

グローバル・モビリティ・サービス株式ファンド（1年決算型）

〈愛称 グローバルMaas（1年決算型）〉

追加型投信／内外／株式

交付運用報告書

第2期（決算日2020年1月20日）

作成対象期間（2019年1月22日～2020年1月20日）

第2期末（2020年1月20日）	
基準価額	10,584円
純資産総額	54,904百万円
第2期	
騰落率	27.7%
分配金（税込み）合計	0円

（注）騰落率は分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

（注）純資産総額の単位未満は切捨てて表示しております。

○交付運用報告書は、運用報告書に記載すべき事項のうち重要なものを記載した書面です。その他の内容については、運用報告書（全体版）に記載しております。

○当ファンドは、投資信託約款において運用報告書（全体版）に記載すべき事項を、電磁的方法によりご提供する旨を定めております。運用報告書（全体版）は、下記の手順にて閲覧・ダウンロードいただけます。

<運用報告書（全体版）の閲覧・ダウンロード方法>

右記URLにアクセス ⇒ ファンド検索機能を利用して該当ファンドのページを表示 ⇒ 運用報告書タブを選択 ⇒ 該当する運用報告書をクリックしてPDFファイルを表示

○運用報告書（全体版）は、受益者の方からのご請求により交付されます。交付をご請求される方は、販売会社までお問い合わせください。

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申し上げます。

さて、「グローバル・モビリティ・サービス株式ファンド（1年決算型）」は、2020年1月20日に第2期の決算を行ないました。

当ファンドは、主として、「グローバル・モビリティ・サービス株式マザーファンド」受益証券に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行なっております。

ここに、当作成対象期間の運用経過等についてご報告申し上げます。

今後とも一層のお引き立てを賜りますようお願い申し上げます。

<643963>

日興アセットマネジメント株式会社

東京都港区赤坂九丁目7番1号
www.nikkoam.com/

当運用報告書に関するお問い合わせ先

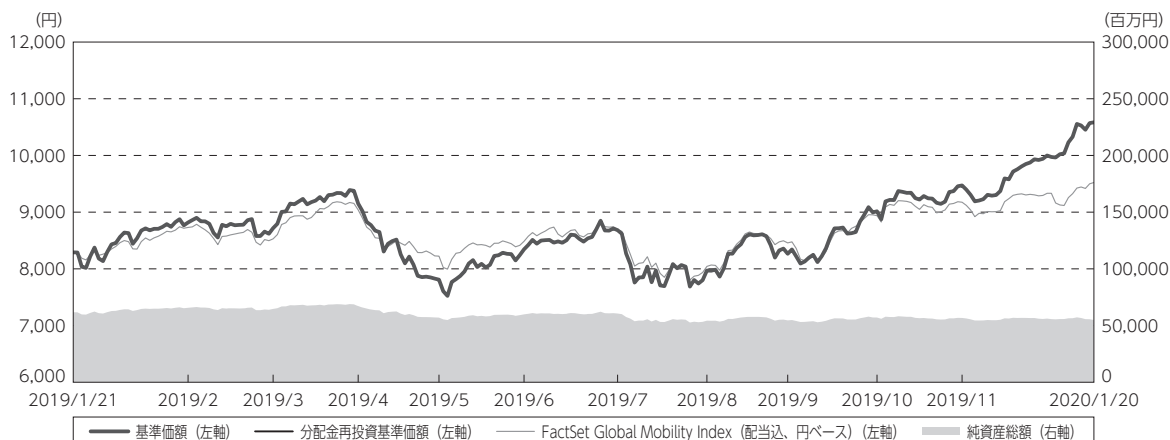
コールセンター 電話番号：0120-25-1404
午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

●お取引状況等についてはご購入された販売会社にお問い合わせください。

運用経過

期中の基準価額等の推移

（2019年1月22日～2020年1月20日）



期首：8,291円

期末：10,584円（既払分配金（税込み）：0円）

騰落率：27.7%（分配金再投資ベース）

(注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）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) 分配金再投資基準価額およびFactSet Global Mobility Index（配当込、円ベース）は、期首（2019年1月21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。

(注) FactSet Global Mobility Index（配当込、円ベース）は当ファンドの参考指数です。

○基準価額の主な変動要因

当ファンドは、主として、日本を含む世界各国の金融商品取引所に上場されているモビリティ・サービス関連企業の株式に実質的に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行なっております。当作成期間中における基準価額の主な変動要因は、以下の通りです。

