

第5期

運用報告書(全体版)

次世代モビリティオープン (為替ヘッジあり)

【2023年3月10日決算】

受益者の皆様へ

平素は格別のご愛顧を賜り厚くお礼申し上げます。

皆様の「次世代モビリティオープン（為替ヘッジあり）」は、2023年3月10日に第5期決算を迎えたので、期中の運用状況ならびに決算のご報告を申し上げます。

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。



〒104-0031 東京都中央区京橋2-2-1

お問い合わせは弊社投信営業部へ

フリーダイヤル ☎ 0120-048-214 (営業日の9:00~17:00)

[ホームページ]

<https://www.okasan-am.jp>

※アクセスにかかる通信料はお客様のご負担となります。

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 | 2018年3月27日から2028年3月10日までです。 | |
| 運用方針 | 次世代モビリティマザーファンド（以下、「マザーファンド」といいます。）を通じて、主として日本を含む世界の取引所上場株式（上場予定、DR（預託証券）を含みます。）のなかから、次世代モビリティに関連する企業 [※] の株式に投資を行い、投資信託財産の成長を目指して運用を行います。 ※次世代モビリティに関連する企業とは、人・モノの移動に関連する幅広い分野で新規性・成長性の高い事業に取り組み、事業の実現性や収益成長が見込まれる企業とします。 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を目指します。一部の通貨について、他の通貨で代替した為替ヘッジを行うことがあります。 | |
| 主要投資対象 | 当ファンド | マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。 |
| | 次世代モビリティマザーファンド | 日本を含む世界の取引所上場株式（上場予定、DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とします。 |
| 投資制限 | 当ファンド | 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。 |
| | 次世代モビリティマザーファンド | 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 |
| 分配方針 | 毎年3月10日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行い、原則として、以下の方針に基づき、収益分配を行います。 分配対象収益の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。繰越分を含めた配当等収益には、マザーファンドの配当等収益のうち投資信託財産に帰属すべき配当等収益を含むものとします。分配金額は、委託会社が分配可能額、基準価額水準等を勘案して決定します。ただし、必ず収益分配を行うものではありません。 | |

○設定以来の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス (現地通貨ベース) | | 株式組入 率 | 株式先物 率 | 投資信託 証券組 入比率 | 純資産 総額 |
|---------------------|-------------|------------|-----------|--|-----------|-----------|-----------|--------------------|--------------|
| | (分配落) | 税込み 分配金 | 期中 騰落率 | (参考指数) | 期中 騰落率 | | | | |
| (設定日) 2018年3月27日 | 円 10,000 | 円 — | % — | ポイント 573.41 | % — | % — | % — | % — | 百万円 3,068 |
| 1期(2019年3月11日) | 8,627 | 0 | △13.7 | 579.23 | 1.0 | 94.1 | — | — | 5,379 |
| 2期(2020年3月10日) | 8,308 | 0 | △3.7 | 557.58 | △3.7 | 86.2 | — | 1.9 | 2,674 |
| 3期(2021年3月10日) | 15,056 | 0 | 81.2 | 765.71 | 37.3 | 93.1 | — | — | 4,845 |
| 4期(2022年3月10日) | 14,550 | 0 | △3.4 | 790.35 | 3.2 | 93.0 | — | — | 3,904 |
| 5期(2023年3月10日) | 13,146 | 0 | △9.6 | 754.01 | △4.6 | 93.7 | — | — | 3,146 |

(注) 基準価額および分配金(税引前)は1万円当たり、基準価額の騰落率は分配金(税引前)込み。

(注) 設定日の基準価額および純資産総額は当初設定元本。

(注) MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス(現地通貨ベース)は当ファンドの参考指数であり、ベンチマークではありません。

MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス(現地通貨ベース)は当該日前営業日の現地終値です。

(注) 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、株式組入比率、株式先物比率および投資信託証券組入比率は実質比率を記載しております。

(注) 株式先物比率=買建比率-売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | | MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス (現地通貨ベース) | | 株式組入 率 | 株式先物 率 | 投資信託 証券組 入比率 |
|--------------------|-------------|--------|--|--------|-----------|-----------|--------------------|
| | 騰落率 | (参考指数) | 騰落率 | | | | |
| (期首) 2022年3月10日 | 円 14,550 | % — | ポイント 790.35 | % — | % 93.0 | % — | % — |
| 3月末 | 15,993 | 9.9 | 846.50 | 7.1 | 93.8 | — | — |
| 4月末 | 13,521 | △7.1 | 780.45 | △1.3 | 94.5 | — | — |
| 5月末 | 13,599 | △6.5 | 780.11 | △1.3 | 95.2 | — | — |
| 6月末 | 12,230 | △15.9 | 725.58 | △8.2 | 93.8 | — | — |
| 7月末 | 13,702 | △5.8 | 759.48 | △3.9 | 92.8 | — | — |
| 8月末 | 13,587 | △6.6 | 748.18 | △5.3 | 94.4 | — | — |
| 9月末 | 12,110 | △16.8 | 685.35 | △13.3 | 91.8 | — | — |
| 10月末 | 12,314 | △15.4 | 721.99 | △8.6 | 94.0 | — | — |
| 11月末 | 12,434 | △14.5 | 747.10 | △5.5 | 93.8 | — | — |
| 12月末 | 11,489 | △21.0 | 729.72 | △7.7 | 90.9 | — | — |
| 2023年1月末 | 12,739 | △12.4 | 768.11 | △2.8 | 95.0 | — | — |
| 2月末 | 13,235 | △9.0 | 760.12 | △3.8 | 95.3 | — | — |
| (期末) 2023年3月10日 | 13,146 | △9.6 | 754.01 | △4.6 | 93.7 | — | — |

