



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	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・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2期（決算日：2020年1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」は、2020年1月21日に第2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・アセット・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			
(設 定 日) 2018年1月22日	円 10,000	円 —	% —	% —	% —	百万円 10
1期(2019年1月21日)	7,766	0	△22.3	98.2	—	227,220
2期(2020年1月21日)	9,600	0	23.6	98.7	—	170,617

(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) 2019年1月21日	円 7,766	% —	% 98.2	% —
1月末	7,889	1.6	99.3	—
2月末	8,515	9.6	98.4	—
3月末	8,192	5.5	99.5	—
4月末	8,878	14.3	98.3	—
5月末	7,686	△1.0	99.5	—
6月末	8,204	5.6	99.7	—
7月末	8,405	8.2	96.0	—
8月末	7,761	△0.1	97.5	—
9月末	8,056	3.7	97.9	—
10月末	8,453	8.8	98.4	—
11月末	8,917	14.8	98.7	—
12月末	9,240	19.0	99.1	—
(期 末) 2020年1月21日	9,600	23.6	98.7	—

(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

基準価額は、前期末の7,766円から当期末9,600円に上昇しました。その結果、期中騰落率は23.6%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

(上昇要因)

- ・セクター別でパフォーマンスにプラス寄与したのは情報技術セクターでした。その他、資本財・サービスセクターやコミュニケーション・サービスセクターもプラスに寄与しました。
- ・個別銘柄では、アンシスやSTマイクロエレクトロニクス、キーサイトの保有がプラスの寄与となりました。これらの銘柄は米中貿易摩擦の影響が小さく、5G関連の設備投資がグローバルに拡大する恩恵や半導体の需給サイクルの反転などを受けて、好業績を発表したことが株価の上昇に繋がりました。

(下落要因)

- ・セクター別では、素材セクターは唯一パフォーマンスにマイナスの寄与となりました。
- ・個別銘柄では、過去の買取にかかるコストが予想外にキャッシュフローを圧迫し、配当を中止するなど財務状況の悪化が見られたノキアの保有がマイナスに寄与しました。また、中国の自動車販売不振の影響から自動車部品のネクスティア・オートモーティブの株価が軟調に推移し、マイナスに寄与しました。その他、デリバリーサービスのグラブハブは通期の業績見通しを下方修正したことからマイナス寄与となりました。

◆市場概況

(世界株式市況)

通期にわたり、米中貿易摩擦の問題に一喜一憂する展開となりました。期初は米連邦準備理事会（FRB）が緩和的な金融政策へ転換し、米中の貿易協議の進展期待から株式市場は上昇しました。その後8月に米国が第4弾の関税引き上げを示唆したことで、投資家心理が再び悪化し株式市場は軟調な展開となりましたが、期末にかけては米中の貿易交渉の進展や、企業業績の改善期待、英国の総選挙結果でEU離脱が確定的となったことなどが支援材料となり、株式市場は上昇しました。

(為替)

為替市場は、年央にかけて、世界景気の後退懸念から欧米の中央銀行で利下げ観測が高まり、円は主要通貨に対して円高傾向となりました。特に英ポンドは、メイ首相の辞任により、EU離脱交渉に不透明感が高まったことから、一時円高が進行しました。しかし、その後、FRBの利下げ停止や年末にかけて株式市場が上昇したことで、投資家のリスク許容姿勢が強まり、円は主要通貨に対して円安に推移しました。

◆運用概況

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日本や欧州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（時価総額 200億ドル以上）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）、スプラック（情報技術）、メディアテック（情報技術）、ヤンデックス（コミュニケーション・サービス）、クアルコム（情報技術）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 2 期
	2019年 1 月 22 日～ 2020年 1 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	113

（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

(2019年1月22日～2020年1月21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 150 (73) (73) (3)	% 1.798 (0.880) (0.880) (0.038)	(a)信託報酬＝各期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は、8,349円です。 委託した資金の運用の対価 交付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、購入後の 情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売買委託手数料 (株式)	7 (7)	0.087 (0.087)	(b)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
(c) 有価証券取引税 (株式)	2 (2)	0.021 (0.021)	(c)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
(d) その他費用 (保管費用) (監査費用) (印刷) (その他)	2 (2) (0) (0) (0)	0.026 (0.022) (0.001) (0.000) (0.002)	(d)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 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	161	1.932	