<値上がり要因>

- ・米国連邦準備制度理事会（FRB）が、それまでの金融政策の方向を転換し、政策金利を引き下げたこと。
- ・米中貿易交渉の進捗に対する期待が高まったこと（期間の初め～2019年4月下旬）や、米中貿易交渉での「第1段階」の部分合意がなされたこと（2019年10月中旬～期間末）。
- ・主要国の購買担当者景気指数（PMI）が安定化し、世界景気の減速懸念が和らいだこと。
- ・生産能力の高さや自動車用バッテリー技術の競争力、設備投資の効率性などが株式市場で評価され、ポートフォリオで保有するTesla, Inc.の株価が上昇したこと。

＜値下がり要因＞

- ・米中間の対立が激化し、米中貿易摩擦が一段と激化したこと（2019年5月上旬～10月上旬）。
- ・香港情勢への警戒感が高まったこと。

1万口当たりの費用明細

(2019年1月22日～2020年1月20日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	167	1.920	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(81)	(0.932)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(81)	(0.932)	運用報告書など各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供などの対価
（ 受 託 会 社 ）	(5)	(0.055)	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	2	0.023	(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
（ 株 式 ）	(2)	(0.023)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	1	0.011	(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
（ 株 式 ）	(1)	(0.011)	
(d) そ の 他 費 用	3	0.036	(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 ）	(2)	(0.017)	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 ）	(0)	(0.004)	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
（ 印 刷 費 用 ）	(1)	(0.014)	印刷費用は、法定開示資料の印刷に係る費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理等に要するその他の諸費用
合 計	173	1.990	
期中の平均基準価額は、8,709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。

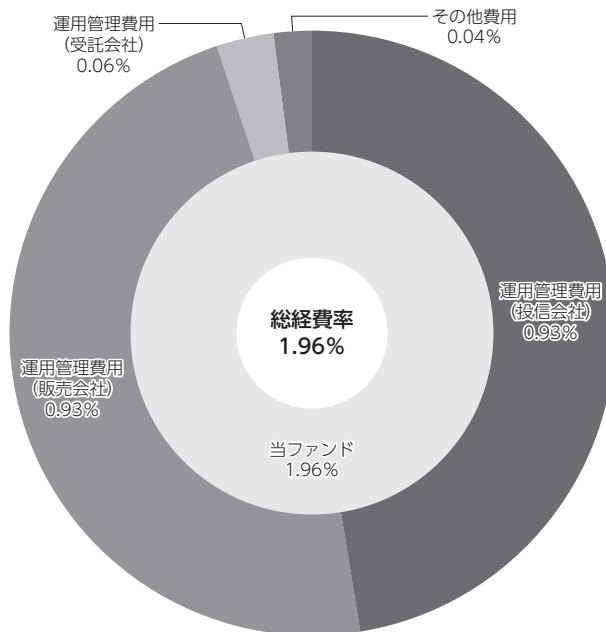
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものをみます。

(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1.96%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。

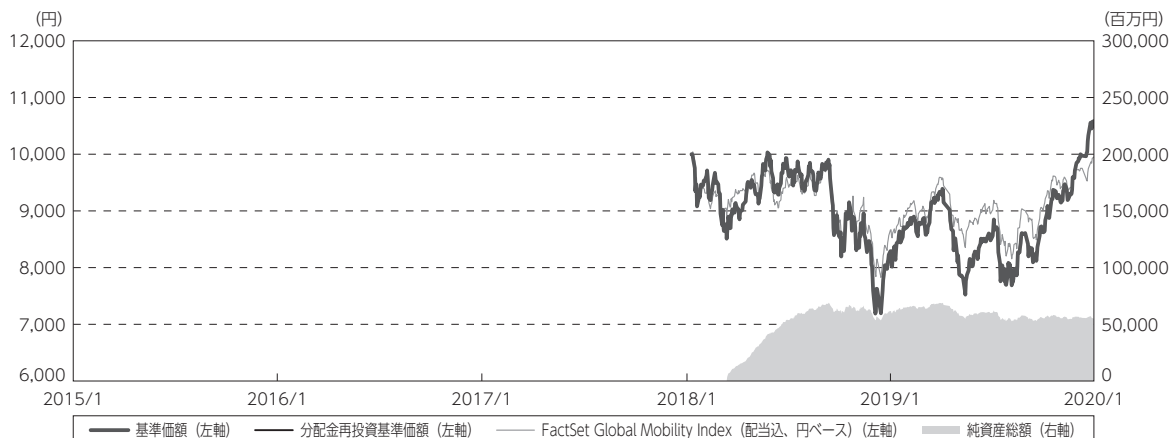
(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、親投資信託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。

