

【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2023年11月9日提出
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 ステファニー・ドゥルーズ
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	新屋敷 昇
【電話番号】	03-6447-6147
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	(1)当初自己設定額 1億円を上限とします。 (2)継続申込額 5兆円を上限とします。 該当事項はありません。
【縦覧に供する場所】	

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

半期報告書を提出しましたので2023年1月25日付をもって提出しました有価証券届出書（2023年8月3日付で
有価証券届出書の訂正届出書を提出済み。以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報に訂正す
るため、また、記載事項の一部に訂正事項がありますのでこれを訂正するため、本訂正届出書を提出しま
す。

2【訂正の内容】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部_____は訂正部分を示し、<更新後>に記載している内
容は原届出書が更新されます。なお、「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」は
原届出書の更新後の内容を記載しています。また、原届出書の「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの
経理状況」において「1 財務諸表」につきましては「中間財務諸表」の記載事項が追加され、「2 ファ
ンドの現況」につきましては原届出書の更新後の内容を記載しています。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<更新後>

ファンドの特色

1 「リスク・パリティ*の観点」からファンド設定時に決定した基本資産配分比率で、世界の株式、REIT、債券に分散投資します。

- 各資産がファンドにもたらすリスクの大きさが等しくなること(リスク・パリティ*)を概ね実現することをめざして決定した「株式20.0%、不動産投資信託(REIT)13.3%、債券66.7%」を基本資産配分比率とし、同比率を維持します。
- 為替変動リスクを株式・REIT・債券の各価格変動リスクに次ぐ4つ目のリスクと捉え、海外債券については為替ヘッジを行なうことで、為替変動リスクのある資産を海外株式と海外REITのみに限定します。

*リスク・パリティを概ね実現するために、各資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクについて、ファンド設定時点における過去長期間のデータを基に、日興アセットマネジメントが独自に各資産の組入比率を決定しました。なお、設定後の各資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクの変化に応じた基本資産配分比率の変更は、原則として行ないません。

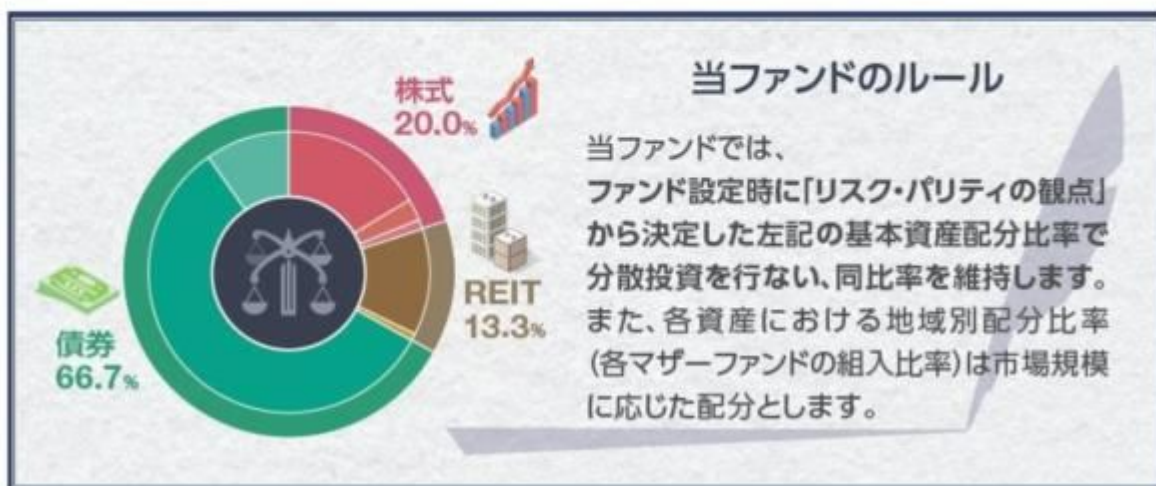
2 各資産への投資にあたってはインデックスファンドを活用します。

- インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、上記の基本資産配分比率とすることをめざします。なお、各資産における地域別配分比率(各マザーファンドの組入比率)は市場規模に応じた配分とします。
- マザーファンドの合計組入比率は、原則として高位を維持します。

*株式における日本、海外先進国、海外新興国の配分比率は、それぞれ対象マザーファンドの連動対象指数の時価総額に基づいて算出します。REITにおける日本、海外先進国の配分比率は、それぞれ対象マザーファンドの連動対象指数の時価総額に基づいて算出します。債券における日本、海外先進国の配分比率は、日本を含む「FTSE世界国債インデックス」における日本と海外先進国の時価総額に基づいて算出します。

3 購入時手数料はかかりません。

※市況動向および資金動向などにより、上記のような運用が行なえない場合があります。



「おとなのバランス」とは？

リスクを相対的に低く抑えることを志向する当ファンドは、一般的な株式ファンドなどに比べて、**ゆったりと落ち着いた（“おとな”の）スタンス**で保有していただけるファンドとなることをめざしています。

それは、預貯金でコツコツと築いた**「まとまったお金」**を資産運用に振り向けたい、「**期間が限られた積立投資**」を行ないたいといった、いわゆる**「おとな」の投資家**にも活用しやすいバランス、「おとなのバランス」と考えています。

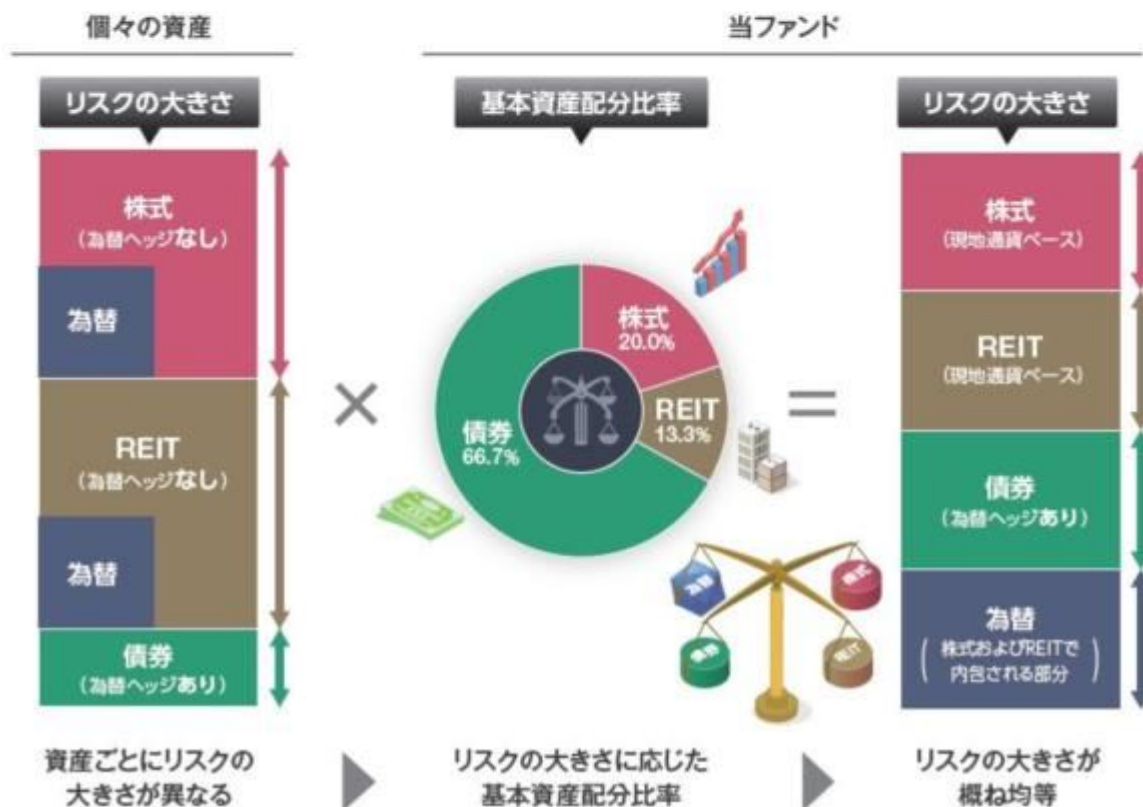
※ファンド設定後は原則、基本資産配分比率を固定します。

1 a. 「リスク・パリティの観点」から決定した資産配分



- 一般的な分散投資では、市場見通しに応じて資産配分を変化させたり、各資産へ均等に投資する方法が主流でした。しかし、これらの方法では、市場の急変時には値動きの大きい資産の影響を強く受けるなど、価格変動が大きくなる傾向がありました。
- 当ファンドは、各資産の価格変動リスクおよび外貨建て資産に内在する為替変動リスクの大きさが等しくなるような資産配分（リスク・パリティ）を意識して決定しました。なお、基本資産配分比率は固定とし、原則その比率を維持します。

当ファンドにおける資産配分の考え方



※上記は「Tracers グローバル3分法(おとなのバランス)」についてのご理解を深めていただくためのイメージであり、実際の運用成果等を保証するものではありません。

1 b. 各資産の値動きの特徴と当ファンドの値動きのイメージ



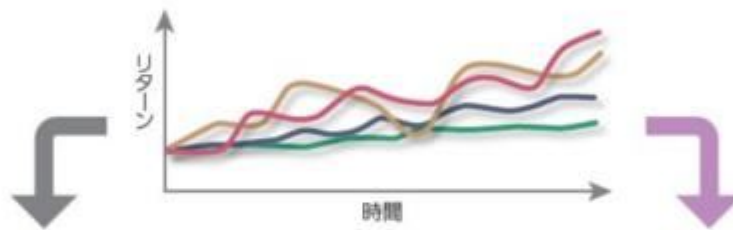
- 当ファンドでは、値動きが異なる傾向にある3つの資産(株式、REIT、債券)へ分散投資を行ないます。
- さらに、これら3つの資産それぞれの価格変動リスクに加え、各資産が内包する為替変動リスクの総計を4つ目の資産(リスク)と捉え、当ファンドが定める基本資産配分比率で投資を行なうことで、特定の資産の影響を受けにくい投資成果をめざします。

各資産の値動きの特徴

	株式	REIT (不動産投資)	債券	為替 (米ドル/円の場合)
景気が良くなると	企業業績が改善する傾向 ↑ 株価は上がる傾向	空室率や賃料水準が改善傾向 ↑ 価格は上がる傾向	金利が上がる傾向 ↓ 債券価格は下がる傾向	相対的に米国の景気が良い場合 通貨価値が上がる傾向 ↑ 米ドル高(円安)傾向
景気が悪くなると	企業業績が悪化する傾向 ↓ 株価は下がる傾向	空室率や賃料水準が悪化する傾向 ↓ 価格は下がる傾向	金利が下がる傾向 ↑ 債券価格は上がる傾向	相対的に米国の景気が悪い場合 通貨価値が下がる傾向 ↓ 米ドル安(円高)傾向