(注) 各期中の費用(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

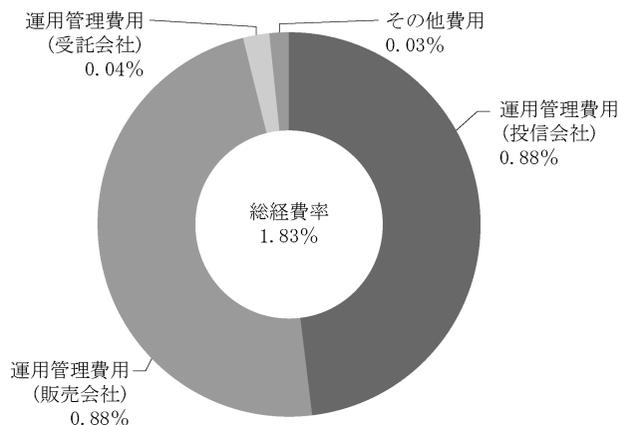
当期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)は1.83%です。

(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

(2019年1月22日～2020年1月21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 187,275	千円 157,014	千口 116,172,919	千円 100,007,626

(注) 単位未満は切り捨て。

■ 株式売買比率

(2019年1月22日～2020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	
	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	218,161,249千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	191,218,032千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.14	

(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

(2019年1月22日～2020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

(2020年1月21日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 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 288,090,836	千口 172,105,192	千円 170,452,982

(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

(2020年1月21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 170,452,982	% 98.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,860,326	1.7
投 資 信 託 財 産 総 額	173,313,308	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(150,199,395千円)の投資信託財産総額(173,280,126千円)に対する比率は86.7%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ドル=110.24円、1ユーロ=122.29円、1スイスフラン=113.80円、1オーストラリアドル=75.78円、1香港ドル=14.19円、100韓国ウォン=9.52円、1新台幣ドル=3.68円。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年1月21日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	173,313,308,515円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	33,524,383
モビリティ・イノベーション・マザーファンド(評価額)	170,452,982,666
未 収 入 金	2,826,801,466
(B) 負 債	2,696,107,689
未 払 解 約 金	1,147,104,443
未 払 信 託 報 酬	1,547,583,818
そ の 他 未 払 費 用	1,419,428
(C) 純資産総額(A - B)	170,617,200,826
元 本	177,722,090,034
次 期 繰 越 損 益 金	△7,104,889,208
(D) 受 益 権 総 口 数	177,722,090,034口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,600円

(注) 当ファンドの期首元本額は292,596,859,863円、期中追加設定元本額は1,600,364,446円、期中一部解約元本額は116,475,134,275円です。

(注) 期末の1口当たり純資産額は0.9600円です。

■損益の状況 (2019年1月22日～2020年1月21日)

項 目	当 期
(A) 有価証券売買損益	35,954,508,874円
売 買 益	42,689,526,508
売 買 損	△ 6,735,017,634
(B) 信 託 報 酬 等	△ 3,429,420,852
(C) 当期損益金(A + B)	32,525,088,022
(D) 前期繰越損益金	△35,517,156,816
(E) 追加信託差損益金	△ 4,112,820,414
(配 当 等 相 当 額)	(86,107,287)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 4,198,927,701)
(F) 計 (C + D + E)	△ 7,104,889,208
(G) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (F + G)	△ 7,104,889,208
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 4,112,820,414
(配 当 等 相 当 額)	(87,824,049)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 4,200,644,463)
分 配 準 備 積 立 金	1,922,276,031
繰 越 損 益 金	△ 4,914,344,825

(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(1,922,276,031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(87,824,049円)より分配対象収益は2,010,100,080円(10,000口当たり113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

社名変更のお知らせ

BNYメロン・アセット・マネジメント・ジャパン株式会社は、2020年4月1日をもって商号を「BNYメロン・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社」に変更する予定です。

モビリティ・イノベーション・マザーファンド

第2期（2020年1月21日決算）〔計算期間：2019年1月22日～2020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	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