最近5年間の基準価額等の推移

(2015年1月20日～2020年1月20日)



- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）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) FactSet Global Mobility Index（配当込、円ベース）は、設定時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) 当ファンドの設定日は2018年1月31日です。

	2018年1月31日 設定日	2019年1月21日 決算日	2020年1月20日 決算日
基準価額 (円)	10,000	8,291	10,584
期間分配金合計 (税込み) (円)	—	0	0
分配金再投資基準価額騰落率 (%)	—	△ 17.1	27.7
FactSet Global Mobility Index (配当込、円ベース) 騰落率 (%)	—	△ 13.4	14.9
純資産総額 (百万円)	100	61,717	54,904

- (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。
 (注) 純資産総額の単位未満は切捨てて表示しております。
 (注) 騰落率は1年前の決算応当日との比較です。
 ただし、設定日の基準価額は設定当初の金額、純資産総額は設定当初の元本額を表示しており、2019年1月21日の騰落率は設定当初との比較です。
 (注) FactSet Global Mobility Index（配当込、円ベース）は当ファンドの参考指数です。
 参考指数は投資対象資産の相場を説明する代表的な指数として記載しているものです。

投資環境

(2019年1月22日～2020年1月20日)

(株式市況)

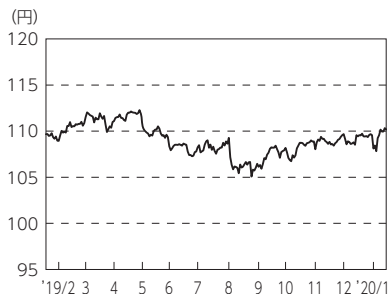
期間中の世界の主要株式市場は総じて上昇しました。

期間の初めから2019年4月下旬にかけては、米国企業の2018年第4四半期の決算内容が概して良好であったことや、米中間の貿易交渉の進捗に対する期待が高まったこと、中国が財政および金融面でさらなる景気刺激に動いたことなどを背景に、世界の主要株式市場は総じて上昇しました。加えて、F R Bが、発表される経済指標に基づいて忍耐強い政策運営を継続するとの判断を示し、さらなる利上げを見送ったことなども、株式市場に安心感をもたらしました。5月上旬から10月上旬にかけては、欧州中央銀行（E C B）やF R Bによる政策金利の引き下げなどが株式市場の支援要因となった一方、米国大統領による対中制裁関税「第4弾」の発動表明に対し、中国が米国からの農産品購入の一時停止を発表するなど米中貿易摩擦が一段と激化したことや、香港情勢への警戒感などが下落要因となり、株価は一進一退の動きとなりました。10月中旬から期間末にかけては、新たに浮上した楽観論が株式市場で支配的となり、株価は総じて一段の上昇を見せました。米中貿易協議で「第1段階」の部分合意がなされたことや、主要国のP M Iが安定化するなかで、世界景気の減速懸念が和らいだことや、英国総選挙での与党保守党の大勝で欧州の政治的不透明感が後退したことなどから、投資家のリスク選好姿勢が強まりました。

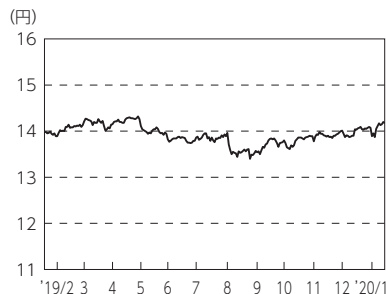
(為替市況)

