |
| 外<br>国  | アメリカ       | 百株<br>14,426<br>(-) | 千米ドル<br>108,150<br>(△221)  | 百株<br>44,392         | 千米ドル<br>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<br>(16,715) | 千英ポンド<br>21,266<br>(1,781) | 34,855<br>(33,431)   | 千英ポンド<br>10,785<br>(1,781) |
|         | スイス        | 174<br>(-)          | 千スイスフラン<br>1,134<br>(△224) | 383                  | 千スイスフラン<br>3,016           |
|         | スウェーデン     | 597                 | 千スウェーデンクローナ<br>11,266      | 1,156                | 千スウェーデンクローナ<br>24,194      |
|         | 香港         | 6,855               | 千香港ドル<br>98,915            | 1,343                | 千香港ドル<br>27,420            |
|         | 韓国         | 287                 | 千韓国ウォン<br>20,361,980       | 11,862               | 千韓国ウォン<br>35,429,595       |
| 台湾      | 14,560     | 千新台幣ドル<br>260,147   | 12,370                     | 千新台幣ドル<br>568,260    |                            |
| 中国オフショア | -<br>(756) | -<br>(-)            | 12,992                     | 千オフショア人民元<br>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              |
| <b>機械 (14.3%)</b>    |         |       |                 |
| クボタ                  | —       | 606.6 | 1,329,060       |
| <b>電気機器 (17.4%)</b>  |         |       |                 |
| ファナック                | 59.8    | 376.5 | 1,613,302       |
| 太陽誘電                 | 300.9   | —     | —               |
| <b>輸送用機器 (58.4%)</b> |         |       |                 |
| 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       |
| <b>陸運業 (9.9%)</b>    |         |       |                 |
| 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)<br>LANDIS+GYR GROUP AG  |         | 百株<br>1,229     | 百株<br>1,020    | 千スイスフラン<br>7,175          | 千円<br>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)<br>EPIROC AB-A   |         | 5,565           | 5,006          | 千スウェーデンクローナ<br>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)<br>BYD COMPANY LIMITED<br>MEITUAN-CLASS B                            |         | 4,470<br>—      | 4,700<br>5,282 | 千香港ドル<br>91,932<br>36,260 | 1,742,111<br>687,144 | 自動車・自動車部品<br>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)<br>SAMSUNG SDI CO., LTD.<br>HANON SYSTEMS                            |         | 320<br>11,382   | 127<br>—       | 千韓国ウォン<br>4,780,842<br>—  | 531,151<br>—         | テクノロジー・ハードウェアおよび機器<br>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)<br>CHROMA ATE INC.<br>MEDIATEK INC                                   |         | —<br>6,110      | 8,300<br>—     | 千新台幣ドル<br>175,545<br>—    | 828,115<br>—         | テクノロジー・ハードウェアおよび機器<br>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)<br>CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A<br>WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A |         | 1,551<br>10,684 | —<br>—         | 千オフショア人民元<br>—<br>—       | —<br>—               | 資本財<br>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)