



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があります（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2期(決算日：2022年2月21日)
 第3期(決算日：2022年3月22日)
 第4期(決算日：2022年4月21日)
 第5期(決算日：2022年5月23日)
 第6期(決算日：2022年6月21日)
 第7期(決算日：2022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、2022年2月21日に第2期、2022年3月22日に第3期、2022年4月21日に第4期、2022年5月23日に第5期、2022年6月21日に第6期、2022年7月21日に第7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>

運用商品開発部

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
	1期(2022年1月21日)	8,708	0	△12.9	94.4	—	54
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

(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ー売り建て比率。

(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 2 期	(期 首) 2022年 1 月21日	8,708	—	94.4	—
	1 月末	8,245	△5.3	98.9	—
	(期 末) 2022年 2 月21日	8,343	△4.2	97.5	—
第 3 期	(期 首) 2022年 2 月21日	8,343	—	97.5	—
	2 月末	8,357	0.2	95.3	—
	(期 末) 2022年 3 月22日	8,488	1.7	95.4	—
第 4 期	(期 首) 2022年 3 月22日	8,488	—	95.4	—
	3 月末	8,964	5.6	97.9	—
	(期 末) 2022年 4 月21日	8,540	0.6	95.7	—
第 5 期	(期 首) 2022年 4 月21日	8,540	—	95.7	—
	4 月末	7,990	△6.4	97.3	—
	(期 末) 2022年 5 月23日	7,636	△10.6	98.9	—
第 6 期	(期 首) 2022年 5 月23日	7,636	—	98.9	—
	5 月末	8,082	5.8	99.1	—
	(期 末) 2022年 6 月21日	7,502	△1.8	97.7	—
第 7 期	(期 首) 2022年 6 月21日	7,502	—	97.7	—
	6 月末	7,664	2.2	97.8	—
	(期 末) 2022年 7 月21日	8,110	8.1	98.6	—

(注) 騰落率は期首比です。

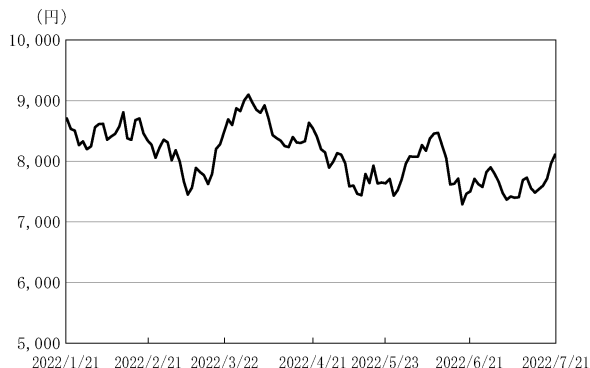
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(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

当作成期中の騰落率は△6.9%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」が下落したことから、当ファンドの基準価額も下落しました。

(上昇要因)

- ・世界の中央銀行がインフレに対処するために金融引締めを進める一方、日銀は緩和的な金融政策を継続する姿勢を示し、米ドルが対円で上昇したこと

(下落要因)

- ・ウクライナ情勢の悪化、原油高に加えて、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、今後の景気減速懸念も台頭する状況下、世界株式市場が下落したこと

◆投資環境

(世界株式市況)

ウクライナ情勢の悪化、原油高などを背景に3月中旬にかけて下落しました。3月末には原油高の動きが一巡したことや、ロシア政府による債務不履行がひとまず回避されたことで上昇しましたが、その後米国のインフレ高進を背景に米国金融当局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、今後の景気減速懸念も台頭する状況下、世界株式市場は下落基調で推移しました。

(為替)

インフレ高進を背景に米国が急速な利上げを進める一方で、日銀は長期金利の上昇を抑制するための「指値オペ」を実施するなど、日米の金融政策の方向性の違いが鮮明化する中で米ドルは対円で大きく上昇しました。

◆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、アルファベット（米国、コミュニケーション・サービス）、ハベル（米国、資本財・サービス）、アンシス（米国、情報技術）、イートン（米国、資本財・サービス）、アルバマール（米国、素材）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2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期
	2022年1月22日～ 2022年2月21日	2022年2月22日～ 2022年3月22日	2022年3月23日～ 2022年4月21日	2022年4月22日～ 2022年5月23日	2022年5月24日～ 2022年6月21日	2022年6月22日～ 2022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	2	9	15	15	20	35