期間中における主要通貨（対円）は、下記の推移となりました。

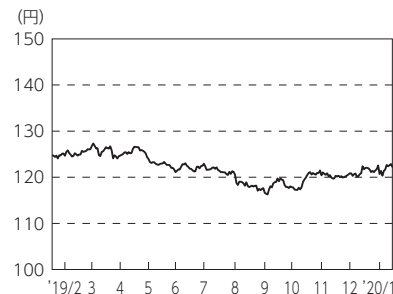
円／アメリカドルの推移



円／香港ドルの推移



円／ユーロの推移



当ファンドのポートフォリオ

（2019年1月22日～2020年1月20日）

（当ファンド）

当ファンドは、「グローバル・モビリティ・サービス株式マザーファンド」受益証券を高位に組み入れて運用を行ないました。

（グローバル・モビリティ・サービス株式マザーファンド）

期間中の主な投資行動は以下の通りです。

人工知能（AI）チップのシミュレーション分野でリーディング企業となる可能性があるSynopsys, Inc.や、小型航空機に緊急事態が発生した際、自動着陸が可能になる新製品を発表したGarmin Ltd.などを買付けました。また、小型荷物配送でドローンを活用したサービスで重要な企業となる可能性のあるUnited Parcel Service, Inc.が、米国連邦航空局からドローン配送サービスの部分的な認可を受けたことなどを受けて、当該銘柄を購入しました。当ファンドでは、ドローン配送の全世界の売上高が2030年までに4,000億～5,000億米ドルに達し、そのうち米国は600～700億ドルを占めると試算しています。第2四半期の決算発表後に株価が下落したAutodesk, Inc.についても、新規に買付けました。経営陣は中国やドイツ、ブレグジット（英国の欧州連合（EU）離脱）情勢に対する慎重姿勢から、販売見通しを引き下げましたが、次世代自動のジェネレーティブデザインで同社は重要な企業になるとの中長期的な見方は依然として有効とみられます。

一方、経営陣が補助金なしでは電気自動車は軌道に乗るかは確かでないと言ったことや、決算会見で電気自動車と自動運転車の開発を経営の優先事項とする様子がうかがえなかったことからPACCAR, Inc.を売却したほか、既存の自動車メーカーと同様の開発スケジュールをもち、自動運転車の戦略が過度に慎重であると判断したVeoneer, Inc.などを売却しました。

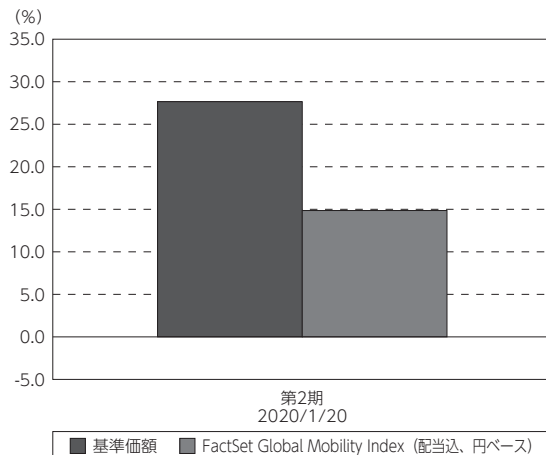
当ファンドのベンチマークとの差異

（2019年1月22日～2020年1月20日）

当ファンドの運用の目標となるベンチマークを設けておりません。

グラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率です。

基準価額と参考指数の対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税込み）込みです。
 (注) FactSet Global Mobility Index（配当込、円ベース）は当ファンドの参考指数です。

分配金

（2019年1月22日～2020年1月20日）

分配金は、基準価額水準、市況動向などを勘案し、以下のとおりといたしました。なお、分配金に充当しなかった収益につきましては、信託財産内に留保し、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20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	1,296

(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、「グローバル・モビリティ・サービス株式マザーファンド」受益証券を原則として高位に組み入れて運用を行ないます。

