

■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	2018年1月5日から2027年12月20日まで
運用方針	マザーファンドへの投資を通じて、日本を除くアジア各国・地域の取引所に上場している株式に投資し、日経アジア300インベスタブル指数（ネット・トータルリターン、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指します。
主要投資対象	当ファンドは以下のマザーファンドを主要投資対象とします。 日経アジア300iインデックス・マザーファンド 日本を除くアジア各国・地域の取引所に上場している株式
当ファンドの運用方法	マザーファンドへの投資を通じて、実質的に以下のような運用を行います。 ■主として日本を除くアジア各国・地域の取引所に上場している株式に投資します。 ■日経アジア300インベスタブル指数（ネット・トータルリターン、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指します。 ■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ません。
組入制限	当ファンド ■株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ■外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 日経アジア300iインデックス・マザーファンド ■株式への投資割合には、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。
配分方針	■年1回（原則として毎年12月20日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、分配金額を決定します。 ■分配対象額の範囲は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の全額とします。 ■分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。 ※委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;">ファンドは複利効果による信託財産の成長を優先するため、分配を極力抑制します。 (基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。)</div>

三井住友・ 日経アジア300i インデックスファンド

【運用報告書(全体版)】

(2021年12月21日から2022年12月20日まで)

第 5 期

決算日 2022年12月20日

受益者の皆さまへ

平素は格別のお引立てに預かり、厚くお礼申し上げます。

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて、日本を除くアジア各国・地域の取引所に上場している株式に投資し、日経アジア300インベスタブル指数（ネット・トータルリターン、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指します。当期についても、運用方針に沿った運用を行いました。今後ともご愛顧のほどお願い申し上げます。

三井住友DSアセットマネジメント

〒105-6426 東京都港区虎ノ門1-17-1
<https://www.smd-am.co.jp>

■口座残高など、お取引状況についてのお問い合わせ
お取引のある販売会社へお問い合わせください。

■当運用報告書についてのお問い合わせ

コールセンター 0120-88-2976
受付時間：午前9時～午後5時（土、日、祝・休日を除く）

三井住友・日経アジア300iインデックスファンド

原則として、各表の数量および金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。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。

■ 設定以来の運用実績

決算期	基準価額			(ベンチマーク) 日経アジア300インベスタブル指数 (ネット・トータルリターン、円ベース)		株式組入 比	株式先物 比率 (買建-売建)	投資信託 証券組入 比率	純資産 総額
	(分配落)	税込 分配金	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率				
(設定日) 2018年1月5日	円 10,000	円 —	% —	100.00	% —	% —	% —	% —	百万円 200
1期(2018年12月20日)	8,312	0	△16.9	86.07	△13.9	78.5	21.5	—	1,145
2期(2019年12月20日)	9,259	0	11.4	97.17	12.9	80.8	19.4	—	1,245
3期(2020年12月21日)	10,080	0	8.9	108.47	11.6	87.1	12.9	—	928
4期(2021年12月20日)	10,814	0	7.3	115.72	6.7	90.7	9.2	0.0	1,097
5期(2022年12月20日)	10,715	0	△0.9	115.70	△0.0	87.7	12.2	—	1,112

※基準価額の騰落率は分配金込み。

※当ファンドは親投資信託を組み入れますので、比率は実質比率を記載しています。

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

※ベンチマークは、当報告書作成時に知りえた情報をもとに当社が独自に計算し、設定時を100として、指数化しています。なお、基準価額の反映を考慮した日付の値を使用しています。

※「日経アジア300インベスタブル指数」(以下「日経アジア300i」といいます。)は、株式会社日本経済新聞社(以下「日経」といいます。)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自体および日経アジア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、その運用およ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およ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。

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		(ベンチマーク) 日経アジア300インベスタブル指数 (ネット・トータルリターン、円ベース)		株式組入 比 率	株式先物 比 率 (買建-売建)	投資信託 証券組入 比 率
	円	騰 落 率	円	騰 落 率			
(期 首) 2021年12月20日	10,814	—	115.72	—	90.7	9.2	0.0
12月末	11,052	2.2	118.30	2.2	89.2	10.4	0.0
2022年1月末	10,850	0.3	116.42	0.6	88.9	11.1	0.0
2月末	10,622	△1.8	113.38	△2.0	88.9	11.2	0.0
3月末	11,211	3.7	119.41	3.2	87.5	12.6	0.0
4月末	10,764	△0.5	114.07	△1.4	86.8	13.2	—
5月末	11,002	1.7	116.97	1.1	86.0	13.6	—
6月末	11,270	4.2	120.35	4.0	86.8	13.0	—
7月末	10,998	1.7	118.06	2.0	85.7	14.2	—
8月末	11,212	3.7	119.71	3.5	85.2	14.8	—
9月末	10,295	△4.8	109.42	△5.4	86.9	13.2	—
10月末	10,008	△7.5	105.95	△8.4	85.8	14.4	—
11月末	10,889	0.7	115.63	△0.1	86.8	13.3	—
(期 末) 2022年12月20日	10,715	△0.9	115.70	△0.0	87.7	12.2	—

※騰落率は期首比です。

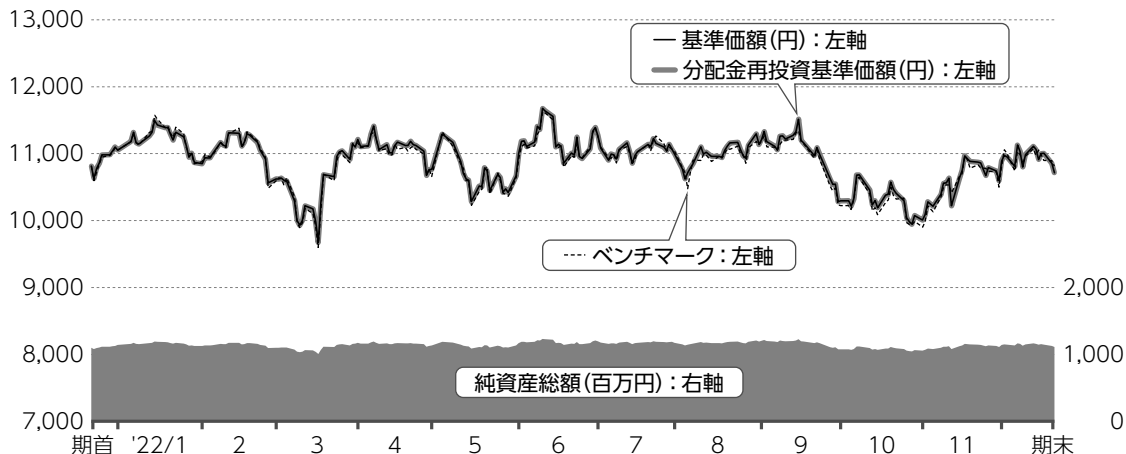
※当ファンドは親投資信託を組み入れますので、比率は実質比率を記載しています。

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

1 運用経過

基準価額等の推移について(2021年12月21日から2022年12月20日まで)

基準価額等の推移



※分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

期首	10,814円
期末	10,715円 (既払分配金0円(税引前))
騰落率	-0.9% (分配金再投資ベース)

分配金再投資基準価額について

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と仮定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します。

※分配金を再投資するかどうかについては、受益者の皆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などによって課税条件も異なります。したがって、受益者の皆さまの損益の状況を示すものではありません。(以下、同じ)