（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く、先進的な取り組みを行う自動車関連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～2022年 7月21日)

項 目	第 2 期～第 7 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 73 (36) (36) (2)	% 0.892 (0.436) (0.436) (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、8,217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)	2 (2)	0.027 (0.027)	(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)	0 (0)	0.006 (0.006)	(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)	40 (1) (37) (2) (0)	0.491 (0.011) (0.452) (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	115	1.416	

(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

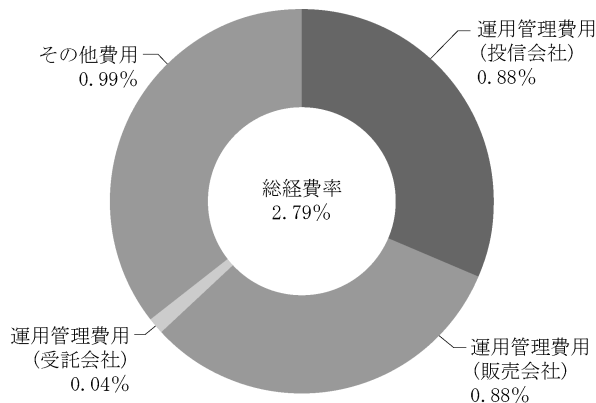
当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)は2.79%です。

(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

(2022年1月22日～2022年7月21日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	第2期～第7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 6,695	千円 10,443	千口 5,425	千円 8,438

(注) 単位未満は切り捨て。

■ 株式売買比率

(2022年1月22日～2022年7月21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2期～第7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	36,633,031千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	86,376,459千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.42	

(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～2022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

(2022年7月21日現在)

親投資信託残高

銘柄	第1期末	第7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 32,381	千口 33,652	千円 51,935

(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

(2022年7月21日現在)

項目	第7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 51,935	% 99.8
コール・ローン等、その他	92	0.2
投資信託財産総額	52,027	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(78,390,350千円)の投資信託財産総額(84,593,091千円)に対する比率は92.7%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=20.4537円、1米ドル=138.51円、1ユーロ=141.17円、1スイスフラン=142.56円、1スウェーデンクローナ=13.53円、1オーストラリアドル=95.39円、1香港ドル=17.64円、100韓国ウォン=10.55円、1新台幣ドル=4.6277円。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第2期末	第3期末	第4期末	第5期末	第6期末	第7期末
	2022年2月21日現在	2022年3月22日現在	2022年4月21日現在	2022年5月23日現在	2022年6月21日現在	2022年7月21日現在
(A) 資 産	52,175,804円	52,374,901円	53,010,697円	48,430,132円	47,586,531円	52,027,657円
コール・ローン等	19,508	46,755	32,833	5,350	114,928	7,855
モビリティ・イノベーション・マザーファンド(評価額)	51,177,519	52,115,246	52,021,972	48,225,048	47,397,387	51,935,593
未 取 入 金	978,777	212,900	955,892	199,734	74,216	84,209
(B) 負 債	243,077	195,800	231,836	121,383	156,885	76,429
未 払 解 約 金	95,299	58,408	86,591	1,103	83,470	2,050
未 払 信 託 報 酬	81,141	71,059	78,683	77,727	71,044	71,976
そ の 他 未 払 費 用	66,637	66,333	66,562	42,553	2,371	2,403
(C) 純資産総額(A-B)	51,932,727	52,179,101	52,778,861	48,308,749	47,429,646	51,951,228
元 本	62,248,290	61,474,779	61,801,561	63,260,378	63,219,936	64,060,615
次 期 繰 越 損 益 金	△10,315,563	△9,295,678	△9,022,700	△14,951,629	△15,790,290	△12,109,387
(D) 受 益 権 総 口 数	62,248,290口	61,474,779口	61,801,561口	63,260,378口	63,219,936口	64,060,615口
1万口当たり基準価額(C/D)	8,343円	8,488円	8,540円	7,636円	7,502円	8,110円

(注) 当ファンドの第2期首元本額は63,097,145円、第2～7期中追加設定元本額は9,901,346円、第2～7期中一部解約元本額は8,937,876円です。

