

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/海外/株式/インデックス型  |   |
|--------|--|---|
| 信託期間   | 2022年12月21日 [当初、2027年1月26日] まで<br>(2018年1月31日設定)   |   |
| 運用方針   | 日経アジア300インベスタブル・マザー<br>ファンド受益証券への投資を通じて、主として<br>日本を除くアジア諸国・地域の企業の株式<br>等（DR（預託証券）を含みます。）に投資を<br>行い、日経アジア300インベスタブル指数<br>（トータルリターン、円換算ベース）に連動<br>する投資成果をめざして運用を行います。<br>マザーファンド受益証券の組入比率は高位を<br>維持することを基本とします。<br>対象インデックスとの連動を維持するため、<br>先物取引等を利用し株式の実質投資比率が<br>100%を超える場合があります。<br>実質組入外貨建資産については、原則として<br>為替ヘッジを行いません。 |   |
| 主要運用対象 | ベビー<br>ファンド  | 日経アジア300インベスタブル・マザー<br>ファンド受益証券を主要投資対象とします。             |
|        | マザー<br>ファンド  | 日本を除くアジア諸国・地域の企<br>業の株式等を主要投資対象とし<br>ます。                |
| 主な組入制限 | ベビー<br>ファンド  | 株式への実質投資割合に制限を<br>設けません。<br>外貨建資産への実質投資割合に<br>制限を設けません。 |
|        | マザー<br>ファンド  | 株式への投資割合に制限を設け<br>ません。<br>外貨建資産への投資割合に制限<br>を設けません。     |
| 分配方針   | 経費等控除後の配当等収益および売買益（評<br>価益を含みます。）等の全額を分配対象額と<br>し、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を<br>勘案して委託会社が決定します。ただし、分<br>配対象収益が少額の場合には分配を行わない<br>ことがあります。<br><br>分配金額の決定にあたっては、信託財産の<br>成長を優先し、原則として分配を抑制する<br>方針とします。（基準価額水準や市況動向等<br>により変更する場合があります。）  |   |

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

## 償還報告書（全体版）

[繰上償還]

# 日経アジア300インベスタブル・ インデックス・ファンド

信託終了日：2022年12月21日

## 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。  
さて、「日経アジア300インベスタブル・インデッ  
クス・ファンド」は、約款の規定に基づき、先般ご案内  
申し上げました予定通り、12月21日に繰り上げて償  
還させていただきました。ここに謹んで運用経過と償  
還内容をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い  
申し上げます。



## 三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号  
ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客様専用  
フリーダイヤル **0120-151034**  
(受付時間：営業日の9:00~17:00、  
土・日・祝日・12月31日~1月3日を除く)

お客様の取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

## 本資料の表記にあたって

- ・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
- ・一印は組入れまたは売買がないことを示しています。

## ○設定以来の運用実績

| 決算期             | 基準価額<br>(分配落) | 標準価額 |       |       | 日経アジア300インベスタブル指数 |       | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 純資産総額 |
|-----------------|---------------|------|-------|-------|-------------------|-------|--------|--------|-------|
|                 |               | 税込分配 | み金騰落  | 期中率   | (トータルリターン、円換算ベース) | 期中率騰落 |        |        |       |
| (設定日)           | 円 銭           | 円    | %     | %     | %                 | %     | %      | %      | 百万円   |
| 2018年1月31日      | 10,000        | —    | —     | —     | 174,697           | —     | —      | —      | 1     |
| 1期(2019年1月28日)  | 8,528         | 0    | △14.7 | △14.0 | 150,305           | △14.0 | 92.1   | 7.5    | 213   |
| 2期(2020年1月27日)  | 9,330         | 0    | 9.4   | 11.7  | 167,953           | 11.7  | 94.6   | 5.3    | 314   |
| 3期(2021年1月26日)  | 11,698        | 10   | 25.5  | 25.6  | 210,892           | 25.6  | 89.4   | 12.0   | 46    |
| 4期(2022年1月26日)  | 11,069        | 10   | △5.3  | △4.9  | 200,606           | △4.9  | 94.3   | 5.2    | 41    |
| (償還時)           | (償還価額)        |      |       |       |                   |       |        |        |       |
| 5期(2022年12月21日) | 10,842.80     | —    | △2.0  | △5.4  | 189,769           | △5.4  | —      | —      | 24    |

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 日経アジア300インベスタブル指数（トータルリターン、円換算ベース）は、日経アジア300インベスタブル指数（トータルリターン、米ドルベース）をもとに委託会社が計算したものです。日経アジア300インベスタブル指数（以下「日経アジア300 i」という。）とは、日本経済新聞社（以下「日経」という。）により算出・公表される株価指数であり、アジアの上場企業300社を構成銘柄としています。日経アジア300 i は、日経によって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、日経は日経アジア300 i 自体及び日経アジア300 i を算出する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。日経アジア300 i を対象とする本件投資信託は、投資信託委託会社等の責任のもとで運用されるものであり、その運用及び本件受益権の取引に関して、日経は一切の義務ないし責任を負いません。日経は日経アジア300 i を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延または中断に関して、責任を負いません。日経は、日経アジア300 i の構成銘柄、計算方法、その他日経アジア300 i の内容を変える権利及び公表を停止する権利を有しています。日経アジア300 i は、S&P Dow Jones Indices LLCの子会社であるS&P Opco, LLCとの契約に基づいて、算出、維持されます。S&P Dow Jones Indices、その関連会社あるいは第三者のライセンサーはいずれも日経アジア300 i をスポンサーもしくはプロモートするものではなく、また日経アジア300 i の算出上の過失に対し一切の責任を負いません。「S&P®」はStandard & Poor's Financial Services LLCの登録商標です。

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(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」は買建比率－売建比率。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日                | 基 準 価 額             |        | 日経アジア300インベスタブル指数<br>(トータルリターン、<br>円換算ベース) |        | 株 組 入 比 率 | 株 先 物 比 率 |
|----------------------|---------------------|--------|--|--------|-----------|-----------|
|                      |                     | 騰 落 率  |  | 騰 落 率  |           |           |
| (期 首)<br>2022年1月26日  | 円 銭<br>11,069       | %<br>— | 200,606                                    | %<br>— | %<br>94.3 | %<br>5.2  |
| 1月末                  | 10,973              | △0.9   | 198,642                                    | △1.0   | 94.0      | 5.7       |
| 2月末                  | 10,741              | △3.0   | 194,077                                    | △3.3   | 92.8      | 7.4       |
| 3月末                  | 11,292              | 2.0    | 204,714                                    | 2.0    | 93.2      | 6.5       |
| 4月末                  | 10,813              | △2.3   | 196,357                                    | △2.1   | 93.3      | 6.5       |
| 5月末                  | 11,037              | △0.3   | 201,174                                    | 0.3    | 84.1      | 15.8      |
| 6月末                  | 11,310              | 2.2    | 206,149                                    | 2.8    | 87.9      | 11.9      |
| 7月末                  | 11,011              | △0.5   | 200,505                                    | △0.1   | 92.0      | 7.9       |
| 8月末                  | 11,210              | 1.3    | 204,903                                    | 2.1    | 93.3      | 6.6       |
| 9月末                  | 10,270              | △7.2   | 187,008                                    | △6.8   | 89.4      | 10.5      |
| 10月末                 | 9,978               | △9.9   | 181,625                                    | △9.5   | 89.4      | 10.6      |
| 11月末                 | 10,866              | △1.8   | 198,434                                    | △1.1   | 90.9      | 9.1       |
| (償還時)<br>2022年12月21日 | (償還価額)<br>10,842.80 | △2.0   | 189,769                                    | △5.4   | —         | —         |

(注) 騰落率は期首比。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(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」は買建比率－売建比率。

# 運用経過

第1期～第5期：2018年1月31日～2022年12月21日

## 設定来の基準価額等の推移について

### 基準価額等の推移



第1期首 10,000円

第5期末 10,842.80円

既払分配金 20円

騰落率 8.6%

(分配金再投資ベース)

※分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、収益分配金（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、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

※実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、受益者のみなさま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。従って、各個人の受益者のみなさまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

### 基準価額の動き

償還価額は設定時に比べ8.6%（分配金再投資ベース）の上昇となりました。

### ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（8.6%）と同程度となりました。

## 基準価額の主な変動要因

### 上昇要因

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額は信託報酬等の管理コストや償還に係る対応要因を除き、ベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

第1期～第5期：2018年1月31日～2022年12月21日

## 投資環境について

### ▶ 外国株式市況

**外国株式市況は上昇しました。**

外国株式市況は、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大後の潤沢な政府支援やワクチン開発に関する報道等が支援材料となり、設定時に比べて上昇しました。

### ▶ 為替市況

**香港ドルは円に対して上昇しました。**

為替市況は、設定時に比べて21.3%の円安・香港ドル高となりました。

## 当該投資信託のポートフォリオについて

### ▶ 日経アジア300インベスタブル・インデックス・ファンド

信託期間を通じて、資産のほぼ全額をマザーファンドに投資したことにより、基準価額はマザーファンドとほぼ同様の推移となりました。

第5期（2022年1月27日～信託終了日）は、前記の運用を維持し、信託終了日にかけて、マザーファンドの売却を行いました。

### ▶ 日経アジア300インベスタブル・マザーファンド

ベンチマークである日経アジア300インベスタブル指数（トータルリターン、円換算ベース）に採用されている日本を除くアジア諸国・地域の企業の株式等（先物を含む）を主要投資対象とし、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行いました。