三井住友・日経アジア300iインデックスファンド

※当ファンドのベンチマークは、日経アジア300インベスタブル指数(ネット・トータルリターン、円ベース)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」といいます。)は、株式会社日本経済新聞社(以下「日経」といいます。)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自体および日経アジア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、その運用およ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およ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。

基準価額の主な変動要因(2021年12月21日から2022年12月20日まで)

当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、実質的にアジア各国・地域の株式に投資し、日経アジア300インベスタブル指数(ネット・トータルリターン、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。実質組入外貨建資産については、対円での為替ヘッジを行いませんでした。

上昇要因

- 6月中旬を底に、インフレのピークアウト期待や景気、企業業績の回復期待などから、インド株式市場が上昇したこと
- 米国の金利上昇に伴う米ドル高・円安の進展により、投資対象通貨が総じて円に対して上昇したこと

下落要因

- 米国の金利上昇とロシアによるウクライナ侵攻に伴う地政学リスクの高まりにより、投資対象の株式市場が概ね下落したこと
- 中国景気の先行き不透明感、IT(情報技術)サプライチェーン(供給網)の混乱に対する懸念などから、香港や中国本土、台湾、韓国などの株式市場が下落したこと

投資環境について(2021年12月21日から2022年12月20日まで)

主なアジアの株式市場は下落しました。また、主なアジア通貨は対円で上昇しました。

アジア株式市場

期を通じて、米国の利上げにより世界の金融市場は引き締め局面へ移行しました。米国に追随してインフレが顕在化した欧州や、インドなどが利上げを実施し、世界的に株式市場は下落圧力が強まりました。

香港や中国市場は、幅広い分野で政府の介入が強まることへの警戒感、ロシアのウクライナ侵攻、中国各地での新型コロナウイルスの感染拡大に加え、根強い不動産問題や米中関係などの不透明感が払しょくされなかったことなどから、下落しました。

台湾や韓国市場は、感染者数の増勢が続いたことや世界的なITや自動車などの供給網の混乱を嫌気したこと、急激な金利上昇に伴う世界的な景気後退懸念から下落しました。

為替市場

米ドル・円相場は米国の政策金利及び先行きの金利見通しが大幅に引き上げられたことや、日銀が金利上昇を抑制するスタンスを示したことなどから日米金利差がさらに拡大するとの観測が強まり、米ドル高・円安が進みました。アジアの主要通貨も、米ドル・円の動きに連れて、円に対して上昇しました。

11月上旬から期末にかけては、FRB(米連邦準備制度理事会)による利上げペースが鈍化するとの観測から米金利が低下に転じたことで、米ドル安・円高となりました。

ポートフォリオについて(2021年12月21日から2022年12月20日まで)

当ファンド

期を通じて、主要投資対象である「日経アジア300iインデックス・マザーファンド」を高位に組み入れました。

日経アジア300iインデックス・マザーファンド

●株式組入比率

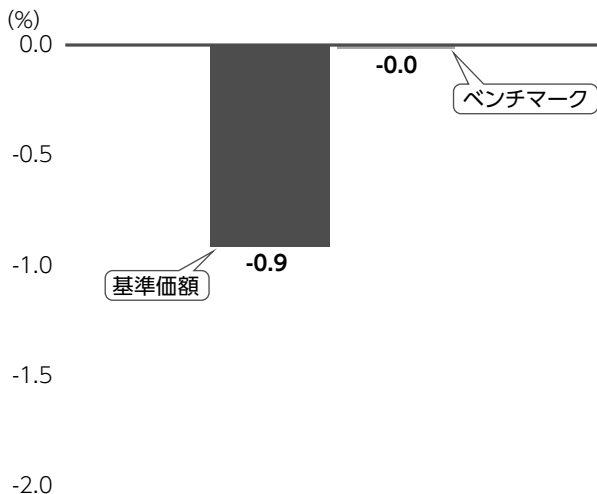
期を通じて、株式および株式指数先物の組入れにより、実質株式組入比率は100%に近い高位を保ちました。

●運用経過

日々の追加設定・解約による資金変動には株式指数先物取引を利用し、実質株式組入比率の調整を行い、トラッキングエラー（ポートフォリオとベンチマークのリターンの乖離）を低く抑えました。

ベンチマークとの差異について(2021年12月21日から2022年12月20日まで)

基準価額とベンチマークの騰落率対比



当ファンドは、日経アジア300iインベスタブル指数(ネット・トータルリターン、円ベース)をベンチマークとしています。

左のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

※基準価額は分配金再投資ベース

ベンチマークとの差異の状況および要因

基準価額の騰落率は-0.9%(分配金再投資ベース)となり、ベンチマークの騰落率-0.0%を0.9%下方乖離しました。

下方乖離要因

- ベンチマークと先物にリターンの差異が生じたこと
- 売買コストが生じたこと
- 保管費用等の支払い

分配金について(2021年12月21日から2022年12月20日まで)

(単位：円、1万口当たり、税引前)

項目	第5期
当期分配金	0
(対基準価額比率)	(0.00%)
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	1,537

※単位未満を切り捨てているため、「当期の収益」と「当期の収益以外」の合計が「当期分配金」と一致しない場合があります。

※「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(税引前)込み)に対する比率で、当ファンドの収益率とは異なります。

期間の分配は、複利効果による信託財産の成長を優先するため、見送りとしたしました。

なお、留保益につきましては、運用の基本方針に基づき運用いたします。

2 今後の運用方針

当ファンド

引き続き、「日経アジア300iインデックス・マザーファンド」を高位に組み入れて運用を行います。

日経アジア300iインデックス・マザーファンド

引き続き、日経アジア300インベスタブル指数(ネット・トータルリターン、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。株式指数先物等の組入れにより、実質株式組入比率を概ね100%に保つことを基本とします。

3 お知らせ

約款変更について

該当事項はございません。

1万口当たりの費用明細(2021年12月21日から2022年12月20日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	36円	0.330%	信託報酬=期中の平均基準価額×信託報酬率×(経過日数/年日数) 期中の平均基準価額は10,890円です。
(投 信 会 社)	(17)	(0.154)	投信会社: ファンド運用の指図等の対価
(販 売 会 社)	(17)	(0.154)	販売会社: 交付運用報告書等各種資料の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(2)	(0.022)	受託会社: ファンド財産の保管および管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	7	0.065	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
(株 式)	(3)	(0.029)	売買委託手数料: 有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(先物・オプション)	(4)	(0.036)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	1	0.013	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
(株 式)	(1)	(0.013)	有価証券取引税: 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(公 社 債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	42	0.384	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)	(40)	(0.366)	保管費用: 海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送付金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(1)	(0.008)	監査費用: 監査法人に支払うファンドの監査費用
(そ の 他)	(1)	(0.011)	そ の 他: 信託事務の処理等に要するその他費用
合 計	86	0.792	