(注) 期末の1口当たり純資産額は、第2期0.8343円、第3期0.8488円、第4期0.8540円、第5期0.7636円、第6期0.7502円、第7期0.8110円です。

■ 損益の状況

項 目	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期
	2022年1月22日～ 2022年2月21日	2022年2月22日～ 2022年3月22日	2022年3月23日～ 2022年4月21日	2022年4月22日～ 2022年5月23日	2022年5月24日～ 2022年6月21日	2022年6月22日～ 2022年7月21日
(A) 有価証券売買損益	△ 2,076,018円	1,051,049円	407,232円	△ 5,439,659円	△ 839,621円	3,945,313円
売 買 益	86,953	1,128,180	477,922	60,961	68,373	3,951,966
売 買 損	△ 2,162,971	△ 77,131	△ 70,690	△ 5,500,620	△ 907,994	△ 6,653
(B) 信託報酬等	△ 147,778	△ 137,392	△ 145,245	△ 120,280	△ 73,415	△ 74,379
(C) 当期損益金(A+B)	△ 2,223,796	913,657	261,987	△ 5,559,939	△ 913,036	3,870,934
(D) 前期繰越損益金	△ 5,719,137	△ 7,724,255	△ 6,638,151	△ 6,298,090	△ 11,515,997	△ 12,379,569
(E) 追加信託差損益金	△ 2,372,630	△ 2,485,080	△ 2,646,536	△ 3,093,600	△ 3,361,257	△ 3,600,752
(配当等相当額)	(17,305)	(17,440)	(19,706)	(24,572)	(27,290)	(32,536)
(売買損益相当額)	(△ 2,389,935)	(△ 2,502,520)	(△ 2,666,242)	(△ 3,118,172)	(△ 3,388,547)	(△ 3,633,288)
(F) 計 (C + D + E)	△ 10,315,563	△ 9,295,678	△ 9,022,700	△ 14,951,629	△ 15,790,290	△ 12,109,387
(G) 収益分配金	0	0	0	0	0	0
次期繰越損益金(F+G)	△ 10,315,563	△ 9,295,678	△ 9,022,700	△ 14,951,629	△ 15,790,290	△ 12,109,387
追加信託差損益金	△ 2,372,630	△ 2,485,080	△ 2,646,536	△ 3,093,600	△ 3,361,257	△ 3,600,752
(配当等相当額)	(17,661)	(18,342)	(21,390)	(25,227)	(30,432)	(36,198)
(売買損益相当額)	(△ 2,390,291)	(△ 2,503,422)	(△ 2,667,926)	(△ 3,118,827)	(△ 3,391,689)	(△ 3,636,950)
分配準備積立金	—	41,304	74,750	73,834	98,453	191,611
繰越損益金	△ 7,942,933	△ 6,851,902	△ 6,450,914	△ 11,931,863	△ 12,527,486	△ 8,700,246

(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2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)、および信託約款に規定する収益調整金(17,661円)より分配対象収益は17,661円(10,000口当たり2円)ですが、当計算期間に分配した金額はありません。

(注) 第3期計算期間末における費用控除後の配当等収益(41,304円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、および信託約款に規定する収益調整金(18,342円)より分配対象収益は59,646円(10,000口当たり9円)ですが、当計算期間に分配した金額はありません。

(注) 第4期計算期間末における費用控除後の配当等収益(34,492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(21,390円)および分配準備積立金(40,258円)より分配対象収益は96,140円(10,000口当たり15円)ですが、当計算期間に分配した金額はありません。

(注) 第5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(25,227円)および分配準備積立金(73,834円)より分配対象収益は99,061円(10,000口当たり15円)ですが、当計算期間に分配した金額はありません。

(注) 第6期計算期間末における費用控除後の配当等収益(26,749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(30,432円)および分配準備積立金(71,704円)より分配対象収益は128,885円(10,000口当たり20円)ですが、当計算期間に分配した金額はありません。

(注) 第7期計算期間末における費用控除後の配当等収益(93,549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(36,198円)および分配準備積立金(98,062円)より分配対象収益は227,809円(10,000口当たり35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

(2022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(53,966,925千口)の内容です。

国内株式

銘柄	第1期末	第7期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
電気機器 (28.2%)			
アンリツ	357.8	—	—
太陽誘電	312.4	300.9	1,448,833
輸送用機器 (40.7%)			
デンソー	279.9	269.5	2,094,554
陸運業 (31.1%)			
東日本旅客鉄道	193.9	236.1	1,600,758
合計	株数・金額	1,144	806 5,144,145
	銘柄数<比率>	4	3 <6.2%>