（グローバル・モビリティ・サービス株式マザーファンド）

ARK社では、自動運転による「サービスとしてのモビリティ（Ma a S）」が、中長期的に公開株式市場で最も生産的な投資機会の1つになる可能性があると考えます。自動運転による「サービスとしてのモビリティ」は、自動運転のタクシー・プラットフォームにより2地点間の移動をより安く、より便利に、より安全なものとする個人的なMa a Sから、自動運転の電気トラックとドローンにより、現在に比べてごくわずかなコストで納品できる「サービスとしての物流」にまで及びます。このようなプラットフォームから経済的生産性の変革促進が加速し、結果的に伝統的な自動車業界が組み込まれるとみられます。技術主導によるイノベーションと費用曲線の低下に関連する若干のデフレ圧力から、自動運転による「サービスとしてのモビリティ」のプラットフォームを開発または可能にする企業については、売上数量の伸び、生産性、収益性が高まると考えられます。このような企業は次第に、人工知能の専門知識、生産能力、ライドシェアリングの提携関係に基づく戦略から恩恵を受けることとなります。これとは対照的に、多くの従来型の自動車製造企業は、実店舗だけの小売店がこの10年間に経験したことと全く同様のバリュートラップに陥ると考えられます。当ファンドでは、自動運転による「サービスとしてのモビリティ」のプラットフォームへと転換できる自動車企業とテクノロジー企業に投資し、その恩恵を享受できるよう努めていきます。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

お知らせ

2019年1月22日から2020年1月20日までの期間に実施いたしました約款変更は以下の通りです。

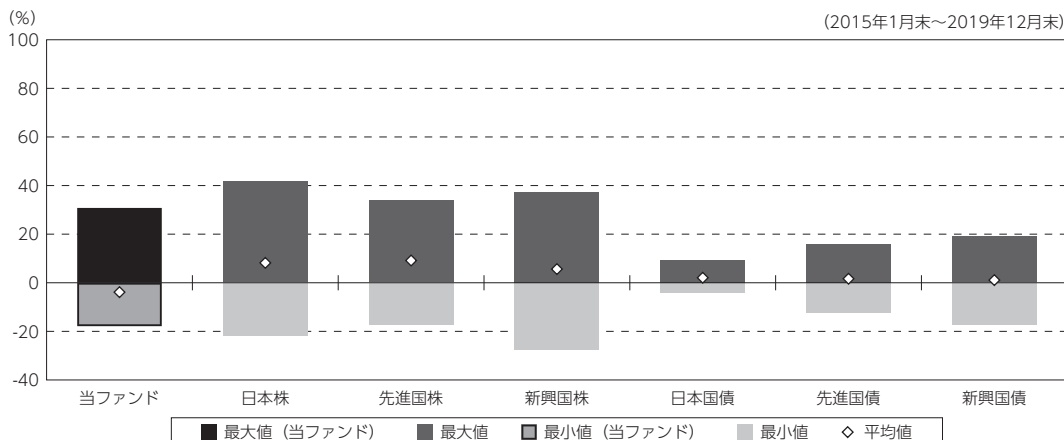
当社ホームページにおいて、より高い安全性を確保するためのセキュリティ対策としてHTTPS化を実施することに伴ない、当ファンドの信託約款における当社ホームページURLの表示を「www.nikkoam.com/」へ変更するべく、2019年4月20日付けにて信託約款に所要の変更を行ないました。（第59条、第60条）

当ファンドの概要

商品分類	追加型投信／内外／株式	
信託期間	2018年1月31日から2028年1月20日までです。	
運用方針	主として、「グローバル・モビリティ・サービス株式マザーファンド」受益証券に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	グローバル・モビリティ・サービス株式ファンド（1年決算型）	「グローバル・モビリティ・サービス株式マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。
	グローバル・モビリティ・サービス株式マザーファンド	日本を含む世界の金融商品取引所上場株式（預託証券を含みます。）を主要投資対象とします。
運用方法	主として、日本を含む世界各国の金融商品取引所に上場されているモビリティ・サービス関連企業の株式に実質的に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行ないます。株式の銘柄選定にあたっては、各企業の成長性、収益性、財務健全性、流動性などを勘案して行ないます。株式の実質組入比率は、高位を維持することを基本とします。外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。	
分配方針	毎決算時、原則として分配対象額のなかから、基準価額水準、市況動向などを勘案して分配を行なう方針です。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。	

（参考情報）

○当ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



(単位:%)

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	30.8	41.9	34.1	37.2	9.3	15.9	19.3
最小値	△ 17.9	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値	△ 3.9	8.2	9.2	5.6	2.1	1.7	1.1

(注) 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

(注) 2015年1月から2019年12月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドは2019年1月以降の年間騰落率を用いております。