株式の国別比率、業種別比率などがベンチマークとほぼ同様になるようにマルチファクターモデルを用いてポートフォリオを構築しました。

(注) マルチファクターモデル  
株式市場の構造（動向）を、複数の要因（業種・通貨・企業規模など）に分類し、高度な統計手法を用いて説明をするモデル

第5期：2022/1/27～2022/12/21

## 当該投資信託のベンチマークとの差異について

### ▶ 日経アジア300インベスタブル・インデックス・ファンド

設定来のベンチマークとの乖離は $\Delta 0.0\%$ 程度となりました。

#### マザーファンド保有以外の要因

ファンドの管理コストや償還に係る対応要因等による影響は $3.1\%$ 程度でした。

#### マザーファンド保有による要因

マザーファンド保有による影響は $\Delta 3.1\%$ 程度でした。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

**主なプラス要因：**銘柄選択要因によるものです。

**主なマイナス要因：**取引要因によるものです。

第5期のベンチマークとの乖離は $3.4\%$ 程度となりました。

#### マザーファンド保有以外の要因

ファンドの管理コストや償還に係る対応要因等による影響は $4.1\%$ 程度でした。

#### マザーファンド保有による要因

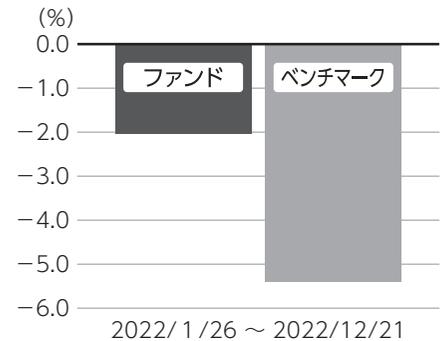
マザーファンド保有による影響は $\Delta 0.7\%$ 程度でした。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

**主なプラス要因：**銘柄選択要因によるものです。

**主なマイナス要因：**取引要因によるものです。

### 基準価額（ベビーファンド）とベンチマークの対比（騰落率）



## ▶ 分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、第3期と第4期は各10円の分配とし、その他の期は見送りとさせていただきます。信託期間中、累計で20円の分配を行わせていただきました。

## ▶ 償還価額

### ▶ 日経アジア300インベスタブル・インデックス・ファンド

償還価額は、10,842円80銭となりました。

信託期間中はご愛顧を賜り、誠にありがとうございました。

2022年1月27日～2022年12月21日

## 1 万口当たりの費用明細

| 項目          | 当期     |         | 項目の概要   |
|-------------|--------|---------|---|
|             | 金額 (円) | 比率 (%)  |   |
| (a) 信託報酬    | 32     | 0.297   | (a) 信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × (期中の日数 ÷ 年間日数)                         |
| ( 投 信 会 社 ) | (15)   | (0.139) | ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価                            |
| ( 販 売 会 社 ) | (15)   | (0.139) | 交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価                                  |
| ( 受 託 会 社 ) | ( 2 )  | (0.020) | ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価                                    |
| (b) 売買委託手数料 | 7      | 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<br>有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料 |
| ( 株 式 )     | ( 6 )  | (0.059) |   |
| (新株予約権証券)   | ( 0 )  | (0.000) |   |
| (投資信託証券)    | ( 0 )  | (0.000) |   |
| (先物・オプション)  | ( 1 )  | (0.009) |   |
| (c) 有価証券取引税 | 7      | 0.067   | (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<br>有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金       |
| ( 株 式 )     | ( 7 )  | (0.067) |   |
| (新株予約権証券)   | ( 0 )  | (0.000) |   |
| (投資信託証券)    | ( 0 )  | (0.000) |   |
| (d) その他費用   | 37     | 0.341   | (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 ) | (37)   | (0.335) | 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用                                       |
| ( 監 査 費 用 ) | ( 0 )  | (0.003) | ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用   |
| ( そ の 他 )   | ( 0 )  | (0.003) | 信託事務の処理等に要するその他諸費用  |
| 合 計         | 83     | 0.773   |   |

期中の平均基準価額は、10,890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。

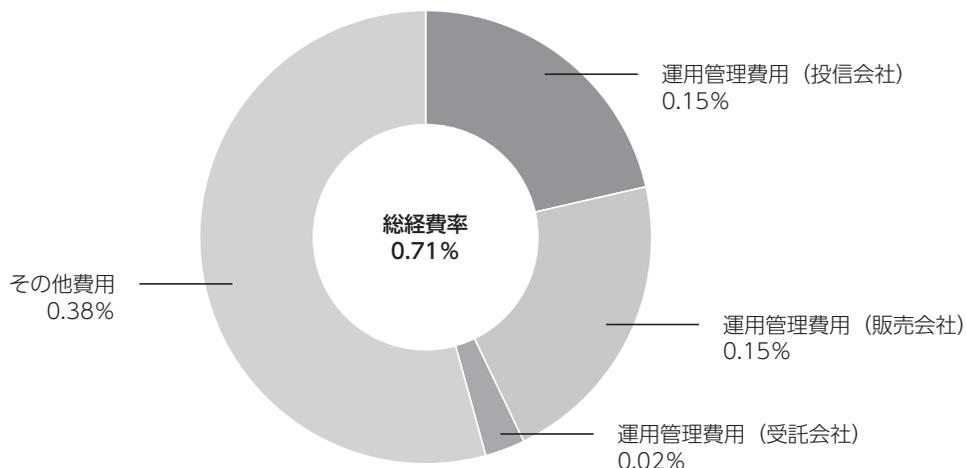
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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

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0.71%**です。



(注) 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) 前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27日～2022年12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           |
| 日経アジア300インベスタブル・マザーファンド | 千口<br>1,712 | 千円<br>1,892 | 千口<br>38,444 | 千円<br>42,120 |

## ○株式売買比率

(2022年1月27日～2022年12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                      |  |
|---------------------|-------------------------|--|
|                     | 日経アジア300インベスタブル・マザーファンド |  |
| (a) 期中の株式売買金額       | 2,081,107千円             |  |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 1,934,848千円             |  |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 1.07                    |  |

(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27日～2022年12月21日)

## 利害関係人との取引状況

&lt;日経アジア300インベスタブル・インデックス・ファンド&gt;

該当事項はございません。

&lt;日経アジア300インベスタブル・マザーファンド&gt;

| 区分     | 買付額等<br>A | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等<br>C | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|--------|-----------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
|        |           |                    |               |           |                    |               |
| 為替直物取引 | 3,889     | 2,331              | 59.9%         | 1,829     | 1,390              | 76.0%         |

平均保有割合 1.6%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

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三菱UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行です。

## ○組入資産の明細

(2022年12月21日現在)

信託終了日現在、有価証券等の組入れはございません。

## 親投資信託残高

| 銘                       | 柄 | 期首(前期末) |              |
|-------------------------|---|---------|--------------|
|                         |   | 口       | 数            |
| 日経アジア300インベスタブル・マザーファンド |   |         | 千口<br>36,731 |

## ○投資信託財産の構成

(2022年12月21日現在)

| 項            | 目 | 償 還 時  |       |
|--------------|---|--------|-------|
|              |   | 評 価 額  | 比 率   |
|              |   | 千円     | %     |
| コール・ローン等、その他 |   | 24,068 | 100.0 |
| 投資信託財産総額     |   | 24,068 | 100.0 |

## ○資産、負債、元本及び償還価額の状況 (2022年12月21日現在)

| 項 目             | 償 還 時       |
|-----------------|-------------|
|                 | 円           |
| (A) 資産          | 24,068,496  |
| コール・ローン等        | 24,068,496  |
| (B) 負債          | 37,314      |
| 未払信託報酬          | 36,928      |
| 未払利息            | 51          |
| その他未払費用         | 335         |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 24,031,182  |
| 元本              | 22,163,255  |
| 償還差益金           | 1,867,927   |
| (D) 受益権総口数      | 22,163,255口 |
| 1万口当たり償還価額(C/D) | 10,842円80銭  |

## &lt;注記事項&gt;

期首元本額 37,144,403円  
 期中追加設定元本額 1,823,987円  
 期中一部解約元本額 16,805,135円  
 また、1口当たり純資産額は、期末1.084280円です。

## ○損益の状況 (2022年1月27日～2022年12月21日)

| 項 目              | 当 期          |
|------------------|--------------|
|                  | 円            |
| (A) 配当等収益        | △ 103        |
| 支払利息             | △ 103        |
| (B) 有価証券売買損益     | △ 417,132    |
| 売買益              | 402,070      |
| 売買損              | △ 819,202    |
| (C) 信託報酬等        | △ 103,467    |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 520,702    |
| (E) 前期繰越損益金      | 2,385,245    |
| (F) 追加信託差損益金     | 3,384        |
| (配当等相当額)         | ( 1,662,427) |
| (売買損益相当額)        | (△1,659,043) |
| 償還差益金(D+E+F)     | 1,867,927    |

(注) (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) (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) (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。

## ○投資信託財産運用総括表

| 信託期間     | 投資信託契約締結日    | 2018年1月31日   |             | 投資信託契約終了時の状況 |             |
|----------|--------------|--------------|-------------|--------------|-------------|
|          | 投資信託契約終了日    | 2022年12月21日  |             | 資産総額         | 24,068,496円 |
| 区分       | 投資信託契約締結当初   | 投資信託契約終了時    | 差引増減または追加信託 | 負債総額         | 37,314円     |
| 受益権口数    | 1,000,000口   | 22,163,255口  | 21,163,255口 | 純資産総額        | 24,031,182円 |
| 元本額      | 1,000,000円   | 22,163,255円  | 21,163,255円 | 受益権口数        | 22,163,255口 |
|          |              |              |             | 1万円当たり償還金    | 10,842円80銭  |
| 毎計算期末の状況 |              |              |             |              |             |
| 計算期      | 元本額          | 純資産総額        | 基準価額        | 1万円当たり分配金    |             |
|          |              |              |             | 金額           | 分配率         |
| 第1期      | 250,095,758円 | 213,289,022円 | 8,528円      | 0円           | 0.0%        |
| 第2期      | 336,928,416  | 314,363,829  | 9,330       | 0            | 0.0         |
| 第3期      | 39,866,971   | 46,636,517   | 11,698      | 10           | 0.1         |
| 第4期      | 37,144,403   | 41,113,876   | 11,069      | 10           | 0.1         |