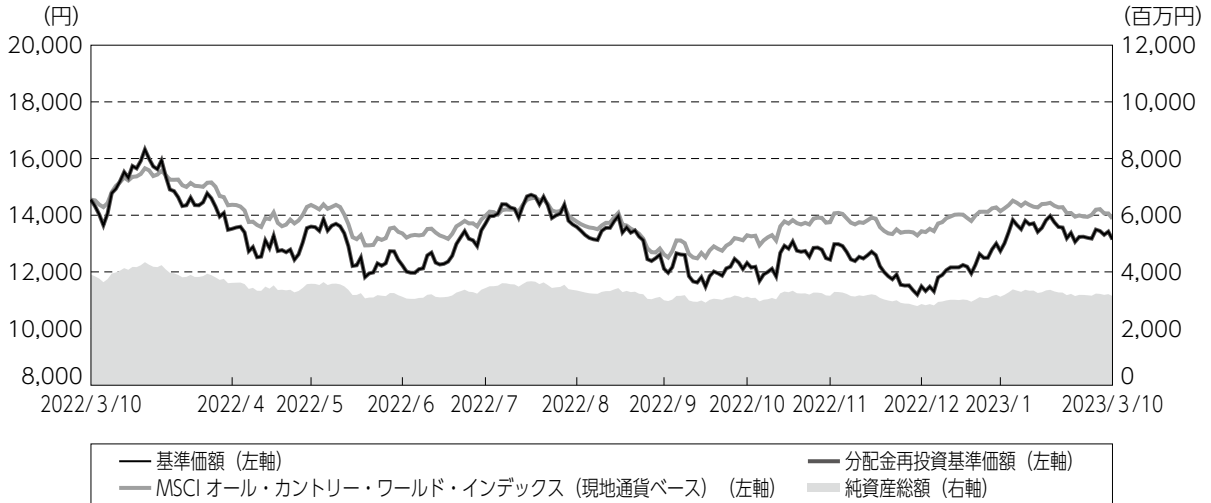
(注) 騰落率は期首比。

MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス(現地通貨ベース)はMSCI Inc.が算出している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

運用経過

期中の基準価額等の推移

（2022年3月11日～2023年3月10日）



期首：14,550円

期末：13,146円（既払分配金（税引前）：0円）

騰落率：△9.6%（分配金再投資ベース）

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 参考指数は、MSCI オール・カントリー・ワールド・インデックス（現地通貨ベース）です。
- (注) 分配金再投資基準価額および参考指数は、期首（2022年3月10日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

当ファンドの主要投資対象である「次世代モビリティマザーファンド」における主なプラス要因およびマイナス要因は以下の通りです。

（主なプラス要因）

- ・半導体株や、自動車・自動車部品株の上昇などがプラスに寄与しました。
- ・個別銘柄では、オン・セミコンダクターや、フェラーリ、S Tマイクロエレクトロニクスなどの上昇がプラスに寄与しました。

（主なマイナス要因）

- ・メディア・娯楽株や、小売株の下落などがマイナスに影響しました。
- ・個別銘柄では、テスラや、アルファベット、ウルフスピードなどの下落がマイナスに影響しました。

また、当ファンドでは、実質組入外貨建資産に対して為替ヘッジを行ったため、為替変動に伴う基準価額への影響は限定的となっています。

投資環境

(2022年3月11日～2023年3月10日)

世界株式市場は、2022年3月中旬から10月中旬にかけては、高いインフレ率を背景に世界的に金融引き締め動きが強まったことから下落しました。10月下旬から2023年3月上旬にかけては、市場予想を上回る良好な企業業績が好感された一方、金融引き締め長期化懸念が重石となり、上下にもみ合いの動きとなりました。地域別では、欧州株が世界株式市場をアウトパフォームした一方、米国株はアンダーパフォームしました。

モビリティ関連株式は、部品の供給不足が緩和された半導体・半導体製造装置株が上昇しました。一方、年間販売台数が目標に届かなかった大手電気自動車株は下落しました。

当ファンドのポートフォリオ

(2022年3月11日～2023年3月10日)

＜次世代モビリティオープン（為替ヘッジあり）＞

「次世代モビリティマザーファンド」の受益証券の組入比率は、概ね高位に維持しました。実質組入外貨建資産については、運用の基本方針に則り、為替ヘッジを行い、高位のヘッジ比率を維持しました。

○次世代モビリティマザーファンド

運用状況につきましては、自動車・自動車部品株や、半導体株を高位にウェイト付けしたポートフォリオで運用しました。2022年10月から期末にかけて、サプライチェーン（供給網）の正常化が業績に追い風となる自動車・自動車部品株、および資本財株の買い付けを行い、ウェイトを引き上げました。一方、業績の下方修正懸念が高まったメディア・娯楽株や、小売株のウェイトを引き下げました。

株式組入比率は、概ね高位を維持しました。

（参考情報）マザーファンドのセクター別比率（2023年3月10日現在）

| セクター | 前期 | 当期 | 増減 |
|--------------------|-------|-------|--------|
| 半導体・半導体製造装置 | 32.9% | 34.3% | 1.4% |
| 自動車・自動車部品 | 27.6% | 30.3% | 2.7% |
| ソフトウェア・サービス | 10.0% | 10.0% | 0.0% |
| テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 6.1% | 5.9% | △ 0.2% |
| メディア・娯楽 | 8.4% | 5.4% | △ 3.0% |
| 資本財 | 2.2% | 4.5% | 2.3% |
| 素材 | 1.5% | 2.6% | 1.1% |
| 運輸 | 2.3% | 2.4% | 0.1% |
| 小売 | 3.4% | 1.5% | △ 1.9% |
| 商業・専門サービス | 0.3% | — | △ 0.3% |
| その他 | 5.4% | 3.1% | △ 2.3% |

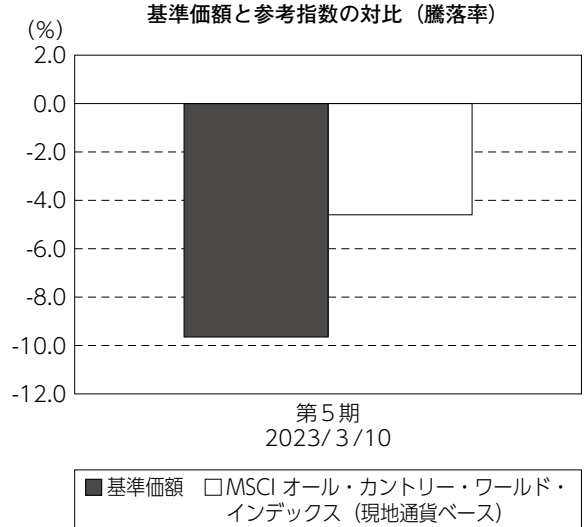
(注) 上記はBloombergのデータを基に岡三アセットマネジメントが作成しております。

