



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3期（決算日：2021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、2021年1月21日に第3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>

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
3 期(2021年1月21日)	14,601	0	52.1	98.0	—	116,407

(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
		騰落率		
(期 首) 2020年1月21日	円 9,600	% —	% 98.7	% —
1 月末	9,216	△4.0	98.0	—
2 月末	8,491	△11.6	98.9	—
3 月末	7,203	△25.0	98.1	—
4 月末	8,202	△14.6	98.8	—
5 月末	8,871	△7.6	99.4	—
6 月末	9,458	△1.5	99.3	—
7 月末	10,051	4.7	98.4	—
8 月末	10,760	12.1	98.4	—
9 月末	10,486	9.2	99.2	—
10 月末	10,608	10.5	100.2	—
11 月末	12,404	29.2	99.0	—
12 月末	12,781	33.1	99.8	—
(期 末) 2021年1月21日	14,601	52.1	98.0	—

(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

期中騰落率は52.1%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。



◆基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

- ・当期中、情報技術セクターを中心に一般消費財・サービスセクターがパフォーマンスに大きくプラス寄与しました。
- ・個別銘柄では、テスラやトゥイリオなどの保有がプラスの寄与となりました。テスラについては、株式分割による投資家層の裾野拡大期待、主要株価指数への組入、またバイデン新大統領のみならずグローバルに環境を重視する傾向が強まりEVに対する期待が高まったことなどから非常に大きく上昇しました。またトゥイリオは、新型コロナウイルスによる影響拡大を背景に顧客企業のデジタルトランスフォーメーションが加速する中で、今後の成長期待が高まり大きく上昇しました。

◆市場概況

(世界株式市況)

新型コロナウイルスの感染が世界的に拡大し、景気に対する懸念が高まったことから、株式市場は2020年3月に大きく下落しました。また、石油輸出国機構（OPEC）と主要産油国で構成する「OPECプラス」での減産協議が決裂したことを受けて、原油価格が急落し、市場のセンチメントを大きく悪化させました。

その後、世界各国での金融・財政両面からの景気刺激策や、前例のない都市封鎖などの規制が緩和の方向へ進んだことから上昇に転じ、新型コロナウイルス感染再拡大が重石となる場面も一時みられましたが、米国大統領選挙を消化し、またワクチン開発や接種の広がり、更なる経済支援策などへの期待などから株式市場は期末にかけて上昇基調で推移しました。

(為替)

新型コロナウイルスの影響により市場が大きく混乱した2020年3月には米ドル円相場は大きく上下しましたが、FRB（米連邦準備理事会）が3月に危機対応としてゼロ金利政策や無制限の量的緩和を導入し、また9月には新型コロナウイルスからの米国経済回復支援のため2023年まで利上げを行わない見通しが示されるなか、米ドルは対円で下落基調で推移しました。

◆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欧州や韓国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 200億米ドル以上）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、米国のアンシス（情報技術）、米国のテスラ（一般消費財・サービス）、米国のゼネラル・モーターズ（一般消費財・サービス）、韓国のサムスンSDI（情報技術）、米国のツイリオ（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3期
	2020年1月22日～ 2021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	4,742

（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

(2020年1月22日～2021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 178 (87) (87) (4)	% 1.798 (0.880) (0.880) (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、9,877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)	9 (9)	0.091 (0.091)	(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)	4 (4)	0.044 (0.044)	(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)	3 (2) (0) (0) (0)	0.028 (0.023) (0.002) (0.001) (0.003)	(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	194	1.961	

(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

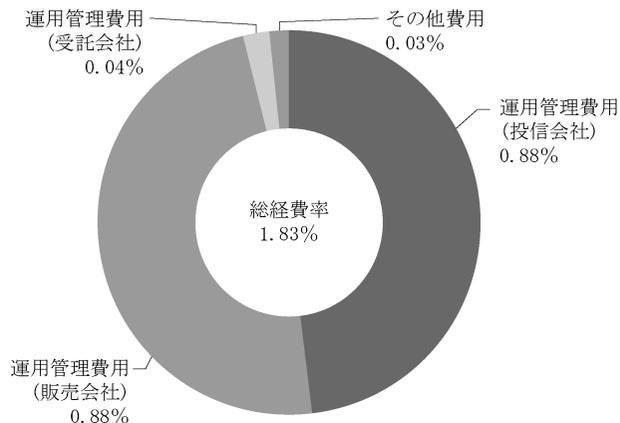
当期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)は1.83%です。