値動きのイメージ

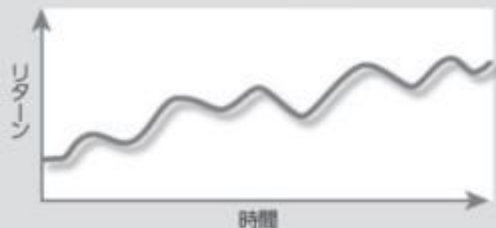
各資産の値動きはそれぞれ異なるため、運用成果は大きく異なる傾向に。



一般的な分散投資にみられる投資成果

価格変動が比較的大きい資産
価格変動が比較的小さい資産

組入比率は
均等

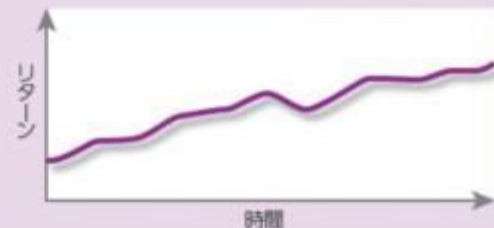


価格変動の大きな資産の影響により、投資成果が大きく変動することも

当ファンドがめざす投資成果

価格変動が比較的大きい資産
価格変動が比較的小さい資産

組入比率は
少なめ
組入比率は
多め



価格変動の大きな資産の影響を受けづらく
なるため、安定的な投資成果が期待される

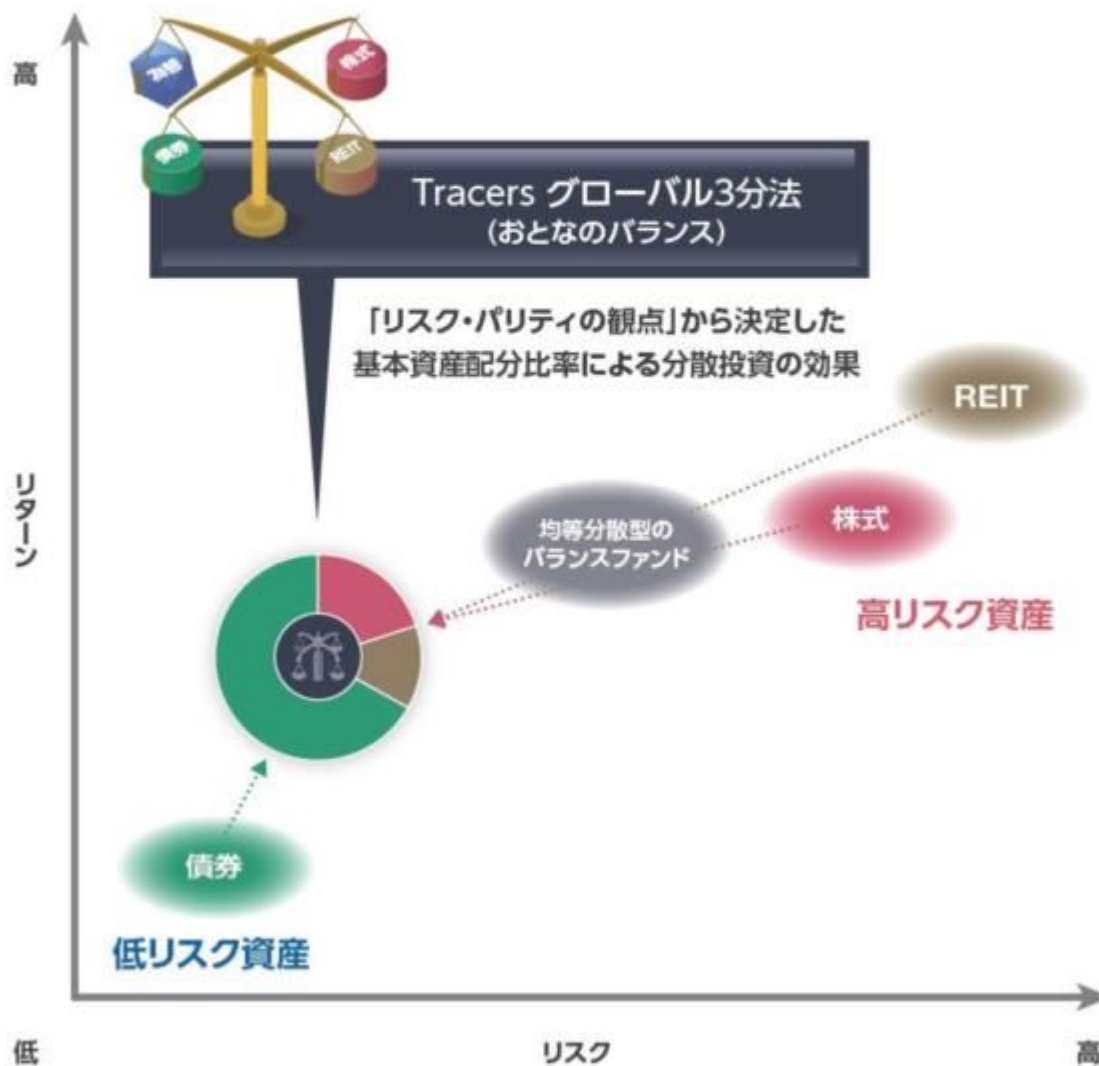
※ 価格変動などに関する説明は一般論であり、実際はこれと異なる値動きをする場合があります。また、各図はイメージです。

1 c. 当ファンドと各資産のリスク・リターンイメージ



- 一般に、値動きが異なる傾向にある複数の資産に分散投資を行なうことで、価格変動リスクの低減とリターンの安定化、つまり、運用効率(リスクあたりのリターン)の向上を期待できます。
- 当ファンドでは、資産ごとの価格変動リスクの傾向を踏まえ、リスクが比較的大きい資産は組入れを少なくし、リスクが比較的小さい資産は組入れを多くする資産配分比率を維持し、リスクの大きな資産の影響を受けづらくすることで、運用効率のさらなる向上をめざします。

各資産と当ファンドのリスク・リターンのイメージ



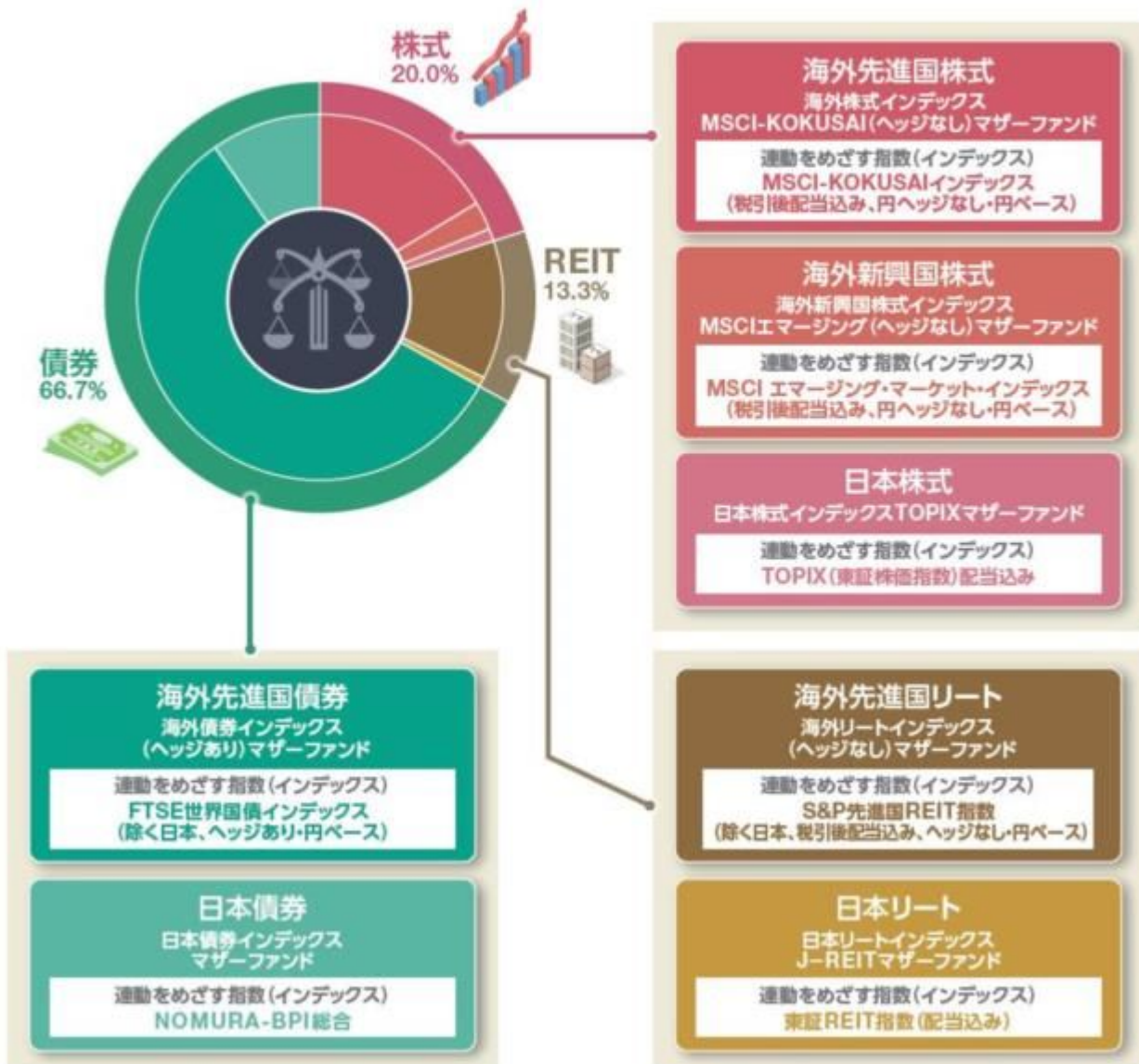
※ 上記は「Tracers グローバル3分法(おとなのバランス)」についてのご理解を深めていただくためのイメージであり、実際のリスク・リターンなどの運用成果を保証するものではありません。

2 各資産への投資にあたってはインデックスファンドを活用



- インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、以下の基本資産配分比率を維持します。なお、各資産における地域別配分比率(各マザーファンドの組入比率)は市場規模に応じた配分とします。
- 各資産におけるマザーファンドの合計組入比率は、原則として高位を維持します。

基本資産配分比率と各資産における投資対象ファンド



- ※株式における日本、海外先進国、海外新興国の配分比率は、それぞれ対象マザーファンドの連動対象指数の時価総額に基づいて算出します。
- REITにおける日本、海外先進国の配分比率は、それぞれ対象マザーファンドの連動対象指数の時価総額に基づいて算出します。債券における日本、海外先進国の配分比率は、日本を含む「FTSE世界国債インデックス」における日本と海外先進国の時価総額に基づいて算出します。
- ※各資産のマザーファンドの配分比率は変動します。
- ※市況動向および資金動向などにより上記のような運用ができない場合があります。

各指数(インデックス)の著作権などの権利について

●TOPIX(東証株価指数)

同指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)に帰属します。また、JPXは同指数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。

●MSCI-KOKUSAIインデックス

同指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

●MSCI エマージング・マーケット・インデックス

同指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

●東証REIT指数

同指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)に帰属します。また、JPXは同指数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。

●S&P先進国REIT指数

同指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利はスタンダード&プアーズ ファイナンシャル サービスズ エル エル シー(S&P)社に帰属します。また、S&P社は同指数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。

●NOMURA-BPI 総合

同指数は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社(以下「NFRC」)が公表している指数で、その知的財産権はNFRCに帰属します。なお、NFRCは、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行なわれる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

●FTSE世界国債インデックス

同指数は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

ファンドの仕組み



■ 当ファンドは、主にマザーファンドに投資するファミリーファンド方式で運用を行ないます。



- 主な投資制限
- 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。
- 分配方針
- 毎決算時に、分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。
 - ※ 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。



「こんな欲しかった」をデザインし、
ルール通りに運用(トレース)する

トレイサーズ
Tracersとは

Tracers (トレイサーズ)は、
「こんな欲しかった」というアイデアをファンドの設計に取り入れ、
事前に定めたルールに沿って運用(トレース)する
日興アセットマネジメントのファンドシリーズです。

(3) 【ファンドの仕組み】

< 更新後 >

委託会社の概況（2023年8月末現在）

1) 資本金

17,363百万円

2) 沿革

1959年：日興証券投資信託委託株式会社として設立

1999年：日興国際投資顧問株式会社と合併し「日興アセットマネジメント株式会社」に社名変更

3) 大株主の状況

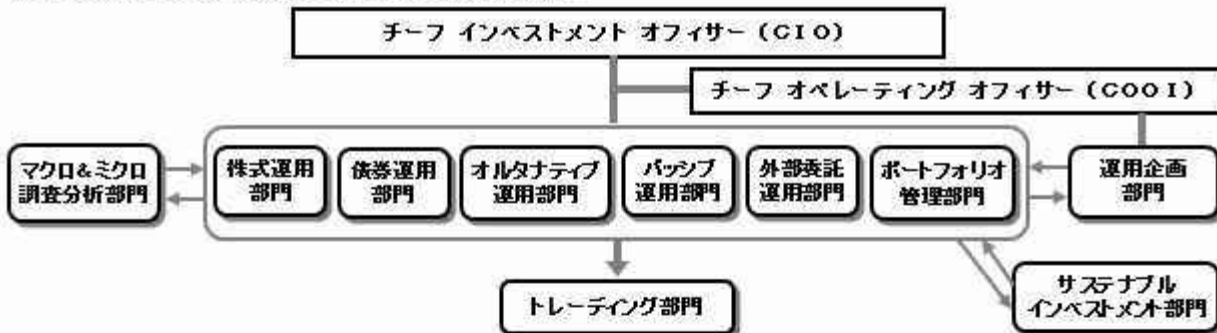
名 称	住 所	所有株数	所有比率
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	192,211,000株	97.562%