(注) 比率はマザーファンドの純資産総額に対する各セクターの比率。

当ファンドのベンチマークとの差異

(2022年3月11日～2023年3月10日)

当ファンドは特定のベンチマークを設けておりませんが、当ファンドの基準価額の騰落率は、参考指数としているMSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス（現地通貨ベース）の騰落率を5.0%下回りました。詳細につきましては前掲の「基準価額の主な変動要因」をご参照ください。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

(注) 参考指数は、MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス（現地通貨ベース）です。

分配金

(2022年3月11日～2023年3月10日)

当ファンドは、毎年3月10日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行い、委託会社が分配可能額、基準価額水準等を勘案して分配金額を決定します。当期の分配につきましては、投資信託財産の成長を目指す観点から、見送りとさせていただきます。なお、収益分配に充てなかった留保益につきましては、運用の基本方針と同一の運用を行ってまいります。

(単位：円、1万口当たり・税引前)

| 項 目 | 第5期 |
|-----------|---------------------------|
| | 2022年3月11日～ 2023年3月10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 | 3,146 |

(注) 対基準価額比率は当期分配金（税引前）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

（投資環境）

世界株式市場は、米国において一部の地方銀行が破綻するなど、金融システムに対する不安が高まっていることから、短期的には不安定な展開が続くものと予想されます。その後、2023年後半以降は、金融システム不安の鎮静化や、金融緩和期待の高まりにより、株価は上昇に転じると予想されます。

モビリティ関連銘柄は、部品不足が解消されつつある自動車・自動車部品株や、半導体株を中心に底堅い展開が想定されます。

（運用方針）

<次世代モビリティオープン（為替ヘッジあり）>

次世代モビリティマザーファンドを通じて、人・モノの移動に関連する幅広い分野で新規性・成長性の高い事業に取り組み、事業の実現性や収益成長が見込まれる銘柄に投資し、投資信託財産の成長を目指して運用を行います。次世代モビリティマザーファンドの受益証券組入れは、高位に維持する方針です。実質組入外貨建資産については、運用の基本方針に則り、高位の為替ヘッジ比率を維持する方針です。

○次世代モビリティマザーファンド

T C W インベストメント・マネジメント・カンパニーからの投資助言を参考に、投資環境や業績動向などを勘案して銘柄選別を行います。引き続き、次世代モビリティ分野の市場拡大が、成長ドライバーとなる銘柄を高位にウェイト付けする方針です。業種としては、半導体株や、自動車・自動車部品株、ソフトウェア・サービス株を高位にウェイト付けします。

株式組入比率については、引き続き高位を維持する方針です。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2022年3月11日～2023年3月10日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|--|-------------------------------|--|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| | 円 | % | |
| (a) 信託報酬 (投信会社) (販売会社) (受託会社) | 236 (144) (86) (6) | 1.804 (1.100) (0.660) (0.044) | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 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) | 9 (9) | 0.068 (0.068) | (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) | 1 (1) | 0.006 (0.006) | (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) (その他) | 4 (3) (2) (0) | 0.034 (0.020) (0.013) (0.001) | (d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、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 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託支払手数料等 |
| 合 計 | 250 | 1.912 | |
| 期中の平均基準価額は、13,079円です。 | | | |

(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) 各金額において基準価額は円未満切捨て、その他は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

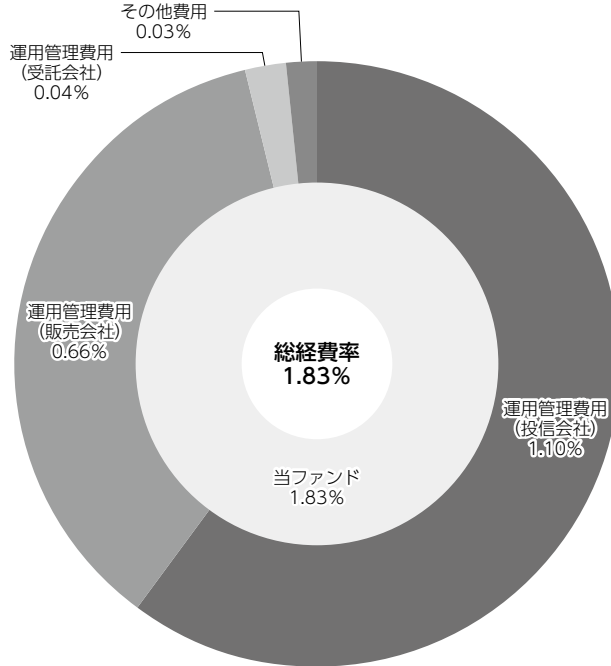
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

（参考情報）

○総経費率

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、売買委託手数料およ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) 当ファンドの費用は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、売買委託手数料およ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) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(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3月11日～2023年3月10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 |
| 次世代モビリティマザーファンド | 千口 393,740 | 千円 700,000 | 千口 992,728 | 千円 1,800,000 |

(注) 単位未満は切捨て。

○株式売買比率

(2022年3月11日～2023年3月10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 |
|-------------------------------|-----------------|
| | 次世代モビリティマザーファンド |
| (a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額 | 14,174,296千円 |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 16,931,026千円 |
| (c) 売 買 高 比 率(a)/(b) | 0.83 |

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

○利害関係人との取引状況等

(2022年3月11日～2023年3月10日)

利害関係人との取引状況

<次世代モビリティオープン（為替ヘッジあり）>
該当事項はございません。

<次世代モビリティマザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | B A | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | D C |
|-----|--------------|--------------------|----------|--------------|--------------------|----------|
| | | | | | | |
| 株 式 | 百万円 4,907 | 百万円 271 | % 5.5 | 百万円 9,266 | 百万円 148 | % 1.6 |

