

# 日経アジア 300 インベスタブル指数シリーズ

## 月次ファクトシート

「日経アジア300インベスタブル指数」は、投資信託など金融商品での利用を想定し開発したアジアの上場企業300社を構成銘柄とする株価指数です。日経が報道を目的として選んだ有力企業群「Asia300」の考え方を定量的なルールに置き換え、数値データに基づいて300銘柄を選定しています。成長を続けるアジアの主要企業に幅広く投資したいというニーズに応える指数を目指します。

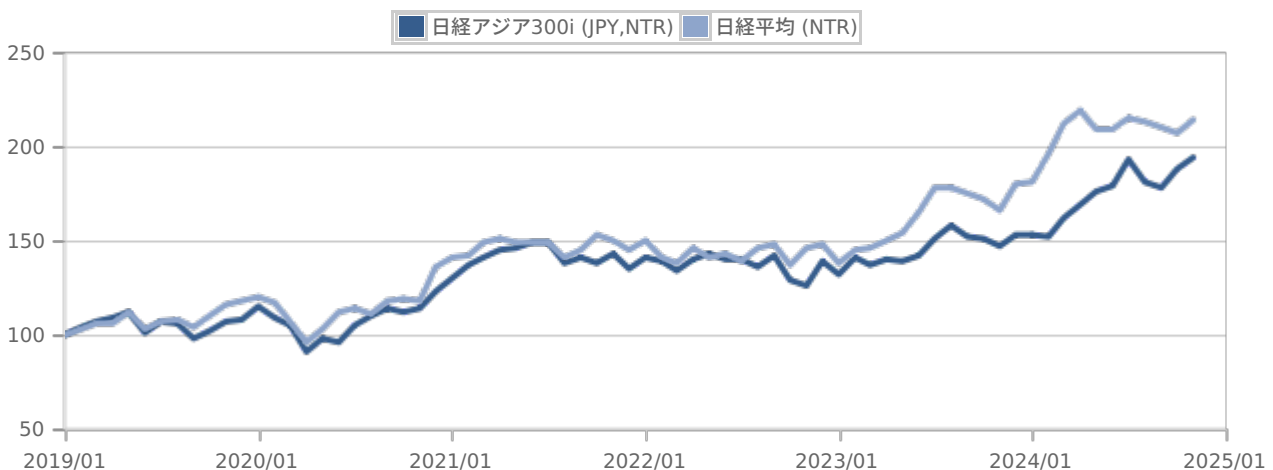
### ■銘柄選定

中国（A株を除く）、香港、台湾、韓国、インドネシア、マレーシア、フィリピン、シンガポール、タイ、インドの10カ国・地域から300銘柄を選定しています。

### ■基本情報

|        |                               |
|--------|-------------------------------|
| 銘柄入れ替え | 年1回(6月)                       |
| 銘柄数    | 300                           |
| ウェイト   | 浮動株時価総額                       |
| 算出開始日  | 2017年12月11日(2012年12月3日まで遡及算出) |
| 基準日    | 2015年12月1日=1,000ポイント          |
| 計算頻度   | リアルタイム(15秒間隔)                 |

### ■パフォーマンス



### ■年間リターン

|                     | 年間リターン% |       |      |       |       |       |
|---------------------|---------|-------|------|-------|-------|-------|
|                     | 2019    | 2020  | 2021 | 2022  | 2023  | YTD   |
| 日経アジア300i (JPY,NTR) | 15.10   | 13.37 | 8.33 | -6.17 | 15.57 | 26.67 |
| 日経平均 (NTR)          | 20.20   | 17.80 | 6.31 | -7.75 | 30.40 | 18.30 |

### ■リスク・リターン

|                     | 累積リターン (年率) % |       |       | 標準偏差 (年率) % |       |       |
|---------------------|---------------|-------|-------|-------------|-------|-------|
|                     | 1年            | 3年    | 5年    | 1年          | 3年    | 5年    |
| 日経アジア300i (JPY,NTR) | 31.96         | 10.71 | 12.54 | 13.82       | 15.45 | 16.36 |
| 日経平均 (NTR)          | 28.47         | 12.40 | 12.99 | 15.12       | 15.24 | 16.47 |

## ■指数の特性

|     | 時価総額(USD Millions) |
|-----|--------------------|
| 合計  | 8,063,528          |
| 最大  | 836,333            |
| 最小  | 794                |
| 平均  | 26,878             |
| 中央値 | 11,582             |