2 【投資方針】

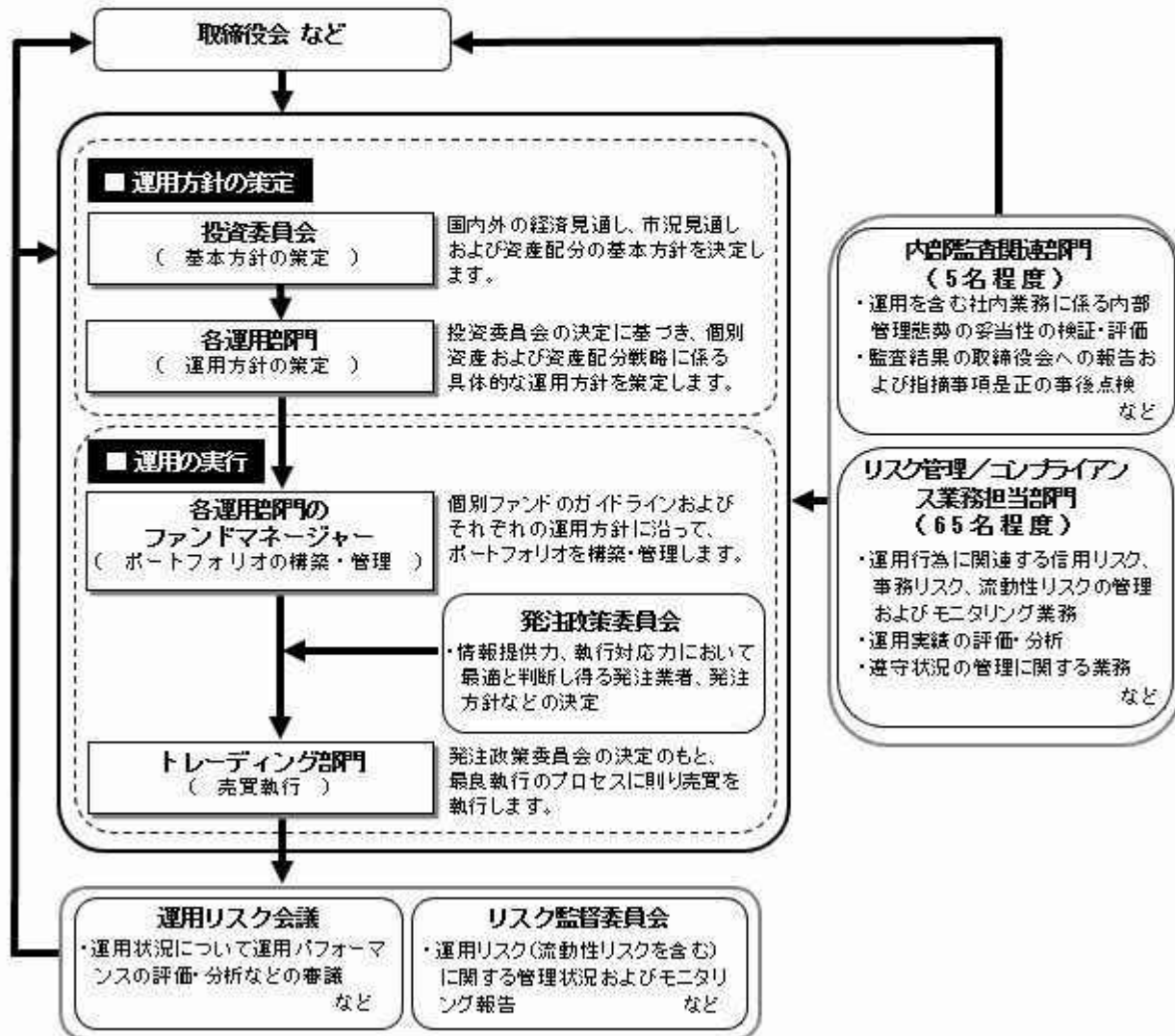
(3) 【運用体制】

< 更新後 >

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



◆委託会社の運用体制における内部管理および意思決定を監督する組織などは以下の通りです。



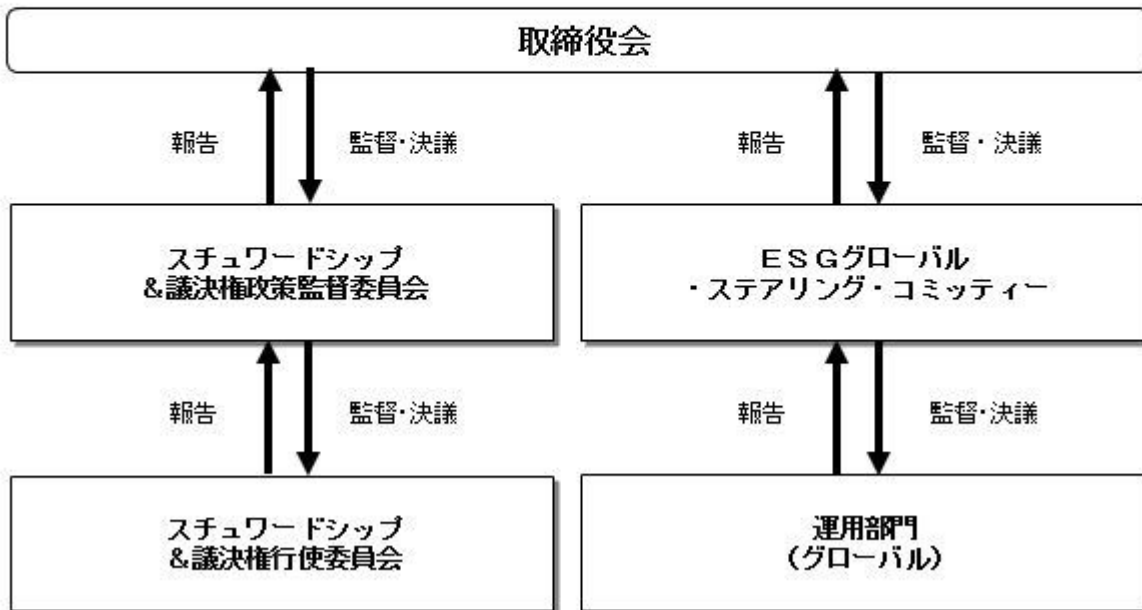
委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

「受託会社」に対しては、日々の純資産照会、月次の勘定残高照会などを行っております。また、独立した監査法人が所定の手続きで受託業務について監査を行っており、内部統制が有効に機能している旨の監査報告書を定期的に受け取っております。

◆投資家としてのESG/フィデューシャリー・デューティ

ESG（環境、社会、企業統治）やフィデューシャリーは、当委託会社にとって最高位に位置する概念であるため、同原則に関連する決議、報告、議論は、当委託会社の取締役会にて行うこととしています。

（スチュワードシップ&議決権政策監督委員会は、議長含め社外委員が過半数以上を占めるメンバーで構成されています）

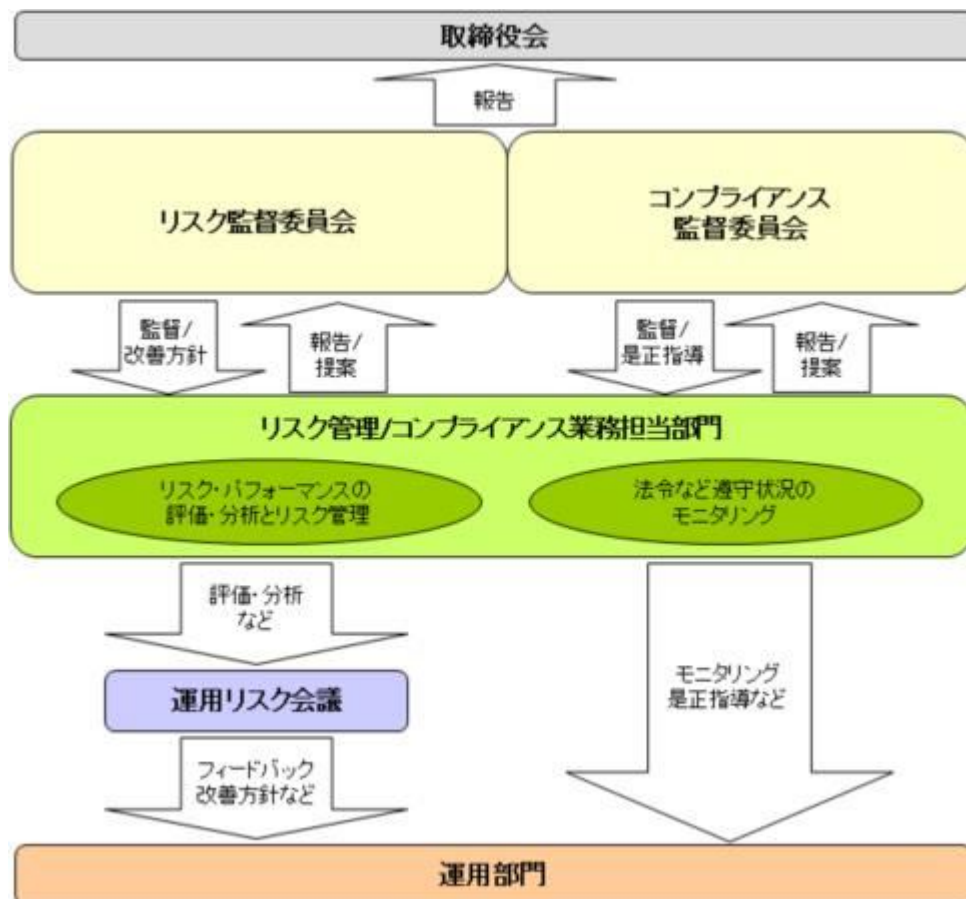


上記体制は2023年8月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

3【投資リスク】

<更新後>

(2) リスク管理体制



全社的なリスク管理

当社では運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理/コンプライアンス業務担当部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。当社グループの法令などの遵守状況についてはコンプライアンス部門が事務局を務めるコンプライアンス監督委員会、リスク管理状況についてはリスク管理部門が事務局を務めるリスク監督委員会を通して経営陣に報告され、更に年一度以上取締役会に対して全体的な活動状況を報告しております。両委員会およびそれに関連する部門別会議においては、法令遵守状況や各種リスク（運用リスク（流動性リスクを含む）、市場リスク、カウンターパーティーリスク、オペレーショナルリスク（事務リスクを含む）など）に関するモニタリングとその報告に加えて、重要事故への対応と各種リスク対応、事故防止のための施策やその管理手法の構築などの支援に努めております。

運用状況の評価・分析および運用リスク管理

ファンド財産について運用状況の評価・分析および運用リスク（流動性リスクを含む）の管理状況をモニタリングします。運用パフォーマンスおよび運用リスクに係る評価と分析の結果については運用リスク会議に報告し、運用リスク（流動性リスクを含む）の管理状況についてはリスク監督委員会へ報告され、問題点の原因の究明や改善策の策定が図られます。加えて外部委託運用部門は、外部委託ファンドの運用管理を行ない、投資方針に沿った運用が行なわれているかなどのモニタリングを行なっています。

法令など遵守状況のモニタリング

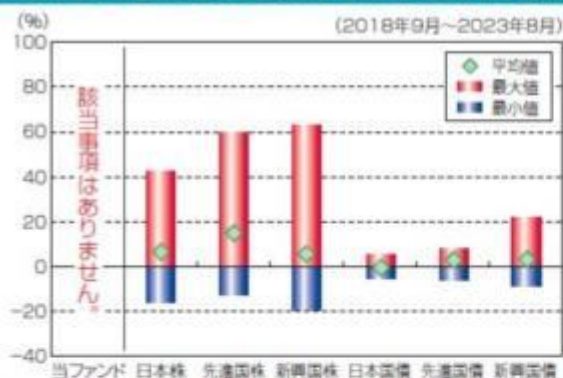
運用における法令・諸規則、信託約款などの遵守状況については、コンプライアンス業務担当部門が管理を行ないます。問題点についてはコンプライアンス関連の委員会に報告され、必要に応じ運用部門に対し是正指導が行なわれるなど、適切に管理・監督を行ないます。

上記体制は2023年8月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

< 更新後 >

(参考情報)

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



当ファンドと他の代表的な資産クラスの平均騰落率、年間最大騰落率および最小騰落率 (%)

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	—	8.5%	14.8%	5.6%	-0.5%	2.9%	3.2%
最大値	—	42.1%	59.8%	62.7%	5.4%	7.9%	21.5%
最小値	—	-16.0%	-12.4%	-19.4%	-5.5%	-6.1%	-8.8%

※上記は当ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2018年9月から2023年8月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。ただし、当ファンドは直近1年間の騰落率がないため、表示しておりません。

<各資産クラスの指数>

日本株……TOPIX(東証株価指数)配当込み
 先進国株……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)
 新興国株……MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
 日本国債……NOMURA-BPI国債
 先進国債……FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
 新興国債……JPモルガンGBI-EMグローバル・ティパーシファイド(円ヘッジなし、円ベース)

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

TOPIX(東証株価指数)配当込み

当指数は、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社に帰属します。

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)

当指数は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)

当指数は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

NOMURA-BPI国債

当指数は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社(以下「NFRIC」)が公表している指数で、その知的財産権はNFRICに帰属します。なお、NFRICは、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2023年2月末の基準価額を起点として指数化しています。

※当ファンドの分配金再投資基準価額および年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)は、分配金(税引前)を再投資したもとして計算した理論上のものであり、実際の基準価額および実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

当指数は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。当指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

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

当指数は、J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、当指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities LLCに帰属します。

4【手数料等及び税金】

(5)【課税上の取扱い】

<更新後>

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度(NISA)の適用対象です。販売会社によっては「つみたてNISA」の適用対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

2024年1月1日以降、公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合にNISAの適用対象となります。当ファンドは、NISAの「成長投資枠(特定非課税管理勘定)」および「つみたて投資枠(特定累積投資勘定)」の対象となる予定ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。上記は、2023年9月末現在のものです。税法が改正された場合などには、変更される場合があります。

個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については配当所得として、20.315%(所得税15.315%および地方税5%)の税率による源泉徴収(原則として、確定申告は不要です。)が行なわれます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税(配当控除の適用はありません。)のいずれかを選択することもできます。