(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

(2020年1月22日～2021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 481,722	千円 563,785	千口 96,486,567	千円 102,252,558

(注) 単位未満は切り捨て。

■ 株式売買比率

(2020年1月22日～2021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	192,436,330千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	120,313,765千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.59

(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

(2020年1月22日～2021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

(2021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 172,105,192	千口 76,100,347	千円 116,304,161

(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

(2021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 116,304,161	% 98.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,630,538	1.4
投 資 信 託 財 産 総 額	117,934,699	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(109,059,951千円)の投資信託財産総額(118,654,865千円)に対する比率は91.9%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=103.61円、1ユーロ=125.50円、1スイスフラン=116.48円、1オーストラリアドル=80.33円、1香港ドル=13.37円、100韓国ウォン=9.44円、1新台幣ドル=3.70円。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年1月21日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	117,934,699,214円
コール・ローン等	254,282,515
モビリティ・イノベーション・マザーファンド(評価額)	116,304,161,023
未 収 入 金	1,376,255,676
(B) 負 債	1,527,040,205
未 払 解 約 金	538,363,224
未 払 信 託 報 酬	986,986,236
そ の 他 未 払 費 用	1,690,745
(C) 純資産総額(A-B)	116,407,659,009
元 本	79,723,915,918
次 期 繰 越 損 益 金	36,683,743,091
(D) 受 益 権 総 口 数	79,723,915,918口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,601円

(注) 当ファンドの期首元本額は177,722,090,034円、期中追加設定元本額は3,753,664,917円、期中一部解約元本額は101,751,839,033円です。

(注) 期末の1口当たり純資産額は1,4601円です。

■損益の状況 (2020年1月22日～2021年1月21日)

項 目	当 期 期
(A) 有価証券売買損益	41,212,570,492円
売 買 益	49,738,572,602
売 買 損	△ 8,526,002,110
(B) 信託報酬等	△ 2,193,486,266
(C) 当期損益金(A+B)	39,019,084,226
(D) 前期繰越損益金	△ 1,288,764,931
(E) 追加信託差損益金	△ 1,046,576,204
(配 当 等 相 当 額)	(73,728,670)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 1,120,304,874)
(F) 計(C+D+E)	36,683,743,091
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	36,683,743,091
追加信託差損益金	△ 1,046,576,204
(配 当 等 相 当 額)	(75,066,890)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 1,121,643,094)
分 配 準 備 積 立 金	37,730,319,295

(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(591,074,099円)、費用控除後の有価証券売買等損益額(36,311,268,934円)、信託約款に規定する収益調整金(75,066,890円)および分配準備積立金(827,976,262円)より分配対象収益は37,805,386,185円(10,000口当たり4,742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

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」に変更いたしました。これに伴い、当ファンドならびにマザーファンドの約款変更を行いました。(2020年4月1日付)

運用報告書を掲載するホームページのアドレスの変更を行いました。(2020年4月21日付)

モビリティ・イノベーション・マザーファンド

第3期（2021年1月21日決算）〔計算期間：2020年1月22日～2021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

(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) 2020年1月21日	9,904	% —	% 98.8	% —
1月末	9,512	△4.0	98.0	—
2月末	8,777	△11.4	98.7	—
3月末	7,460	△24.7	97.6	—
4月末	8,502	△14.2	98.3	—
5月末	9,204	△7.1	98.8	—
6月末	9,825	△0.8	98.5	—
7月末	10,451	5.5	98.4	—
8月末	11,205	13.1	98.2	—
9月末	10,936	10.4	98.9	—
10月末	11,081	11.9	99.6	—
11月末	12,963	30.9	98.3	—
12月末	13,374	35.0	99.0	—
(期 末) 2021年1月21日	15,283	54.3	98.1	—