(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) 2019年1月21日	7,879	% —	% 98.3	% —
1月末	8,008	1.6	99.3	—
2月末	8,654	9.8	98.2	—
3月末	8,339	5.8	99.2	—
4月末	9,047	14.8	97.9	—
5月末	7,852	△0.3	98.8	—
6月末	8,388	6.5	98.8	—
7月末	8,606	9.2	96.0	—
8月末	7,958	1.0	97.3	—
9月末	8,273	5.0	97.5	—
10月末	8,692	10.3	98.0	—
11月末	9,179	16.5	98.1	—
12月末	9,524	20.9	98.3	—
(期 末) 2020年1月21日	9,904	25.7	98.8	—

(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

当期末の基準価額は、9,904円となりました。その結果、期中騰落率は25.7%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。

■市場概況

市場概況については、2ページをご参照ください。

■運用概況

運用概況については、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

(2019年1月22日～2020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 7 (7)	% 0.087 (0.087)	(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、8,543円です。
(b) 有価証券取引税 (株式)	2 (2)	0.021 (0.021)	(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)	2 (2) (0)	0.024 (0.022) (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	11	0.132	

(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

(2019年1月22日～2020年1月21日)

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国内	上場	千株 1,840	千円 4,833,826	千株 7,311	千円 14,199,469
	アメリカ	百株 127,646	千ドル 375,155	百株 240,397 (-)	千ドル 972,158 (469)
外 国	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	3,138	16,893	10,073	54,583
	イタリア	-	-	33,968	20,915
	フランス	2,891	6,912	6,561	60,706
	オランダ	-	-	10,829	17,157
	ルクセンブルク	883	4,490	1,770	7,407
	スイス	4,915	千スイスフラン 11,589	1,133 (-)	千スイスフラン 7,650 (814)
	オーストラリア	-	千オーストラリアドル -	49,651	千オーストラリアドル 12,231
	香港	76,133	千香港ドル 155,322	334,833	千香港ドル 323,869
	韓国	2,133	千韓国ウォン 5,161,298	10,663	千韓国ウォン 48,094,738
台湾	100,820	千新台湾ドル 2,270,923	106,600 (-)	千新台湾ドル 1,559,186 (14,835)	

(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

(2019年1月22日～2020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	218,161,249千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	191,218,032千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.14

(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

(2019年1月22日～2020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

(2020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 (47.7%)				
三菱電機	2,882.5	2,260.8	3,553,977	
パナソニック	3,037.7	—	—	
アンリツ	—	737.9	1,599,029	
太陽誘電	1,367.7	1,156.5	4,013,055	
輸送用機器 (52.3%)				
デンソー	1,218	800.3	4,003,900	
トヨタ自動車	724	305.7	2,400,967	
日野自動車	2,830.9	1,336.6	1,499,665	
スズキ	429.1	421.3	2,137,676	
合 計	株 数 ・ 金 額	12,489	7,019	19,208,272
	銘柄数 < 比率 >	7	7	< 11.3% >