平均保有割合18.4%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

次世代モビリティオープン（為替ヘッジあり）

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------------|---------|
| 売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A) | 2,268千円 |
| う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B) | 74千円 |
| (B) / (A) | 3.3% |

(注) 売買委託手数料総額は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

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あり、当ファンドに係る利害関係人とはOKASAN SECURITIES TOKYO/JAPANです。

○組入資産の明細

(2023年3月10日現在)

親投資信託残高

| 銘 柄 | 期 首 (前期末) | | 当 期 末 | |
|------------------------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| | 口 数 | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| 次 世 代 モ ビ リ ティ マ ザ ー フ ァ ン ド | 千口 2,229,413 | 千口 1,630,425 | 千円 3,044,657 | 千円 3,044,657 |

(注) 口数・評価額の単位未満は切捨て。

○投資信託財産の構成

(2023年3月10日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|------------------------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 次 世 代 モ ビ リ ティ マ ザ ー フ ァ ン ド | 千円 3,044,657 | % 92.7 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 238,059 | 7.3 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 3,282,716 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

(注) 次世代モビリティマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（15,158,412千円）の投資信託財産総額（15,978,909千円）に対する比率は94.9%です。

(注) 外貨建資産は、当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。なお、邦貨換算レートは1米ドル＝136.01円、1ユーロ＝144.05円、1香港ドル＝17.32円、1韓国ウォン＝0.1028円です。

次世代モビリティオープン（為替ヘッジあり）

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2023年3月10日現在）

| 項 目 | 当 期 末 |
|----------------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 5,989,471,691 |
| コール・ローン等 | 218,058,934 |
| 次世代モビリティマザーファンド(評価額) | 3,044,657,267 |
| 未収入金 | 2,726,755,490 |
| (B) 負債 | 2,842,844,769 |
| 未払金 | 2,811,176,906 |
| 未払解約金 | 3,476,644 |
| 未払信託報酬 | 27,985,509 |
| 未払利息 | 186 |
| その他未払費用 | 205,524 |
| (C) 純資産総額(A－B) | 3,146,626,922 |
| 元本 | 2,393,540,449 |
| 次期繰越損益金 | 753,086,473 |
| (D) 受益権総口数 | 2,393,540,449口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 13,146円 |

(注) 計算期間末における1口当たりの純資産額は、1,3146円です。

(注) 当ファンドの期首元本額は2,683,395,587円、期中追加設定元本額は350,274,171円、期中一部解約元本額は640,129,309円です。

○損益の状況（2022年3月11日～2023年3月10日）

| 項 目 | 当 期 |
|--------------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 39,784 |
| 受取利息 | 657 |
| 支払利息 | △ 40,441 |
| (B) 有価証券売買損益 | △229,789,029 |
| 売買益 | 715,360,080 |
| 売買損 | △945,149,109 |
| (C) 信託報酬等 | △ 60,583,768 |
| (D) 当期繰越損益金(A+B+C) | △290,412,581 |
| (E) 前期繰越損益金 | 249,470,724 |
| (F) 追加信託差損益金 | 794,028,330 |
| (配当等相当額) | (216,416,507) |
| (売買損益相当額) | (577,611,823) |
| (G) 計(D+E+F) | 753,086,473 |
| (H) 収益分配金 | 0 |
| 次期繰越損益金(G+H) | 753,086,473 |
| 追加信託差損益金 | 794,028,330 |
| (配当等相当額) | (216,666,760) |
| (売買損益相当額) | (577,361,570) |
| 分配準備積立金 | 403,575,302 |
| 繰越損益金 | △444,517,159 |

(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(C)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(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定した価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 収益分配金

| 決算期 | 第5期 |
|------------------------------|--------------|
| (a) 配当等収益(費用控除後) | 0円 |
| (b) 有価証券等損益額(費用控除後、繰越欠損金補填後) | 0円 |
| (c) 信託約款に規定する収益調整金 | 349,511,171円 |
| (d) 信託約款に規定する分配準備積立金 | 403,575,302円 |
| 分配対象収益(a+b+c+d) | 753,086,473円 |
| 分配対象収益(1万口当たり) | 3,146円 |
| 分配金額 | 0円 |
| 分配金額(1万口当たり) | 0円 |

<お知らせ>

該当事項はございません。

用語解説

○資産、負債、元本及び基準価額の状況は、期末における資産、負債、元本及び基準価額の計算過程を表しています。主な項目の説明は次の通りです。

| 項目 | 説明 |
|---------------------|---|
| 資産 | ファンドが保有する財産の合計です。 |
| コール・ローン等 | 金融機関向けの安全性の高い短期貸付運用などの残高です。 |
| 各種有価証券等(評価額) | 組入れた株式・債券・ファンドなどの評価金額です。 |
| 未収入金 | 入金が予定されている有価証券の売却代金などです。 |
| 未取配当金 | 入金が予定されている株式の配当金等です。 |
| 未取利息 | 入金が予定されているコール・ローン等の利息や債券の利息の合計です。 |
| 負債 | 支払いが予定されている金額の合計です。 |
| 未払収益分配金 | 期末時点で支払いが予定されている収益分配金です。 |
| 未払解約金 | 支払いが予定されている解約金です。 |
| 未払信託報酬 | 支払いが予定されている信託報酬の額です。 |
| その他未払費用 | 支払いが予定されている監査費用、その他の費用です。 |
| 純資産総額(資産－負債) | ファンドが保有する財産の合計から支払いが予定されている金額の合計を差し引いたものです。 |
| 元本 | ファンド全体の元本残高です。 |
| 次期繰越損益金 | 純資産総額と元本の差額（翌期に繰り越す損益金の合計額）です。 |
| 受益権総口数 | 受益者が保有する受益権口数の合計です。 |
| 1(万)口当たり基準価額 | 1(万)口当たりのファンドの時価です。 |