※期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出しています。

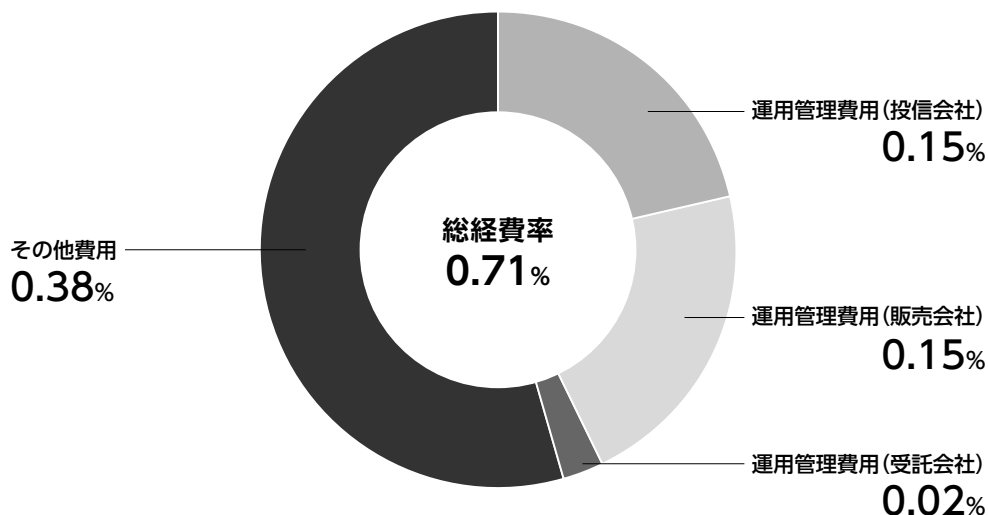
※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

※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。



参考情報 総経費率(年率換算)



※各費用は、前掲「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、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。

※各比率は、年率換算した値(小数点以下第2位未満を四捨五入)です。

※上記の前提条件で算出しているため、「1万口当たりの費用明細」の各比率とは、値が異なる場合があります。なお、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。

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(年率換算)は0.71%です。

■ 当期中の売買及び取引の状況(2021年12月21日から2022年12月20日まで)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
日経アジア300iインデックス・マザーファンド	千口 147,902	千円 163,433	千口 128,522	千円 143,228

■ 親投資信託の株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2021年12月21日から2022年12月20日まで)

項 目	当 期
	日経アジア300iインデックス・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	121,897千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	993,099千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.12

※(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

※外貨建資産については、(a)は各月末(ただし、決算日の属する月については決算日)の日本の対顧客電信売買相場の仲値で換算した邦貨金額の合計、(b)は各月末の同仲値で換算した邦貨金額合計の平均です。

■ 利害関係人との取引状況等(2021年12月21日から2022年12月20日まで)

当期中における利害関係人との取引等はありません。

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況

(2021年12月21日から2022年12月20日まで)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

■ 組入れ資産の明細(2022年12月20日現在)

親投資信託残高

種 類	期首(前期末)	期	末
	口 数	口 数	評 価 額
日経アジア300iインデックス・マザーファンド	千口 1,003,760	千口 1,023,140	千円 1,114,507

※日経アジア300iインデックス・マザーファンドの期末の受益権総口数は1,023,140,841口です。

■ 投資信託財産の構成

(2022年12月20日現在)

項 目	期 末	
	評 価 額	比 率
日経アジア300iインデックス・マザーファンド	1,114,507 千円	98.7%
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	14,776	1.3
投 資 信 託 財 産 総 額	1,129,283	100.0

※日経アジア300iインデックス・マザーファンドにおいて、期末における外貨建資産(1,113,472千円)の投資信託財産総額(1,127,668千円)に対する比率は98.7%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本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、1アメリカ・ドル=134.54円、1香港・ドル=17.29円、1シンガポール・ドル=99.18円、1台湾・ドル=4.377円、1フィリピン・ペソ=2.428円、1インド・ルピー=1.64円、100インドネシア・ルピア=0.87円、100韓国・ウォン=10.35円、1マレーシア・リングギット=30.351円、1タイ・バーツ=3.85円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年12月20日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	1,129,283,417円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,083,581
日経アジア300iインデックス・マザーファンド(評価額)	1,114,507,318
未 収 入 金	12,692,518
(B) 負 債	16,697,874
未 払 解 約 金	14,754,343
未 払 信 託 報 酬	1,899,198
そ の 他 未 払 費 用	44,333
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	1,112,585,543
元 本	1,038,331,074
次 期 繰 越 損 益 金	74,254,469
(D) 受 益 権 総 口 数	1,038,331,074口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	10,715円

※当期における期首元本額1,015,275,945円、期中追加設定元本額220,796,312円、期中一部解約元本額197,741,183円です。

※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

■ 分配金のお知らせ

	当 期
1 万 口 当 た り 分 配 金 (税 引 前)	0円

上記のほか、投資信託財産の計算に関する規則第58条第1項各号に該当する事項はありません。

■ 損益の状況

(自2021年12月21日 至2022年12月20日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 257円
受 取 利 息	20
支 払 利 息	△ 277
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 7,920,537
売 買 益	4,585,658
売 買 損	△ 12,506,195
(C) 信 託 報 酬 等	△ 3,867,472
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 11,788,266
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	51,825,631
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	34,217,104
(配当等相当額)	(83,793,439)
(売買損益相当額)	(△ 49,576,335)
(G) 合 計 (D + E + F)	74,254,469
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	74,254,469
追 加 信 託 差 損 益 金	34,217,104
(配当等相当額)	(84,195,829)
(売買損益相当額)	(△ 49,978,725)
分 配 準 備 積 立 金	75,440,987
繰 越 損 益 金	△ 35,403,622

※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。
 ※株式投信の信託報酬等には消費税等相当額が含まれており、公社債投信には内訳の一部に消費税等相当額が含まれています。
 ※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。
 ※分配金の計算過程は以下の通りです。

	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	20,285,541円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	84,195,829
(d) 分配準備積立金	55,155,446
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	159,636,816
1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	1,537.44
(f) 分配金	0
1 万 口 当 た り 分 配 金	0

日経アジア300iインデックス・マザーファンド

第5期（2021年12月21日から2022年12月20日まで）

信託期間	無期限（設定日：2018年1月5日）
運用方針	<p>■主として日本を除くアジア各国・地域の取引所に上場している株式に投資し、日経アジア300インベスタブル指数（ネット・トータルリターン、円ベース）に連動する投資成果を目指して運用を行います。</p> <p>■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ません。</p>

原則として、各表の数量および金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。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。

■設定以来の運用実績

決算期	基準価額		(ベンチマーク) 日経アジア300インベスタブル指数 (ネット・トータルリターン、円ベース)		株式組入 比率	株式先物 比率 (買建-売建)	投資信託 証券組入 比率	純資産 総額
	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率				
(設定日) 2018年1月5日	円 10,000	% -	100.00	% -	% -	% -	% -	百万円 200
1期(2018年12月20日)	8,358	△16.4	86.07	△13.9	78.4	21.5	-	1,147
2期(2019年12月20日)	9,336	11.7	97.17	12.9	80.6	19.3	-	1,247
3期(2020年12月21日)	10,186	9.1	108.47	11.6	87.0	12.9	-	930
4期(2021年12月20日)	10,958	7.6	115.72	6.7	90.6	9.2	0.0	1,099
5期(2022年12月20日)	10,893	△0.6	115.70	△0.0	87.5	12.2	-	1,114

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

※ベンチマークは、当報告書作成時に知れた情報をもとに当社が独自に計算し、設定時を100として、指数化しています。なお、基準価額の反映を考慮した日付の値を使用しています。