(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	千ドル	千円	
ANSYS, INC.	4,259	3,111	84,093	9,270,445	ソフトウェア・サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	16,365	—	—	—	電気通信サービス
BORGWARNER INC	—	3,252	13,506	1,488,902	自動車・自動車部品
AMPHENOL CORPORATION	2,794	1,890	20,693	2,281,286	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUANTA SERVICES INC	19,887	—	—	—	資本財
CORNING INC	13,383	5,056	15,201	1,675,766	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CREE INC	6,433	4,026	21,081	2,324,018	半導体・半導体製造装置
CUBIC CORP	—	2,053	14,343	1,581,241	資本財
DIODES INC	—	5,145	30,332	3,343,820	半導体・半導体製造装置
NEXTERA ENERGY, INC.	—	864	21,912	2,415,579	公益事業
FLIR SYSTEMS, INC.	4,579	7,712	42,155	4,647,178	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ITRON INC	3,920	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LITTELFUSE, INC.	580	490	9,366	1,032,551	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MAGNA INTERNATIONAL INC.	4,756	—	—	—	自動車・自動車部品
ON SEMICONDUCTOR CORPORATI	18,190	15,386	38,466	4,240,596	半導体・半導体製造装置
PACCAR INC	7,372	—	—	—	資本財
QUALCOMM INC	7,029	5,946	57,029	6,286,924	半導体・半導体製造装置
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,593	1,407	53,432	5,890,435	資本財
ROCKWELL AUTOMATION INC	—	1,147	23,485	2,589,021	資本財
SEMTECH CORPORATION	4,176	5,011	27,545	3,036,630	半導体・半導体製造装置
SKYWORKS SOLUTIONS INC	2,927	2,295	28,502	3,142,072	半導体・半導体製造装置
XILINX INC	6,495	3,046	31,348	3,455,895	半導体・半導体製造装置
WABCO HOLDINGS INC	4,138	—	—	—	資本財
SPLUNK INC	6,858	4,792	75,699	8,345,128	ソフトウェア・サービス
VISTEON CORPORATION	1,546	—	—	—	自動車・自動車部品
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	—	561	17,409	1,919,242	ソフトウェア・サービス
LEAR CORPORATION	1,708	—	—	—	自動車・自動車部品
YANDEX NV	23,763	13,019	59,108	6,516,089	メディア・娯楽
TESLA INC.	—	656	33,489	3,691,861	自動車・自動車部品
TE CONNECTIVITY LIMITED	2,773	2,345	23,498	2,590,499	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GENERAL MOTORS CO.	4,384	—	—	—	自動車・自動車部品
APTIV PLC	7,553	4,378	40,076	4,417,983	自動車・自動車部品
GENTHERM INC	—	2,589	12,468	1,374,483	自動車・自動車部品
TWILIO INC.	2,167	1,700	20,291	2,236,941	ソフトウェア・サービス
HUBBELL INCORPORATED	—	1,864	27,817	3,066,595	資本財
SPOTIFY TECHNOLOGY SA	2,493	—	—	—	メディア・娯楽
NIO INC - ADR	19,946	—	—	—	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	
AUTOHOME INC		百株	百株	千ドル	千円	メディア・娯楽
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A		7,714	—	—	—	ソフトウェア・サービス
GRUBHUB INC		—	7,165	16,093	1,774,198	小売
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC		4,734	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LUMENTUM HOLDINGS INC		9,450	2,707	28,533	3,145,540	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
EVERBRIDGE INC		5,088	4,478	34,465	3,799,531	ソフトウェア・サービス
ALPHABET INC.		—	2,311	20,388	2,247,626	メディア・娯楽
		374	276	40,947	4,514,062	
小 計	株 数 ・ 金 額	229,443	116,692	982,784	108,342,150	
	銘柄数〈比率〉	33	31	—	<63.6%>	
(ユーロ・・・ドイツ)				千ユーロ		
CONTINENTAL AG		2,047	810	9,178	1,122,431	自動車・自動車部品
RHEINMETALL AG		1,868	—	—	—	資本財
SIEMENS AG		—	1,275	14,897	1,821,811	資本財
LEONI AG		3,971	—	—	—	自動車・自動車部品
INFINEON TECHNOLOGIES AG		9,563	9,942	21,017	2,570,239	半導体・半導体製造装置
HELLA GMBH & CO. KGAA		3,135	1,623	7,613	931,056	自動車・自動車部品
小 計	株 数 ・ 金 額	20,586	13,651	52,707	6,445,539	
	銘柄数〈比率〉	5	4	—	<3.8%>	
(ユーロ・・・イタリア)						
PRYSMIAN SPA		10,579	8,294	18,165	2,221,445	資本財
PIRELLI&C. S.P.A.		31,684	—	—	—	自動車・自動車部品
小 計	株 数 ・ 金 額	42,263	8,294	18,165	2,221,445	
	銘柄数〈比率〉	2	1	—	<1.3%>	
(ユーロ・・・フランス)						
CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN		5,606	—	—	—	自動車・自動車部品
PLASTIC OMNIUM		2,482	4,418	11,275	1,378,834	自動車・自動車部品
小 計	株 数 ・ 金 額	8,088	4,418	11,275	1,378,834	
	銘柄数〈比率〉	2	1	—	<0.8%>	
(ユーロ・・・オランダ)						
STMICROELECTRONICS N.V.		30,198	19,368	49,119	6,006,805	半導体・半導体製造装置
小 計	株 数 ・ 金 額	30,198	19,368	49,119	6,006,805	
	銘柄数〈比率〉	1	1	—	<3.5%>	
(ユーロ・・・ルクセンブルク)						
STABILUS S.A.		886	—	—	—	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額	886	—	—	—	
	銘柄数〈比率〉	1	—	—	<—%>	
ユーロ計	株 数 ・ 金 額	102,024	45,732	131,266	16,052,625	
	銘柄数〈比率〉	11	7	—	<9.4%>	