用語解説

○損益の状況は、期中にファンドがどのような収益や損失を計上したかを表しています。主な項目の説明は次の通りです。

| 項目 | 説明 |
|-----------------|---|
| 配当等収益 | ファンドが受取った配当金・利息等の合計です。 |
| 受取配当金 | 保有する株式等の配当金等です。 |
| 受取利息 | 債券、コール・ローン等の利息等です。 |
| 有価証券売買損益 | 有価証券の売買損益と期末の評価損益の合計額です。 |
| 売買益 | 売買益と期末評価益の合計です。 |
| 売買損 | 売買損と期末評価損の合計です。 |
| 信託報酬等 | 信託報酬のほか保管費用、監査費用、その他の費用と、それらに掛かる消費税等相当額です。 |
| 当期損益金 | 当期における収支合計です。 |
| 前期繰越損益金 | 前期分の分配準備積立金と繰越損益金の合計額から当期中の解約に対する持分を控除した金額です。 |
| 追加信託差損益金 | 受益者がファンドに払い込んだ金額と元本との差額です。 |
| (配当等相当額) | 配当等に相当する額です。 |
| (売買損益相当額) | 売買損益に相当する額です。 |
| 計 | 収益分配前の期中の収支の総合計です。 |
| 収益分配金 | 期中の分配可能額から受益者に支払われる分配金です。 |
| 次期繰越損益金 | 翌期に繰り越す損益金の合計です。 |
| 追加信託差損益金 | 翌期に繰り越す追加信託差損益金です。 |
| (配当等相当額) | 配当等に相当する額です。 |
| (売買損益相当額) | 売買損益に相当する額です。 |
| 分配準備積立金 | 翌期に繰り越す分配準備積立金の額です。 |
| 繰越損益金 | 翌期に繰り越す損益金の額です。 |

次世代モビリティマザーファンド

第5期 運用状況のご報告

決算日：2023年3月10日

当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|--|
| 運用方針 | 主として、日本を含む世界の取引所上場株式（上場予定、DR（預託証券）を含みます。）のなかから、次世代モビリティに関連する企業の株式に投資を行い、投資信託財産の成長を目指して運用を行います。 |
| 主要投資対象 | 日本を含む世界の取引所上場株式（上場予定、DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とします。 |
| 投資制限 | 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。外貨建資産へ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 | | MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス (円換算ベース) | | 株式 組入比率 | 株式 先物比率 | 投資信託証券 組入比率 | 純資産 総額 |
|---------------------|-------------|--------|---|-------------|------------|------------|----------------|--------------|
| | 期 騰 落 | 中 率 | (参考指数) | 期 騰 落 | | | | |
| (設定日) 2018年3月27日 | 円 10,000 | % — | ポイント 438.65 | % — | % — | % — | % — | 百万円 6,580 |
| 1期 (2019年3月11日) | 9,081 | △ 9.2 | 453.06 | 3.3 | 96.8 | — | — | 16,514 |
| 2期 (2020年3月10日) | 8,457 | △ 6.9 | 404.18 | △10.8 | 92.5 | — | 2.0 | 8,287 |
| 3期 (2021年3月10日) | 16,679 | 97.2 | 594.13 | 47.0 | 95.1 | — | — | 20,957 |
| 4期 (2022年3月10日) | 17,201 | 3.1 | 641.59 | 8.0 | 94.6 | — | — | 19,440 |
| 5期 (2023年3月10日) | 18,674 | 8.6 | 701.34 | 9.3 | 96.9 | — | — | 15,870 |

(注) 基準価額は1万円当たり。

(注) 設定日の基準価額および純資産総額は当初設定元本。

(注) MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス (円換算ベース) は当ファンドの参考指数であり、ベンチマークではありません。

MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス (円換算ベース) は当該日前営業日の現地終値です。

(注) 株式先物比率=買建比率-売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス (円換算ベース) (参考指数) | | 株 式 組 入 比 率 | 株 式 先 物 比 率 | 投 資 信 託 証 券 組 入 比 率 |
|----------------------|-------------|--------|--|--------|----------------|----------------|------------------------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | | |
| (期 首) 2022年 3月10日 | 円 17,201 | % — | ポイント 641.59 | % — | % 94.6 | % — | % — |
| 3月末 | 19,891 | 15.6 | 724.77 | 13.0 | 95.5 | — | — |
| 4月末 | 17,457 | 1.5 | 691.20 | 7.7 | 95.9 | — | — |
| 5月末 | 17,543 | 2.0 | 690.61 | 7.6 | 97.3 | — | — |
| 6月末 | 16,649 | △ 3.2 | 680.23 | 6.0 | 96.8 | — | — |
| 7月末 | 18,480 | 7.4 | 698.68 | 8.9 | 96.3 | — | — |
| 8月末 | 18,883 | 9.8 | 705.83 | 10.0 | 96.4 | — | — |
| 9月末 | 17,488 | 1.7 | 664.47 | 3.6 | 94.3 | — | — |
| 10月末 | 18,274 | 6.2 | 715.61 | 11.5 | 96.1 | — | — |
| 11月末 | 17,612 | 2.4 | 703.75 | 9.7 | 97.3 | — | — |
| 12月末 | 15,699 | △ 8.7 | 666.54 | 3.9 | 96.1 | — | — |
| 2023年 1月末 | 17,350 | 0.9 | 691.40 | 7.8 | 97.4 | — | — |
| 2月末 | 18,820 | 9.4 | 707.13 | 10.2 | 97.8 | — | — |
| (期 末) 2023年 3月10日 | 18,674 | 8.6 | 701.34 | 9.3 | 96.9 | — | — |