※指数の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

■ 当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		(ベ ン チ マ ー ク) 日経アジア300iインベスタブル指数 (ネット・トータル リターン、円ベース)		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率 (買建-売建)	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
(期 首) 2021年12月20日	円 10,958	% -	115.72	% -	% 90.6	% 9.2	% 0.0
12月末	11,201	2.2	118.30	2.2	89.2	10.4	0.0
2022年1月末	10,999	0.4	116.42	0.6	88.9	11.1	0.0
2月末	10,771	△1.7	113.38	△2.0	88.8	11.2	0.0
3月末	11,371	3.8	119.41	3.2	87.4	12.6	0.0
4月末	10,920	△0.3	114.07	△1.4	86.7	13.2	-
5月末	11,165	1.9	116.97	1.1	85.9	13.6	-
6月末	11,440	4.4	120.35	4.0	86.8	13.0	-
7月末	11,167	1.9	118.06	2.0	85.7	14.2	-
8月末	11,388	3.9	119.71	3.5	85.1	14.8	-
9月末	10,459	△4.6	109.42	△5.4	86.8	13.1	-
10月末	10,171	△7.2	105.95	△8.4	85.7	14.3	-
11月末	11,068	1.0	115.63	△0.1	86.7	13.3	-
(期 末) 2022年12月20日	10,893	△0.6	115.70	△0.0	87.5	12.2	-

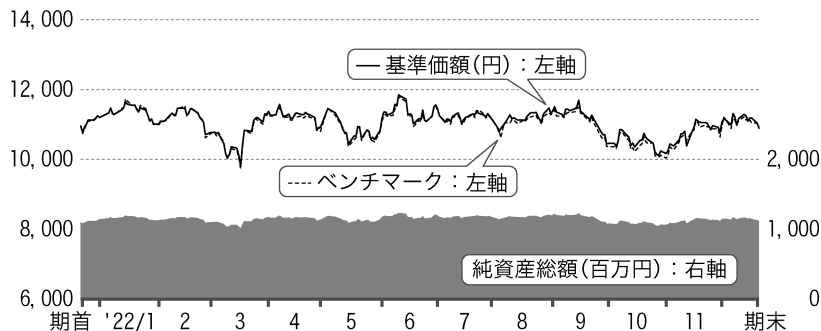
※騰落率は期首比です。

※株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

1 運用経過

▶ 基準価額等の推移について (2021年12月21日から2022年12月20日まで)

基準価額等の推移



期首	10,958円
期末	10,893円
騰落率	-0.6%

※ベンチマークは、期首の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

※当ファンドのベンチマークは、日経アジア300インベスタブル指数(ネット・トータルリターン、円ベース)です。
 ※指数の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

▶ 基準価額の主な変動要因 (2021年12月21日から2022年12月20日まで)

当ファンドは、実質的にアジア各国・地域の株式に投資し、日経アジア300インベスタブル指数(ネット・トータルリターン、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。外貨建資産については、対円での為替ヘッジを行いませんでした。

上昇要因

- ・ 6月中旬を底に、インフレのピークアウト期待や景気、企業業績の回復期待などから、インド株式市場が上昇したこと
- ・ 米国の金利上昇に伴う米ドル高・円安の進展により、投資対象通貨が総じて円に対して上昇したこと

下落要因

- ・ 米国の金利上昇とロシアによるウクライナ侵攻に伴う地政学リスクの高まりにより、投資対象の株式市場が概ね下落したこと
- ・ 中国景気の先行き不透明感、IT(情報技術)サプライチェーン(供給網)の混乱に対する懸念などから、香港や中国本土、台湾、韓国などの株式市場が下落したこと

▶ 投資環境について (2021年12月21日から2022年12月20日まで)

主なアジアの株式市場は下落しました。また、主なアジア通貨は対円で上昇しました。

アジア株式市場

期を通じて、米国の利上げにより世界の金融市場は引き締め局面へ移行しました。米国に追隨してインフレが顕在化した欧州や、インドなどが利上げを実施し、世界的に株式市場は下落圧力が強まりました。

香港や中国市場は、幅広い分野で政府の介入が強まることへの警戒感、ロシアのウクライナ侵攻、中国各地での新型コロナウイルスの感染拡大に加え、根強い不動産問題や米中関係などの不透明感が払しょくされなかったことなどから、下落しました。

台湾や韓国市場は、感染者数の増勢が続いたことや世界的なITや自動車などの供給網の混乱を嫌気したこと、急激な金利上昇に伴う世界的な景気後退懸念から下落しました。

為替市場

米ドル・円相場は米国の政策金利及び先行きの金利見通しが大幅に引き上げられたことや、日銀が金利上昇を抑制するスタンスを示したことなどから日米金利差がさらに拡大するとの観測が強まり、米ドル高・円安が進みました。アジアの主要通貨も、米ドル・円の動きに連れて、円に対して上昇しました。

11月上旬から期末にかけては、FRB（米連邦準備制度理事会）による利上げペースが鈍化するとの観測から米金利が低下に転じたことで、米ドル安・円高となりました。

▶ ポートフォリオについて (2021年12月21日から2022年12月20日まで)

株式組入比率

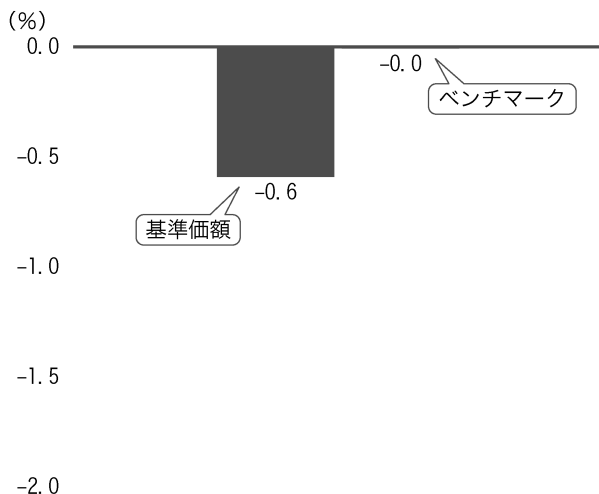
期を通じて、株式および株式指数先物の組入れにより、実質株式組入比率は100%に近い高位を保ちました。

運用経過

日々の追加設定・解約による資金変動には株式指数先物取引を利用し、実質株式組入比率の調整を行い、トラッキングエラー（ポートフォリオとベンチマークのリターンの乖離）を低く抑えました。

▶ ベンチマークとの差異について (2021年12月21日から2022年12月20日まで)

基準価額とベンチマークの騰落率対比



当ファンドは、日経アジア300インベスタブル指数（ネット・トータルリターン、円ベース）をベンチマークとしています。

左のグラフは、基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

【ベンチマークとの差異の状況および要因】

基準価額の騰落率は-0.6%となり、ベンチマークの騰落率-0.0%を0.6%下方乖離しました。

下方乖離要因

- ・ベンチマークと先物にリターンの差異が生じたこと
- ・売買コストが生じたこと
- ・保管費用等の支払い

2 今後の運用方針

引き続き、日経アジア300インベスタブル指数（ネット・トータルリターン、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。株式指数先物等の組入れにより、実質株式組入比率を概ね100%に保つことを基本とします。

■ 1万口当たりの費用明細(2021年12月21日から2022年12月20日まで)

項目	金額	比率	項目の概要
(a) 売買委託手数料 (株式) (先物・オプション) (投資信託証券)	7円 (3) (4) (0)	0.065% (0.029) (0.036) (0.000)	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：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) (投資信託証券)	1 (1) (0)	0.013 (0.013) (0.000)	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：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)	42 (40) (1)	0.376 (0.365) (0.011)	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：海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送回金・資産の移転等に要する費用 その他：信託事務の処理等に要するその他費用
合計	50	0.454	

期中の平均基準価額は11,054円です。

※期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は、追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出しています。

※比率欄は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

※各項目毎に円未満は四捨五入しています。

■ 当期中の売買及び取引の状況(2021年12月21日から2022年12月20日まで)