## ■ウェイト上位20銘柄

| 銘柄名                   | 国・地域   | セクター           | ウェイト% |
|-----------------------|--------|----------------|-------|
| 台湾積体回路製造 (TSMC)       | 台湾     | 情報技術           | 15.60 |
| 騰訊控股 (テンセント)          | 中国     | コミュニケーション・サービス | 6.33  |
| サムスン電子                | 韓国     | 情報技術           | 4.37  |
| アリババ集団                | 中国     | 一般消費財・サービス     | 3.58  |
| HDFC銀行                | インド    | 金融             | 2.30  |
| リライアンス・インダストリーズ       | インド    | エネルギー          | 2.17  |
| 美团                    | 中国     | 一般消費財・サービス     | 2.02  |
| AIA                   | 香港     | 金融             | 1.78  |
| 鴻海 (ホンハイ) 精密工業        | 台湾     | 情報技術           | 1.58  |
| ICICI銀行               | インド    | 金融             | 1.58  |
| 中国建設銀行                | 中国     | 金融             | 1.52  |
| インフォシス                | インド    | 情報技術           | 1.48  |
| SKハイニックス              | 韓国     | 情報技術           | 1.44  |
| 聯発科技 (メディアテック)        | 台湾     | 情報技術           | 1.28  |
| DBSグループ・ホールディングス(DBS) | シンガポール | 金融             | 1.17  |
| 小米 (シャオミ)             | 中国     | 情報技術           | 1.05  |
| 京東集団 (JDドットコム)        | 中国     | 一般消費財・サービス     | 0.98  |
| バルティ・エアテル             | インド    | コミュニケーション・サービス | 0.96  |
| タタ・コンサルタンシー・サービシズ     | インド    | 情報技術           | 0.96  |
| 香港取引所                 | 香港     | 金融             | 0.95  |

(※) 国・地域は本社所在地ベース、セクターはGICS (世界産業分類基準) による

## ■国・地域別ウェイト／セクター別ウェイト

| 国・地域別ウェイト% | セクター別ウェイト% |                |       |
|------------|------------|----------------|-------|
| 台湾         | 25.80      | 情報技術           | 32.83 |
| 中国         | 24.62      | 金融             | 20.02 |
| インド        | 19.65      | 一般消費財・サービス     | 12.89 |
| 韓国         | 12.34      | コミュニケーション・サービス | 11.35 |
| 香港         | 5.95       | 資本財・サービス       | 5.11  |
| シンガポール     | 4.30       | エネルギー          | 4.37  |
| インドネシア     | 2.31       | 素材             | 3.78  |
| マレーシア      | 1.99       | 生活必需品          | 3.40  |
| タイ         | 1.96       | 公益事業           | 2.58  |
| フィリピン      | 1.07       | ヘルスケア          | 2.01  |
|            |            | 不動産            | 1.65  |

(※) 国・地域は本社所在地ベース、セクターはGICS (世界産業分類基準) による

## ■リファレンス

詳しい計算方法や構成銘柄選定ルールは「算出要領」を参照ください。

→(URL) <https://indexes.nikkei.co.jp/asia300/index/profile?idx=asia300j> (円ベース)

<https://indexes.nikkei.co.jp/asia300/index/profile?idx=asia300i> (ドルベース)

(※) 月次ファクトシートは前月末時点のデータで作成しています。

<<免責事項>>

「日経アジア 300 インベスタブル指数シリーズ」は、日本経済新聞社（以下「日経」という）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す。「日経アジア 300 インベスタブル指数シリーズ」の前提となる「Asia300」は日経によって独自に選択された企業群であり、日経は「Asia300」及び「日経アジア 300 インベスタブル指数シリーズ」について、著作権その他一切の知的財産権を有しています。日経は、「日経アジア 300 インベスタブル指数シリーズ」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、遅延又は中断に関して、一切の責任を負いません。日経は、「日経アジア 300 インベスタブル指数シリーズ」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 インベスタブル指数シリーズ」の算出は、日経との契約により SGX が実施します。算出に用いる一部のデータに関する権利は SGX に帰属します。SGX は、「日経アジア 300 インベスタブル指数シリーズ」の誤謬、遅延、有用性、また、利用の結果その他について一切責任を負いません。

<<本資料について>>

本資料は日経の著作物であり、本資料の全部又は一部を、いかなる形式によっても日経に無断で複写、複製、転載または流布することができません。本資料は日経アジア 300 インベスタブル指数シリーズについて深く理解いただくことを目的として作成したものであり、日経アジア 300 インベスタブル指数シリーズを対象とした金融商品等の売買に関する勧誘を行うためのものではありません。本資料は作成時点までの信頼できるとされる各種情報、データに基づいて作成されていますが、その正確性、相当性、完全性などに対して日経は責任を負いません。また本資料に記載された情報を利用したことにより発生するいかなる費用又は損害について、日経は一切その責任を負いません。本資料は、常に最新の情報に更新されていることを保証せず、また予告なく変更することがあります。本資料が対象とする指数の運営において本資料と異なる方法等が適用されることがあります。いずれの場合も日経からの最新の開示に基づく情報が優先されます。

<<連絡先>>

日本経済新聞社  
インデックス事業室  
index@nex.nikkei.co.jp