## ○償還金のお知らせ

|                |            |
|----------------|------------|
| 1万円当たり償還金(税込み) | 10,842円80銭 |
|----------------|------------|

◆償還金は償還日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

◆課税上の取り扱い

- ・個人受益者の場合、償還価額から取得費(申込手数料(税込)を含みます。)を控除した利益(譲渡益)が譲渡所得等として課税され、原則として、20.315%(所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%)の税率による申告分離課税が適用されます。
- ・特定口座(源泉徴収選択口座)を利用する場合、20.315%(所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%)の税率で源泉徴収され、原則として、申告は不要です。

※法人受益者に対する課税は異なります。

※課税上の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

## 【お知らせ】

受益権の口数が投資信託約款に定められた口数を下回っており、投資信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認められるため、信託約款の規定に基づき、信託を終了しました。

(2022年12月21日)

# 日経アジア300インベスタブル・マザーファンド

## 《第4期》決算日2022年1月26日

[計算期間：2021年1月27日～2022年1月26日]

「日経アジア300インベスタブル・マザーファンド」は、1月26日に第4期の決算を行いました。  
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第4期の運用状況をご報告申し上げます。

|        |   |
|--------|---|
| 運用方針   | 主として日本を除くアジア諸国・地域の企業の株式等に投資を行い、日経アジア300インベスタブル指数（トータルリターン、円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。<br>株式の組入比率は高位を維持することを基本とします。<br>対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式の実質投資比率が100%を超える場合があります。<br>組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 |
| 主要運用対象 | 日本を除くアジア諸国・地域の企業の株式等（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とします。  |
| 主な組入制限 | 株式への投資割合に制限を設けません。<br>外貨建資産への投資割合に制限を設けません。   |

### ○設定以来の運用実績

| 決算期                 | 基準価額   |       | 日経アジア300インベスタブル指数 |       | 株組入比率 | 株先物比率 | 純資産総額      |
|---------------------|--------|-------|-------------------|-------|-------|-------|------------|
|                     | 期騰落    | 中率    | (トータルリターン、円換算ベース) | 期騰落   |       |       |            |
| (設定日)<br>2018年1月26日 | 円      | %     | 174,385           | —     | %     | %     | 百万円<br>499 |
| 1期(2019年1月28日)      | 8,522  | △14.8 | 150,305           | △13.8 | 92.1  | 7.5   | 840        |
| 2期(2020年1月27日)      | 9,354  | 9.8   | 167,953           | 11.7  | 94.6  | 5.3   | 1,136      |
| 3期(2021年1月26日)      | 11,778 | 25.9  | 210,892           | 25.6  | 89.4  | 12.0  | 1,087      |
| 4期(2022年1月26日)      | 11,191 | △5.0  | 200,606           | △4.9  | 94.3  | 5.2   | 1,319      |

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 日経アジア300インベスタブル指数（トータルリターン、円換算ベース）は、日経アジア300インベスタブル指数（トータルリターン、米ドルベース）をもとに委託会社が計算したものです。日経アジア300インベスタブル指数（以下「日経アジア300i」という。）とは、日本経済新聞社（以下「日経」という。）により算出・公表される株価指数であり、アジアの上場企業300社を構成銘柄としています。日経アジア300iは、日経によって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、日経は日経アジア300i自体及び日経アジア300iを算出する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。日経アジア300iを対象とする本件投資信託は、投資信託委託会社等の責任のもとで運用されるものであり、その運用及び本件受益権の取引に関して、日経は一切の義務ないし責任を負いません。日経は日経アジア300iを継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延または中断に関して、責任を負いません。日経は、日経アジア300iの構成銘柄、計算方法、その他日経アジア300iの内容を変える権利及び公表を停止する権利を有しています。日経アジア300iは、S&P Dow Jones Indices LLCの子会社であるS&P Opco, LLCとの契約に基づいて、算出、維持されます。S&P Dow Jones Indices、その関連会社あるいは第三者のライセンサーはいずれも日経アジア300iをスポンサーもしくはプロモートするものではなく、また日経アジア300iの算出上の過失に対し一切の責任を負いません。「S&P®」はStandard & Poor's Financial Services LLCの登録商標です。

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日               | 基 準 価 額 |       | 日経アジア300インベスタブル指数<br>(トータルリターン、<br>円換算ベース) |       | 株 組 入 比 率 | 株 先 物 比 率 |
|---------------------|---------|-------|--|-------|-----------|-----------|
|                     | 騰 落 率   | 騰 落 率 | 騰 落 率                                      | 騰 落 率 |           |           |
| (期 首)<br>2021年1月26日 | 円       | %     |  | %     | %         | %         |
|                     | 11,778  | —     | 210,892                                    | —     | 89.4      | 12.0      |
| 1月末                 | 11,305  | △4.0  | 201,410                                    | △4.5  | 92.9      | 6.6       |
| 2月末                 | 11,900  | 1.0   | 212,615                                    | 0.8   | 92.6      | 7.2       |
| 3月末                 | 11,892  | 1.0   | 212,377                                    | 0.7   | 88.7      | 11.1      |
| 4月末                 | 12,054  | 2.3   | 214,955                                    | 1.9   | 91.6      | 8.3       |
| 5月末                 | 12,008  | 2.0   | 213,889                                    | 1.4   | 92.0      | 7.9       |
| 6月末                 | 12,127  | 3.0   | 216,085                                    | 2.5   | 91.9      | 7.6       |
| 7月末                 | 11,352  | △3.6  | 202,219                                    | △4.1  | 90.8      | 8.7       |
| 8月末                 | 11,282  | △4.2  | 200,954                                    | △4.7  | 91.1      | 8.7       |
| 9月末                 | 11,191  | △5.0  | 200,141                                    | △5.1  | 89.9      | 9.8       |
| 10月末                | 11,671  | △0.9  | 208,255                                    | △1.3  | 92.9      | 6.7       |
| 11月末                | 11,198  | △4.9  | 199,889                                    | △5.2  | 91.4      | 8.2       |
| 12月末                | 11,302  | △4.0  | 202,099                                    | △4.2  | 93.1      | 5.1       |
| (期 末)<br>2022年1月26日 | 11,191  | △5.0  | 200,606                                    | △4.9  | 94.3      | 5.2       |

(注) 騰落率は期首比。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○運用経過

## ●当期中の基準価額等の推移について

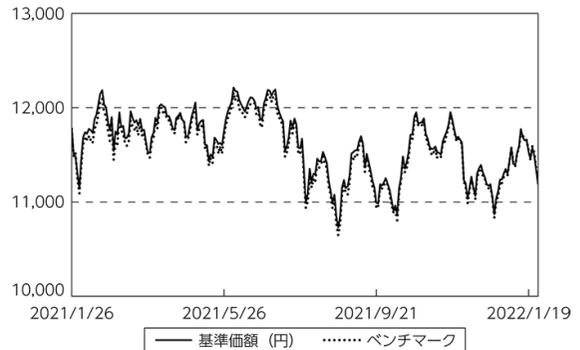
## ◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ5.0%の下落となりました。

## ◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(−4.9%)を0.1%下回りました。

## 基準価額等の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

**● 基準価額の主な変動要因**

(下落要因)

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

**● 投資環境について****◎ 外国株式市況**

- ・ 外国株式市況は下落しました。
- ・ 外国株式市況は、好調な経済指標等を受けて上昇する局面もありましたが、中国不動産セクターの債務問題や世界的なインフレへの警戒感等を背景に下落しました。

**◎ 為替市況**

- ・ 香港ドルは円に対して上昇しました。
- ・ 為替市況は、期首に比べて9.2%の円安・香港ドル高となりました。

**● 当該投資信託のポートフォリオについて**

- ・ ベンチマークである日経アジア300インベスタブル指数（トータルリターン、円換算ベース）に採用されている日本を除くアジア諸国・地域の企業の株式等（先物を含む）を主要投資対象とし、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・ 株式の国別比率、業種別比率などがベンチマークとほぼ同様になるようにマルチファクターモデルを用いてポートフォリオを構築しました。

(注) マルチファクターモデル

株式市場の構造（動向）を、複数の要因（業種・通貨・企業規模など）に分類し、高度な統計手法を用いて説明をするモデル

- 当該投資信託のベンチマークとの差異について  
ベンチマークは4.9%の下落となったため、乖離は△0.1%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：銘柄選択要因によるものです。

主なマイナス要因：取引要因によるものです。

**○ 今後の運用方針**

- ・ ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

## ○1万口当たりの費用明細

(2021年1月27日～2022年1月26日)

| 項 目                   | 当 期   |           | 項 目 の 概 要   |
|-----------------------|-------|-----------|---|
|                       | 金 額   | 比 率       |   |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料     | 円     | %         | (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<br>有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料                      |
| (株 式)                 | ( 7 ) | ( 0.061 ) |   |
| ( 投 資 信 託 証 券 )       | ( 0 ) | ( 0.000 ) |   |
| (先物・オプション)            | ( 1 ) | ( 0.006 ) |   |
| (b) 有 価 証 券 取 引 税     | 9     | 0.075     | (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<br>有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金                            |
| (株 式)                 | ( 9 ) | ( 0.075 ) |   |
| ( 投 資 信 託 証 券 )       | ( 0 ) | ( 0.000 ) |   |
| (c) そ の 他 費 用         | 49    | 0.420     | (c)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数<br>有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用<br>信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| (保 管 費 用)             | (48)  | ( 0.416 ) |   |
| (そ の 他)               | ( 0 ) | ( 0.004 ) |   |
| 合 計                   | 65    | 0.556     |   |
| 期中の平均基準価額は、11,608円です。 |       |           |   |