(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1期末	第7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	21,309	2,951,630	ソフトウェア・サービス
ALBEMARLE CORPORATION	—	818	17,975	2,489,749	素材
POWER INTEGRATIONS, INC.	—	679	5,446	754,424	半導体・半導体製造装置
AMPHENOL CORPORATION	1,005	1,419	9,749	1,350,354	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DIODES INC	1,787	961	7,176	994,006	半導体・半導体製造装置
NVIDIA CORPORATION	1,304	344	6,141	850,603	半導体・半導体製造装置
PLUG POWER INC	5,246	5,845	10,579	1,465,427	資本財
MAGNA INTERNATIONAL INC.	2,908	1,624	9,927	1,375,121	自動車・自動車部品
ON SEMICONDUCTOR CORPORATI	2,497	1,549	9,308	1,289,309	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	842	452	6,872	951,841	半導体・半導体製造装置

銘柄	第1期末	第7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		
ROPER TECHNOLOGIES INC	199	191	7,839	1,085,816	資本財	
ROCKWELL AUTOMATION INC	528	508	10,980	1,520,950	資本財	
SEMTECH CORPORATION	3,176	2,423	14,210	1,968,337	半導体・半導体製造装置	
TRIMBLE INC.	—	2,500	15,733	2,179,206	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	804	774	8,279	1,146,824	半導体・半導体製造装置	
SPLUNK INC	1,340	1,291	13,744	1,903,766	ソフトウェア・サービス	
VISTEON CORPORATION	1,413	1,360	15,746	2,181,013	自動車・自動車部品	
NXP SEMICONDUCTORS NV	457	440	7,768	1,075,986	半導体・半導体製造装置	
TESLA INC.	111	107	7,991	1,106,906	自動車・自動車部品	
TE CONNECTIVITY LIMITED	541	894	10,937	1,514,943	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
GENERAL MOTORS CO.	1,626	1,565	5,442	753,803	自動車・自動車部品	
APTIV PLC	1,156	1,628	16,026	2,219,878	自動車・自動車部品	
EATON CORP PLC	1,050	1,364	18,266	2,530,057	資本財	
TWILIO INC.	871	839	7,840	1,086,034	ソフトウェア・サービス	
HUBBELL INCORPORATED	784	1,108	21,318	2,952,757	資本財	
CNH INDUSTRIAL NV	13,759	13,248	15,646	2,167,156	資本財	
ZUORA INC - CLASS A	6,826	6,572	5,981	828,457	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	8,769	1,214,713	運輸	
WOLFSPEED INC	1,028	731	5,867	812,638	半導体・半導体製造装置	
MP MATERIALS CORP	7,540	5,681	17,089	2,367,100	素材	
MARVELL TECHNOLOGY INC	3,504	2,745	14,735	2,041,011	半導体・半導体製造装置	
LUMENTUM HOLDINGS INC	1,939	2,049	17,515	2,426,076	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	2,285	26,218	3,631,472	メディア・娯楽	
小計	株数・金額	73,577	68,476	398,436	55,187,379	
	銘柄数〈比率〉	33	33	—	<66.3%>	
(ユーロ・・・ドイツ)			千ユーロ			
MERCEDES-BENZ GROUP AG	2,120	984	5,450	769,507	自動車・自動車部品	
SIEMENS AG	835	—	—	—	資本財	