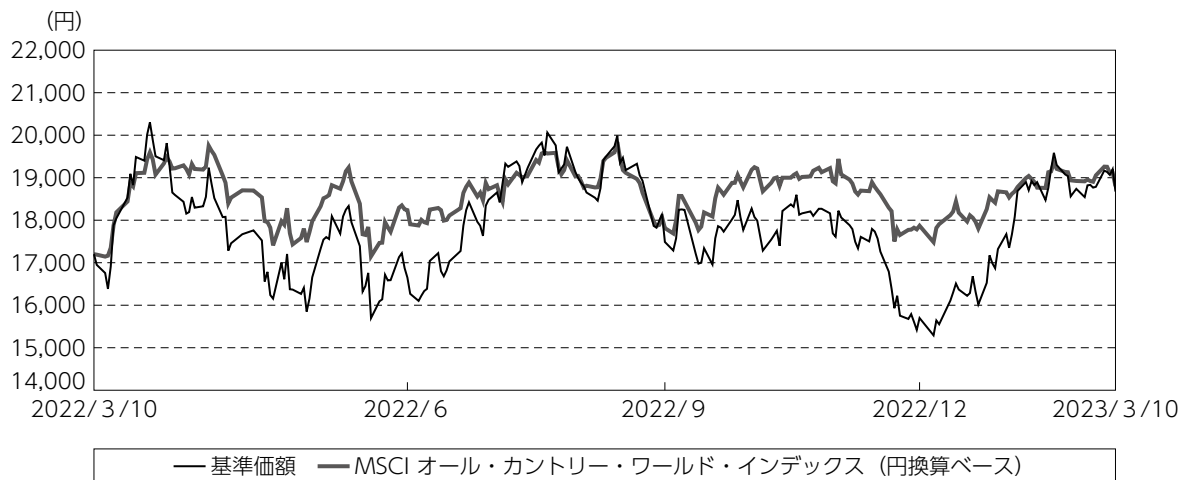
(注) 騰落率は期首比。

MSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス (円換算ベース) はMSCI Inc.が算出している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

運用経過

期中の基準価額等の推移

(2022年3月11日～2023年3月10日)



(注) 参考指数は、MSCI オール・カントリー・ワールド・インデックス (円換算ベース) です。

(注) 参考指数は、期首 (2022年3月10日) の値が基準価額と同一となるように指数化しております。

○基準価額の主な変動要因

当ファンドにおける主なプラス要因およびマイナス要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・半導体株や、自動車・自動車部品株の上昇などがプラスに寄与しました。
- ・個別銘柄では、オン・セミコンダクターや、フェラーリ、STマイクロエレクトロニクスなどの上昇がプラスに寄与しました。
- ・為替市場で円が海外通貨に対して下落 (円安) したことがプラスに寄与しました。

(主なマイナス要因)

- ・メディア・娯楽株や、小売株の下落などがマイナスに影響しました。
- ・個別銘柄では、テスラや、アルファベット、ウルフスピードなどの下落がマイナスに影響しました。

投資環境

(2022年3月11日～2023年3月10日)

世界株式市場は、2022年3月中旬から10月中旬にかけては、高いインフレ率を背景に世界的に金融引き締め動きが強まったことから下落しました。10月下旬から2023年3月上旬にかけては、市場予想を上回る良好な企業業績が好感された一方、金融引き締めの長期化懸念が重石となり、上下にもみ合いの動きとなりました。地域別では、欧州株が世界株式市場をアウトパフォームした一方、米国株はアンダーパフォームしました。

モビリティ関連株式は、部品の供給不足が緩和された半導体・半導体製造装置株が上昇しました。一方、年間販売台数が目標に届かなかった大手電気自動車株は下落しました。

当ファンドのポートフォリオ

(2022年3月11日～2023年3月10日)

当ファンドは、主として日本を含む世界の取引所上場株式（DR（預託証券）を含みます。）から、次世代モビリティに関連する企業に投資を行います。また、TCWインベストメント・マネジメント・カンパニーからの投資助言を参考に、投資環境や業績動向などを勘案して銘柄選別を行います。

運用状況につきましては、自動車・自動車部品株や、半導体株を高位にウェイト付けたポートフォリオで運用しました。2022年10月から期末にかけて、サプライチェーン（供給網）の正常化が業績に追い風となる自動車・自動車部品株、および資本財株の買い付けを行い、ウェイトを引き上げました。一方、業績の下方修正懸念が高まったメディア・娯楽株や、小売株のウェイトを引き下げました。

株式組入比率は、概ね高位を維持しました。組入外貨建資産につきましては、運用の基本方針に則り、為替ヘッジは行いませんでした。

当ファンドのベンチマークとの差異

(2022年3月11日～2023年3月10日)

当ファンドは特定のベンチマークを設けておりませんが、当ファンドの基準価額の騰落率は、参考指数としているMSCI オール・カンントリー・ワールド・インデックス（円換算ベース）の騰落率を0.7%下回りました。詳細につきましては前掲の「基準価額の主な変動要因」をご参照ください。

今後の運用方針**(投資環境)**

世界株式市場は、米国において一部の地方銀行が破綻するなど、金融システムに対する不安が高まっていることから、短期的には不安定な展開が続くものと予想されます。その後、2023年後半以降は、金融システム不安の鎮静化や、金融緩和期待の高まりにより、株価は上昇に転じると予想されます。

モビリティ関連銘柄は、部品不足が解消されつつある自動車・自動車部品株や、半導体株を中心に底堅い展開が想定されます。

(運用方針)

TCWインベストメント・マネジメント・カンパニーからの投資助言を参考に、投資環境や業績動向などを勘案して銘柄選別を行います。引き続き、次世代モビリティ分野の市場拡大が、成長ドライバーとなる銘柄を高位にウェイト付けする方針です。業種としては、半導体株や、自動車・自動車部品株、ソフトウェア・サービス株を高位にウェイト付けします。

株式組入比率については、引き続き高位を維持する方針です。また、組入外貨建資産については、運用の基本方針に則り、為替ヘッジは行わない方針です。

○1万口当たりの費用明細

(2022年3月11日～2023年3月10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 13 (13) | % 0.070 (0.070) | (a) 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 |
| (b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) | 1 (1) | 0.006 (0.006) | (b) 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 |
| (c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他) | 4 (4) (0) | 0.021 (0.021) (0.000) | (c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、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 その他は、金銭信託支払手数料等 |
| 合 計 | 18 | 0.097 | |
| 期中の平均基準価額は、17,845円です。 | | | |

(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) 各金額において基準価額は円未満切捨て、その他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

(2022年3月11日～2023年3月10日)