(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) 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

(2021年1月27日～2022年1月26日)

## 株式

|     |        | 買 付              |                                     | 売 付            |                                    |
|-----|--------|------------------|-------------------------------------|----------------|------------------------------------|
|     |        | 株 数              | 金 額                                 | 株 数            | 金 額                                |
| 外 国 | アメリカ   | 百株<br>51         | 千アメリカドル<br>117                      | 百株<br>491      | 千アメリカドル<br>1,059                   |
|     | 香港     | 5,665<br>( 18)   | 千香港ドル<br>18,488<br>( —)             | 2,871          | 千香港ドル<br>5,065                     |
|     | シンガポール | 434<br>( 173)    | 千シンガポールドル<br>149<br>( 12)           | 261<br>( 167)  | 千シンガポールドル<br>110<br>( 19)          |
|     | マレーシア  | 708<br>( 200)    | 千マレーシアリングギット<br>457<br>( —)         | 531            | 千マレーシアリングギット<br>380                |
|     | タイ     | 583              | 千タイバーツ<br>3,564                     | 656<br>( —)    | 千タイバーツ<br>2,387<br>(0.30245)       |
|     | フィリピン  | 399              | 千フィリピンペソ<br>1,786                   | 362            | 千フィリピンペソ<br>1,580                  |
|     | インドネシア | 2,692<br>(1,146) | 千インドネシアルピア<br>1,332,421<br>( 7,396) | 1,431<br>( 20) | 千インドネシアルピア<br>614,559<br>( 16,620) |
|     | 韓国     | 83<br>( 10)      | 千韓国ウォン<br>804,958<br>( 12,269)      | 50<br>( 0.29)  | 千韓国ウォン<br>481,232<br>( 12,269)     |
|     | 台湾     | 1,140<br>( 15)   | 千ニュー台湾ドル<br>18,354<br>(△ 57)        | 690            | 千ニュー台湾ドル<br>9,261                  |
|     | インド    | 1,361<br>( 12)   | 千インドルピー<br>117,864<br>( —)          | 2              | 千インドルピー<br>47                      |

(注) 金額は受渡代金。

(注) ( )内は株式分割・増資割当および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。

## 新株予約権証券

|     |    | 買 付             |                          | 売 付     |             |
|-----|----|-----------------|--------------------------|---------|-------------|
|     |    | 証 券 数           | 金 額                      | 証 券 数   | 金 額         |
| 外 国 | タイ | 証券<br>—<br>(79) | 千タイバーツ<br>—<br>(0.30245) | 証券<br>— | 千タイバーツ<br>— |

(注) 金額は受渡代金。

(注) ( )内は株主割当および権利行使等による増減分です。

## 投資信託証券

| 銘柄 |                              | 買付           |           | 売付    |           |
|----|------------------------------|--------------|-----------|-------|-----------|
|    |                              | 口数           | 金額        | 口数    | 金額        |
| 外国 | シンガポール                       | 千口           | 千シンガポールドル | 千口    | 千シンガポールドル |
|    | CAPITALAND INTEGRATED COMMER | —<br>(0.943) | —<br>(1)  | 0.943 | 1         |

(注) 金額は受渡代金。

(注) ( )内は分割・合併および償還等による増減分です。

## 先物取引の種類別取引状況

| 種類別 |        | 買建           |              | 売建       |          |
|-----|--------|--------------|--------------|----------|----------|
|     |        | 新規買付額        | 決済額          | 新規売付額    | 決済額      |
| 外国  | 株式先物取引 | 百万円<br>1,149 | 百万円<br>1,206 | 百万円<br>— | 百万円<br>— |

(注) 外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月の月初から決算日までの分については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

## ○株式売買比率

(2021年1月27日～2022年1月26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       | 963,714千円   |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 1,085,032千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.88        |

(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27日～2022年1月26日)

## 利害関係人との取引状況

| 区分     | 買付額等<br>A      |               |           | 売付額等<br>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 | $\frac{D}{C}$ |           |
| 為替直物取引 | 百万円<br>1,190   | 百万円<br>790    | %<br>66.4 | 百万円<br>919     | 百万円<br>646    | %<br>70.3 |

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三菱UFJ銀行、三菱UFJ信託銀行です。

## ○組入資産の明細

(2022年1月26日現在)

## 外国株式

| 銘柄                           | 株数      | 株数    | 期末      |        | 業種等                    |
|------------------------------|---------|-------|---------|--------|------------------------|
|                              |         |       | 評価額     |        |                        |
|                              |         |       | 外貨建金額   | 邦貨換算金額 |                        |
| (アメリカ)                       | 百株      | 百株    | 千アメリカドル | 千円     |                        |
| ICICI BANK LTD-SPON ADR      | 61      | —     | —       | —      | 銀行                     |
| INFOSYS LTD-SP ADR           | 83      | —     | —       | —      | ソフトウェア・サービス            |
| WIPRO LTD-ADR                | 70      | —     | —       | —      | ソフトウェア・サービス            |
| TATA MOTORS LTD-SPON ADR     | 27      | —     | —       | —      | 自動車・自動車部品              |
| VEDANTA LTD-ADR              | 42      | —     | —       | —      | 素材                     |
| RELIANCE INDS-SPONS GDR 144A | 33      | —     | —       | —      | エネルギー                  |
| LARSEN & TOUBRO-GDR REG S    | 59      | —     | —       | —      | 資本財                    |
| STATE BANK OF INDI-GDR REG S | 17      | —     | —       | —      | 銀行                     |
| MAHINDRA & MAHINDRA-SPON GDR | 44      | —     | —       | —      | 自動車・自動車部品              |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD   | 6       | 7     | 41      | 4,765  | 資本財                    |
| 小計                           | 株数・金額   | 447   | 7       | 41     | 4,765                  |
|                              | 銘柄数<比率> | 10    | 1       | —      | <0.4%>                 |
| (香港)                         |         |       | 千香港ドル   |        |                        |
| PETROCHINA CO LTD-H          | 220     | 460   | 178     | 2,602  | エネルギー                  |
| SWIRE PACIFIC LTD - CL A     | 5       | 10    | 46      | 672    | 不動産                    |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD    | 40      | 55    | 309     | 4,519  | 資本財                    |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES      | 30      | 40    | 381     | 5,578  | 不動産                    |
| MTR CORP                     | 35      | 35    | 147     | 2,161  | 運輸                     |
| CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H | 420     | 600   | 243     | 3,552  | エネルギー                  |
| HONG KONG & CHINA GAS        | 294     | 206   | 250     | 3,660  | 公益事業                   |
| NEW WORLD DEVELOPMENT        | 27      | 47    | 152     | 2,229  | 不動産                    |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD    | 35      | 25    | 121     | 1,770  | 公益事業                   |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEAR  | 25      | 28    | 1,309   | 19,149 | 各種金融                   |
| CLP HOLDINGS LTD             | 50      | 30    | 234     | 3,427  | 公益事業                   |
| HENDERSON LAND DEVELOPMENT   | 36      | 36    | 125     | 1,836  | 不動産                    |
| HANG SENG BANK LTD           | 20      | 17    | 265     | 3,884  | 銀行                     |
| CITIC LTD                    | 20      | 50    | 43      | 641    | 資本財                    |
| CHINA EASTERN AIRLINES CO-H  | 60      | —     | —       | —      | 運輸                     |
| CHINA RESOURCES BEER HOLDING | 40      | 40    | 240     | 3,517  | 食品・飲料・タバコ              |
| SINO LAND CO                 | 80      | —     | —       | —      | 不動産                    |
| BYD CO LTD-H                 | 15      | 20    | 484     | 7,087  | 自動車・自動車部品              |
| TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD | —       | 40    | 539     | 7,888  | 資本財                    |
| CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H | 20      | 20    | 10      | 151    | 運輸                     |
| HUANENG POWER INTL INC-H     | 120     | —     | —       | —      | 公益事業                   |
| ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H  | 25      | 25    | 105     | 1,547  | 素材                     |
| CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT | 207     | 167   | 154     | 2,261  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 105     | 135   | 832     | 12,177 | 保険                     |
| AIR CHINA LTD-H              | 80      | 20    | 12      | 177    | 運輸                     |
| SINO BIOPHARMACEUTICAL       | 205     | 205   | 114     | 1,678  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TENCENT HOLDINGS LTD         | 111     | 139   | 6,488   | 94,862 | メディア・娯楽                |
| ZTE CORP-H                   | 2       | 2     | 4       | 64     | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H  | 80      | 140   | 148     | 2,169  | 素材                     |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-H    | 1,900   | 2,280 | 1,349   | 19,733 | 銀行                     |
| SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP | 16      | 20    | 309     | 4,529  | 耐久消費財・アパレル             |
| SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H | 80      | 80    | 17      | 250    | 資本財                    |
| CHINA SHENHUA ENERGY CO-H    | 80      | 60    | 123     | 1,802  | エネルギー                  |