銘柄		第1期末	第7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	千ユーロ	千円		
INFINEON TECHNOLOGIES AG		4,218	4,061	10,028	1,415,731	半導体・半導体製造装置	
KION GROUP AG		957	922	4,266	602,245	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	5,968	19,745	2,787,484		
	銘柄数〈比率〉	5	3	—	<3.3%〉		
(ユーロ・・・フランス)							
SCHNEIDER ELECTRIC SE		1,288	1,240	15,196	2,145,288	資本財	
PLASTIC OMNIUM		1,091	—	—	—	自動車・自動車部品	
ALSTOM		3,696	—	—	—	資本財	
小計	株数・金額	6,076	1,240	15,196	2,145,288		
	銘柄数〈比率〉	3	1	—	<2.6%〉		
(ユーロ・・・オランダ)							
STMICROELECTRONICS N.V.		4,497	2,532	8,543	1,206,124	半導体・半導体製造装置	
ALFEN BEHEER B.V.		1,083	1,042	10,664	1,505,445	資本財	
小計	株数・金額	5,580	3,575	19,207	2,711,570		
	銘柄数〈比率〉	2	2	—	<3.3%〉		
ユーロ計	株数・金額	20,860	10,784	54,149	7,644,344		
	銘柄数〈比率〉	10	6	—	<9.2%〉		
(スイス)				千スイスフラン			
ABB LTD.		2,558	2,463	6,730	959,554	資本財	
LANDIS+GYR GROUP AG		1,277	1,229	7,077	1,008,968	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	3,693	13,808	1,968,522		
	銘柄数〈比率〉	2	2	—	<2.4%〉		
(スウェーデン)				千スウェーデンクローナ			
EPIROC AB-A		—	5,565	92,060	1,245,578	資本財	
小計	株数・金額	—	5,565	92,060	1,245,578		
	銘柄数〈比率〉	—	1	—	<1.5%〉		
(香港)				千香港ドル			
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LIMITED		59,880	—	—	—	自動車・自動車部品	
BYD COMPANY LIMITED		—	3,435	98,928	1,745,089	自動車・自動車部品	

銘柄		第1期末		第7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	千香港ドル	千円	
	XPENG INC - CLASS A SHARES	5,536	5,330	55,495	978,933	自動車・自動車部品
小計	株数・金額	65,416	8,765	154,423	2,724,023	
	銘柄数〈比率〉	2	2	—	<3.3%〉	
(韓国)				千韓国ウォン		
	SAMSUNG SDI CO., LTD.	329	402	22,476,272	2,371,246	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
	HANON SYSTEMS	9,309	8,963	9,188,028	969,336	自動車・自動車部品
小計	株数・金額	9,639	9,366	31,664,300	3,340,583	
	銘柄数〈比率〉	2	2	—	<4.0%〉	
(台湾)				千新台幣ドル		
	MEDIATEK INC	6,350	6,110	409,981	1,897,269	半導体・半導体製造装置
小計	株数・金額	6,350	6,110	409,981	1,897,269	
	銘柄数〈比率〉	1	1	—	<2.3%〉	
(中国オフショア)				千オフショア人民元		
	CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	—	1,551	81,600	1,669,031	資本財
	WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A	12,071	10,684	66,341	1,356,933	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	147,942	3,025,965	
	銘柄数〈比率〉	1	2	—	<3.6%〉	
合計	株数・金額	191,750	124,998	—	77,033,666	
	銘柄数〈比率〉	51	49	—	<92.5%〉	

(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) 一印は組み入れなし。

モビリティ・イノベーション・マザーファンド

第4期（2022年1月21日決算）〔計算期間：2021年1月22日～2022年1月21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

(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) 2021年1月21日	15,283	% —	% 98.1	% —
1月末	14,922	△2.4	98.1	—
2月末	15,121	△1.1	98.1	—
3月末	15,395	0.7	97.9	—
4月末	15,809	3.4	99.1	—
5月末	15,576	1.9	98.0	—
6月末	16,589	8.5	98.4	—
7月末	16,368	7.1	98.9	—
8月末	16,688	9.2	98.4	—
9月末	16,179	5.9	97.2	—
10月末	17,799	16.5	99.2	—
11月末	18,173	18.9	99.6	—
12月末	18,257	19.5	98.2	—
(期 末) 2022年1月21日	16,361	7.1	97.9	—

(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

期中騰落率は7.1%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)

- ・2021年10月から年末にかけて、良好な企業決算やオミクロン株に対する過度な懸念が後退し、グローバル株式市場が上昇したこと

(下落要因)

- ・年明け以降、米連邦準備理事会（FRB）の金融引き締め姿勢が鮮明になる中で、グローバル株式市場が下落したこと



■市場概況

(世界株式市況)