(1)株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	香 港	百株 633 (8.73)	千香港・ドル 1,276 (△2)	百株 806	千香港・ドル 1,002
	シ ン ガ ポ ー ル	百株 66	千シンガポール・ドル 21	百株 131	千シンガポール・ドル 39
	台 湾	百株 385.5 (15.58)	千台湾・ドル 3,355 (△150)	百株 335.51	千台湾・ドル 1,406
	フ ィ リ ピ ン	百株 274.9 (20.74)	千フィリピン・ペソ 642 (-)	百株 155.24	千フィリピン・ペソ 646
	イ ン ド	百株 67.9 (149.92)	千インド・ルピー 8,182 (-)	百株 128.2	千インド・ルピー 4,854
国	イ ン ド ネ シ ア	百株 500 (203.98)	千インドネシア・ルピア 241,009 (-)	百株 413	千インドネシア・ルピア 111,413

日経アジア300 i インデックス・マザーファンド

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	韓 国	百株 6.61 (0.12)	千韓国・ウォン 44,526 (-)	百株 17.76	千韓国・ウォン 83,278
	マ レ - シ ア	百株 53	千マレーシア・リンギット 46	百株 118	千マレーシア・リンギット 74
	タ イ	百株 186	千タイ・バーツ 981	百株 200	千タイ・バーツ 1,144

※金額は受渡し代金。

※()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。

(2) 投資信託証券

			買 付		売 付		
			口 数	買 付 額	口 数	売 付 額	
外 国	シンガポール	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	口	千シンガポール・ドル	口	千シンガポール・ドル	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	-	-	696	1	
			(127)	(-)	(-)	127	0
					(-)	(-)	(-)

※金額は受渡し代金。

※()内は分割・償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

※管理上の都合により、一部の銘柄において属性が変わっている場合があります。

(3) 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 1,703	百万円 1,674	百万円 -	百万円 -

※金額は受渡し代金。

※外国の取引金額は、各月末(ただし、決算日の属する月については決算日)の日本の対顧客電信売買相場の仲値で換算した邦貨金額の合計です。

■ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2021年12月21日から2022年12月20日まで)

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	121,897千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	993,099千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.12

※(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

※外貨建資産については、(a)は各月末(ただし、決算日の属する月については決算日)の日本の対顧客電信売買相場の仲値で換算した邦貨金額の合計、(b)は各月末の同仲値で換算した邦貨金額合計の平均です。

■ 利害関係人との取引状況等(2021年12月21日から2022年12月20日まで)

当期中における利害関係人との取引等はありません。

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

■ 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況
(2021年12月21日から2022年12月20日まで)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

■ 組入れ資産の明細(2022年12月20日現在)

(1)外国株式

銘柄	期首(前期末)		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	千アメリカ・ドル	千円	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	5	5	25	3,390	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	5 1	25 -	3,390 <0.3%>	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	190	190	83	1,435	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	110	60	25	433	資本財
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	30	-	-	-	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	40	40	200	3,468	消費者サービス
MTR CORP	20	30	120	2,082	運輸
SUN HUNG KAI PROPERTIES	30	30	315	5,451	不動産
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	10	-	-	-	不動産
CLP HOLDINGS LTD	30	30	167	2,899	公益事業
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	10	10	25	439	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	120	90	109	1,885	自動車・自動車部品
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	27.3	27.3	72	1,255	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	204.16	204.16	149	2,587	公益事業
HANG SENG BANK LTD	15	13	165	2,854	銀行
NEW WORLD DEVELOPMENT	30	-	-	-	不動産
CGN POWER CO LTD-H	200	200	36	622	公益事業
CHINA VANKE CO LTD-H	34	34	56	982	不動産
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	30	30	164	2,842	食品・飲料・タバコ
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	50	50	226	3,911	資本財
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	50	50	20	347	不動産
CK ASSET HOLDINGS LTD	40	35	162	2,804	不動産
CHINA GAS HOLDINGS LTD	38	38	41	718	公益事業
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	440	440	162	2,814	エネルギー
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	22	22	725	12,537	各種金融
WH GROUP LTD	140	-	-	-	食品・飲料・タバコ
ASMPT LTD	-	5	27	477	半導体・半導体製造装置
TENCENT HOLDINGS LTD	112	112	3,588	62,044	メディア・娯楽
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	-	30	60	1,039	不動産
XIAOMI CORP-CLASS B	254	254	273	4,734	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

日経アジア300iインデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
AIR CHINA LTD-H	60	40	28	494	運輸
ZTE CORP-H	14	14	24	421	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PETROCHINA CO LTD-H	480	380	133	2,306	エネルギー
MEITUAN-CLASS B	77	74	1,323	22,876	小売
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	272	272	2,367	40,938	小売
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	—	32	79	1,369	食品・飲料・タバコ
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	60	60	301	5,207	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	25	25	69	1,203	素材
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,840	1,910	886	15,323	銀行
CHINA FEIHE LTD	—	50	35	616	食品・飲料・タバコ
JD.COM INC - CL A	33	38.33	859	14,858	小売
NETEASE INC	37	37	411	7,113	メディア・娯楽
HAIER SMART HOME CO LTD-H	36	42	111	1,920	耐久消費財・アパレル
CHINA TOWER CORP LTD-H	860	860	71	1,234	電気通信サービス
WUXI APPTec CO LTD-H	8	8	59	1,031	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	10	10	20	349	消費者サービス
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	29	—	—	—	消費者サービス
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	40	—	—	—	運輸
BAIDU INC-CLASS A	40	42	466	8,067	メディア・娯楽
BEIGENE LTD	9	13	154	2,672	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BILIBILI INC-CLASS Z	4	4	71	1,236	メディア・娯楽
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	50	60	134	2,328	エネルギー
ZTO EXPRESS CAYMAN INC	11	9	189	3,267	運輸
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	150.4	150.4	124	2,145	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA RESOURCES LAND LTD	60	60	214	3,713	不動産
BYD CO LTD-H	15	15	306	5,301	自動車・自動車部品
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	490	570	147	2,542	銀行
AIA GROUP LTD	220	222	1,854	32,069	保険
CITIC LTD	30	120	94	1,637	資本財
IND & COMM BK OF CHINA-H	1,390	1,220	463	8,015	銀行
SUPER HI INTERNATIONAL HOLDI	—	1	0	13	消費者サービス
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	80	70	146	2,529	不動産
CRRC CORP LTD - H	—	80	25	438	資本財
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	—	60	47	824	運輸
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	130	130	38	663	不動産
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	20	20	196	3,404	耐久消費財・アパレル
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	30	30	264	4,569	資本財
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	72	52	27	481	自動車・自動車部品
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	13	15	115	2,000	耐久消費財・アパレル
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	105	110	548	9,490	保険
CHINA MENGNIU DAIRY CO	—	50	173	2,999	食品・飲料・タバコ
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	65	65	67	1,168	自動車・自動車部品
WEICHAI POWER CO LTD-H	50	20	21	368	資本財
SUNNY OPTICAL TECH	14	14	133	2,312	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	—	14	147	2,548	公益事業
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	60	—	—	—	資本財
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	120	100	106	1,832	素材
CHINA EVERGRANDE GROUP	40	40	5	102	不動産