(注) 上記の騰落率は決算日に対応した数値とは異なります。

(注) 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

《各資産クラスの指数》

日本株：東証株価指数（TOPIX、配当込）

先進国株：MSCI-KOKUSAIインデックス（配当込、円ベース）

新興国株：MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込、円ベース）

日本国債：NOMURA-BPI国債

先進国債：FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

新興国債：JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド（円ヘッジなし、円ベース）

(注) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

当ファンドの参考指数について

●FactSet Global Mobility Index（配当込、円ベース）

FactSet Global Mobility Indexは、ファクトセット社が開発した世界のモビリティ製造およびサービス関連企業の株式で構成された指数です。主にモビリティ製造、小売およびサービス、旅客運送、貨物輸送及び物流、モビリティ拡張技術関連の企業を中心としています。

指数について

●東証株価指数（TOPIX、配当込）は、東京証券取引所第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、東京証券取引所に帰属します。●MSCI-KOKUSAIインデックス（配当込、円ベース）は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当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。●MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込、円ベース）は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当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。●NOMURA-BPI国債は、野村証券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。●FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。なお、当指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利は、FTSE Fixed Income LLCに帰属します。●JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド（円ヘッジなし、円ベース）は、J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、当指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities LLCに帰属します。

当ファンドのデータ

組入資産の内容

（2020年1月20日現在）

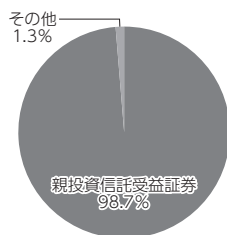
○組入上位ファンド

銘柄名	第2期末
グローバル・モビリティ・サービス株式マザーファンド	98.7%
組入銘柄数	1銘柄

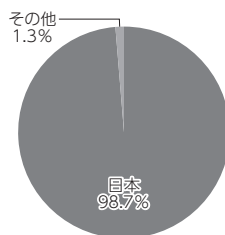
（注）組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

（注）組入銘柄に関する詳細な情報等につきましては、運用報告書（全体版）に記載しております。

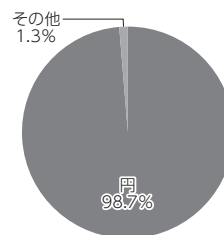
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



（注）比率は当ファンドの純資産総額に対する割合です。

（注）国別配分につきましては発行国もしくは投資国を表示しております。

（注）その他にはコール・ローン等を含む場合があります。

純資産等

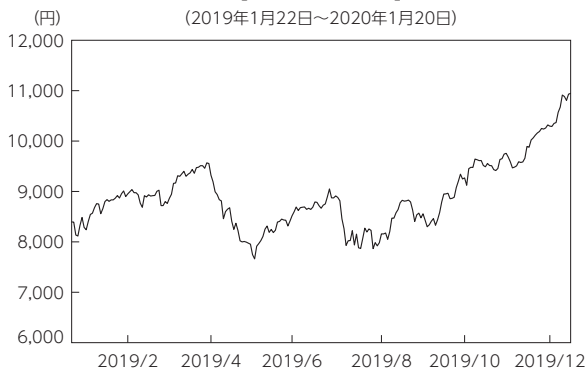
項目	第2期末
	2020年1月20日
純資産総額	54,904,835,711円
受益権総口数	51,874,977,755口
1万口当たり基準価額	10,584円

（注）期中における追加設定元本額は6,633,947,074円、同解約元本額は29,197,306,099円です。

組入上位ファンドの概要

グローバル・モビリティ・サービス株式マザーファンド

【基準価額の推移】



【1万口当たりの費用明細】

(2019年1月22日～2020年1月20日)

項目	当期	
	金額	比率
(a) 売買委託手数料 (株 式)	2 (2)	0.023 (0.023)
(b) 有価証券取引税 (株 式)	1 (1)	0.011 (0.011)
(c) その他費用 (保管費用) (その他)	2 (2) (0)	0.018 (0.018) (0.000)
合 計	5	0.052

期中の平均基準価額は、8,904円です。

(注) 上記項目の概要につきましては運用報告書(全体版)をご参照ください。

(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。

【組入上位10銘柄】

(2020年1月20日現在)