2) 解約金および償還金に対する課税

解約時および償還時の差益(譲渡益)*については譲渡所得として、20.315%(所得税15.315%および地方税5%)の税率による申告分離課税の対象となり、確定申告が必要となります。なお、源泉徴収ありの特定口座(源泉徴収選択口座)を選択している場合は、20.315%(所得税15.315%および地方税5%)の税率による源泉徴収(原則として、確定申告は不要です。)が行なわれます。

* 解約価額および償還価額から取得費用(申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を含みます。)を控除した利益

確定申告等により、解約時および償還時の差損(譲渡損失)については、上場株式等の譲渡益、上場株式等の配当等および特定公社債等の利子所得(申告分離課税を選択したものに限り)と損益通算が可能です。また、解約時および償還時の差益(譲渡益)、普通分配金および特定公社債等の利子所得(申告分離課税を選択したものに限り)については、上場株式等の譲渡損失と損益通算が可能です。

少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA」をご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。なお、他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度(つみたてNISA)をご利用の場合、毎年、年間40万円の範囲で販売会社との契約に基づいて定期的かつ継続的な方法で購入することにより生じる配当所得および譲渡所得が20年間非課税となります。なお、「NISA」と「つみたてNISA」の投資枠は、年ごとに選択制であり、同一年において両方を併用した投資は行なえません。

2024年1月1日以降、NISAをご利用の場合、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となり、税法

上の要件を満たした商品を購入した場合に限り、非課税の適用を受けることができます。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人受益者の場合

1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については配当所得として、15.315%（所得税のみ）の税率による源泉徴収が行なわれます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税から控除される場合があります。

2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

1) 各受益者の買付時の基準価額（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が個別元本になります。

2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。

2) 受益者が収益分配金を受け取る際

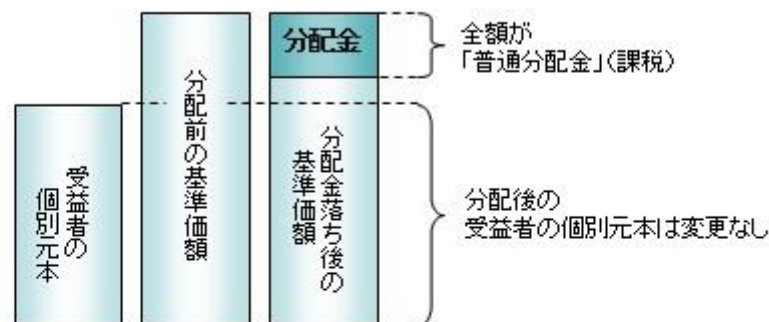
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。

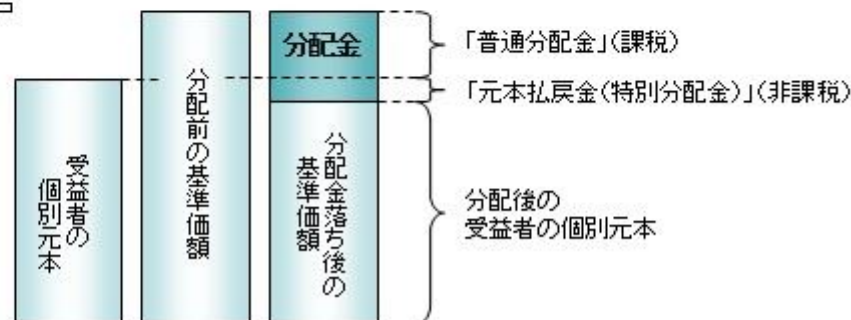
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

上記は2023年11月9日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

【Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）】

以下の運用状況は2023年 8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	205,335,969	99.69
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		635,977	0.31
合計（純資産総額）		205,971,946	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
日本	親投資信託受益証券	海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド	90,896,748	1.3358	121,419,876	1.3144	119,474,685	58.01
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-KOZUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	6,752,883	4.7735	32,234,888	5.2120	35,196,026	17.09
日本	親投資信託受益証券	海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド	8,507,242	2.8436	24,191,194	3.0023	25,541,292	12.40
日本	親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	12,428,188	1.3656	16,972,171	1.3454	16,720,884	8.12
日本	親投資信託受益証券	海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド	1,775,420	2.3383	4,151,465	2.4629	4,372,681	2.12
日本	親投資信託受益証券	日本リートインデックスJ-REITマザーファンド	789,297	2.5047	1,976,953	2.5916	2,045,542	0.99
日本	親投資信託受益証券	日本株式インデックSTOPIXマザーファンド	839,477	2.2006	1,847,354	2.3644	1,984,859	0.96

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.69
合計	99.69

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
2023年 2月末日	22		0.9919	
3月末日	34		0.9938	
4月末日	59		0.9998	
5月末日	66		1.0056	
6月末日	109		1.0265	
7月末日	175		1.0263	
8月末日	205		1.0260	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
当中間期	2023年 2月10日～2023年 8月 9日	

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
当中間期	2023年 2月10日～2023年 8月 9日	2.41

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落ち）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落ち、以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。

(4) 【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
当中間期	2023年 2月10日～2023年 8月 9日	211,151,544	26,533,151

(注)第1期中間計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(参考)

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

以下の運用状況は2023年 8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	51,679,183,590	99.48
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		267,881,692	0.52
合計（純資産総額）		51,947,065,282	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	256,355,000	0.49

(注)先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	855,700	2,021.35	1,729,669,195	2,515.00	2,152,085,500	4.14
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	110,200	9,999.31	1,101,923,962	12,145.00	1,338,379,000	2.58
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	961,200	723.32	695,255,184	1,163.50	1,118,356,200	2.15
日本	株式	キーエンス	電気機器	15,600	51,777.42	807,727,830	60,520.00	944,112,000	1.82
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	5,007,300	163.96	820,996,908	168.30	842,728,590	1.62
日本	株式	日立製作所	電気機器	76,500	6,610.24	505,683,360	9,694.00	741,591,000	1.43
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	109,100	4,285.59	467,557,869	6,681.00	728,897,100	1.40
日本	株式	三菱商事	卸売業	100,900	4,167.40	420,490,660	7,196.00	726,076,400	1.40
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	33,000	13,296.73	438,792,189	21,575.00	711,975,000	1.37
日本	株式	三井物産	卸売業	117,400	3,375.73	396,310,702	5,432.00	637,716,800	1.23
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	138,300	3,852.00	532,731,600	4,508.00	623,456,400	1.20
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	118,600	4,602.72	545,882,592	5,220.00	619,092,000	1.19
日本	株式	任天堂	その他製品	98,400	6,062.10	596,510,640	6,267.00	616,672,800	1.19
日本	株式	信越化学工業	化学	129,800	3,139.96	407,566,808	4,659.00	604,738,200	1.16
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	126,700	3,381.93	428,490,531	4,703.00	595,870,100	1.15
日本	株式	第一三共	医薬品	136,200	4,530.05	616,992,810	4,299.00	585,523,800	1.13
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	99,300	3,952.40	392,473,320	5,472.00	543,369,600	1.05
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	222,000	1,649.64	366,220,080	2,410.00	535,020,000	1.03
日本	株式	HOYA	精密機器	33,000	14,695.77	484,960,410	16,155.00	533,115,000	1.03

日本	株式	KDDI	情報・通信業	120,800	4,393.94	530,787,952	4,325.00	522,460,000	1.01
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	77,100	6,039.52	465,646,992	6,545.00	504,619,500	0.97
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	151,700	2,675.38	405,855,146	3,227.00	489,535,900	0.94
日本	株式	ダイキン工業	機械	18,800	22,041.92	414,388,204	25,225.00	474,230,000	0.91
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	84,800	3,887.77	329,682,896	5,249.00	445,115,200	0.86
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	251,300	1,474.22	370,471,486	1,670.00	419,671,000	0.81
日本	株式	村田製作所	電気機器	47,300	7,199.35	340,529,268	8,185.00	387,150,500	0.75
日本	株式	S M C	機械	5,100	58,878.97	300,282,750	70,600.00	360,060,000	0.69
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	56,800	5,610.88	318,697,984	5,981.00	339,720,800	0.65
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	147,600	2,041.58	301,337,208	2,214.50	326,860,200	0.63
日本	株式	デンソー	輸送用機器	32,200	7,345.06	236,511,174	9,959.00	320,679,800	0.62

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.36
		建設業	2.09
		食料品	3.37
		繊維製品	0.41
		パルプ・紙	0.17
		化学	5.94
		医薬品	5.11
		石油・石炭製品	0.46
		ゴム製品	0.68
		ガラス・土石製品	0.68
		鉄鋼	0.98
		非鉄金属	0.66
		金属製品	0.51
		機械	5.48
		電気機器	17.22
		輸送用機器	8.31
		精密機器	2.38
		その他製品	2.27
		電気・ガス業	1.37
		陸運業	2.96
		海運業	0.66
		空運業	0.49
倉庫・運輸関連業	0.14		
情報・通信業	8.05		
卸売業	6.80		
小売業	4.36		

	銀行業	6.56
	証券、商品先物取引業	0.73
	保険業	2.24
	その他金融業	1.16
	不動産業	1.88
	サービス業	4.89
合 計		99.48

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物 2023年09月	買建	11	日本円	251,091,050	256,355,000	0.49

(注)先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

海外株式インデックスMSCI - KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は2023年 8月31日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	219,083,946,393	69.08
	カナダ	10,602,531,154	3.34
	ドイツ	7,666,112,583	2.42
	イタリア	1,696,883,446	0.54
	フランス	10,165,200,117	3.21
	オランダ	5,843,659,101	1.84
	スペイン	2,283,691,525	0.72
	ベルギー	664,346,591	0.21
	オーストリア	159,698,484	0.05
	ルクセンブルク	169,810,125	0.05
	フィンランド	1,013,896,509	0.32
	アイルランド	6,068,987,256	1.91
	ポルトガル	163,905,261	0.05
	イギリス	12,539,190,332	3.95
	スイス	10,062,629,796	3.17
スウェーデン	2,597,340,175	0.82	
ノルウェー	601,318,445	0.19	

	デンマーク	2,941,071,403	0.93
	ケイマン	453,922,817	0.14
	オーストラリア	6,007,667,749	1.89
	バミューダ	272,822,236	0.09
	ニュージーランド	232,472,410	0.07
	香港	1,697,142,322	0.54
	シンガポール	977,758,616	0.31
	イスラエル	641,803,497	0.20
	ジャージー	886,434,492	0.28
	アラブ首長国連邦	0	0.00
	マン島	53,808,426	0.02
	小計	305,548,051,261	96.34
投資証券	アメリカ	5,463,542,510	1.72
	カナダ	14,859,936	0.00
	フランス	115,053,602	0.04
	ベルギー	32,618,868	0.01
	イギリス	109,997,569	0.03
	オーストラリア	388,529,872	0.12
	香港	76,746,806	0.02
	シンガポール	128,963,964	0.04
	小計	6,330,313,127	2.00
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		5,270,303,890	1.66
合計（純資産総額）		317,148,668,278	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	4,299,394,775	1.36
	買建	ドイツ	828,051,120	0.26

(注)先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		4,338,174,330	1.37

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
------	----	-----	----	--------------	-----------------	-----------------	-----------------	-----------------	-----------------

アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	627,544	22,370.96	14,038,764,651	27,434.43	17,216,311,940	5.43
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	280,494	37,026.91	10,385,826,964	48,069.09	13,483,093,574	4.25
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	366,170	17,408.63	6,374,519,098	19,747.23	7,230,844,674	2.28
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	97,960	21,326.45	2,089,139,727	72,023.96	7,055,467,905	2.22
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	236,400	15,292.66	3,615,184,911	19,865.65	4,696,241,078	1.48
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	212,960	15,363.08	3,271,722,546	20,019.16	4,263,281,591	1.34
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	113,195	31,922.89	3,613,512,130	37,558.77	4,251,466,102	1.34
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	87,880	20,742.98	1,822,893,095	43,143.62	3,791,461,326	1.20
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	51,425	42,765.37	2,199,209,637	52,786.97	2,714,570,035	0.86
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	37,060	78,445.52	2,907,191,326	71,861.68	2,663,194,083	0.84
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	160,801	15,508.98	2,493,860,480	16,210.65	2,606,689,695	0.82
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	32,079	51,950.11	1,666,507,781	80,116.13	2,570,045,591	0.81
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	116,110	18,130.21	2,105,099,444	21,660.99	2,515,057,781	0.79
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	64,382	28,834.56	1,856,426,833	35,998.82	2,317,676,416	0.73
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	95,631	24,907.10	2,381,891,025	23,937.32	2,289,150,423	0.72
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	16,530	70,732.01	1,169,200,213	130,451.33	2,156,360,584	0.68
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	93,439	19,347.73	1,807,833,398	22,520.64	2,104,306,828	0.66
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	33,715	46,278.78	1,560,289,199	60,513.64	2,040,217,440	0.64
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	40,105	42,659.86	1,710,873,761	48,338.10	1,938,599,741	0.61
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	108,950	18,020.08	1,963,288,122	17,700.15	1,928,431,735	0.61
デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	65,575	17,669.22	1,158,659,298	27,627.60	1,811,679,870	0.57
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	71,831	25,503.60	1,831,949,274	23,418.31	1,682,161,057	0.53
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	100,843	14,459.75	1,458,165,016	16,112.70	1,624,853,208	0.51
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	15,927	80,826.29	1,287,320,365	97,614.28	1,554,702,765	0.49

アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	70,096	21,902.79	1,535,298,467	21,684.38	1,519,988,581	0.48
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	18,194	47,855.39	870,681,128	79,731.63	1,450,637,313	0.46
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	54,611	26,125.09	1,426,717,508	26,473.89	1,445,765,934	0.46
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	162,942	8,654.34	1,410,156,371	8,840.71	1,440,523,621	0.45
フランス	株式	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	耐久消費財・アパレル	10,979	107,206.75	1,177,022,965	128,511.35	1,410,926,221	0.44
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	17,549	73,114.10	1,283,079,472	79,278.41	1,391,256,852	0.44

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	エネルギー	5.05
		素材	3.98
		資本財	6.57
		商業・専門サービス	1.51
		運輸	1.82
		自動車・自動車部品	2.17
		耐久消費財・アパレル	1.60
		消費者サービス	2.07
		メディア・娯楽	5.98
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.45
		生活必需品流通・小売り	1.68
		食品・飲料・タバコ	3.83
		家庭用品・パーソナル用品	1.73
		ヘルスケア機器・サービス	4.38
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.46
		銀行	5.17
		金融サービス	6.47
		保険	2.99
		ソフトウェア・サービス	9.27
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.84
電気通信サービス	1.14		
公益事業	2.71		
半導体・半導体製造装置	6.13		
不動産管理・開発	0.34		
投資証券			2.00
合計			98.34

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等(円)	評価額 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI2309	買建	130	米ドル	29,109,750	4,255,845,450	29,407,625	4,299,394,775	1.36
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 2309	買建	130	ユーロ	5,165,440	825,643,930	5,180,500	828,051,120	0.26

(注)先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	24,900,000.00	3,544,953,800	3,616,832,270	1.14
	ユーロ	買建	4,300,000.00	669,100,525	684,157,920	0.22
	英ポンド	買建	200,000.00	37,167,200	37,184,140	0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

海外新興国株式インデックスMSCIEマージング(ヘッジなし)マザーファンド

以下の運用状況は2023年 8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	342,406,248	0.32
	メキシコ	2,858,380,755	2.64
	ブラジル	5,492,194,787	5.08
	チリ	535,344,219	0.49
	コロンビア	99,985,643	0.09
	ペルー	280,812,465	0.26
	オランダ	64,987,904	0.06
	ルクセンブルク	101,849,698	0.09
	ギリシャ	480,156,131	0.44
	トルコ	734,644,250	0.68
	チェコ	167,227,211	0.15
	キプロス	290	0.00
	ハンガリー	258,031,415	0.24
	ポーランド	760,217,358	0.70
	ロシア	4,946,948	0.00
ケイマン	12,458,211,571	11.52	

	パミューダ	233,354,536	0.22
	香港	1,811,108,587	1.67
	シンガポール	23,471,937	0.02
	マレーシア	1,419,762,487	1.31
	タイ	2,051,197,244	1.90
	フィリピン	625,870,281	0.58
	インドネシア	2,034,365,057	1.88
	韓国	12,325,979,900	11.40
	台湾	14,926,677,260	13.80
	中国	15,544,972,317	14.37
	インド	15,103,949,975	13.96
	カタール	935,945,754	0.87
	エジプト	49,366,121	0.05
	南アフリカ	3,176,793,159	2.94
	英ヴァージン諸島	222	0.00
	アラブ首長国連邦	1,341,055,517	1.24
	クウェート	835,030,971	0.77
	サウジアラビア	4,279,965,054	3.96
	小計	101,358,263,272	93.71
社債券	インド	0	0.00
投資証券	メキシコ	66,866,197	0.06
	南アフリカ	35,849,899	0.03
	小計	102,716,096	0.09
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		6,702,618,888	6.20
合計(純資産総額)		108,163,598,256	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	6,790,159,584	6.28

(注)先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		1,054,615,546	0.98
	売建		903,275,508	0.84

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	2,558,355	2,285.83	5,847,977,163	2,544.61	6,510,040,021	6.02
中国	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	646,150	6,344.14	4,099,269,521	6,069.65	3,921,906,932	3.63
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	496,460	7,179.91	3,564,541,025	7,434.68	3,691,021,233	3.41
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費財・サービス流通・小売り	1,710,000	1,578.46	2,699,177,507	1,683.22	2,878,307,055	2.66
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	316,462	4,095.57	1,296,092,584	4,304.12	1,362,093,272	1.26
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サービス	526,485	2,518.48	1,325,945,404	2,500.14	1,316,289,367	1.22
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	535,787	1,685.16	902,891,947	1,706.84	914,503,755	0.85
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	345,188	2,252.25	777,449,685	2,554.56	881,805,874	0.82
インド	株式	HDFC BANK LIMITED	銀行	287,193	2,942.91	845,184,790	2,810.08	807,037,029	0.75
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	9,961,920	99.84	994,633,771	78.05	777,624,487	0.72
ケイマン	株式	PDD HOLDINGS INC-ADR	一般消費財・サービス流通・小売り	52,570	9,705.13	510,198,860	14,348.06	754,277,935	0.70
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	56,810	9,767.87	554,913,016	13,229.51	751,569,031	0.69
ブラジル	株式	VALE SA	素材	348,106	2,063.25	718,229,834	1,941.35	675,797,489	0.62
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,295,212	469.75	608,427,488	485.99	629,472,255	0.58
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	204,875	2,574.97	527,547,177	3,029.23	620,615,135	0.57
ケイマン	株式	JD.COM INC - CL A	一般消費財・サービス流通・小売り	244,273	2,602.82	635,800,796	2,455.43	599,796,229	0.55
ケイマン	株式	BAIDU INC-CLASS A	メディア・娯楽	234,860	2,274.41	534,170,147	2,542.99	597,247,806	0.55
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	203,782	2,911.52	593,316,479	2,830.40	576,784,573	0.53
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	94,436	5,800.13	547,741,536	6,035.89	570,005,402	0.53
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	648,000	1,074.46	696,252,370	876.54	567,998,892	0.53
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	85,570	6,047.56	517,489,924	6,082.91	520,515,464	0.48
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	158,932	3,071.72	488,195,063	3,250.69	516,639,315	0.48
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	銀行	5,753,500	84.51	486,238,136	88.32	508,149,120	0.47
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	一般消費財・サービス流通・小売り	20,330	25,520.20	518,825,841	24,867.43	505,554,862	0.47
韓国	株式	POSCO HOLDINGS INC	素材	7,460	41,445.79	309,185,632	64,264.00	479,409,440	0.44
中国	株式	BYD CO LTD-H	自動車・自動車部品	102,000	4,538.39	462,916,053	4,560.62	465,183,648	0.43

ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	464,960	766.62	356,449,166	974.56	453,132,182	0.42
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE CV	電気通信サービス	3,110,749	172.37	536,211,808	142.38	442,922,967	0.41
サウジアラビア	株式	THE SAUDI NATIONAL BANK	銀行	306,275	1,390.34	425,829,293	1,413.24	432,842,531	0.40
中国	株式	BANK OF CHINA LTD - H	銀行	8,233,000	60.75	500,191,095	50.30	414,128,133	0.38

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	4.80
		素材	7.36
		資本財	4.26
		商業・専門サービス	0.05
		運輸	1.93
		自動車・自動車部品	3.54
		耐久消費財・アパレル	1.28
		消費者サービス	2.71
		メディア・娯楽	6.23
		一般消費財・サービス流通・小売り	5.57
		生活必需品流通・小売り	1.50
		食品・飲料・タバコ	3.59
		家庭用品・パーソナル用品	0.78
		ヘルスケア機器・サービス	1.00
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.56
		銀行	15.32
		金融サービス	2.60
		保険	2.55
		ソフトウェア・サービス	2.34
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.31
電気通信サービス	2.81		
公益事業	2.40		
半導体・半導体製造装置	8.64		
不動産管理・開発	1.56		
社債券			
投資証券			0.09
合計			93.80

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等(円)	評価額 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	ニューヨーク証券取引所	MINMSC1E2309	買建	936	米ドル	47,164,135	6,895,396,537	46,444,320	6,790,159,584	6.28

(注)先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	700,000.00	102,235,000	102,256,700	0.09
	ユーロ	買建	150,000.00	23,921,100	23,973,210	0.02
	ポーランドズロチ	買建	660,000.00	23,560,878	23,600,676	0.02
	香港ドル	買建	22,400,000.00	417,304,540	417,264,960	0.39
	韓国ウォン	買建	4,400,000,000.00	486,118,038	487,520,000	0.45
	米ドル	売建	6,179,361.00	903,422,578	903,275,508	0.84

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

日本リートインデックスJ - R E I Tマザーファンド

以下の運用状況は2023年 8月31日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	60,216,338,550	98.45
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		946,554,767	1.55
合計(純資産総額)		61,162,893,317	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人 投資証券	6,547	565,424.42	3,701,833,684	615,000	4,026,405,000	6.58
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	5,765	542,423.52	3,127,071,593	605,000	3,487,825,000	5.70
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	18,148	161,718.1	2,934,860,106	171,100	3,105,122,800	5.08
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	9,776	296,874.27	2,902,242,957	292,900	2,863,390,400	4.68
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人 投資証券	26,901	97,372.64	2,619,421,521	97,800	2,630,917,800	4.30
日本	投資証券	G L P投資法人 投資証券	18,957	145,399.15	2,756,331,801	137,300	2,602,796,100	4.26

日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資証券	8,459	287,063.31	2,428,268,576	276,200	2,336,375,800	3.82
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	11,183	180,465.18	2,018,142,108	181,100	2,025,241,300	3.31
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	12,554	147,491.72	1,851,611,145	156,500	1,964,701,000	3.21
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	5,331	359,217.33	1,914,987,589	350,500	1,868,515,500	3.05
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資証券	27,171	56,909.67	1,546,292,812	60,500	1,643,845,500	2.69
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	16,864	79,975.72	1,348,710,671	84,100	1,418,262,400	2.32
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	3,838	352,233.9	1,351,873,709	369,000	1,416,222,000	2.32
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	18,098	72,588.35	1,313,704,054	73,800	1,335,632,400	2.18
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	1,938	663,102.55	1,285,092,748	657,000	1,273,266,000	2.08
日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	8,562	156,593.55	1,340,753,992	146,000	1,250,052,000	2.04
日本	投資証券	アクティブア・プロパティーズ投資法人 投資証券	2,944	406,140.51	1,195,677,682	408,000	1,201,152,000	1.96
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	2,334	512,564.58	1,196,325,748	495,500	1,156,497,000	1.89
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	3,266	324,972.07	1,061,358,781	344,000	1,123,504,000	1.84
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	3,595	319,506.18	1,148,624,745	305,000	1,096,475,000	1.79
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人 投資証券	7,173	160,939.76	1,154,420,899	148,700	1,066,625,100	1.74
日本	投資証券	イオンリート投資法人 投資証券	6,885	155,440.76	1,070,209,699	147,300	1,014,160,500	1.66
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投資証券	2,082	488,867.15	1,017,821,415	470,500	979,581,000	1.60
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	6,600	150,930.38	996,140,549	146,700	968,220,000	1.58
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	2,760	349,632.33	964,985,244	340,500	939,780,000	1.54
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券	4,120	216,085.63	890,272,832	226,000	931,120,000	1.52
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人 投資証券	7,786	113,877.98	886,654,011	111,500	868,139,000	1.42
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人 投資証券	5,250	156,280.35	820,471,879	162,400	852,600,000	1.39
日本	投資証券	森トラストリート投資法人 投資証券	10,818	70,950.39	767,541,345	73,600	796,204,800	1.30
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人 投資証券	1,163	612,427.48	712,253,163	684,000	795,492,000	1.30

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.45
合計	98.45

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は2023年 8月31日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	44,280,898,707	77.48
	カナダ	938,636,943	1.64
	ドイツ	24,928,087	0.04
	イタリア	6,334,835	0.01
	フランス	981,403,603	1.72
	オランダ	112,280,738	0.20
	スペイン	231,850,821	0.41
	ベルギー	595,754,183	1.04
	アイルランド	21,057,900	0.04
	イギリス	2,554,432,439	4.47
	オーストラリア	3,794,828,743	6.64
	ニュージーランド	156,939,652	0.27
	香港	690,796,303	1.21
	シンガポール	2,025,556,019	3.54
	韓国	125,364,125	0.22
	イスラエル	67,820,832	0.12
ガーンジー	115,479,456	0.20	
	小計	56,724,363,386	99.25
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		425,872,812	0.75
合計（純資産総額）		57,150,236,198	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建		21,926,430	0.04