新型コロナウイルスの感染再拡大が世界株式市場の下押し材料となりましたが、バイデン政権による大規模な財政政策に対する期待や、FRB議長がインフレは一時的だとして金融緩和の継続を示す中、世界株式市場は2021年8月末にかけて上昇基調で推移しました。9月には中国大手不動産会社の経営不安が嫌気されましたが、米国企業の良い決算を受けて市場は上昇に転じ、11月以降は米国金融政策の早期正常化姿勢が市場の重石となったものの、世界で感染が拡大するオミクロン株に関して重症化しにくいとの見方が広がるなど過度な懸念が後退する中で株式市場は年末にかけて上昇しました。

年明け後は、FRBの金融引き締めを急ぐ姿勢が鮮明になり、長期金利が上昇する中で、成長期待の高い銘柄を中心に下落しました。

(為替)

アフガニスタン情勢の悪化や中国大手不動産会社の経営不安、またオミクロン株に対する懸念などでリスク回避的に円高が一時的に進行する場面がみられました。一方で、原油価格が高止まりするなど高水準のインフレが継続する状況下、米国金融当局がテーパリング（量的金融緩和の縮小）の加速を決定し、早期利上げに前向きな姿勢を示すなど、金融引き締め姿勢が鮮明になる中で米ドルは円に対して上昇基調で推移しました。

■運用概況

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、米国のMPマテリアルズ（素材）、米国のアルファベット（コミュニケーション・サービス）、米国のエヌビディア（情報技術）、米国のアンシス（情報技術）、米国のマーベル・テクノロジー（情報技術）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投資を行います。引き続き、先進的な取り組みを行う自動車関連企業に投資を行うことで、信託財産の成長を目指します。

■ 1 万口当たりの費用明細

(2021年1月22日～2022年1月21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 8 (8)	% 0.049 (0.049)	(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、16,406円です。
(b) 有価証券取引税 (株式)	5 (5)	0.029 (0.029)	(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)	0.026 (0.024) (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	17	0.104	

(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

(2021年1月22日～2022年1月21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
		213	1,025,050	345	1,841,310
外 国	アメリカ	百株	千米ドル	百株	千米ドル
		42,358 (1,688)	202,888 (-)	57,566 (2,796)	382,767 (13,922)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	1,537 (1,060)	11,791 (2,199)	3,717 (-)	23,543 (2,199)
	フランス	5,151	30,379	2,524	10,931
	オランダ	1,432 (2,780)	9,891 (2,063)	5,398	12,456
	スイス	567	千スイスフラン 3,541	2,664 (-)	千スイスフラン 9,721 (290)
	香港	9,440 (5,592)	千香港ドル 20,445 (89,382)	23,426	千香港ドル 166,253
	韓国	3,456	千韓国ウォン 14,439,624	2,974	千韓国ウォン 50,744,467
	台湾	110	千新台湾ドル 10,920	4,430 (-)	千新台湾ドル 404,272 (10,800)
	中国オフショア	13,270	千オフショア人民元 76,925	1,199	千オフショア人民元 8,712

(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

(2021年1月22日～2022年1月21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	93,780,241千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	107,962,224千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.86

(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

(2021年1月22日～2022年1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

(2022年1月21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 (38.4%)			
アンリツ	343.8	357.8	596,094
太陽誘電	415.9	312.4	1,765,060
輸送用機器 (40.2%)			
デンソー	372.7	279.9	2,469,277
陸運業 (21.4%)			
東日本旅客鉄道	144.2	193.9	1,311,151
合 計	株数・金額	1,276	1,144 6,141,584
	銘柄数<比率>	4	4 <6.4%>

(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、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。