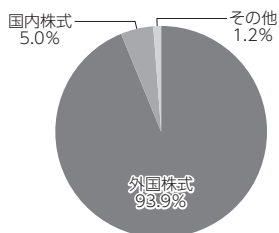
	銘柄名	業種/種別等	通貨	国(地域)	比率
1	TESLA INC	自動車・自動車部品	アメリカドル	アメリカ	9.0
2	AEROVIRONMENT INC	資本財	アメリカドル	アメリカ	5.6
3	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	アメリカドル	アメリカ	5.2
4	AMAZON.COM INC	小売	アメリカドル	アメリカ	5.1
5	APTIV PLC	自動車・自動車部品	アメリカドル	ジャージー	4.8
6	XILINX INC	半導体・半導体製造装置	アメリカドル	アメリカ	4.8
7	TRIMBLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	アメリカドル	アメリカ	3.6
8	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	アメリカドル	ケイマン諸島	3.4
9	NXP SEMICONDUCTORS NV	半導体・半導体製造装置	アメリカドル	オランダ	3.1
10	JD.COM INC-ADR	小売	アメリカドル	ケイマン諸島	2.9
	組入銘柄数		42銘柄		

(注) 比率は、純資産総額に対する割合です。

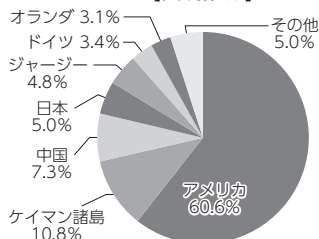
(注) 組入銘柄に関する詳細な情報等につきましては、運用報告書(全体版)に記載しております。

(注) 国(地域)につきましては発行国もしくは投資国を表示しております。

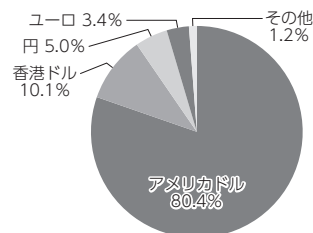
【資産別配分】



【国別配分】



【通貨別配分】



(注) 比率は当ファンドの純資産総額に対する割合です。

(注) 国別配分につきましては発行国もしくは投資国を表示しております。

(注) その他にはコール・ローン等を含む場合があります。

※当マザーファンドの計算期間における運用経過の説明は運用報告書(全体版)をご参照ください。

グローバル・モビリティ・サービス株式ファンド（1年決算型）

【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 2019年1月21日現在	第2期 2020年1月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,266,652,016	1,343,471,713
親投資信託受益証券	61,069,141,894	54,195,889,551
未収入金	—	2,154,424,231
流動資産合計	62,335,793,910	57,693,785,495
資産合計	62,335,793,910	57,693,785,495
負債の部		
流動負債		
未払解約金	43,704,170	2,245,493,458
未払受託者報酬	16,081,017	15,256,228
未払委託者報酬	546,756,515	518,713,943
未払利息	1,806	192
その他未払費用	11,592,834	9,485,963
流動負債合計	618,136,342	2,788,949,784
負債合計	618,136,342	2,788,949,784
純資産の部		
元本等		
元本	74,438,336,780	51,874,977,755
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△12,720,679,212	3,029,857,956
(分配準備積立金)	—	6,695,370,435
元本等合計	61,717,657,568	54,904,835,711
純資産合計	61,717,657,568	54,904,835,711
負債純資産合計	62,335,793,910	57,693,785,495

【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期 自 2018年1月31日 至 2019年1月21日	第2期 自 2019年1月22日 至 2020年1月20日
営業収益		
受取利息	3,185	1,062
有価証券売買等損益	△6,981,733,117	14,880,142,858
営業収益合計	△6,981,729,932	14,880,143,920
営業費用		
支払利息	581,950	356,640
受託者報酬	21,547,614	32,219,883
委託者報酬	732,622,883	1,095,480,464
その他費用	12,157,043	10,876,733
営業費用合計	766,909,490	1,138,933,720
営業利益又は営業損失(△)	△7,748,639,422	13,741,210,200
経常利益又は経常損失(△)	△7,748,639,422	13,741,210,200
当期純利益又は当期純損失(△)	△7,748,639,422	13,741,210,200
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額(△)	28,962,456	2,124,306,054
期首剰余金又は期首欠損金(△)	—	△12,720,679,212
剰余金増加額又は欠損金減少額	516,639,636	4,918,304,304
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	516,639,636	4,918,304,304
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	—	—
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,459,716,970	784,671,282
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	—	—
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,459,716,970	784,671,282
分配金	—	—
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△12,720,679,212	3,029,857,956