(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54.3%となりました。なお、当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数がないため、ベンチマークおよび参考指数などは設定しておりません。基準価額の主な変動要因については、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

(2020年1月22日～2021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 9 (9)	% 0.090 (0.090)	(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、10,274円です。
(b) 有価証券取引税 (株式)	5 (5)	0.044 (0.044)	(b) 有価証券取引税＝各期中の有価証券取引税÷各期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (その他)	3 (2) (0)	0.025 (0.023) (0.003)	(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	0.159	

(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

(2020年1月22日～2021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	
		241	1,296,376	5,984	13,471,410	
外 国	アメリカ	百株	千米ドル	百株	千米ドル	
		85,992	309,688	115,088	910,655	
	(2,296)	(-)	(-)	(223)		
	ユーロ			千ユーロ		千ユーロ
		ドイツ	9,557	36,109	13,402	53,977
			(1,471)	(1,534)	(955)	(875)
		イタリア	-	-	8,294	14,777
		フランス	2,270	13,475	3,238	13,524
	オランダ	-	-	12,602	34,638	
	スイス	5,776	千スイスフラン 13,725	6,434 (-)	千スイスフラン 20,026 (250)	
香港	81,160	千香港ドル 148,182	257,574	千香港ドル 359,873		
韓国	469	千韓国ウォン 27,250,640	11,238	千韓国ウォン 67,444,900		
台湾	- (-)	千新台幣ドル - (0.00037)	68,910 (-)	千新台幣ドル 2,415,263 (16,748)		

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) 単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

(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

(2020年1月22日～2021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	192,436,330千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	120,313,765千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.59

(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

(2020年1月22日～2021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

(2021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 (52.1%)			
三菱電機	2,260.8	—	—
アンリツ	737.9	343.8	917,946
太陽誘電	1,156.5	415.9	2,599,375
輸送用機器 (33.4%)			
デンソー	800.3	372.7	2,254,089
トヨタ自動車	305.7	—	—
日野自動車	1,336.6	—	—
スズキ	421.3	—	—
陸運業 (14.5%)			
東日本旅客鉄道	—	144.2	980,560
合 計	株数・金額	7,019	1,276 6,751,970
	銘柄数<比率>	7	4 <5.8%>