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
------	----	-----	--------------	-----------------	-----------------	-----------------	-----------------	-----------------

アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	280,192	17,885.72	5,011,435,869	18,377.33	5,149,183,649	9.01
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	28,381	113,612.87	3,224,446,888	115,869.34	3,288,487,966	5.75
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	48,021	41,542.42	1,994,908,738	41,082.19	1,972,808,326	3.45
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	150,830	11,915.28	1,797,182,025	12,121.44	1,828,277,097	3.20
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	88,416	15,563.87	1,376,095,962	19,248.69	1,701,892,352	2.98
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	204,415	8,938.12	1,827,086,301	8,269.07	1,690,322,353	2.96
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	99,252	16,290.33	1,616,848,543	16,595.16	1,647,103,019	2.88
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	304,647	4,729.48	1,440,822,882	4,529.27	1,379,830,346	2.41
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	64,081	20,909.50	1,339,902,130	19,098.10	1,223,825,731	2.14
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	43,118	27,812.39	1,199,214,780	27,070.39	1,167,221,162	2.04
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	519,214	1,874.24	973,136,369	2,198.89	1,141,697,588	2.00
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL-REIT	103,560	9,709.67	1,005,534,244	9,576.10	991,700,916	1.74
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	176,468	4,984.32	879,574,120	5,027.81	887,248,987	1.55
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	47,737	17,800.29	849,732,596	17,225.28	822,283,382	1.44
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	88,499	8,337.93	737,899,200	9,261.76	819,657,383	1.43
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	121,424	6,781.84	823,478,899	6,421.10	779,676,132	1.36
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	35,422	22,400.68	793,476,899	21,396.36	757,902,218	1.33
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	19,495	34,196.81	666,666,865	35,111.39	684,496,587	1.20
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	37,746	19,554.12	738,089,828	18,092.24	682,910,068	1.19
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	65,018	10,213.15	664,039,091	9,555.63	621,288,081	1.09
香港	投資証券	LINK REIT	776,080	865.46	671,667,148	736.81	571,828,549	1.00
アメリカ	投資証券	UDR INC	94,035	6,288.79	591,367,146	5,886.01	553,491,138	0.97
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	79,794	7,307.81	583,119,496	6,932.80	553,196,162	0.97
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	53,200	9,907.05	527,055,393	9,843.64	523,681,967	0.92
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	187,956	2,828.56	531,644,958	2,776.33	521,829,385	0.91
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	32,411	16,326.18	529,148,118	15,836.38	513,273,042	0.90
イギリス	投資証券	SEGO PLC	370,890	1,404.72	520,998,483	1,376.77	510,631,635	0.89
アメリカ	投資証券	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	95,373	5,103.72	486,757,897	5,296.82	505,174,186	0.88
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	215,842	2,546.33	549,605,569	2,339.19	504,897,606	0.88
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	166,344	3,029.17	503,884,413	3,024.87	503,170,306	0.88

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
投資証券	99.25
合計	99.25

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等 (円)	評価額 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	米ドル	売建	150,000.00	21,900,000	21,926,430	0.04

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

日本債券インデックスマザーファンド

以下の運用状況は2023年 8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	44,588,399,070	86.62
地方債証券	日本	2,832,658,960	5.50
特殊債券	日本	2,611,073,000	5.07
社債券	日本	1,298,788,000	2.52
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		145,920,870	0.28
合計（純資産総額）		51,476,839,900	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	利率 （％）	償還期限	投資 比率 （％）
日本	国債証券	第341回利付国債（10年）	700,000,000	100.99	706,944,000	100.62	704,340,000	0.300	2025/12/20	1.37
日本	国債証券	第344回利付国債（10年）	700,000,000	100.30	702,136,000	100.09	700,637,000	0.100	2026/9/20	1.36
日本	国債証券	第347回利付国債（10年）	680,000,000	100.14	681,005,400	99.90	679,354,000	0.100	2027/6/20	1.32
日本	国債証券	第345回利付国債（10年）	660,000,000	100.23	661,547,700	100.04	660,323,400	0.100	2026/12/20	1.28
日本	国債証券	第346回利付国債（10年）	660,000,000	100.17	661,122,000	99.98	659,881,200	0.100	2027/3/20	1.28
日本	国債証券	第343回利付国債（10年）	645,000,000	100.33	647,173,700	100.11	645,715,950	0.100	2026/6/20	1.25
日本	国債証券	第342回利付国債（10年）	630,000,000	100.36	632,294,900	100.13	630,875,700	0.100	2026/3/20	1.23
日本	国債証券	第340回利付国債（10年）	620,000,000	101.21	627,551,600	100.78	624,891,800	0.400	2025/9/20	1.21
日本	国債証券	第349回利付国債（10年）	590,000,000	99.94	589,646,000	99.74	588,483,700	0.100	2027/12/20	1.14
日本	国債証券	第358回利付国債（10年）	590,000,000	98.91	583,569,000	98.39	580,554,100	0.100	2030/3/20	1.13
日本	国債証券	第339回利付国債（10年）	570,000,000	101.11	576,338,400	100.72	574,104,000	0.400	2025/6/20	1.12
日本	国債証券	第360回利付国債（10年）	580,000,000	98.53	571,485,600	97.94	568,063,600	0.100	2030/9/20	1.10
日本	国債証券	第357回利付国債（10年）	560,000,000	99.12	555,072,000	98.58	552,048,000	0.100	2029/12/20	1.07
日本	国債証券	第350回利付国債（10年）	540,000,000	99.83	539,082,000	99.61	537,926,400	0.100	2028/3/20	1.04

日本	国債証券	第351回利付国債（10年）	535,000,000	99.74	533,646,450	99.47	532,201,950	0.100	2028/6/20	1.03
日本	国債証券	第352回利付国債（10年）	520,000,000	99.64	518,128,000	99.35	516,620,000	0.100	2028/9/20	1.00
日本	国債証券	第348回利付国債（10年）	500,000,000	100.04	500,240,000	99.83	499,190,000	0.100	2027/9/20	0.97
日本	国債証券	第335回利付国債（10年）	490,000,000	101.00	494,929,400	100.59	492,910,600	0.500	2024/9/20	0.96
日本	国債証券	第363回利付国債（10年）	500,000,000	97.74	488,735,500	97.14	485,710,000	0.100	2031/6/20	0.94
日本	国債証券	第364回利付国債（10年）	500,000,000	97.55	487,764,000	96.90	484,515,000	0.100	2031/9/20	0.94
日本	国債証券	第361回利付国債（10年）	460,000,000	97.91	450,395,500	97.66	449,249,800	0.100	2030/12/20	0.87
日本	国債証券	第359回利付国債（10年）	420,000,000	98.68	414,493,800	98.17	412,339,200	0.100	2030/6/20	0.80
日本	国債証券	第353回利付国債（10年）	400,000,000	99.54	398,172,000	99.21	396,860,000	0.100	2028/12/20	0.77
日本	国債証券	第338回利付国債（10年）	390,000,000	101.01	393,970,200	100.65	392,566,200	0.400	2025/3/20	0.76
日本	国債証券	第362回利付国債（10年）	400,000,000	98.36	393,448,000	97.40	389,636,000	0.100	2031/3/20	0.76
日本	国債証券	第366回利付国債（10年）	400,000,000	100.00	400,000,000	97.26	389,044,000	0.200	2032/3/20	0.76
日本	国債証券	第369回利付国債（10年）	390,000,000	100.62	392,433,000	99.20	386,903,400	0.500	2032/12/20	0.75
日本	国債証券	第117回利付国債（20年）	343,000,000	113.55	389,493,650	111.38	382,033,400	2.100	2030/3/20	0.74
日本	国債証券	第370回利付国債（10年）	370,000,000	100.68	372,534,200	98.96	366,159,400	0.500	2033/3/20	0.71
日本	国債証券	第144回利付国債（20年）	330,000,000	110.86	365,838,000	108.22	357,142,500	1.500	2033/3/20	0.69

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	86.62
地方債証券	5.50
特殊債券	5.07
社債券	2.52
合計	99.72

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

以下の運用状況は2023年 8月31日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	10,850,129,098	48.51
	カナダ	437,833,490	1.96
	メキシコ	210,754,190	0.94
	ドイツ	1,441,442,661	6.44
	イタリア	1,691,985,821	7.56
	フランス	1,830,473,470	8.18
	オランダ	333,351,675	1.49
	スペイン	1,084,849,320	4.85
	ベルギー	411,898,882	1.84
	オーストリア	271,802,802	1.22
	フィンランド	101,558,149	0.45
	アイルランド	132,291,559	0.59
	イギリス	1,113,182,207	4.98
	スウェーデン	55,075,899	0.25
	ノルウェー	42,723,100	0.19
	デンマーク	70,107,722	0.31
	ポーランド	118,824,622	0.53
	オーストラリア	309,670,880	1.38
	ニュージーランド	34,448,123	0.15
	シンガポール	89,600,970	0.40
マレーシア	260,898,554	1.17	
中国	1,368,667,679	6.12	
イスラエル	74,216,319	0.33	
	小計	22,335,787,192	99.86
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		31,923,258	0.14
合計（純資産総額）		22,367,710,450	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建		23,022,376,206	102.93

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	13,342.74	533,709,954	13,524.07	540,962,807	2.000	2026/11/15	2.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,800,000	13,985.51	531,449,561	14,105.43	536,006,510	2.250	2024/11/15	2.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,200,000	13,826.67	442,453,759	13,843.31	442,986,000	2.250	2025/11/15	1.98
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,650,000	13,830.17	366,499,699	13,980.37	370,479,938	2.000	2025/2/15	1.66
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,430,000	14,065.90	341,801,418	14,208.88	345,275,920	2.375	2024/8/15	1.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,400,000	12,242.86	293,828,739	12,382.16	297,171,851	1.500	2030/2/15	1.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,100,000	13,293.34	279,160,332	13,512.06	283,753,410	1.625	2026/5/15	1.27
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,000,000	13,672.62	273,452,480	13,831.87	276,637,593	2.000	2025/8/15	1.24
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,990,000	12,481.09	248,373,771	12,512.65	249,001,906	0.625	2027/11/30	1.11
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,600,000	13,362.45	213,799,225	13,581.74	217,307,937	1.625	2026/2/15	0.97
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	13,574.89	203,623,476	13,690.82	205,362,389	2.875	2028/8/15	0.92
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	13,452.68	201,790,265	13,588.60	203,829,043	2.375	2027/5/15	0.91
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,600,000	12,546.00	200,736,126	12,682.85	202,925,600	1.250	2028/6/30	0.91
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,500,000	12,910.71	193,660,747	13,260.22	198,903,346	0.375	2025/11/30	0.89
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,700,000	11,558.57	196,495,724	11,582.63	196,904,821	0.625	2030/5/15	0.88
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,300,000	13,793.97	179,321,610	13,929.54	181,084,036	2.125	2025/5/15	0.81
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,350,000	7,406.49	174,052,562	7,609.24	178,817,191	1.250	2050/5/15	0.80
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,400,000	12,257.95	171,611,388	12,546.35	175,649,008	1.125	2028/8/31	0.79
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,200,000	13,758.15	165,097,812	13,899.27	166,791,334	1.750	2025/3/15	0.75
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	850,000	20,039.40	170,334,973	19,444.67	165,279,779	5.750	2032/10/25	0.74
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,100,000	13,429.26	147,721,964	13,581.17	149,392,935	2.250	2027/2/15	0.67
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,100,000	13,336.36	146,700,004	13,482.94	148,312,385	2.250	2027/8/15	0.66
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1,000,000	14,586.12	145,861,273	14,443.68	144,436,860	1.500	2031/5/25	0.65
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,800,000	7,664.64	137,963,684	7,869.09	141,643,765	1.375	2050/8/15	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	13,822.18	138,221,821	14,034.61	140,346,152	1.500	2024/9/30	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,100,000	12,150.59	133,656,496	12,477.24	137,249,738	0.500	2027/10/31	0.61
ドイツ	国債証券	BUNDESREP. DEUTSCHLAND	900,000	15,371.81	138,346,315	14,990.46	134,914,199	1.700	2032/8/15	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	12,793.07	127,930,711	13,058.05	130,580,577	1.125	2027/2/28	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	12,459.55	124,595,523	12,730.81	127,308,182	1.250	2028/4/30	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	900,000	13,836.45	124,528,134	13,939.81	125,458,372	2.625	2025/12/31	0.56

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.86
合計	99.86

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率 (%)
-------	----	----	----	---------	--------	-----------------