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.	1,145	860	28,694	3,266,621	ソフトウェア・サービス
AMPHENOL CORPORATION	674	1,005	7,833	891,770	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CREE INC	1,681	—	—	—	半導体・半導体製造装置
DIODES INC	2,398	1,787	15,859	1,805,422	半導体・半導体製造装置
NEXTERA ENERGY, INC.	1,612	—	—	—	公益事業
NVIDIA CORPORATION	441	1,304	31,492	3,585,113	半導体・半導体製造装置
PLUG POWER INC	5,149	5,246	11,331	1,289,984	資本財
LITTELFUSE, INC.	228	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MAGNA INTERNATIONAL INC.	2,753	2,908	23,458	2,670,470	自動車・自動車部品
ON SEMICONDUCTOR CORPORATI	7,173	2,497	13,870	1,578,986	半導体・半導体製造装置
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	3,736	—	—	—	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	407	842	14,023	1,596,412	半導体・半導体製造装置
RAVEN INDUSTRIES INC	2,964	—	—	—	資本財
ROPER TECHNOLOGIES INC	435	199	8,766	997,946	資本財
ROCKWELL AUTOMATION INC	703	528	16,575	1,886,980	資本財
SEMTECH CORPORATION	2,336	3,176	23,681	2,695,913	半導体・半導体製造装置
SKYWORKS SOLUTIONS INC	1,070	804	11,497	1,308,896	半導体・半導体製造装置
SPLUNK INC	1,784	1,340	15,836	1,802,867	ソフトウェア・サービス
VISTEON CORPORATION	1,358	1,413	15,008	1,708,543	自動車・自動車部品
NXP SEMICONDUCTORS NV	715	457	9,125	1,038,809	半導体・半導体製造装置
YANDEX NV	2,371	—	—	—	メディア・娯楽
TESLA INC.	486	111	11,134	1,267,530	自動車・自動車部品
TE CONNECTIVITY LIMITED	721	541	8,343	949,814	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GENERAL MOTORS CO.	7,210	1,626	8,886	1,011,604	自動車・自動車部品
APTIV PLC	2,036	1,156	16,422	1,869,514	自動車・自動車部品
EATON CORP PLC	1,411	1,050	16,922	1,926,502	資本財
TWILIO INC.	878	871	17,566	1,999,793	ソフトウェア・サービス
HUBBELL INCORPORATED	1,044	784	15,225	1,733,299	資本財
CNH INDUSTRIAL NV	16,662	13,759	22,097	2,515,539	資本財
ZUORA INC - CLASS A	—	6,826	11,126	1,266,666	ソフトウェア・サービス
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	—	343	5,972	679,881	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LYFT INC-A	—	3,147	11,836	1,347,439	運輸
UBER TECHNOLOGIES INC	—	3,105	11,746	1,337,201	運輸

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	
VIRGIN GALACTIC HOLDINGS INC		3,183	—	—	—	資本財
WOLFSPEED INC		—	1,028	9,527	1,084,596	半導体・半導体製造装置
JD.COM INC-ADR		953	—	—	—	小売
MP MATERIALS CORP		5,102	7,540	31,933	3,635,310	素材
MARVELL TECHNOLOGY INC		—	3,504	25,859	2,943,898	半導体・半導体製造装置
LUMENTUM HOLDINGS INC		2,087	1,939	19,195	2,185,214	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WORKHORSE GROUP INC		5,732	—	—	—	自動車・自動車部品
EVERBRIDGE INC		1,077	1,748	9,067	1,032,247	ソフトウェア・サービス
ALPHABET INC.		157	118	31,689	3,607,487	メディア・娯楽
小 計	株 数 ・ 金 額	89,892	73,577	531,608	60,518,279	
	銘柄数〈比率〉	36	33	—	<62.6%>	
(ユーロ・・・ドイツ)				千ユーロ		
DAIMLER AG		2,529	2,120	15,521	1,997,331	自動車・自動車部品
SIEMENS AG		857	835	12,271	1,579,107	資本財
INFINEON TECHNOLOGIES AG		5,659	4,218	15,958	2,053,506	半導体・半導体製造装置
KION GROUP AG		1,275	957	8,621	1,109,455	資本財
DAIMLER TRUCK HOLDING AG		—	1,071	3,535	454,896	自動車・自動車部品
小 計	株 数 ・ 金 額	10,322	9,203	55,908	7,194,298	
	銘柄数〈比率〉	4	5	—	<7.4%>	
(ユーロ・・・フランス)						
SCHNEIDER ELECTRIC SE		802	1,288	20,807	2,677,488	資本財
PLASTIC OMNIUM		2,646	1,091	2,464	317,142	自動車・自動車部品
ALSTOM		—	3,696	12,262	1,577,923	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額	3,449	6,076	35,534	4,572,554	
	銘柄数〈比率〉	2	3	—	<4.7%>	
(ユーロ・・・オランダ)						
STMICROELECTRONICS N.V.		6,766	4,497	18,631	2,397,526	半導体・半導体製造装置
ALFEN BEHEER B.V.		—	1,083	7,419	954,742	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額	6,766	5,580	26,051	3,352,268	
	銘柄数〈比率〉	1	2	—	<3.5%>	
ユーロ計	株 数 ・ 金 額	20,538	20,860	117,493	15,119,121	
	銘柄数〈比率〉	7	10	—	<15.6%>	

