



BNY MELLON

INVESTMENT MANAGEMENT

●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	2050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・ファンド（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（原則として毎年1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。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）。	

## モビリティ・イノベーション・ ファンド

追加型投信／内外／株式

### 運用報告書（全体版）

第6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」は、2024年1月22日に第6期決算を行いました。ここに、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
2期(2020年1月21日)	9,600	0	23.6	98.7	—	170,617
3期(2021年1月21日)	14,601	0	52.1	98.0	—	116,407
4期(2022年1月21日)	15,358	0	5.2	97.8	—	96,671
5期(2023年1月23日)	13,679	0	△10.9	99.3	—	74,926
6期(2024年1月22日)	16,217	0	18.6	97.1	—	75,281

(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
	騰落率	騰落率		
(期 首)	円	%	%	%
2023年1月23日	13,679	—	99.3	—
1月末	14,222	4.0	98.8	—
2月末	14,936	9.2	97.3	—
3月末	14,552	6.4	98.4	—
4月末	13,910	1.7	96.8	—
5月末	15,134	10.6	99.7	—
6月末	16,286	19.1	99.5	—
7月末	16,536	20.9	98.3	—
8月末	16,316	19.3	100.4	—
9月末	15,921	16.4	97.5	—
10月末	14,410	5.3	96.9	—
11月末	15,652	14.4	96.7	—
12月末	16,174	18.2	98.2	—
(期 末)				
2024年1月22日	16,217	18.6	97.1	—

(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

当期の基準価額の期中騰落率は18.6%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の金融緩和と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の金融緩和と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、「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。

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

当期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 6 期
	2023年1月24日～ 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	6,312

（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～2024年1月22日)

項目	当期		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 275 (135) (135) (6)	% 1.794 (0.878) (0.878) (0.038)	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は、15,337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)	10 (10)	0.062 (0.062)	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、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)	10 (10)	0.065 (0.065)	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(d) その他費用 (保管費用) (監査費用) (印刷) (その他)	4 (3) (1) (0) (0)	0.027 (0.021) (0.003) (0.001) (0.002)	(d) その他費用＝期中のその他費用÷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 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	299	1.948	

(注) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含む)は、追加・解約によ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。

### (参考情報)

#### ○総経費率

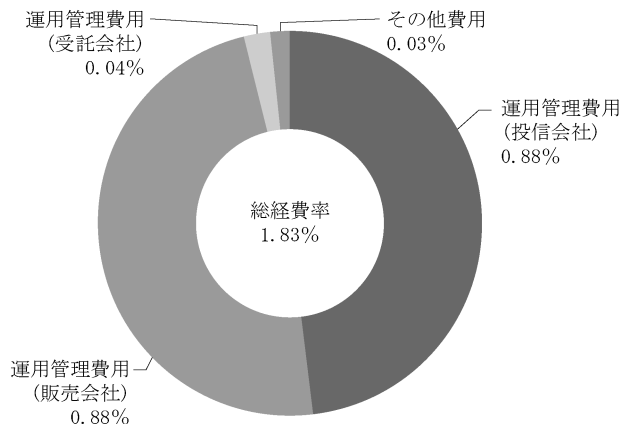
当期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)は1.83%です。

(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～2024年1月22日)

### 親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	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 228,384	千円 364,437	千口 8,634,906	千円 14,642,021

(注) 単位未満は切り捨て。

## ■ 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	
	モビリティ・イノベーション・マザーファンド	
(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)

### 親投資信託残高

銘柄	期首(前期末)		
	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 50,408,839	千口 42,002,318	千円 75,209,350

(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	当 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 75,209,350	% 98.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,021,620	1.3
投 資 信 託 財 産 総 額	76,230,970	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(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新台湾ドル=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	76,230,970,847円
コール・ローン等	16,061,967
モビリティ・イノベーション・マザーファンド(評価額)	75,209,350,784
未 収 入 金	1,005,558,096
(B) 負 債	949,374,994
未 払 解 約 金	264,296,450
未 払 信 託 報 酬	683,239,876
そ の 他 未 払 費 用	1,838,668
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	75,281,595,853
元 本	46,422,248,202
次 期 繰 越 損 益 金	28,859,347,651
(D) 受 益 権 総 口 数	46,422,248,202口
1万口当たり基準価額(C/D)	16,217円

(注) 当ファンドの期首元本額は54,775,501,157円、期中追加設定元本額は718,462,725円、期中一部解約元本額は9,071,715,680円です。

(注) 期末の1口当たり純資産額は1.6217円です。

## ■損益の状況 (2023年1月24日～2024年1月22日)

項 目	当 期 期
(A) 有 価 証 券 売 買 損 益	13,081,440,600円
売 買 益	14,620,684,855
売 買 損	△ 1,539,244,255
(B) 信 託 報 酬 等	△ 1,386,453,418
(C) 当 期 損 益 金 (A + B)	11,694,987,182
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	15,090,105,598
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	2,074,254,871
( 配 当 等 相 当 額 )	( 2,519,644,309)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△ 445,389,438)
(F) 計 ( C + D + E )	28,859,347,651
(G) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (F + G)	28,859,347,651
追 加 信 託 差 損 益 金	2,074,254,871
( 配 当 等 相 当 額 )	( 2,520,590,741)
( 売 買 損 益 相 当 額 )	(△ 446,335,870)
分 配 準 備 積 立 金	26,785,092,780

(注) 損益の状況の中で(A)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(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) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(686,611,017円)、費用控除後の有価証券売買等損益額(3,409,340,058円)、信託約款に規定する収益調整金(2,520,590,741円)および分配準備積立金(22,689,141,705円)より分配対象収益は29,305,683,521円(10,000口当たり6,312円)ですが、当期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

当期の分配金はございません。

## ■お知らせ

### 約款変更のお知らせ

新NISA制度の成長投資枠対象商品に係る法令上の要件を満たすため、当ファンドの信託期間を2050年1月21日までに延長し、当ファンドおよびマザーファンドにおいて、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。 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おりません。基準価額の主な変動要因については、2ページを参照ください。

## ■投資環境

投資環境については、2ページをご参照ください。

## ■当ファンドのポートフォリオ

当ファンドのポートフォリオについては、3ページをご参照ください。

## ■今後の運用方針

今後の運用方針については、3ページをご参照ください。



## ■ 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	千米ドル	百株	千米ドル
		14,426 (-)	108,150 (△221)	44,392	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		千英ポンド		千英ポンド
		110,133 (16,715)	21,266 (1,781)	34,855 (33,431)	10,785 (1,781)
	スイス		千スイスフラン		千スイスフラン
		174 (-)	1,134 (△224)	383	3,016
	スウェーデン		千スウェーデンクローナ		千スウェーデンクローナ
	597	11,266	1,156	24,194	
香港		千香港ドル		千香港ドル	
	6,855	98,915	1,343	27,420	
韓国		千韓国ウォン		千韓国ウォン	
	287	20,361,980	11,862	35,429,595	
台湾		千新台幣ドル		千新台幣ドル	
	14,560	260,147	12,370	568,260	
中国オフショア		千オフショア人民元		千オフショア人民元	
	- (756)	- (-)	12,992	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)		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)