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) ABB LTD. LANDIS+GYR GROUP AG	百株 — 2,808	百株 4,663 1,927	千スイスフラン 10,791 20,023	千円 1,228,101 2,278,686	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 銘 柄 数 〈 比 率 〉	2,808 1	6,590 2	30,815 — <2.1%>	3,506,788
(オーストラリア) OROCOBRE LTD	49,651	—	千オーストラリアドル —	—	素材
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 〈 比 率 〉	49,651 1	— —	— — <—%>	—
(香港) GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LIMITED GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LIMITED MEITUAN DIANPING-CLASS B	124,160 211,800 172,964 —	— 237,680 — 12,544	千香港ドル — 215,813 — 138,736	— 3,062,392 — 1,968,672	自動車・自動車部品 自動車・自動車部品 自動車・自動車部品 小売
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 〈 比 率 〉	508,924 3	250,224 2	354,550 — <3.0%>	5,031,065
(韓国) HYUNDAI MOBIS CO., LTD. SAMSUNG SDI CO., LTD. HANON SYSTEMS	1,645 2,037 24,774	853 1,255 17,816	千韓国ウォン 21,004,218 34,600,596 19,776,081	1,999,601 3,293,976 1,882,682	自動車・自動車部品 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 銘 柄 数 〈 比 率 〉	28,456 3	19,926 3	75,380,895 — <4.2%>	7,176,261
(台湾) DELTA ELECTRONICS INC MEDIATEK INC	85,360 —	33,130 46,450	千新台湾ドル 505,232 1,946,255	1,859,255 7,162,218	テクノロジー・ハードウェアおよび機器 半導体・半導体製造装置
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 〈 比 率 〉	85,360 1	79,580 2	2,451,487 — <5.3%>	9,021,474
合 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 〈 比 率 〉	1,006,668 53	518,745 47	— — <87.5%>	149,130,365

(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

(2020年1月21日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	168,338,637	97.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	4,941,489	2.9
投 資 信 託 財 産 総 額	173,280,126	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(150,199,395千円)の投資信託財産総額(173,280,126千円)に対する比率は86.7%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ドル=110.24円、1ユーロ=122.29円、1スイスフラン=113.80円、1オーストラリアドル=75.78円、1香港ドル=14.19円、100韓国ウォン=9.52円、1新台幣ドル=3.68円。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年1月21日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	173,280,126,932円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	4,934,167,310
株 式 (評 価 額)	168,338,637,278
未 収 配 当 金	7,322,344
(B) 負 債	2,826,918,827
未 払 解 約 金	2,826,801,466
そ の 他 未 払 費 用	117,361
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	170,453,208,105
元 本	172,105,192,515
次 期 繰 越 損 益 金	△1,651,984,410
(D) 受 益 権 総 口 数	172,105,192,515口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,904円

(注) 当親ファンドの期首元本額は288,090,836,467円、期中追加設定元本額は187,275,686円、期中一部解約元本額は116,172,919,638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172,105,192,515円です。

(注) 期末の1口当たり純資産額は0.9904円です。

■損益の状況 (2019年1月22日～2020年1月21日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	2,695,233,889円
受 取 配 当 金	2,673,480,943
受 取 利 息	21,565,032
そ の 他 収 益 金	187,914
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	40,674,845,018
売 買 損 益	54,404,243,522
売 買 損	△13,729,398,504
(C) 保 管 費 用 等	△ 47,462,399
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	43,322,616,508
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△61,109,633,387
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 30,261,070
(G) 解 約 差 損 益 金	16,165,293,539
(H) 計 (D + E + F + G)	△ 1,651,984,410
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	△ 1,651,984,410

(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

社名変更のお知らせ

BNYメロン・アセット・マネジメント・ジャパン株式会社は、2020年4月1日をもって商号を「BNYメロン・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社」に変更する予定です。