日経アジア300インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
CIOC GROUP LTD-H	90	90	32	560	素材	
GANFENG LITHIUM GROUP CO L-H	—	8.4	54	935	素材	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	25	25	64	1,106	不動産	
BOC AVIATION LTD	6	6	39	688	資本財	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	—	20	27	480	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	9,546.86 70	9,382.59 74	20,269 —	350,460 <31.4%>	
(シンガポール)		百株	百株	千シンガポール・ドル	千円	
THAI BEVERAGE PCL	122	126	8	843	食品・飲料・タバコ	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	27	28	86	8,597	銀行	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	32	32	109	10,825	銀行	
SINGAPORE AIRLINES LTD	16	25	13	1,383	運輸	
CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	45	—	—	—	不動産	
OLAM GROUP LTD	—	19	2	269	食品・生活必需品小売り	
KEPPEL CORP LTD	28	28	20	2,030	資本財	
UOL GROUP LTD	15	9	6	599	不動産	
CITY DEVELOPMENTS LTD	8	8	6	649	不動産	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	3	2	5	564	資本財	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	78	75	91	9,082	銀行	
GENTING SINGAPORE LTD	157	90	8	843	消費者サービス	
VENTURE CORP LTD	5	5	8	849	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	139	139	36	3,584	電気通信サービス	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	19	28	9	938	資本財	
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	20	20	6	658	公益事業	
SATS LTD	18	12	3	339	運輸	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	18	15	13	1,335	各種金融	
COMFORTDELGRO CORP LTD	9	38	4	463	運輸	
OLAM INTERNATIONAL LTD	19	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	40	54	22	2,217	食品・飲料・タバコ	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	818 20	753 19	464 —	46,077 <4.1%>	
(台湾)		百株	百株	千台湾・ドル	千円	
SILERGY CORP	—	6	282	1,238	半導体・半導体製造装置	
ADVANTECH CO LTD	10.99	10.99	372	1,630	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	55	65	622	2,725	半導体・半導体製造装置	
WIWYNN CORP	—	1.5	127	560	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TAIWAN CEMENT	101.35	111.47	377	1,651	素材	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	90	90	587	2,572	食品・飲料・タバコ	
FORMOSA PLASTICS CORP	90	80	690	3,022	素材	
NAN YA PLASTICS CORP	100	100	715	3,129	素材	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	80	80	563	2,465	素材	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	70	70	219	959	資本財	
CHINA STEEL CORP	250	230	650	2,849	素材	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	20	—	—	—	自動車・自動車部品	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	8	8	476	2,083	小売	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	190	210	901	3,948	半導体・半導体製造装置	
DELTA ELECTRONICS INC	40	40	1,160	5,077	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	236	226	2,293	10,041	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	

日経アジア300i インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
YAGEO CORPORATION	5	3.97	187	820	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	350	350	16,327	71,473	半導体・半導体製造装置
ASUSTEK COMPUTER INC	10	10	264	1,155	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	10	10	294	1,286	半導体・半導体製造装置
QUANTA COMPUTER INC	50	50	362	1,584	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NANYA TECHNOLOGY CORP	20	20	107	470	半導体・半導体製造装置
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	70	70	780	3,416	電気通信サービス
MEDIATEK INC	30	30	1,968	8,614	半導体・半導体製造装置
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	20	10	169	739	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
EVERGREEN MARINE CORP LTD	—	20	324	1,418	運輸
WAN HAI LINES LTD	—	23	175	767	運輸
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	143	150.15	849	3,720	保険
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	150	150	602	2,636	保険
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	—	266.84	648	2,838	銀行
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	230	205	628	2,750	銀行
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	390	360	793	3,474	銀行
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	185.51	—	—	—	銀行
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	10	10	270	1,184	食品・生活必需品小売り
LARGAN PRECISION CO LTD	2	2	450	1,969	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	10	10	309	1,352	半導体・半導体製造装置
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	—	20	281	1,230	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN MOBILE CO LTD	40	30	282	1,237	電気通信サービス
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	40	30	197	862	電気通信サービス
PEGATRON CORP	30	30	191	837	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	20	30	240	1,054	エネルギー
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	60	60	174	762	運輸
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	—	2.5	231	1,013	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,216.85 36	3,282.42 41	37,151 —	162,631 <14.6%>
(フィリピン)	百株	百株	千フィリピン・ペソ	千円	
AYALA LAND INC	102	102	299	728	不動産
PUREGOLD PRICE CLUB INC	20	20	66	161	食品・生活必需品小売り
PLDT INC	2	2	238	579	電気通信サービス
ACEN CORP	—	172	123	299	公益事業
METROPOLITAN BANK & TRUST	49.9	49.9	273	665	銀行
EMPERADOR INC	—	50	101	245	食品・飲料・タバコ
MANILA ELECTRIC COMPANY	5.7	5.7	166	403	公益事業
SM PRIME HOLDINGS INC	145	205	698	1,695	不動産
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	36	36	351	852	銀行
AYALA CORPORATION	5	5	349	848	資本財
JOLLIBEE FOODS CORP	9.5	9.5	223	542	消費者サービス
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	5	11.3	221	537	運輸
ABOTIZ EQUITY VENTURES INC	62.6	25.9	142	345	資本財
GLOBE TELECOM INC	0.65	0.65	139	339	電気通信サービス
SM INVESTMENTS CORP	9.6	9.6	872	2,118	資本財
BDO UNIBANK INC	48.6	34.2	368	895	銀行
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	348	348	114	278	各種金融
SAN MIGUEL CORP	9.4	—	—	—	資本財

日経アジア300 i インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)	期末				業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	89	—	—	—	資本財	
GT CAPITAL HOLDINGS INC	0.77	2.37	92	224	資本財	
JG SUMMIT HOLDINGS INC	54.78	54.78	259	631	資本財	
LT GROUP INC	61	61	54	133	資本財	
小計	株数・金額 銘柄数 < 比率 >	1,064.5 20	1,204.9 20	5,157 —	12,526 <1.1% >	
(インド)		百株	百株	千インド・ルピー	千円	
INFOSYS LTD	70.12	67.46	10,168	16,676	ソフトウェア・サービス	
VEDANTA LTD	23.32	23.32	733	1,202	素材	
TECH MAHINDRA LTD	8.19	11.46	1,176	1,929	ソフトウェア・サービス	
SHREE CEMENT LTD	0.23	0.23	547	898	素材	
INDIAN OIL CORP LTD	56.67	85	662	1,086	エネルギー	
DIVI'S LABORATORIES LTD	3.21	2.69	900	1,476	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	2.44	2.44	634	1,040	素材	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	17.9	13.55	1,209	1,984	運輸	
BAJAJ FINANCE LTD	4.27	4.9	3,276	5,373	各種金融	
ADANI GREEN ENERGY LTD	—	7.21	1,486	2,438	公益事業	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	1.58	2.18	986	1,618	食品・飲料・タバコ	
EICHER MOTORS LTD	1.48	2.57	870	1,428	自動車・自動車部品	
AVENUE SUPERMARTS LTD	2.75	2.75	1,124	1,844	食品・生活必需品小売り	
INTERGLOBE AVIATION LTD	1.9	1.9	385	631	運輸	
ADANI TRANSMISSION LTD	—	5.07	1,358	2,227	公益事業	
TATA STEEL LTD	13.51	135.1	1,510	2,477	素材	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	2.2	2.45	2,107	3,457	自動車・自動車部品	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	78.45	67.27	980	1,608	エネルギー	
AMBUJA CEMENTS LTD	20.41	—	—	—	素材	
ITC LTD	57.93	57.93	1,972	3,234	食品・飲料・タバコ	
ASIAN PAINTS LTD	8.32	8.32	2,563	4,203	素材	
NESTLE INDIA LTD	0.66	0.66	1,325	2,173	食品・飲料・タバコ	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	16.47	16.47	4,476	7,341	家庭用品・パーソナル用品	
STATE BANK OF INDIA	35.69	35.69	2,157	3,537	銀行	
ICICI BANK LTD	93.29	93.29	8,456	13,868	銀行	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	58	63.61	16,534	27,116	エネルギー	
NTPC LTD	65.98	87.61	1,505	2,468	公益事業	
JSW STEEL LTD	13.18	17.83	1,336	2,191	素材	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	82.04	63.02	1,379	2,262	公益事業	
TITAN CO LTD	8.63	7.69	1,939	3,180	耐久消費財・アパレル	
BAJAJ AUTO LTD	1.23	1.23	446	732	自動車・自動車部品	
BHARTI AIRTEL LTD	44.54	44.54	3,743	6,138	電気通信サービス	
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	12.13	18.4	627	1,029	エネルギー	
GAIL INDIA LTD	30.08	—	—	—	公益事業	
GRASIM INDUSTRIES LTD	5.95	7.04	1,243	2,038	素材	
HCL TECHNOLOGIES LTD	21.69	19.85	2,051	3,363	ソフトウェア・サービス	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	34.34	33.4	9,053	14,847	各種金融	
LARSEN & TOUBRO LTD	13.6	12.69	2,771	4,545	資本財	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	22.02	17.65	2,277	3,735	自動車・自動車部品	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	19.59	19.59	1,935	3,174	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	18.01	19.1	6,115	10,030	ソフトウェア・サービス	