| 銘柄                           | 株数      | 当期末   |           |        | 業種等                    |  |
|------------------------------|---------|-------|-----------|--------|------------------------|--|
|                              |         | 株数    | 評価額       |        |                        |  |
|                              |         |       | 外貨建金額     | 邦貨換算金額 |                        |  |
| (香港)                         | 百株      | 百株    | 千香港ドル     | 千円     |                        |  |
| AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN | 10      | —     | —         | —      | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| IND & COMM BK OF CHINA-H     | 1,560   | 1,770 | 835       | 12,214 | 銀行                     |  |
| CHINA OVERSEAS LAND & INVEST | 60      | 75    | 174       | 2,549  | 不動産                    |  |
| ANTA SPORTS PRODUCTS LTD     | 20      | 26    | 314       | 4,599  | 耐久消費財・アパレル             |  |
| CHINA RAILWAY GROUP LTD-H    | 20      | 210   | 98        | 1,446  | 資本財                    |  |
| CHINA RESOURCES LAND LTD     | 80      | 60    | 225       | 3,302  | 不動産                    |  |
| WEICHAI POWER CO LTD-H       | 30      | 30    | 42        | 619    | 資本財                    |  |
| COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO   | 80      | 230   | 150       | 2,202  | 不動産                    |  |
| GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT | 90      | 140   | 252       | 3,688  | 自動車・自動車部品              |  |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H | 520     | 590   | 173       | 2,535  | 銀行                     |  |
| CHINA EVERGRANDE GROUP       | 100     | —     | —         | —      | 不動産                    |  |
| GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H | 12      | 112   | 88        | 1,288  | 自動車・自動車部品              |  |
| SINOPHARM GROUP CO-H         | 32      | —     | —         | —      | ヘルスケア機器・サービス           |  |
| CHINA GAS HOLDINGS LTD       | 44      | 44    | 60        | 882    | 公益事業                   |  |
| LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD   | 35      | 35    | 158       | 2,323  | 不動産                    |  |
| SUNNY OPTICAL TECH           | 13      | 16    | 327       | 4,781  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| AIA GROUP LTD                | 234     | 278   | 2,372     | 34,689 | 保険                     |  |
| GREAT WALL MOTOR COMPANY-H   | 60      | 60    | 137       | 2,013  | 自動車・自動車部品              |  |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L | 40      | 50    | 229       | 3,347  | 消費者サービス                |  |
| SUNAC CHINA HOLDINGS LTD     | 30      | 30    | 30        | 450    | 不動産                    |  |
| SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H | 5       | 10    | 33        | 483    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| WH GROUP LTD                 | 160     | 160   | 82        | 1,204  | 食品・飲料・タバコ              |  |
| CHINA VANKE CO LTD-H         | 35      | 35    | 71        | 1,051  | 不動産                    |  |
| CGN POWER CO LTD-H           | 210     | 210   | 45        | 672    | 公益事業                   |  |
| CK ASSET HOLDINGS LTD        | 30      | 55    | 291       | 4,261  | 不動産                    |  |
| WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC    | 45      | 75    | 641       | 9,380  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H    | 90      | 90    | 36        | 539    | 素材                     |  |
| BOC AVIATION LTD             | 4       | 4     | 26        | 387    | 資本財                    |  |
| CHINA TOWER CORP LTD-H       | —       | 780   | 72        | 1,060  | 電気通信サービス               |  |
| MEITUAN-CLASS B              | —       | 96    | 2,167     | 31,691 | 小売                     |  |
| XIAOMI CORP-CLASS B          | —       | 284   | 500       | 7,315  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |  |
| WUXI APPTec CO LTD-H         | —       | 8     | 99        | 1,450  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI | —       | 20    | 36        | 530    | 消費者サービス                |  |
| ALIBABA GROUP HOLDING LTD    | 246     | 338   | 3,947     | 57,717 | 小売                     |  |
| ZTO EXPRESS CAYMAN INC       | —       | 16    | 357       | 5,221  | 運輸                     |  |
| HAIER SMART HOME CO LTD-H    | —       | 36    | 114       | 1,678  | 耐久消費財・アパレル             |  |
| BILIBILI INC-CLASS Z         | —       | 4     | 106       | 1,557  | メディア・娯楽                |  |
| BAIDU INC-CLASS A            | —       | 51    | 750       | 10,970 | メディア・娯楽                |  |
| JD.COM INC - CL A            | —       | 43    | 1,209     | 17,677 | 小売                     |  |
| NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC | —       | 29    | 33        | 485    | 消費者サービス                |  |
| BEIGENE LTD                  | —       | 10    | 143       | 2,097  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| NETEASE INC                  | —       | 48    | 720       | 10,533 | メディア・娯楽                |  |
| 小計                           | 株数・金額   | 8,379 | 11,192    | 31,907 | 466,492                |  |
|                              | 銘柄数<比率> | 61    | 69        | —      | <35.4%>                |  |
| (シンガポール)                     |         |       | 千シンガポールドル |        |                        |  |
| OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 92      | 94    | 114       | 9,674  | 銀行                     |  |
| SEMBCORP INDUSTRIES LTD      | 11      | 11    | 2         | 205    | 公益事業                   |  |
| CAPITALAND LTD               | 61      | —     | —         | —      | 不動産                    |  |
| CITY DEVELOPMENTS LTD        | 16      | 7     | 4         | 416    | 不動産                    |  |
| JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD | 1       | 1     | 2         | 170    | 資本財                    |  |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD       | 37      | 38    | 133       | 11,330 | 銀行                     |  |
| KEPPEL CORP LTD              | 28      | 28    | 14        | 1,259  | 資本財                    |  |

| 銘柄                           | 株数      | 当期    |              | 期末    |        | 業種等                |
|------------------------------|---------|-------|--------------|-------|--------|--------------------|
|                              |         | 株数    | 株数           | 評価額   |        |                    |
|                              |         |       |              | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |                    |
| (シンガポール)                     | 百株      | 百株    | 千シンガポールドル    | 千円    |        |                    |
| UNITED OVERSEAS BANK LTD     | 28      | 35    | 104          | 8,814 |        | 銀行                 |
| VENTURE CORP LTD             | 6       | 6     | 10           | 909   |        | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| SINGAPORE TECH ENGINEERING   | 17      | 34    | 12           | 1,065 |        | 資本財                |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 132     | 174   | 42           | 3,640 |        | 電気通信サービス           |
| SINGAPORE AIRLINES LTD       | 21      | 30    | 14           | 1,265 |        | 運輸                 |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD       | 21      | 21    | 19           | 1,672 |        | 各種金融               |
| UOL GROUP LTD                | 20      | 11    | 7            | 669   |        | 不動産                |
| COMFORTDELGRO CORP LTD       | 16      | 16    | 2            | 184   |        | 運輸                 |
| OLAM INTERNATIONAL LTD       | 2       | 38    | 6            | 540   |        | 食品・生活必需品小売り        |
| THAI BEVERAGE PCL            | 226     | 226   | 14           | 1,244 |        | 食品・飲料・タバコ          |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD     | 65      | 52    | 21           | 1,836 |        | 食品・飲料・タバコ          |
| GENTING SINGAPORE LTD        | 143     | 238   | 17           | 1,491 |        | 消費者サービス            |
| SATS LTD                     | 11      | 11    | 4            | 365   |        | 運輸                 |
| CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI | —       | 61    | 21           | 1,855 |        | 不動産                |
| 小計                           | 株数・金額   | 954   | 1,132        | 573   | 48,614 |                    |
|                              | 銘柄数<比率> | 20    | 20           | —     | <3.7%> |                    |
| (マレーシア)                      |         |       | 千マレーシアリングギット |       |        |                    |
| GENTING MALAYSIA BHD         | 100     | —     | —            | —     |        | 消費者サービス            |
| GENTING BHD                  | 72      | 20    | 8            | 237   |        | 消費者サービス            |
| TELEKOM MALAYSIA BHD         | 47      | —     | —            | —     |        | 電気通信サービス           |
| TENAGA NASIONAL BHD          | 49      | 49    | 44           | 1,205 |        | 公益事業               |
| KUALA LUMPUR KEPONG BHD      | 14      | 14    | 30           | 817   |        | 食品・飲料・タバコ          |
| MALAYAN BANKING BHD          | 123     | 147   | 120          | 3,286 |        | 銀行                 |
| IOI CORP BHD                 | 116     | 116   | 44           | 1,209 |        | 食品・飲料・タバコ          |
| MISC BHD                     | 38      | 38    | 26           | 717   |        | 運輸                 |
| CIMB GROUP HOLDINGS BHD      | 85      | 172   | 90           | 2,452 |        | 銀行                 |
| PETRONAS GAS BHD             | 15      | 15    | 25           | 692   |        | 公益事業               |
| PUBLIC BANK BERHAD           | 50      | 384   | 160          | 4,359 |        | 銀行                 |
| PPB GROUP BERHAD             | 18      | 27    | 43           | 1,193 |        | 食品・飲料・タバコ          |
| DIGI.COM BHD                 | 60      | 109   | 41           | 1,131 |        | 電気通信サービス           |
| MAXIS BHD                    | 50      | 69    | 29           | 804   |        | 電気通信サービス           |
| AXIATA GROUP BERHAD          | 98      | 41    | 15           | 413   |        | 電気通信サービス           |
| PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD | 48      | 48    | 42           | 1,160 |        | 素材                 |
| PETRONAS DAGANGAN BHD        | 10      | 21    | 40           | 1,105 |        | エネルギー              |
| IHH HEALTHCARE BHD           | 52      | 52    | 32           | 894   |        | ヘルスケア機器・サービス       |
| HAP SENG CONSOLIDATED        | 42      | 17    | 12           | 350   |        | 資本財                |
| TOP GLOVE CORP BHD           | —       | 90    | 18           | 498   |        | ヘルスケア機器・サービス       |
| HARTALEGA HOLDINGS BHD       | 35      | 35    | 18           | 507   |        | ヘルスケア機器・サービス       |
| NESTLE (MALAYSIA) BERHAD     | 5       | 1     | 13           | 359   |        | 食品・飲料・タバコ          |
| PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN | —       | 39    | 23           | 635   |        | 素材                 |
| SIME DARBY PLANTATION BHD    | 56      | 56    | 21           | 590   |        | 食品・飲料・タバコ          |
| 小計                           | 株数・金額   | 1,183 | 1,560        | 906   | 24,625 |                    |
|                              | 銘柄数<比率> | 22    | 22           | —     | <1.9%> |                    |
| (タイ)                         |         |       | 千タイバーツ       |       |        |                    |
| CENTRAL PATTANA PCL-NVDR     | 8       | 8     | 41           | 143   |        | 不動産                |
| KASIKORN BANK PCL-NVDR       | 20      | 20    | 287          | 990   |        | 銀行                 |
| CP ALL PCL-NVDR              | 100     | 96    | 568          | 1,962 |        | 食品・生活必需品小売り        |
| BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR  | 14      | 29    | 387          | 1,335 |        | 銀行                 |
| ADVANCED INFO SERVICE-NVDR   | 29      | 29    | 643          | 2,221 |        | 電気通信サービス           |
| SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR  | 37      | 22    | 271          | 937   |        | 銀行                 |
| SIAM CEMENT PCL-NVDR         | 11      | 8     | 302          | 1,043 |        | 素材                 |
| PTT PCL-NVDR                 | 155     | 217   | 830          | 2,863 |        | エネルギー              |