(注) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

(注) 評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注) 評価額の単位未満は切り捨て。

(注) 一印は組み入れなし。

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.	3,111	1,145	43,386	4,495,233	ソフトウェア・サービス
BORGWARNER INC	3,252	—	—	—	自動車・自動車部品
AMPHENOL CORPORATION	1,890	674	9,034	936,108	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CORNING INC	5,056	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CREE INC	4,026	1,681	19,257	1,995,260	半導体・半導体製造装置
CUBIC CORP	2,053	—	—	—	資本財
DIODES INC	5,145	2,398	19,138	1,982,907	半導体・半導体製造装置
NEXTERA ENERGY, INC.	864	1,612	13,554	1,404,406	公益事業
FLIR SYSTEMS, INC.	7,712	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NVIDIA CORPORATION	—	441	23,608	2,446,044	半導体・半導体製造装置
PLUG POWER INC	—	5,149	32,186	3,334,791	資本財
LITTELFUSE, INC.	490	228	6,499	673,431	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MAGNA INTERNATIONAL INC.	—	2,753	20,884	2,163,813	自動車・自動車部品
ON SEMICONDUCTOR CORPORATI	15,386	7,173	27,216	2,819,888	半導体・半導体製造装置
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	—	3,736	20,207	2,093,696	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	5,946	407	6,705	694,805	半導体・半導体製造装置
RAVEN INDUSTRIES INC	—	2,964	10,976	1,137,298	資本財
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,407	435	18,323	1,898,478	資本財
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,147	703	18,562	1,923,219	資本財
SEMTECH CORPORATION	5,011	2,336	19,045	1,973,263	半導体・半導体製造装置
SKYWORKS SOLUTIONS INC	2,295	1,070	17,438	1,806,768	半導体・半導体製造装置
XILINX INC	3,046	—	—	—	半導体・半導体製造装置
SPLUNK INC	4,792	1,784	30,814	3,192,721	ソフトウェア・サービス
VISTEON CORPORATION	—	1,358	19,228	1,992,234	自動車・自動車部品
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	561	—	—	—	ソフトウェア・サービス
NXP SEMICONDUCTORS NV	—	715	12,485	1,293,636	半導体・半導体製造装置
YANDEX NV	13,019	2,371	16,681	1,728,395	メディア・娯楽
TESLA INC.	656	486	41,341	4,283,364	自動車・自動車部品
TE CONNECTIVITY LIMITED	2,345	721	9,401	974,042	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GENERAL MOTORS CO.	—	7,210	40,279	4,173,367	自動車・自動車部品
APTIV PLC	4,378	2,036	29,551	3,061,877	自動車・自動車部品
GENTHERM INC	2,589	—	—	—	自動車・自動車部品
EATON CORP PLC	—	1,411	17,785	1,842,805	資本財
TWILIO INC.	1,700	878	34,537	3,578,455	ソフトウェア・サービス
HUBBELL INCORPORATED	1,864	1,044	17,391	1,801,983	資本財
CNH INDUSTRIAL NV	—	16,662	22,960	2,378,912	資本財

銘柄		期首(前期末)	当 期 末			業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千米ドル	千円	
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A		7,165	—	—	—	ソフトウェア・サービス
VIRGIN GALACTIC HOLDINGS INC		—	3,183	10,196	1,056,498	資本財
JD.COM INC-ADR		—	953	9,090	941,874	小売
MP MATERIALS CORP		—	5,102	17,617	1,825,375	素材
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC		2,707	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LUMENTUM HOLDINGS INC		4,478	2,087	20,045	2,076,958	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WORKHORSE GROUP INC		—	5,732	13,374	1,385,776	自動車・自動車部品
EVERBRIDGE INC		2,311	1,077	15,539	1,610,062	ソフトウェア・サービス
ALPHABET INC.		276	157	29,803	3,087,949	メディア・娯楽
小 計	株 数 ・ 金 額	116,692	89,892	734,154	76,065,711	
	銘柄数〈比率〉	31	36	—	<65.4%>	
(ユーロ・・・ドイツ)				千ユーロ		
CONTINENTAL AG		810	—	—	—	自動車・自動車部品
DAIMLER AG		—	2,529	14,650	1,838,634	自動車・自動車部品
SIEMENS AG		1,275	857	10,496	1,317,299	資本財
INFINEON TECHNOLOGIES AG		9,942	5,659	19,743	2,477,837	半導体・半導体製造装置
KION GROUP AG		—	1,275	9,404	1,180,279	資本財
HELLA GMBH & CO. KGAA		1,623	—	—	—	自動車・自動車部品
小 計	株 数 ・ 金 額	13,651	10,322	54,295	6,814,051	
	銘柄数〈比率〉	4	4	—	<5.9%>	
(ユーロ・・・イタリア)						
PRYSMIAN SPA		8,294	—	—	—	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額	8,294	—	—	—	
	銘柄数〈比率〉	1	—	—	<—%>	
(ユーロ・・・フランス)						
SCHNEIDER ELECTRIC SE		—	802	9,884	1,240,561	資本財
PLASTIC OMNIUM		4,418	2,646	8,311	1,043,091	自動車・自動車部品
小 計	株 数 ・ 金 額	4,418	3,449	18,196	2,283,652	
	銘柄数〈比率〉	1	2	—	<2.0%>	
(ユーロ・・・オランダ)						
STMICROELECTRONICS N.V.		19,368	6,766	22,667	2,844,801	半導体・半導体製造装置
小 計	株 数 ・ 金 額	19,368	6,766	22,667	2,844,801	
	銘柄数〈比率〉	1	1	—	<2.4%>	
ユーロ計	株 数 ・ 金 額	45,732	20,538	95,159	11,942,505	
	銘柄数〈比率〉	7	7	—	<10.3%>	