日経アジア300 i インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	期首(前期末)		期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
TATA MOTORS LTD	28.08	32.45	1,356	2,224	自動車・自動車部品	
WIPRO LTD	31.28	27.29	1,061	1,741	ソフトウェア・サービス	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	10.5	6.98	632	1,037	家庭用品・パーソナル用品	
DABUR INDIA LTD	9.68	9.68	570	935	家庭用品・パーソナル用品	
ADANI ENTERPRISES LTD	—	5.07	2,066	3,388	資本財	
COAL INDIA LTD	36.22	36.22	823	1,350	エネルギー	
INDUS TOWERS LTD	23.47	—	—	—	電気通信サービス	
小計	株数・金額 銘柄数 < 比率 >	1,111.23 45	1,200.85 45	110,543 —	181,291 <16.3%>	
(インドネシア)		百株	百株	千インドネシア・ルピア	千円	
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	39	39	38,512	335	素材	
MAYORA INDAH PT	60	60	14,520	126	食品・飲料・タバコ	
ELANG MAHKOTA TEKNOLOGI TBK	200	314	31,871	277	メディア・娯楽	
UNILEVER INDONESIA TBK PT	160	160	75,680	658	家庭用品・パーソナル用品	
SEMEN INDONESIA PERSE-RIGHTS	—	8.98	323	2	素材	
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	390	390	222,300	1,934	自動車・自動車部品	
GUDANG GARAM TBK PT	13	13	24,765	215	食品・飲料・タバコ	
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	63	63	43,785	380	素材	
KALBE FARMA TBK PT	440	440	95,480	830	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	64	87	52,200	454	食品・飲料・タバコ	
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	96	96	67,200	584	食品・飲料・タバコ	
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	818	818	304,296	2,647	電気通信サービス	
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	945	1,016	878,840	7,645	銀行	
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	358	358	358,000	3,114	銀行	
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	157	—	—	—	公益事業	
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	1,087	1,189	590,933	5,141	銀行	
ADARO ENERGY INDONESIA TBK P	444	188	74,636	649	エネルギー	
BARITO PACIFIC TBK PT	541	541	40,845	355	素材	
INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	40	40	38,100	331	素材	
CHANDRA ASRI PETROCHEMICAL	65	260	63,180	549	素材	
SARANA MENARA NUSANTARA PT	500	500	54,500	474	電気通信サービス	
MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	—	190	81,510	709	素材	
小計	株数・金額 銘柄数 < 比率 >	6,480 20	6,770.98 21	3,151,477 —	27,417 <2.5%>	
(韓国)		百株	百株	千韓国・ウォン	千円	
KIA CORP	4.73	4.73	29,515	3,054	自動車・自動車部品	
NETMARBLE CORP	0.86	0.48	2,452	253	メディア・娯楽	
SK HYNIX INC	9.94	9.94	78,526	8,127	半導体・半導体製造装置	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	0.61	0.61	13,084	1,354	保険	
LOTTE CHEMICAL CORP-RIGHTS	—	0.05	224	23	素材	
AMOREPACIFIC GROUP	0.89	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品	
HYUNDAI MOTOR CO	2.64	2.64	41,976	4,344	自動車・自動車部品	
POSCO HOLDINGS INC	1.4	1.4	39,410	4,078	素材	
SAMSUNG SDI CO LTD	1.08	1.01	65,347	6,763	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	0.87	1.05	14,857	1,537	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	0.42	0.81	5,832	603	資本財	
KOREA ZINC CO LTD	0.15	0.23	13,501	1,397	素材	
S-OIL CORP	1.16	0.94	8,215	850	エネルギー	

日経アジア300i インデックス・マザーファンド

銘柄	期首(前期末)		期末		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
LOTTE CHEMICAL CORP	0.45	0.28	4,704	486	素材	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	1.35	1.22	24,766	2,563	自動車・自動車部品	
HANON SYSTEMS	3	3	2,535	262	自動車・自動車部品	
COWAY CO LTD	0.76	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
KT CORP	3.18	2.36	8,507	880	電気通信サービス	
LG UPLUS CORP	4.14	—	—	—	電気通信サービス	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	1.6	1.6	11,808	1,222	保険	
KT&G CORP	2.74	2.1	20,349	2,106	食品・飲料・タバコ	
LG DISPLAY CO LTD	6.16	4.09	5,460	565	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SK INC	0.83	0.81	16,443	1,701	資本財	
KANGWON LAND INC	3.15	—	—	—	消費者サービス	
NAVER CORP	2.52	2.79	51,196	5,298	メディア・娯楽	
KAKAO CORP	5.51	5.51	30,745	3,182	メディア・娯楽	
NCSOFT CORP	0.29	0.29	12,832	1,328	メディア・娯楽	
LG CORP	1.95	1.95	15,522	1,606	資本財	
LG H&H	0.2	0.16	10,976	1,136	家庭用品・パーソナル用品	
LG CHEM LTD	0.81	0.87	55,071	5,699	素材	
HYUNDAI STEEL CO	2.37	—	—	—	素材	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	8.53	9.53	35,737	3,698	銀行	
KB FINANCIAL GROUP INC	7.73	7.21	37,636	3,895	銀行	
SAMSUNG SDS CO LTD	0.72	0.72	9,108	942	ソフトウェア・サービス	
SAMSUNG C&T CORP	1.88	1.82	21,840	2,260	資本財	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	0.3	0.3	24,630	2,549	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	1.48	1.5	9,765	1,010	ヘルスケア機器・サービス	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	95.58	94.66	563,227	58,293	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
LG ELECTRONICS INC	2.05	2.05	17,814	1,843	耐久消費財・アパレル	
CELLTRION INC	1.83	1.86	33,294	3,445	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	4.74	4.74	10,096	1,044	公益事業	
KOREAN AIR LINES CO LTD	—	3.78	9,298	962	運輸	
SK TELECOM	1.91	1.91	9,311	963	電気通信サービス	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	0.6	0.41	6,970	721	運輸	
HANA FINANCIAL GROUP	5.07	5.7	25,393	2,628	銀行	
AMOREPACIFIC CORP	0.34	0.56	7,392	765	家庭用品・パーソナル用品	
SK INNOVATION CO LTD	1.13	0.95	15,960	1,651	エネルギー	
小計	株数・金額 銘柄数 < 比率 >	199.65 45	188.62 42	1,421,333 —	147,107 <13.2%>	
(マレーシア)		百株	百株	千マレーシア・リンギット	千円	
MISC BHD		37	23	16	504	運輸
SIME DARBY PLANTATION BHD		43	43	19	578	食品・飲料・タバコ
PETRONAS DAGANGAN BHD		7	7	15	473	エネルギー
MALAYAN BANKING BHD		143	127	110	3,357	銀行
GENTING BHD		59	—	—	—	消費者サービス
PUBLIC BANK BERHAD		275	275	121	3,672	銀行
AXIATA GROUP BERHAD		91	91	27	836	電気通信サービス
KUALA LUMPUR KEPONG BHD		11	11	23	717	食品・飲料・タバコ
TOP GLOVE CORP BHD		91	91	6	196	ヘルスケア機器・サービス
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD		34	37	31	955	素材
IOI CORP BHD		79	79	31	947	食品・飲料・タバコ