| 銘柄                            | 株数               | 当期    |            | 期末    |        | 業種等                    |
|-------------------------------|------------------|-------|------------|-------|--------|------------------------|
|                               |                  | 株数    | 株数         | 評価額   |        |                        |
|                               |                  |       |            | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |                        |
| (タイ)                          | 百株               | 百株    | 千タイバーツ     | 千円    |        |                        |
| AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR | 77               | 137   | 849        | 2,930 |        | 運輸                     |
| CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR   | 92               | 92    | 234        | 809   |        | 食品・飲料・タバコ              |
| INDORAMA VENTURES PCL-NVDR    | 11               | 45    | 213        | 737   |        | 素材                     |
| PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR  | 48               | 24    | 136        | 469   |        | 素材                     |
| THAI OIL PCL-NVDR             | 4                | —     | —          | —     |        | エネルギー                  |
| INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR     | 39               | 39    | 297        | 1,025 |        | 電気通信サービス               |
| BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR  | 93               | 93    | 205        | 709   |        | ヘルスケア機器・サービス           |
| HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR  | 54               | 54    | 75         | 260   |        | 小売                     |
| ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR   | 7                | —     | —          | —     |        | 公益事業                   |
| BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR  | 22               | —     | —          | —     |        | ヘルスケア機器・サービス           |
| DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR   | —                | 9     | 331        | 1,142 |        | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| TRUE CORP PCL-NVDR            | 297              | —     | —          | —     |        | 電気通信サービス               |
| MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR  | 12               | 61    | 186        | 641   |        | 消費者サービス                |
| BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR   | 48               | 48    | 148        | 513   |        | 食品・生活必需品小売り            |
| ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR      | 19               | 45    | 436        | 1,505 |        | 公益事業                   |
| GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR  | 126              | 152   | 763        | 2,635 |        | 公益事業                   |
| GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR     | —                | 22    | 179        | 618   |        | 公益事業                   |
| 小計                            | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 1,323 | 1,250      | 7,390 | 25,497 |                        |
|                               |                  | 23    | 21         | —     | <1.9%> |                        |
| (フィリピン)                       |                  |       | 千フィリピンペソ   |       |        |                        |
| PLDT INC                      | 3                | 1     | 292        | 649   |        | 電気通信サービス               |
| SM PRIME HOLDINGS INC         | 204              | 276   | 967        | 2,148 |        | 不動産                    |
| AYALA LAND INC                | 88               | 88    | 305        | 679   |        | 不動産                    |
| BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN  | 29               | 58    | 551        | 1,224 |        | 銀行                     |
| INTL CONTAINER TERM SVCS INC  | 18               | 18    | 373        | 829   |        | 運輸                     |
| JOLLIBEE FOODS CORP           | 0.2              | 0.2   | 4          | 10    |        | 消費者サービス                |
| SM INVESTMENTS CORP           | 11               | 11    | 1,045      | 2,320 |        | 資本財                    |
| MANILA ELECTRIC COMPANY       | 9                | 17    | 577        | 1,282 |        | 公益事業                   |
| AYALA CORPORATION             | 4                | 4     | 379        | 843   |        | 資本財                    |
| ABOITIZ EQUITY VENTURES INC   | 24               | 24    | 155        | 344   |        | 資本財                    |
| METROPOLITAN BANK & TRUST     | 51               | 51    | 286        | 637   |        | 銀行                     |
| BDO UNIBANK INC               | 45               | 23    | 293        | 652   |        | 銀行                     |
| SAN MIGUEL CORP               | 10               | 10    | 113        | 252   |        | 資本財                    |
| DMCI HOLDINGS INC             | 110              | —     | —          | —     |        | 資本財                    |
| ALLIANCE GLOBAL GROUP INC     | 110              | 110   | 135        | 301   |        | 資本財                    |
| JG SUMMIT HOLDINGS INC        | 55               | 55    | 339        | 754   |        | 資本財                    |
| GLOBE TELECOM INC             | 1                | 1     | 598        | 1,328 |        | 電気通信サービス               |
| METRO PACIFIC INVESTMENTS CO  | 360              | 360   | 137        | 304   |        | 各種金融                   |
| PUREGOLD PRICE CLUB INC       | —                | 66    | 244        | 542   |        | 食品・生活必需品小売り            |
| GT CAPITAL HOLDINGS INC       | 5                | 1     | 93         | 207   |        | 資本財                    |
| LT GROUP INC                  | 80               | 80    | 80         | 179   |        | 資本財                    |
| 小計                            | 株数・金額<br>銘柄数<比率> | 1,222 | 1,259      | 6,976 | 15,492 |                        |
|                               |                  | 20    | 20         | —     | <1.2%> |                        |
| (インドネシア)                      |                  |       | 千インドネシアルピア |       |        |                        |
| KALBE FARMA TBK PT            | 562              | 562   | 95,540     | 764   |        | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TELKOM INDONESIA PERSERO TBK  | 868              | 920   | 394,680    | 3,157 |        | 電気通信サービス               |
| INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P  | 79               | 79    | 50,165     | 401   |        | 食品・飲料・タバコ              |
| BANK CENTRAL ASIA TBK PT      | 217              | 1,338 | 1,040,295  | 8,322 |        | 銀行                     |
| INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA   | 33               | 33    | 36,135     | 289   |        | 素材                     |
| ASTRA INTERNATIONAL TBK PT    | 349              | 349   | 190,205    | 1,521 |        | 自動車・自動車部品              |
| GUDANG GARAM TBK PT           | 13               | 13    | 40,722     | 325   |        | 食品・飲料・タバコ              |
| BANK RAKYAT INDONESIA PERSER  | 935              | 1,352 | 550,264    | 4,402 |        | 銀行                     |

| 銘柄                            | 株数      | 当期    |       | 期末         |        | 業種等                    |
|-------------------------------|---------|-------|-------|------------|--------|------------------------|
|                               |         | 株数    | 株数    | 評価額        | 評価額    |                        |
|                               |         |       |       | 外貨建金額      | 邦貨換算金額 |                        |
| (インドネシア)                      | 百株      | 百株    |       | 千インドネシアルピア | 千円     |                        |
| SEMEN INDONESIA PERSERO TBK   | 49      | 49    |       | 33,320     | 266    | 素材                     |
| BUKIT ASAM TBK PT             | 110     | —     |       | —          | —      | エネルギー                  |
| BANK MANDIRI PERSERO TBK PT   | 305     | 532   |       | 384,370    | 3,074  | 銀行                     |
| UNILEVER INDONESIA TBK PT     | 180     | 243   |       | 98,658     | 789    | 家庭用品・パーソナル用品           |
| ADARO ENERGY TBK PT           | 229     | 229   |       | 50,609     | 404    | エネルギー                  |
| JASA MARGA (PERSERO) TBK PT   | 62      | —     |       | —          | —      | 運輸                     |
| CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT | 139     | 139   |       | 90,350     | 722    | 食品・飲料・タバコ              |
| INDAH KIAT PULP & PAPER TBK   | 73      | 73    |       | 55,845     | 446    | 素材                     |
| MAYORA INDAH PT               | —       | 351   |       | 70,200     | 561    | 食品・飲料・タバコ              |
| CHANDRA ASRI PETROCHEMICAL    | 97      | 97    |       | 79,055     | 632    | 素材                     |
| SARANA MENARA NUSANTARA PT    | 794     | 794   |       | 82,973     | 663    | 電気通信サービス               |
| ELANG MAHKOTA TEKNOLOGI TBK   | —       | 328   |       | 56,580     | 452    | メディア・娯楽                |
| BARITO PACIFIC TBK PT         | 740     | 740   |       | 64,750     | 518    | 素材                     |
| 小計                            | 株数・金額   | 5,834 | 8,221 | 3,464,716  | 27,717 |                        |
|                               | 銘柄数<比率> | 19    | 19    | —          | <2.1%> |                        |
| (韓国)                          |         |       |       | 千韓国ウォン     |        |                        |
| SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD    | 100     | 117   |       | 868,686    | 82,698 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| KOREA ELECTRIC POWER CORP     | 3       | 3     |       | 7,330      | 697    | 公益事業                   |
| SK TELECOM                    | 0.68    | 2     |       | 14,525     | 1,382  | 電気通信サービス               |
| HYUNDAI MOTOR CO              | 2       | 3     |       | 61,462     | 5,851  | 自動車・自動車部品              |
| POSCO                         | 1       | 2     |       | 53,566     | 5,099  | 素材                     |
| SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO  | 1       | 1     |       | 18,992     | 1,808  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| KT CORP                       | 4       | 2     |       | 7,240      | 689    | 電気通信サービス               |
| HYUNDAI MOBIS CO LTD          | 1       | 1     |       | 41,241     | 3,926  | 自動車・自動車部品              |
| KB FINANCIAL GROUP INC        | 7       | 9     |       | 54,245     | 5,164  | 銀行                     |
| SAMSUNG FIRE & MARINE INS     | 0.62    | 0.62  |       | 12,617     | 1,201  | 保険                     |
| SAMSUNG SDI CO LTD            | 1       | 1     |       | 87,312     | 8,312  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD   | 7       | 12    |       | 47,087     | 4,482  | 銀行                     |
| LG ELECTRONICS INC            | 2       | 2     |       | 37,466     | 3,566  | 耐久消費財・アパレル             |
| AMOREPACIFIC GROUP            | 1       | 1     |       | 4,846      | 461    | 家庭用品・パーソナル用品           |
| KT&G CORP                     | 2       | 3     |       | 24,742     | 2,355  | 食品・飲料・タバコ              |
| NCSOFT CORP                   | 0.31    | 0.33  |       | 18,414     | 1,753  | メディア・娯楽                |
| LG DISPLAY CO LTD             | 4       | 8     |       | 17,340     | 1,650  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR  | 0.96    | 0.6   |       | 4,980      | 474    | 資本財                    |
| AMOREPACIFIC CORP             | 0.74    | 0.74  |       | 11,137     | 1,060  | 家庭用品・パーソナル用品           |
| HANA FINANCIAL GROUP          | 6       | 7     |       | 33,962     | 3,233  | 銀行                     |
| LG CHEM LTD                   | 0.88    | 1     |       | 68,801     | 6,549  | 素材                     |
| LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE    | 0.2     | 0.16  |       | 15,232     | 1,450  | 家庭用品・パーソナル用品           |
| SK INNOVATION CO LTD          | 0.96    | 1     |       | 34,471     | 3,281  | エネルギー                  |
| KAKAO CORP                    | 1       | 6     |       | 59,480     | 5,662  | メディア・娯楽                |
| COWAY CO LTD                  | 0.94    | 0.94  |       | 6,589      | 627    | 耐久消費財・アパレル             |
| KIA CORP                      | 5       | 6     |       | 48,424     | 4,610  | 自動車・自動車部品              |
| SK HYNIX INC                  | 10      | 12    |       | 143,842    | 13,693 | 半導体・半導体製造装置            |
| LG CORP                       | 1       | 3     |       | 24,254     | 2,309  | 資本財                    |
| HYUNDAI STEEL CO              | 2       | 1     |       | 4,497      | 428    | 素材                     |
| KANGWON LAND INC              | 3       | 1     |       | 4,195      | 399    | 消費者サービス                |
| NAVER CORP                    | 3       | 3     |       | 110,768    | 10,545 | メディア・娯楽                |
| CELLTRION INC                 | 1       | 2     |       | 41,685     | 3,968  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CELLTRION INC-NEW             | 0.03    | 0.03  |       | 475        | 45     | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| LG UPLUS CORP                 | 3       | 3     |       | 4,684      | 446    | 電気通信サービス               |
| S-OIL CORP                    | 0.9     | 0.9   |       | 7,767      | 739    | エネルギー                  |
| SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT  | 1       | 1     |       | 10,147     | 966    | 保険                     |