為替予約取引	米ドル	売建	76,323,000.00	10,517,650,177	11,139,694,159	49.80
	加ドル	売建	4,092,000.00	421,837,235	441,032,008	1.97
	メキシコペソ	売建	24,690,000.00	198,281,410	212,560,184	0.95
	ユーロ	売建	47,525,000.00	7,056,703,601	7,588,710,938	33.93
	英ポンド	売建	6,056,000.00	1,047,211,376	1,123,283,261	5.02
	スウェーデンクローナ	売建	4,170,000.00	53,309,969	56,185,250	0.25
	ノルウェークローネ	売建	3,149,000.00	40,226,370	43,402,814	0.19
	デンマーククローネ	売建	3,360,000.00	69,068,189	71,780,489	0.32
	ポーランドズロチ	売建	3,382,000.00	113,867,869	119,998,853	0.54
	豪ドル	売建	3,505,000.00	325,981,181	330,764,568	1.48
	ニュージーランドドル	売建	418,000.00	35,769,715	35,946,642	0.16
	シンガポールドル	売建	841,000.00	87,279,192	90,831,105	0.41
	マレーシアリングgit	売建	10,130,000.00	305,006,196	318,865,049	1.43
	中国元	売建	68,696,000.00	1,353,282,929	1,373,256,742	6.14
	イスラエルシュケル	売建	1,991,000.00	76,279,705	76,064,144	0.34

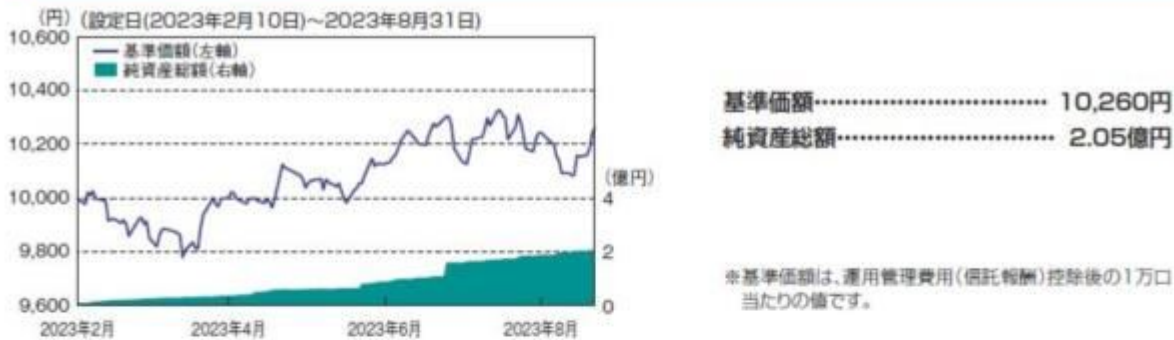
(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

参考情報

運用実績

2023年8月31日現在

基準価額・純資産の推移



分配の推移

該当事項はありません。

主要な資産の状況

資産構成比率(マザーファンドの組入比率)

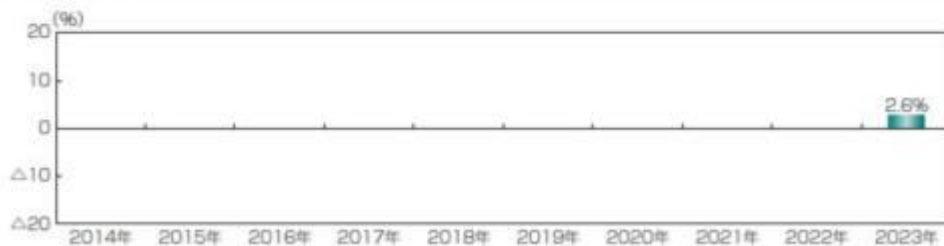
資産	比率	資産別比率
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)	17.1%	20.2%
海外新興国株式インデックスMSCIエマージング(ヘッジなし)	2.1%	
日本株式インデックスTOPIX	1.0%	13.4%
海外リートインデックス(ヘッジなし)	12.4%	
日本リートインデックスJ-REIT	1.0%	66.1%
海外債券インデックス(ヘッジあり)	58.0%	
日本債券インデックス	8.1%	0.3%
現金その他	0.3%	

通貨別エクスポージャー

通貨	比率
アメリカドル	22.6%
ユーロ	2.1%
イギリスポンド	1.3%
オーストラリアドル	1.2%
カナダドル	0.8%
その他	72.0%

※比率は当ファンドの純資産総額比です。
※端数処理の関係で合計が100%とならない場合があります。

年間収益率の推移



※ファンドの年間収益率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。
※当ファンドには、ベンチマークはありません。
※2023年は、設定時から2023年8月末までの騰落率です。

※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2023年 2月10日から2023年 8月 9日まで）の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

【Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)	
当中間計算期間末 2023年 8月 9日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,304,243
親投資信託受益証券	187,854,545
流動資産合計	190,158,788
資産合計	190,158,788
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,013,262
未払受託者報酬	8,330
未払委託者報酬	33,169
未払利息	4
その他未払費用	35,890
流動負債合計	1,090,655
負債合計	1,090,655
純資産の部	
元本等	
元本	184,618,393
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	4,449,740
元本等合計	189,068,133
純資産合計	189,068,133
負債純資産合計	190,158,788

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)	
当中間計算期間 自 2023年 2月10日 至 2023年 8月 9日	
営業収益	
有価証券売買等損益	2,041,035
営業収益合計	2,041,035
営業費用	
支払利息	184
受託者報酬	8,330
委託者報酬	33,169

		当中間計算期間 自 2023年 2月10日 至 2023年 8月 9日
その他費用		35,891
営業費用合計		77,574
営業利益又は営業損失（ ）		1,963,461
経常利益又は経常損失（ ）		1,963,461
中間純利益又は中間純損失（ ）		1,963,461
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）		242,112
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,801,629
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		2,801,629
剰余金減少額又は欠損金増加額		73,238
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		73,238
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-
分配金		-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		4,449,740

（ 3 ）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
-----------------	--

（中間貸借対照表に関する注記）

		当中間計算期間末 2023年 8月 9日現在
1.	期首元本額	10,000,000円
	期中追加設定元本額	201,151,544円
	期中一部解約元本額	26,533,151円
2.	受益権の総数	184,618,393口

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

		当中間計算期間 自 2023年 2月10日 至 2023年 8月 9日
該当事項はありません。		

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	当中間計算期間末 2023年 8月 9日現在
中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	中間貸借対照表計上額は中間計算期間末日の時価で計上しているため、その差額は ありません。
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載 しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品 の時価を帳簿価額としております。
金融商品の時価等に関する事項につ いての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提 条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 2023年 8月 9日現在
1口当たり純資産額	1.0241円
(1万口当たり純資産額)	(10,241円)

当ファンドは、「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」「海外株式インデックスMSCI-K
OKUSA I (ヘッジなし)マザーファンド」「海外新興国株式インデックスMSCIエマージング(ヘッジ
なし)マザーファンド」「日本リートインデックス」-REITマザーファンド」「海外リートインデックス
(ヘッジなし)マザーファンド」「日本債券インデックスマザーファンド」「海外債券インデックス(ヘッジ
あり)マザーファンド」を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受
益証券」は同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通りです。ただし、当該情報は監査の対象外
であります。

(参考)

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

貸借対照表

(単位 : 円)

2023年 8月 9日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	83,326,210
株式	50,586,383,810
派生商品評価勘定	98,900
未収入金	60,060,500
未収配当金	68,778,921

2023年 8月 9日現在

前払金	35,000
流動資産合計	50,798,683,341
資産合計	50,798,683,341
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	557,750
未払解約金	39,270,714
未払利息	159
流動負債合計	39,828,623
負債合計	39,828,623
純資産の部	
元本等	
元本	21,938,368,800
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	28,820,485,918
元本等合計	50,758,854,718
純資産合計	50,758,854,718
負債純資産合計	50,798,683,341

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

		2023年 8月 9日現在
1.	期首	2023年 2月10日
	期首元本額	22,734,797,694円
	期首からの追加設定元本額	939,352,820円
	期首からの一部解約元本額	1,735,781,714円
	元本の内訳	

DCインデックスバランス（株式20）	749,857,891円
DCインデックスバランス（株式40）	2,076,106,689円
DCインデックスバランス（株式60）	4,355,548,203円
DCインデックスバランス（株式80）	5,116,868,374円
インデックスファンド日本株式（DC専用）	1,712,242,214円
世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	2,808,434,143円
インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	493,098,615円
Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	777,238円
Niつみインデックスラップ世界10指数（均等型）	678,947円
Niつみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	276,830円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	1,854,159,840円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	213,009,294円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	611,595,097円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	972,652,681円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	973,062,744円
計	21,938,368,800円
2. 受益権の総数	21,938,368,800口
3. 担保資産 デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次のとおりであります。 株式	708,205,000円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

	2023年 8月 9日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（株式関連）

（2023年 8月 9日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	160,335,000	-	159,880,000	455,000
	合計	160,335,000	-	159,880,000	455,000

（注）1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、同中間計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

2023年 8月 9日現在	
1口当たり純資産額	2.3137円
(1万口当たり純資産額)	(23,137円)

海外株式インデックスMSCI - KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2023年 8月 9日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	124,500,071
コール・ローン	3,732,713,058
株式	299,796,686,891
投資証券	6,207,401,722
派生商品評価勘定	95,316,603
未収入金	239,535
未収配当金	221,296,964
差入委託証拠金	628,431,526
流動資産合計	310,806,586,370
資産合計	310,806,586,370
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	18,151,464
未払解約金	1,469,445,217
未払利息	7,123
流動負債合計	1,487,603,804
負債合計	1,487,603,804

2023年 8月 9日現在

純資産の部	
元本等	
元本	60,661,976,187
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	248,657,006,379
元本等合計	309,318,982,566
純資産合計	309,318,982,566
負債純資産合計	310,806,586,370

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式及び投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>(1) デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。</p> <p>(2) 為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

		2023年 8月 9日現在
1.	期首	2023年 2月10日
	期首元本額	61,138,454,902円
	期首からの追加設定元本額	4,761,205,095円
	期首からの一部解約元本額	5,237,683,810円
	元本の内訳	
	インデックスファンド海外株式ヘッジなし（DC専用）	32,352,312,957円

		2023年 8月 9日現在
	DCインデックスバランス（株式20）	115,468,457円
	DCインデックスバランス（株式40）	317,937,990円
	DCインデックスバランス（株式60）	666,253,380円
	DCインデックスバランス（株式80）	777,862,759円
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	1,312,237,079円
	日興五大陸株式ファンド	3,523,146,488円
	インデックスファンド海外先進国株式（適格機関投資家向け）	12,085,689円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	75,144,450円
	インデックスファンド先進国株式（適格機関投資家向け）	5,823,598,051円
	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	9,628,437,178円
	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	6,269,607円
	インデックスファンドMSCIオール・カンントリー（全世界株式）	62,406,298円
	Tracers MSCIオール・カンントリー・インデックス（全世界株式）	234,238,265円
	Niつみインデックスラップ世界10指数（均等型）	307,359円
	Niつみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	125,452円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	1,406,776,567円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	16,195,435円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	46,905,456円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	74,587,947円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	74,834,963円
	インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,134,844,360円
	計	60,661,976,187円
2.	受益権の総数	60,661,976,187口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

		2023年 8月 9日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	
時価の算定方法	<p>(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。</p>	
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（株式関連）

（2023年 8月 9日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建	3,460,501,072	-	3,478,862,295	18,361,223
	合計	3,460,501,072	-	3,478,862,295	18,361,223

（注）1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、同中間計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

また契約額等及び時価の邦貨換算は、本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（通貨関連）

（2023年 8月 9日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,648,745,100	-	2,707,556,090	58,810,990
	米ドル	2,224,816,030	-	2,277,608,070	52,792,040
	ユーロ	423,929,070	-	429,948,020	6,018,950
	売建	16,438,680	-	16,445,754	7,074
	英ポンド	16,438,680	-	16,445,754	7,074
	合計	2,665,183,780	-	2,724,001,844	58,803,916

（注）1.時価の算定方法

(1) 本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

同中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

同中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

・ 同中間計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算しております。

・同中間計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2)本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については同中間計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

(3)上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

2023年 8月 9日現在	
1口当たり純資産額	5.0991円
(1万口当たり純資産額)	(50,991円)

海外新興国株式インデックスMSCIEマージング(ヘッジなし)マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2023年 8月 9日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,729,937,970
コール・ローン	1,367,100,616
株式	101,103,098,907
投資証券	96,086,264
派生商品評価勘定	7,573,102
未収入金	127,146,431
未収配当金	329,108,552
未収利息	6,143
差入委託証拠金	3,902,407,396
流動資産合計	108,662,465,381
資産合計	
108,662,465,381	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	87,498,417
未払解約金	2,041,594,808
未払利息	2,609
流動負債合計	2,129,095,834
負債合計	
2,129,095,834	
純資産の部	
元本等	
元本	43,475,139,545
剰余金	
剰余金又は欠損金()	63,058,230,002
元本等合計	106,533,369,547
純資産合計	
106,533,369,547	
負債純資産合計	
108,662,465,381	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式及び投資証券は移動平均法、社債券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場(外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>(1) デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。</p> <p>(2) 為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条及び第61条にしたがって処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