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	資本財 テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ABB LTD.		4,794	2,558	8,799	1,092,010	
LANDIS+GYR GROUP AG		1,138	1,277	7,816	970,053	
小 計	株 数 ・ 金 額	5,932	3,835	16,616	2,062,063	
	銘柄数〈比率〉	2	2	—	<2.1%>	
(香港)				千香港ドル		自動車・自動車部品 小売 自動車・自動車部品
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LIMITED		69,360	59,880	115,089	1,682,606	
MEITUAN-CLASS B		4,450	—	—	—	
XPENG INC - CLASS A SHARES		—	5,536	97,671	1,427,959	
小 計	株 数 ・ 金 額	73,810	65,416	212,760	3,110,565	
	銘柄数〈比率〉	2	2	—	<3.2%>	
(韓国)				千韓国ウォン		素材 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
LG CHEM LTD.		279	—	—	—	
SAMSUNG SDI CO., LTD.		571	329	22,670,976	2,165,078	
HANON SYSTEMS		8,305	9,309	10,845,649	1,035,759	
小 計	株 数 ・ 金 額	9,157	9,639	33,516,625	3,200,837	
	銘柄数〈比率〉	3	2	—	<3.3%>	
(台湾)				千新台幣ドル		半導体・半導体製造装置
MEDIATEK INC		10,670	6,350	692,150	2,850,688	
小 計	株 数 ・ 金 額	10,670	6,350	692,150	2,850,688	
	銘柄数〈比率〉	1	1	—	<3.0%>	
(中国オフショア)				千オフショア人民元		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A		—	12,071	88,157	1,580,043	
小 計	株 数 ・ 金 額	—	12,071	88,157	1,580,043	
	銘柄数〈比率〉	—	1	—	<1.6%>	
合 計	株 数 ・ 金 額	210,001	191,750	—	88,441,601	
	銘柄数〈比率〉	51	51	—	<91.5%>	

(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) 一印は組み入れなし。

■投資信託財産の構成

(2022年1月21日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	94,583,185	96.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,414,611	3.5
投 資 信 託 財 産 総 額	97,997,796	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(89,769,956千円)の投資信託財産総額(97,997,796千円)に対する比率は91.6%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オフショア人民元=17.92円、1米ドル=113.84円、1ユーロ=128.68円、1スイスフラン=124.10円、1オーストラリアドル=81.89円、1香港ドル=14.62円、100韓国ウォン=9.55円、1新台幣ドル=4.12円。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年1月21日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	98,018,257,262円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,326,260,238
株 式 (評 価 額)	94,583,185,425
未 収 入 金	104,534,718
未 収 配 当 金	4,276,881
(B) 負 債	1,395,643,653
未 払 金	20,460,724
未 払 解 約 金	1,375,155,648
そ の 他 未 払 費 用	27,281
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	96,622,613,609
元 本	59,055,279,336
次 期 繰 越 損 益 金	37,567,334,273
(D) 受 益 権 総 口 数	59,055,279,336口
1万口当たり基準価額(C/D)	16,361円

(注) 当親ファンドの期首元本額は76,100,347,460円、期中追加設定元本額は546,184,353円、期中一部解約元本額は17,591,252,477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59,022,897,990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)32,381,346円です。

(注) 期末の1口当たり純資産額は1.6361円です。

■損益の状況 (2021年1月22日～2022年1月21日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	659,104,076円
受 取 配 当 金	659,052,993
受 取 利 息	46,477
そ の 他 収 益 金	4,606
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	7,316,981,957
売 買 益	24,849,792,343
売 買 損	△17,532,810,386
(C) 保 管 費 用 等	△ 28,832,831
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	7,947,253,202
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	40,206,171,016
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	371,218,827
(G) 解 約 差 損 益 金	△10,957,308,772
(H) 計 (D + E + F + G)	37,567,334,273
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	37,567,334,273

(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

運用委託先の株式およびマルチアセット運用に関する事業承継により、新会社（ニュートン・インベストメント・マネジメント・ノースアメリカ・エルエルシー）が運用を行うことになりましたので、信託約款に所要の変更を行いました。(2021年9月1日付)