| 銘柄                              | 株数         | 当 期 末 |          |         |                        | 業 種 等     |
|---------------------------------|------------|-------|----------|---------|------------------------|-----------|
|                                 |            | 株数    | 株数       | 評 価 額   |                        |           |
|                                 |            |       |          | 外貨建金額   | 邦貨換算金額                 |           |
| (韓国)                            | 百株         | 百株    | 千韓国ウォン   | 千円      |                        |           |
| LOTTE CHEMICAL CORP             | 0.25       | 0.25  | 5,000    | 476     | 素材                     |           |
| HYUNDAI GLOVIS CO LTD           | 0.43       | 0.43  | 6,772    | 644     | 運輸                     |           |
| KOREA ZINC CO LTD               | 0.14       | 0.35  | 18,095   | 1,722   | 素材                     |           |
| E-MART INC                      | 0.35       | —     | —        | —       | 食品・生活必需品小売り            |           |
| SK INC                          | 0.81       | 0.54  | 12,096   | 1,151   | 資本財                    |           |
| HANON SYSTEMS                   | —          | 4     | 4,644    | 442     | 自動車・自動車部品              |           |
| SAMSUNG SDS CO LTD              | 0.87       | 0.87  | 12,615   | 1,200   | ソフトウェア・サービス            |           |
| SAMSUNG C&T CORP                | 1          | 1     | 17,092   | 1,627   | 資本財                    |           |
| SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD        | 0.32       | 0.32  | 24,960   | 2,376   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |           |
| NETMARBLE CORP                  | 1          | 0.59  | 6,932    | 659     | メディア・娯楽                |           |
| CELLTRION HEALTHCARE CO LTD     | 1          | 1     | 12,024   | 1,144   | ヘルスケア機器・サービス           |           |
| CELLTRION HEALTHCARE CO LTD-NEW | 0.02       | 0.03  | 192      | 18      | ヘルスケア機器・サービス           |           |
| 小 計                             | 株 数        | 金 額   | 197      | 241     | 2,132,935              | 203,055   |
|                                 | 銘柄数 < 比率 > |       | 47       | 47      | —                      | < 15.4% > |
| (台湾)                            |            |       | 千ニュー台湾ドル |         |                        |           |
| DELTA ELECTRONICS INC           | 40         | 40    | 1,076    | 4,418   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |           |
| FAR EASTERN NEW CENTURY CORP    | 40         | 40    | 114      | 469     | 資本財                    |           |
| FORMOSA PLASTICS CORP           | 80         | 110   | 1,149    | 4,720   | 素材                     |           |
| HON HAI PRECISION INDUSTRY      | 234        | 294   | 3,028    | 12,435  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |           |
| UNITED MICROELECTRONICS CORP    | 220        | 260   | 1,599    | 6,566   | 半導体・半導体製造装置            |           |
| NAN YA PLASTICS CORP            | 70         | 120   | 1,026    | 4,213   | 素材                     |           |
| PRESIDENT CHAIN STORE CORP      | 20         | 20    | 531      | 2,180   | 食品・生活必需品小売り            |           |
| TAIWAN CEMENT                   | 127        | 127   | 595      | 2,445   | 素材                     |           |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC    | 370        | 430   | 27,563   | 113,184 | 半導体・半導体製造装置            |           |
| ASUSTEK COMPUTER INC            | 10         | 20    | 720      | 2,956   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |           |
| REALTEK SEMICONDUCTOR CORP      | —          | 10    | 531      | 2,180   | 半導体・半導体製造装置            |           |
| YAGEO CORPORATION               | —          | 10    | 451      | 1,851   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |           |
| QUANTA COMPUTER INC             | 60         | 60    | 558      | 2,291   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |           |
| CATHAY FINANCIAL HOLDING CO     | 170        | 220   | 1,386    | 5,691   | 保険                     |           |
| FORMOSA CHEMICALS & FIBRE       | 70         | 70    | 550      | 2,259   | 素材                     |           |
| FUBON FINANCIAL HOLDING CO      | 150        | 183   | 1,381    | 5,673   | 保険                     |           |
| MEDIATEK INC                    | 30         | 40    | 4,340    | 17,821  | 半導体・半導体製造装置            |           |
| CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT    | 360        | 470   | 1,280    | 5,259   | 銀行                     |           |
| TAIWAN MOBILE CO LTD            | 70         | 30    | 301      | 1,238   | 電気通信サービス               |           |
| CHINA STEEL CORP                | 280        | 310   | 1,036    | 4,258   | 素材                     |           |
| NOVATEK MICROELECTRONICS COR    | —          | 20    | 946      | 3,884   | 半導体・半導体製造装置            |           |
| ADVANTECH CO LTD                | 11         | 11    | 458      | 1,880   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |           |
| CATCHER TECHNOLOGY CO LTD       | 10         | 10    | 155      | 638     | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |           |
| CHUNGHWA TELECOM CO LTD         | 110        | 70    | 819      | 3,363   | 電気通信サービス               |           |
| FAR EASTONE TELECOMM CO LTD     | 80         | 30    | 195      | 800     | 電気通信サービス               |           |
| CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD    | 30         | 30    | 103      | 425     | 自動車・自動車部品              |           |
| FORMOSA PETROCHEMICAL CORP      | 40         | 30    | 286      | 1,177   | エネルギー                  |           |
| MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT    | 260        | 210   | 774      | 3,182   | 銀行                     |           |
| FIRST FINANCIAL HOLDING CO      | 178        | 240   | 604      | 2,482   | 銀行                     |           |
| LARGAN PRECISION CO LTD         | 3          | 3     | 618      | 2,537   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |           |
| UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO    | 110        | 120   | 811      | 3,331   | 食品・飲料・タバコ              |           |
| PEGATRON CORP                   | 50         | 50    | 349      | 1,435   | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |           |
| HOTAI MOTOR COMPANY LTD         | 10         | 10    | 598      | 2,455   | 小売                     |           |
| NANYA TECHNOLOGY CORP           | 20         | 20    | 144      | 591     | 半導体・半導体製造装置            |           |
| TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP     | 40         | 60    | 168      | 693     | 運輸                     |           |