株式

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|----|------|------------------------|--------------------------|-------------|-----------------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 国内 | 上場 | 千株 — | 千円 — | 千株 35 | 千円 279,876 |
| 外 | アメリカ | 百株 6,823 (1,329) | 千米ドル 31,515 (△ 55) | 百株 9,149 | 千米ドル 57,009 |
| | ユーロ | | 千ユーロ | | 千ユーロ |
| | ドイツ | 290 | 2,437 | 470 | 2,917 |
| | オランダ | 30 | 112 | 335 | 2,259 |
| 国 | 香港 | 1,180 (188) | 千香港ドル 15,084 (—) | 4,800 | 千香港ドル 26,984 |

(注) 金額は受渡代金。

(注) 単位未満は切捨て。

(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

(2022年3月11日～2023年3月10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 | 14,174,296千円 |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 16,931,026千円 |
| (c) 売 買 高 比 率(a)／(b) | 0.83 |

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

○利害関係人との取引状況等

(2022年3月11日～2023年3月10日)

利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等 A | | | 売付額等 C | | |
|-----|--------------------|---------------|----------|--------------------|---------------|----------|
| | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ | |
| 株 式 | 百万円 4,907 | 百万円 271 | % 5.5 | 百万円 9,266 | 百万円 148 | % 1.6 |

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目 | 当 期 |
|----------------------------|----------|
| 売 買 委 託 手 数 料 総 額(A) | 12,335千円 |
| う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額(B) | 409千円 |
| (B)／(A) | 3.3% |

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あり、当ファンドに係る利害関係人とはOKASAN SECURITIES TOKYO/JAPANです。

○組入資産の明細

(2023年3月10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 (49.3%) | | | |
| 日本電産 | 46 | 28 | 191,072 |
| 輸送用機器 (50.7%) | | | |
| デンソー | 43 | 26 | 196,222 |
| 合 計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 89 | 54 387,294 |
| | | 2 | 2 <2.4%> |

(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) 合計欄の< >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 | |
| WOLFSPEED INC | 660 | 500 | 3,371 | 458,557 | 半導体・半導体製造装置 |
| EATON CORP PLC | — | 220 | 3,836 | 521,753 | 資本財 |
| FORD MOTOR CO | 2,420 | 1,600 | 1,992 | 270,931 | 自動車・自動車部品 |
| GENERAL MOTORS CO | 780 | 580 | 2,193 | 298,346 | 自動車・自動車部品 |
| AMERICAN AXLE & MFG HOLDINGS | — | 700 | 602 | 81,973 | 自動車・自動車部品 |
| MAGNA INTERNATIONAL INC | 370 | 220 | 1,190 | 161,938 | 自動車・自動車部品 |
| BORGWARNER INC | 260 | — | — | — | 自動車・自動車部品 |
| TE CONNECTIVITY LTD | 290 | 210 | 2,689 | 365,766 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| APTIV PLC | 425 | 340 | 3,856 | 524,538 | 自動車・自動車部品 |
| NIO INC - ADR | 400 | — | — | — | 自動車・自動車部品 |
| UBER TECHNOLOGIES INC | 1,200 | 880 | 2,844 | 386,834 | 運輸 |
| WORKIVA INC | — | 70 | 616 | 83,801 | ソフトウェア・サービス |
| NEW RELIC INC | — | 90 | 653 | 88,893 | ソフトウェア・サービス |
| CARVANA CO | 205 | — | — | — | 小売 |
| DXC TECHNOLOGY CO | — | 190 | 501 | 68,196 | ソフトウェア・サービス |
| AMAZON.COM INC | 12 | 190 | 1,752 | 238,391 | 小売 |
| ANALOG DEVICES INC | — | 150 | 2,753 | 374,489 | 半導体・半導体製造装置 |
| ANSYS INC | 134 | 95 | 2,852 | 387,912 | ソフトウェア・サービス |
| AUTODESK INC | 160 | 120 | 2,405 | 327,223 | ソフトウェア・サービス |

次世代モビリティマザーファンド

| 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 | | |
| ALPHABET INC-CL A | 49 | 620 | 5,723 | 778,499 | メディア・娯楽 | |
| MARVELL TECHNOLOGY INC | 170 | — | — | — | 半導体・半導体製造装置 | |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC | 300 | 275 | 2,289 | 311,415 | 半導体・半導体製造装置 | |
| NVIDIA CORP | 380 | 285 | 6,679 | 908,446 | 半導体・半導体製造装置 | |
| QUALCOMM INC | 390 | 280 | 3,282 | 446,406 | 半導体・半導体製造装置 | |
| ADVANCED MICRO DEVICES | 100 | — | — | — | 半導体・半導体製造装置 | |
| SYNAPTICS INC | 53 | — | — | — | 半導体・半導体製造装置 | |
| DIGI INTERNATIONAL INC | — | 190 | 632 | 86,079 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| GENTEX CORP | 580 | 380 | 1,047 | 142,492 | 自動車・自動車部品 | |
| LATTICE SEMICONDUCTOR CORP | 210 | 140 | 1,246 | 169,525 | 半導体・半導体製造装置 | |
| ON SEMICONDUCTOR | 920 | 670 | 5,454 | 741,862 | 半導体・半導体製造装置 | |
| MICROSOFT CORP | 210 | 135 | 3,406 | 463,293 | ソフトウェア・サービス | |
| INTEL CORP | 540 | — | — | — | 半導体・半導体製造装置 | |
| APPLE INC | 400 | 235 | 3,538 | 481,321 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| ADOBE INC | 72 | — | — | — | ソフトウェア・サービス | |
| BROADCOM INC | 20 | — | — | — | 半導体・半導体製造装置 | |
| VISTEON CORP | 180 | 160 | 2,645 | 359,806 | 自動車・自動車部品 | |
| NXP SEMICONDUCTORS NV | 340 | 250 | 4,495 | 611,466 | 半導体・半導体製造装置 | |
| TESLA INC | 167 | 370 | 6,398 | 870,197 | 自動車・自動車部品 | |
| ENPHASE ENERGY INC | 160 | 55 | 1,187 | 161,467 | 半導体・半導体製造装置 | |
| AMBARELLA INC | — | 140 | 1,126 | 153,188 | 半導体・半導体製造装置 | |
| MONGODB INC | — | 40 | 838 | 114,014 | ソフトウェア・サービス | |
| RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A | 90 | 140 | 203 | 27,667 | 自動車・自動車部品 | |
| MOBILEYE GLOBAL INC-A | — | 1,220 | 4,956 | 674,182 | 自動車・自動車部品 | |
| ACV AUCTIONS INC-A | 380 | — | — | — | 商業・専門サービス | |
| SIGMA LITHIUM CORP | — | 120 | 408 | 55,541 | 素材 | |
| NUTANIX INC - A | — | 170 | 423 | 57,596 | ソフトウェア・サービス | |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 | 13,027 | 12,030 | 90,096 | 12,254,019 | |
| | 銘柄数 < 比率 > | 34 | 36 | — | <77.2%> | |
| (ユーロ・・・ドイツ) | | | | 千ユーロ | | |
| VOLKSWAGEN AG | 160 | 70 | 1,249 | 179,940 | 自動車・自動車部品 | |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG | 1,360 | 1,030 | 3,693 | 531,986 | 半導体・半導体製造装置 | |
| DR ING HC F PORSCHE AG | — | 240 | 2,784 | 401,035 | 自動車・自動車部品 | |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 | 1,520 | 1,340 | 7,726 | 1,112,961 | |
| | 銘柄数 < 比率 > | 2 | 3 | — | <7.0%> | |
| (ユーロ・・・オランダ) | | | | | | |
| STMICROELECTRONICS NV | 1,090 | 850 | 3,998 | 575,969 | 半導体・半導体製造装置 | |