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	
ABB LTD.		4,663	4,794	12,643	1,472,763	資本財
LANDIS+GYR GROUP AG		1,927	1,138	8,569	998,150	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
小 計	株 数 ・ 金 額	6,590	5,932	21,213	2,470,914	
	銘柄数〈比率〉	2	2	—	<2.1%>	
(香港)				千香港ドル		
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LIMITED		—	69,360	234,436	3,134,420	自動車・自動車部品
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD		237,680	—	—	—	自動車・自動車部品
MEITUAN-CLASS B		12,544	4,450	165,540	2,213,269	小売
小 計	株 数 ・ 金 額	250,224	73,810	399,976	5,347,689	
	銘柄数〈比率〉	2	2	—	<4.6%>	
(韓国)				千韓国ウォン		
LG CHEM LTD.		—	279	27,986,000	2,641,878	素材
HYUNDAI MOBIS CO., LTD.		853	—	—	—	自動車・自動車部品
SAMSUNG SDI CO., LTD.		1,255	571	42,541,920	4,015,957	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HANON SYSTEMS		17,816	8,305	14,950,530	1,411,330	自動車・自動車部品
小 計	株 数 ・ 金 額	19,926	9,157	85,478,450	8,069,165	
	銘柄数〈比率〉	3	3	—	<6.9%>	
(台湾)				千新台幣ドル		
DELTA ELECTRONICS INC		33,130	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MEDIATEK INC		46,450	10,670	930,424	3,442,568	半導体・半導体製造装置
小 計	株 数 ・ 金 額	79,580	10,670	930,424	3,442,568	
	銘柄数〈比率〉	2	1	—	<3.0%>	
合 計	株 数 ・ 金 額	518,745	210,001	—	107,338,555	
	銘柄数〈比率〉	47	51	—	<92.3%>	

(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) ー印は組み入れなし。

■投資信託財産の構成

(2021年1月21日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	114,090,526	96.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	4,564,339	3.8
投 資 信 託 財 産 総 額	118,654,865	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(109,059,951千円)の投資信託財産総額(118,654,865千円)に対する比率は91.9%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=103.61円、1ユーロ=125.50円、1スイスフラン=116.48円、1オーストラリアドル=80.33円、1香港ドル=13.37円、100韓国ウォン=9.44円、1新台幣ドル=3.70円。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年1月21日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	119,013,354,316円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,421,170,216
株 式 (評 価 額)	114,090,526,367
未 収 入 金	2,499,302,194
未 収 配 当 金	2,355,539
(B) 負 債	2,706,835,840
未 払 金	1,330,543,624
未 払 解 約 金	1,376,255,676
そ の 他 未 払 費 用	36,540
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	116,306,518,476
元 本	76,100,347,460
次 期 繰 越 損 益 金	40,206,171,016
(D) 受 益 権 総 口 数	76,100,347,460口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,283円

(注) 当親ファンドの期首元本額は172,105,192,515円、期中追加設定元本額は481,722,412円、期中一部解約元本額は96,486,567,467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76,100,347,460円です。

(注) 期末の1口当たり純資産額は1.5283円です。

■損益の状況 (2020年1月22日～2021年1月21日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	994,224,542円
受 取 配 当 金	991,359,769
受 取 利 息	2,864,585
そ の 他 収 益 金	188
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	46,580,006,067
売 買 益	63,351,093,415
売 買 損	△16,771,087,348
(C) 保 管 費 用 等	△ 32,147,373
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	47,542,083,236
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 1,651,984,410
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	82,063,321
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	82,063,321
(H) 解 約 差 損 益 金	△ 5,765,991,131
(H) 計 (D + E + F + G)	40,206,171,016
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	40,206,171,016

(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

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」に変更いたしました。これに伴う約款変更を行いました。(2020年4月1日付)