| 銘柄                           | 株数           | 当 期 末  |          | 業 種 等   |                        |  |
|------------------------------|--------------|--------|----------|---------|------------------------|--|
|                              |              | 株 数    | 評 価 額    |         |                        |  |
|                              |              |        | 外貨建金額    |         | 邦貨換算金額                 |  |
| (台湾)                         | 百株           | 百株     | 千ニュー台湾ドル | 千円      |                        |  |
| ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT | 50           | 90     | 900      | 3,695   | 半導体・半導体製造装置            |  |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額    | 3,404  | 3,870    | 57,152  | 234,692                |  |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | 33     | 36       | —       | <17.8%>                |  |
| (インド)                        |              |        | 千インドルピー  |         |                        |  |
| HOUSING DEVELOPMENT FINANCE  | —            | 41     | 10,458   | 16,002  | 銀行                     |  |
| TATA CONSULTANCY SVCS LTD    | —            | 23     | 9,043    | 13,837  | ソフトウェア・サービス            |  |
| ITC LTD                      | —            | 69     | 1,491    | 2,282   | 食品・飲料・タバコ              |  |
| HINDUSTAN UNILEVER LTD       | —            | 20     | 4,770    | 7,299   | 家庭用品・パーソナル用品           |  |
| OIL & NATURAL GAS CORP LTD   | —            | 107    | 1,770    | 2,708   | エネルギー                  |  |
| COAL INDIA LTD               | —            | 45     | 740      | 1,132   | エネルギー                  |  |
| GAIL INDIA LTD               | —            | 44     | 644      | 986     | 公益事業                   |  |
| AMBUJA CEMENTS LTD           | —            | 21     | 755      | 1,156   | 素材                     |  |
| BAJAJ AUTO LTD               | —            | 1      | 610      | 934     | 自動車・自動車部品              |  |
| SUN PHARMACEUTICAL INDUS     | —            | 21     | 1,763    | 2,697   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| ASIAN PAINTS LTD             | —            | 11     | 3,546    | 5,426   | 素材                     |  |
| POWER GRID CORP OF INDIA LTD | —            | 75     | 1,655    | 2,532   | 公益事業                   |  |
| VEDANTA LTD                  | —            | 26     | 849      | 1,299   | 素材                     |  |
| BHARTI AIRTEL LTD            | —            | 56     | 4,026    | 6,161   | 電気通信サービス               |  |
| NTPC LTD                     | —            | 112    | 1,523    | 2,331   | 公益事業                   |  |
| INFOSYS LTD                  | —            | 83     | 14,443   | 22,098  | ソフトウェア・サービス            |  |
| ICICI BANK LTD               | —            | 117    | 9,389    | 14,366  | 銀行                     |  |
| MARUTI SUZUKI INDIA LTD      | —            | 2      | 2,460    | 3,764   | 自動車・自動車部品              |  |
| RELIANCE INDUSTRIES LTD      | —            | 74     | 17,573   | 26,888  | エネルギー                  |  |
| STATE BANK OF INDIA          | —            | 46     | 2,411    | 3,689   | 銀行                     |  |
| TATA STEEL LTD               | —            | 15     | 1,750    | 2,677   | 素材                     |  |
| BHARAT PETROLEUM CORP LTD    | —            | 15     | 578      | 885     | エネルギー                  |  |
| GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD | —            | 7      | 711      | 1,087   | 家庭用品・パーソナル用品           |  |
| DABUR INDIA LTD              | —            | 11     | 597      | 913     | 家庭用品・パーソナル用品           |  |
| JSW STEEL LTD                | —            | 18     | 1,189    | 1,819   | 素材                     |  |
| LARSEN & TOUBRO LTD          | —            | 16     | 3,215    | 4,919   | 資本財                    |  |
| TITAN CO LTD                 | —            | 8      | 1,932    | 2,956   | 耐久消費財・アパレル             |  |
| WIPRO LTD                    | —            | 31     | 1,768    | 2,705   | ソフトウェア・サービス            |  |
| MAHINDRA & MAHINDRA LTD      | —            | 19     | 1,667    | 2,552   | 自動車・自動車部品              |  |
| TATA MOTORS LTD              | —            | 52     | 2,591    | 3,964   | 自動車・自動車部品              |  |
| HCL TECHNOLOGIES LTD         | —            | 27     | 3,053    | 4,671   | ソフトウェア・サービス            |  |
| DIVI'S LABORATORIES LTD      | —            | 3      | 1,356    | 2,075   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |  |
| NESTLE INDIA LTD             | —            | 0.81   | 1,522    | 2,328   | 食品・飲料・タバコ              |  |
| TECH MAHINDRA LTD            | —            | 11     | 1,772    | 2,711   | ソフトウェア・サービス            |  |
| SHREE CEMENT LTD             | —            | 0.26   | 636      | 974     | 素材                     |  |
| INDUS TOWERS LTD             | —            | 28     | 728      | 1,114   | 電気通信サービス               |  |
| EICHER MOTORS LTD            | —            | 2      | 718      | 1,099   | 自動車・自動車部品              |  |
| PIDILITE INDUSTRIES LTD      | —            | 3      | 776      | 1,188   | 素材                     |  |
| INTERGLOBE AVIATION LTD      | —            | 4      | 810      | 1,239   | 運輸                     |  |
| BAJAJ FINANCE LTD            | —            | 5      | 4,032    | 6,168   | 各種金融                   |  |
| GRASIM INDUSTRIES LTD        | —            | 10     | 1,764    | 2,699   | 素材                     |  |
| AVENUE SUPERMARTS LTD        | —            | 4      | 1,666    | 2,550   | 食品・生活必需品小売り            |  |
| INDIAN OIL CORP LTD          | —            | 63     | 774      | 1,184   | エネルギー                  |  |
| BRITANNIA INDUSTRIES LTD     | —            | 2      | 849      | 1,299   | 食品・飲料・タバコ              |  |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額    | —      | 1,371    | 126,394 | 193,383                |  |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | —      | 44       | —       | <14.7%>                |  |
| 合 計                          | 株 数 ・ 金 額    | 22,945 | 30,104   | —       | 1,244,336              |  |
|                              | 銘柄 数 < 比 率 > | 255    | 299      | —       | <94.3%>                |  |

(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。

## 外国新株予約権証券

| 銘柄                  | 期首(前期末) |       | 当 期 末   |        |
|---------------------|---------|-------|---------|--------|
|                     | 証 券 数   | 証 券 数 | 評 価 額   |        |
|                     |         |       | 外貨建金額   | 邦貨換算金額 |
| (タイ)                | 証券      | 証券    | 千タイバーツ  | 千円     |
| MINOR INTL PCL-CW24 | —       | 38    | 0.12692 | 0.437  |
| MINOR INTL PCL-CW23 | —       | 41    | 0.17548 | 0.605  |
| 合 計                 | 証券数・金額  | —     | 0.3024  | 1      |
|                     | 銘柄数<比率> | —     | —       | <0.0%> |

(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) 評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

## 先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄別    |         |  | 当 期 末 |       |
|--------|---------|--|-------|-------|
|        |         |  | 買 建 額 | 売 建 額 |
| 外国     |         |  | 百万円   | 百万円   |
| 株式先物取引 | MINI MS |  | 68    | —     |

(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。

## ○投資信託財産の構成

(2022年1月26日現在)

| 項 目          | 当 期 末     |       |
|--------------|-----------|-------|
|              | 評 価 額     | 比 率   |
|              | 千円        | %     |
| 株式           | 1,244,336 | 87.0  |
| 新株予約権証券      | 1         | 0.0   |
| コール・ローン等、その他 | 186,450   | 13.0  |
| 投資信託財産総額     | 1,430,787 | 100.0 |

(注) 期末における外貨建純資産 (1,316,006千円) の投資信託財産総額 (1,430,787千円) に対する比率は92.0%です。

(注) 外貨建資産は、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。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

|                   |                   |                    |                       |
|-------------------|-------------------|--------------------|-----------------------|
| 1 アメリカドル=113.84円  | 1 香港ドル=14.62円     | 1 シンガポールドル=84.71円  | 1 マレーシアリングgit=27.163円 |
| 1 タイバーツ=3.45円     | 1 フィリピンペソ=2.2207円 | 100インドネシアルピア=0.80円 | 100韓国ウォン=9.52円        |
| 1 ニュー台湾ドル=4.1064円 | 1 インドルピー=1.53円    |                    |                       |

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年1月26日現在)

| 項 目             | 当 期 末          |
|-----------------|----------------|
|                 | 円              |
| (A) 資産          | 1,432,722,775  |
| コール・ローン等        | 169,600,396    |
| 株式(評価額)         | 1,244,336,925  |
| 新株予約権証券(評価額)    | 1,043          |
| 未収入金            | 1,935,239      |
| 未収配当金           | 154,042        |
| 差入委託証拠金         | 16,695,130     |
| (B) 負債          | 113,651,911    |
| 未払金             | 113,482,743    |
| 未払解約金           | 169,167        |
| 未払利息            | 1              |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 1,319,070,864  |
| 元本              | 1,178,709,355  |
| 次期繰越損益金         | 140,361,509    |
| (D) 受益権総口数      | 1,178,709,355口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 11,191円        |

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 923,229,320円  
 期中追加設定元本額 609,597,500円  
 期中一部解約元本額 354,117,465円  
 また、1口当たり純資産額は、期末11,191円です。

## ②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

|                               |                |
|-------------------------------|----------------|
| eMAXIS 日経アジア300インベスタブル・インデックス | 1,141,977,428円 |
| 日経アジア300インベスタブル・インデックス・ファンド   | 36,731,927円    |
| 合計                            | 1,178,709,355円 |

## ○損益の状況 (2021年1月27日～2022年1月26日)

| 項 目                | 当 期          |
|--------------------|--------------|
|                    | 円            |
| (A) 配当等収益          | 19,578,823   |
| 受取配当金              | 19,580,303   |
| 受取利息               | 25           |
| 支払利息               | △ 1,505      |
| (B) 有価証券売買損益       | △ 62,594,283 |
| 売買益                | 166,677,045  |
| 売買損                | △229,271,328 |
| (C) 先物取引等取引損益      | △ 14,682,526 |
| 取引益                | 6,802,817    |
| 取引損                | △ 21,485,343 |
| (D) 保管費用等          | △ 4,992,698  |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | △ 62,690,684 |
| (F) 前期繰越損益金        | 164,115,257  |
| (G) 追加信託差損益金       | 99,641,187   |
| (H) 解約差損益金         | △ 60,704,251 |
| (I) 計(E+F+G+H)     | 140,361,509  |
| 次期繰越損益金(I)         | 140,361,509  |

(注) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (G)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) (H)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。