日経アジア300 i インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	期首(前期末)		期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	136	136	78	2,385	銀行	
TENAGA NASIONAL BHD	36	52	48	1,469	公益事業	
PPB GROUP BERHAD	16	16	27	847	食品・飲料・タバコ	
PETRONAS GAS BHD	10	18	29	910	公益事業	
DIGI.COM BHD	65	65	24	747	電気通信サービス	
MAXIS BHD	32	32	12	367	電気通信サービス	
HAP SENG CONSOLIDATED	17	—	—	—	資本財	
NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	1	1	13	415	食品・飲料・タバコ	
HARTALEGA HOLDINGS BHD	22	22	3	104	ヘルスケア機器・サービス	
IHH HEALTHCARE BHD	71	59	34	1,056	ヘルスケア機器・サービス	
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	42	68	33	1,011	素材	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,318 22	1,253 20	710 —	21,555 <1.9%>	
(タイ)	百株	百株	千タイ・パーツ	千円		
SIAM CEMENT PCL-NVDR	6	6	198	764	素材	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	50	—	—	—	消費者サービス	
SCB X PCL-NVDR	—	29	300	1,155	銀行	
KASIKORNBANK PCL-NVDR	28	21	302	1,164	銀行	
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	54	39	156	600	素材	
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	14	—	—	—	銀行	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	18	18	334	1,288	電気通信サービス	
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	73	73	206	793	ヘルスケア機器・サービス	
PTT PCL-NVDR	162	162	506	1,949	エネルギー	
CP ALL PCL-NVDR	90	90	594	2,286	食品・生活必需品小売り	
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	79	79	582	2,243	運輸	
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	3	25	177	683	不動産	
BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	13	13	186	718	銀行	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	23	64	154	593	食品・飲料・タバコ	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	11	28	130	501	素材	
INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	47	19	143	554	電気通信サービス	
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	39	8	27	107	食品・生活必需品小売り	
SIAM MAKRO PUBLIC CO-NVDR	—	13	50	193	食品・生活必需品小売り	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	86	86	130	503	小売	
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	10	10	684	2,633	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	49	34	326	1,256	公益事業	
GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	131	91	493	1,900	公益事業	
CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	—	54	243	935	小売	
GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	3	13	94	362	公益事業	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	989 21	975 22	6,023 —	23,191 <2.1%>	
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	24,749.09 300	25,016.36 305	— —	975,649 <87.5%>	

※邦貨換算金額は、期末の時価を日本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。

※<>内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

※銘柄コードの変更等、管理上の都合により同一銘柄であっても別銘柄として記載されている場合があります。

(2)外国投資信託証券

銘柄		期首(前期末)		期末		組入比率
		口数	口数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール) CAPITALAND INTEGRATED COMMER		口	口	千シンガポール・ドル	千円	%
		696	—	—	—	—
小計	口数・金額	696	—	—	—	
	銘柄数<比率>	1	—	—	<—>	
合計	口数・金額	696	—	—	—	
	銘柄数<比率>	1	—	—	<—>	

※邦貨換算金額は、期末の時価を日本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。

※<>内は、純資産総額に対する評価額の比率。

※銘柄コードの変更等、管理上の都合により同一銘柄であっても別銘柄として記載されている場合があります。

(3)先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		期末	
		買建額	売建額
外	SGX NIFTY 50	29	—
	FTSE Taiwan Index	20	—
	MINI HSI IDX FUT	50	—
国	MSCI SING IX ETS	11	—
	KOSPI2 INX FUT	23	—

※邦貨換算金額は、期末の時価を日本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12月20日現在)

項目	期末	
	評価額	比率
株式	975,649	86.5
コール・ローン等、その他	152,018	13.5
投資信託財産総額	1,127,668	100.0

※期末における外貨建資産(1,113,472千円)の投資信託財産総額(1,127,668千円)に対する比率は98.7%です。

※外貨建資産は、期末の時価を日本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、1アメリカ・ドル=134.54円、1香港・ドル=17.29円、1シンガポール・ドル=99.18円、1台湾・ドル=4.377円、1フィリピン・ペソ=2.428円、1インド・ルピー=1.64円、100インドネシア・ルピア=0.87円、100韓国・ウォン=10.35円、1マレーシア・リングギット=30.351円、1タイ・バーツ=3.85円です。

■ 資産、負債、元本及び基準価額の状況

(2022年12月20日現在)

項 目	期 末
(A) 資 産	1,132,112,500円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	96,705,198
株 式 (評 価 額)	975,649,823
未 収 入 金	11,290,188
未 収 配 当 金	891,623
差 入 委 託 証 拠 金	47,575,668
(B) 負 債	17,602,368
未 払 金	4,909,765
未 払 解 約 金	12,692,518
そ の 他 未 払 費 用	85
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	1,114,510,132
元 本	1,023,140,841
次 期 繰 越 損 益 金	91,369,291
(D) 受 益 権 総 口 数	1,023,140,841口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	10,893円

※当期における期首元本額1,003,760,520円、期中追加設定元本額147,902,673円、期中一部解約元本額128,522,352円です。

※上記表中の次期繰越損益金がマイナス表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

※期末における元本の内訳は、三井住友・日経アジア300iインデックスファンド1,023,140,841円です。

※上記表中の受益権総口数および1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第7号および第11号に規定する受益権の総数および計算口数当たりの純資産の額となります。

■ お知らせ

＜約款変更について＞

該当事項はございません。

■ 損益の状況

(自2021年12月21日 至2022年12月20日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	24,423,136円
受 取 配 当 金	23,957,341
受 取 利 息	235,883
そ の 他 収 益 金	232,236
支 払 利 息	△ 2,324
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 8,379,446
売 買 益	189,961,159
売 買 損	△198,340,605
(C) 先 物 取 引 等 損 益	△ 17,309,374
取 引 益	35,159,355
取 引 損	△ 52,468,729
(D) そ の 他 費 用 等	△ 4,309,664
(E) 当 期 損 益 金 (A + B + C + D)	△ 5,575,348
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	96,120,315
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 14,706,511
(H) 追 加 信 託 差 損 益 金	15,530,835
(I) 合 計 (E + F + G + H)	91,369,291
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	91,369,291

※有価証券売買損益および先物取引等損益は期末の評価換えによるものを含みます。

※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。

※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。