次世代モビリティマザーファンド

| 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 |
| (ユーロ・・・オランダ) FERRARI NV | | 百株 200 | 百株 135 | 千ユーロ 3,414 | 千円 491,808 | 自動車・自動車部品 | |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 | 1,290 | 985 | 7,412 | 1,067,777 | | |
| | 銘柄数<比率> | 2 | 2 | — | <6.7%> | | |
| ユーロ計 | 株 数 ・ 金 額 | 2,810 | 2,325 | 15,138 | 2,180,739 | | |
| | 銘柄数<比率> | 4 | 5 | — | <13.7%> | | |
| (香港) | | | | 千香港ドル | | | |
| BYD CO LTD-H | | 320 | 230 | 5,037 | 87,240 | 自動車・自動車部品 | |
| GREAT WALL MOTOR COMPANY-H | | 2,900 | — | — | — | 自動車・自動車部品 | |
| BAIDU INC-CLASS A | | 600 | 320 | 4,403 | 76,263 | メディア・娯楽 | |
| XPENG INC - CLASS A SHARES | | 450 | — | — | — | 自動車・自動車部品 | |
| NIO INC-CLASS A | | — | 280 | 1,993 | 34,529 | 自動車・自動車部品 | |
| GANFENG LITHIUM GROUP CO L-H | | 650 | 658 | 3,582 | 62,054 | 素材 | |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 | 4,920 | 1,488 | 15,016 | 260,087 | | |
| | 銘柄数<比率> | 5 | 4 | — | <1.6%> | | |
| (韓国) | | | | 千韓国ウォン | | | |
| LG CHEM LTD | | 40 | 40 | 2,840,000 | 291,952 | 素材 | |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 | 40 | 40 | 2,840,000 | 291,952 | | |
| | 銘柄数<比率> | 1 | 1 | — | <1.8%> | | |
| 合 計 | 株 数 ・ 金 額 | 20,797 | 15,883 | — | 14,986,798 | | |
| | 銘柄数<比率> | 44 | 46 | — | <94.4%> | | |

(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捨て。

○投資信託財産の構成

(2023年3月10日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 株 式 | 千円 15,374,092 | % 96.2 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 604,817 | 3.8 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 15,978,909 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

(注) 当期末における外貨建純資産(15,158,412千円)の投資信託財産総額(15,978,909千円)に対する比率は94.9%です。

(注) 外貨建資産は、当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。なお、邦貨換算レートは1米ドル=136.01円、1ユーロ=144.05円、1香港ドル=17.32円、1韓国ウォン=0.1028円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年3月10日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|------------------|
| (A) 資産 | 16,072,518,822 円 |
| コール・ローン等 | 451,857,184 |
| 株式(評価額) | 15,374,092,307 |
| 未収入金 | 235,190,218 |
| 未収配当金 | 11,379,113 |
| (B) 負債 | 201,661,687 |
| 未払金 | 141,659,414 |
| 未払解約金 | 60,000,000 |
| 未払利息 | 329 |
| その他未払費用 | 1,944 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 15,870,857,135 |
| 元本 | 8,499,086,677 |
| 次期繰越損益金 | 7,371,770,458 |
| (D) 受益権総口数 | 8,499,086,677口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 18,674円 |

(注) 計算期間末における1口当たりの純資産額は、1.8674円です。

(注) 当ファンドの期首元本額は11,301,646,200円、期中追加設定元本額は554,993,862円、期中一部解約元本額は3,357,553,385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、以下の通りです。

次世代モビリティオープン (為替ヘッジなし)

6,868,660,808円

次世代モビリティオープン (為替ヘッジあり)

1,630,425,869円

○損益の状況 (2022年3月11日~2023年3月10日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|----------------|
| (A) 配当等収益 | 145,774,112 円 |
| 受取配当金 | 145,962,242 |
| 受取利息 | △ 4,720 |
| その他収益金 | 1,878 |
| 支払利息 | △ 185,288 |
| (B) 有価証券売買損益 | 1,333,297,331 |
| 売買益 | 4,877,684,739 |
| 売買損 | △3,544,387,408 |
| (C) その他費用等 | △ 3,652,755 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 1,475,418,688 |
| (E) 前期繰越損益金 | 8,138,792,247 |
| (F) 追加信託差損益金 | 435,006,138 |
| (G) 解約差損益金 | △2,677,446,615 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 7,371,770,458 |
| 次期繰越損益金(H) | 7,371,770,458 |

(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>

該当事項はございません。