		2023年 8月 9日現在
1.	期首	2023年 2月10日
	期首元本額	43,220,523,913円
	期首からの追加設定元本額	6,121,332,706円
	期首からの一部解約元本額	5,866,717,074円
	元本の内訳	
	日興五大陸株式ファンド	1,817,755,104円
	インデックスファンド海外新興国(エマージング)株式	18,626,921,650円
	インデックスファンド新興国株式(適格機関投資家向け)	3,164,779,865円
	グローバル3倍3分法ファンド(適格機関投資家向け)	19,785,189,161円
	Tracers グローバル3分法(おとなのバランス)	1,647,059円
	インデックスファンドMSCIオール・カンントリー(全世界株式)	16,401,078円
	Tracers MSCIオール・カンントリー・インデックス(全世界株式)	61,545,352円
	Niつみインデックスラップ世界10指数(均等型)	642,255円
	Niつみインデックスラップ世界10指数(安定成長型)	258,021円
	計	43,475,139,545円
2.	受益権の総数	43,475,139,545口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

	2023年 8月 9日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(デリバティブ取引等に関する注記)
取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(2023年 8月 9日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	5,454,295,402	-	5,383,646,373	70,649,029
合計		5,454,295,402	-	5,383,646,373	70,649,029

(注) 1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、同中間計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

また契約額等及び時価の邦貨換算は、本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

(2023年 8月 9日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	513,908,000	-	512,854,155	1,053,845
	米ドル	513,908,000	-	512,854,155	1,053,845
	売建	1,222,508,543	-	1,230,730,984	8,222,441
	米ドル	396,557,000	-	401,625,280	5,068,280
	メキシコペソ	16,449,840	-	16,591,410	141,570
	チェココルナ	23,843,057	-	24,035,977	192,920
	ポーランドズロチ	10,305,396	-	10,321,247	15,851
	香港ドル	400,453,850	-	403,794,450	3,340,600
	韓国ウォン	130,560,000	-	130,560,000	-
	インドルピー	182,700,000	-	182,700,000	-
	南アフリカランド	39,852,800	-	39,316,680	536,120
	香港・オフショア 人民元	21,786,600	-	21,785,940	660
合計		1,736,416,543	-	1,743,585,139	9,276,286

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

同中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

同中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 同中間計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算しております。
- ・ 同中間計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2) 本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については同中間計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

(3) 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

2023年 8月 9日現在	
1口当たり純資産額	2.4504円
(1万口当たり純資産額)	(24,504円)

日本リートインデックスJ - R E I Tマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2023年 8月 9日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	194,221,395
投資証券	61,049,688,000
未収入金	25,343,100
未収配当金	590,900,647
流動資産合計	61,860,153,142
資産合計	61,860,153,142
負債の部	
流動負債	
未払解約金	106,761,056
未払利息	370
流動負債合計	106,761,426
負債合計	106,761,426
純資産の部	
元本等	
元本	24,205,016,939
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	37,548,374,777
元本等合計	61,753,391,716
純資産合計	61,753,391,716
負債純資産合計	61,860,153,142

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券</p>
-----------------	--

	適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
--	--

（貸借対照表に関する注記）

		2023年 8月 9日現在
1.	期首	2023年 2月10日
	期首元本額	23,742,309,243円
	期首からの追加設定元本額	2,389,666,249円
	期首からの一部解約元本額	1,926,958,553円
	元本の内訳	
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	2,501,021,705円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	1,552,107,949円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	153,846,157円
	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	19,485,374,760円
	財産3分法（適格機関投資家専用）	510,076,952円
	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	729,565円
	Niつみインデックスラップ世界10指数（均等型）	612,059円
	Niつみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	253,459円
	財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）奇数月分配型	994,333円
	計	24,205,016,939円
2.	受益権の総数	24,205,016,939口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

		2023年 8月 9日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	

(1口当たり情報)

2023年 8月 9日現在	
1口当たり純資産額	2.5513円
(1万口当たり純資産額)	(25,513円)

海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2023年 8月 9日現在

資産の部	
流動資産	
預金	252,406,939
コール・ローン	1,477,012,909
投資証券	55,776,628,274
未収入金	145,870,308
未収配当金	105,624,210
流動資産合計	57,757,542,640
資産合計	57,757,542,640
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,218,720
未払解約金	1,661,176,038
未払利息	2,818
流動負債合計	1,662,397,576
負債合計	1,662,397,576
純資産の部	
元本等	
元本	18,972,342,347
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	37,122,802,717
元本等合計	56,095,145,064
純資産合計	56,095,145,064
負債純資産合計	57,757,542,640

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券</p> <p>金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券</p>
--------------------	--

	<p>当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>（3）時価が入手できなかった有価証券</p> <p>適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3.その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

		2023年 8月 9日現在
1.	期首	2023年 2月10日
	期首元本額	19,644,232,705円
	期首からの追加設定元本額	3,080,080,128円
	期首からの一部解約元本額	3,751,970,486円
	元本の内訳	
	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	2,240,327,978円
	インデックスファンド海外先進国リート（適格機関投資家向け）	7,004,923円
	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	16,490,690,196円
	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	7,900,665円
	Ni つみインデックスラップ世界10指数（均等型）	527,407円
	Ni つみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	432,061円
	海外先進国REITインデックスファンド（適格機関投資家向け）	225,459,117円
	計	18,972,342,347円
2.	受益権の総数	18,972,342,347口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

		2023年 8月 9日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	
時価の算定方法	<p>(1)有価証券</p> <p>売買目的有価証券</p> <p>重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p>	

	2023年 8月 9日現在
	(2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（通貨関連）

（2023年 8月 9日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	202,678,530	-	203,897,250	1,218,720
	加ドル	25,413,000	-	25,642,680	229,680
	豪ドル	106,216,650	-	106,816,632	599,982
	ニュージーランドドル	8,649,300	-	8,680,700	31,400
	シンガポールドル	62,399,580	-	62,757,238	357,658
	合計	202,678,530	-	203,897,250	1,218,720

（注）1.時価の算定方法

(1)本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

同中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

同中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・同中間計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算しております。
- ・同中間計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2)本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については同中間計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

(3)上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

2023年 8月 9日現在

1口当たり純資産額	2.9567円
(1万口当たり純資産額)	(29,567円)

日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2023年 8月 9日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	174,387,372
国債証券	44,381,571,470
地方債証券	2,834,321,080
特殊債券	2,614,693,000
社債券	1,200,044,000
未収利息	114,315,624
前払費用	3,986,611
流動資産合計	51,323,319,157
資産合計	51,323,319,157
負債の部	
流動負債	
未払解約金	6,158,931
未払利息	332
流動負債合計	6,159,263
負債合計	6,159,263
純資産の部	
元本等	
元本	37,842,206,626
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	13,474,953,268
元本等合計	51,317,159,894
純資産合計	51,317,159,894
負債純資産合計	51,323,319,157

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券</p>
-----------------	--

	適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
--	--

(貸借対照表に関する注記)

		2023年 8月 9日現在
1.	期首	2023年 2月10日
	期首元本額	35,889,356,118円
	期首からの追加設定元本額	2,830,538,427円
	期首からの一部解約元本額	877,687,919円
	元本の内訳	
	DCインデックスバランス(株式20)	5,492,385,793円
	DCインデックスバランス(株式40)	5,263,438,772円
	DCインデックスバランス(株式60)	4,092,655,523円
	DCインデックスバランス(株式80)	728,155,531円
	インデックスファンド日本債券(DC専用)	2,277,530,084円
	世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	4,589,631,597円
	インデックス・アセットバランス・オープン(適格機関投資家向け)	1,729,528,043円
	Tracers グローバル3分法(おとなのバランス)	11,614,114円
	Niつみインデックスラップ世界10指数(均等型)	1,146,822円
	Niつみインデックスラップ世界10指数(安定成長型)	951,184円
	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	3,146,102,031円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	1,557,744,874円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	1,540,576,343円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	906,208,299円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	135,302,773円
	インデックスファンド日本債券(1年決算型)	5,966,265,265円
	日本債券インデックスファンド(個人型年金向け)	402,969,578円
	計	37,842,206,626円
2.	受益権の総数	37,842,206,626口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

		2023年 8月 9日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引	

	該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(1口当たり情報)

2023年 8月 9日現在	
1口当たり純資産額	1.3561円
(1万口当たり純資産額)	(13,561円)

海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2023年 8月 9日現在

資産の部	
流動資産	
預金	91,004,633
コール・ローン	513,499,691
国債証券	22,456,283,064
派生商品評価勘定	3,478,839
未収利息	193,724,378
前払費用	16,166,303
流動資産合計	23,274,156,908
資産合計	23,274,156,908
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	901,111,630
未払金	32,369,125
未払解約金	7,139,573
未払利息	980
流動負債合計	940,621,308
負債合計	940,621,308
純資産の部	
元本等	
元本	16,886,803,096
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	5,446,732,504
元本等合計	22,333,535,600
純資産合計	22,333,535,600
負債純資産合計	23,274,156,908

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

		2023年 8月 9日現在
1.	期首	2023年 2月10日
	期首元本額	15,998,349,713円
	期首からの追加設定元本額	1,345,734,113円
	期首からの一部解約元本額	457,280,730円
	元本の内訳	
	インデックスファンド海外債券ヘッジあり（DC専用）	5,615,606,794円
	インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	1,472,658,217円
	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	82,480,008円
	Niつみインデックスラップ世界10指数（均等型）	1,173,663円
	Niつみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	2,435,018円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	8,649,950,777円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	123,159,394円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	176,280,057円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	186,616,798円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	138,966,110円
	インデックスファンド海外債券（ヘッジあり）1年決算型	437,476,260円
	計	16,886,803,096円
2.	受益権の総数	16,886,803,096口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額
（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

	2023年 8月 9日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（デリバティブ取引等に関する注記）
取引の時価等に関する事項

（通貨関連）

（2023年 8月 9日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	21,770,482,613	-	22,668,115,404	897,632,791
	米ドル	10,582,166,942	-	10,966,045,357	383,878,415
	加ドル	422,452,484	-	435,633,757	13,181,273
	メキシコペソ	199,010,814	-	206,086,419	7,075,605
	ユーロ	7,061,592,998	-	7,452,441,785	390,848,787
	英ポンド	1,059,547,605	-	1,114,155,923	54,608,318
	スウェーデンクローナ	53,717,178	-	56,052,564	2,335,386
	ノルウェークローネ	40,171,830	-	43,692,132	3,520,302
	デンマーククローネ	68,813,417	-	70,228,135	1,414,718
	ポーランドズロチ	110,371,502	-	117,797,372	7,425,870
	豪ドル	324,446,815	-	325,249,394	802,579
	ニュージーランドドル	35,281,021	-	36,461,105	1,180,084
	シンガポールドル	89,232,049	-	91,217,709	1,985,660

	マレーシアリン ギット	305,006,196	-	315,871,634	10,865,438
	中国元	1,345,834,190	-	1,360,842,503	15,008,313
	イスラエルシケ ル	72,837,572	-	76,339,615	3,502,043
	合計	21,770,482,613	-	22,668,115,404	897,632,791

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

同中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

同中間計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 同中間計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算しております。
- ・ 同中間計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2) 本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については同中間計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

(3) 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

2023年 8月 9日現在	
1口当たり純資産額	1.3225円
(1万口当たり純資産額)	(13,225円)

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2023年 8月31日現在です。

【Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）】

【純資産額計算書】

資産総額	209,750,817円
負債総額	3,778,871円
純資産総額（ - ）	205,971,946円
発行済口数	200,749,169口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0260円

(参考)

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	51,984,571,642円
負債総額	37,506,360円
純資産総額（ - ）	51,947,065,282円
発行済口数	21,970,476,622口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3644円

海外株式インデックスMSCI - K O K U S A I（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	317,223,249,216円
負債総額	74,580,938円
純資産総額（ - ）	317,148,668,278円
発行済口数	60,849,628,198口
1口当たり純資産額（ / ）	5.2120円

海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	108,317,788,719円
負債総額	154,190,463円
純資産総額（ - ）	108,163,598,256円
発行済口数	43,917,345,468口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4629円

日本リートインデックスJ - R E I Tマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	61,165,312,787円
負債総額	2,419,470円
純資産総額（ - ）	61,162,893,317円
発行済口数	23,599,999,542口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5916円

海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	57,182,948,823円
負債総額	32,712,625円
純資産総額（ - ）	57,150,236,198円
発行済口数	19,035,547,247口
1口当たり純資産額（ / ）	3.0023円

日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	51,493,133,593円
負債総額	16,293,693円
純資産総額（ - ）	51,476,839,900円
発行済口数	38,261,972,091口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3454円

海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	23,699,165,160円
負債総額	1,331,454,710円
純資産総額（ - ）	22,367,710,450円
発行済口数	17,017,292,392口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3144円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

<更新後>

(1) 資本金の額

2023年8月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の意思決定機関（2023年8月末現在）

・株主総会

株主総会は、取締役の選任および定款変更に係る決議などの株式会社の基本的な方針や重要な事項の決定を行ないます。

当社は、毎年3月31日の最終の株主名簿に記載または記録された議決権を有する株主をもって、その事業年度に関する定時株主総会において、その権利を行使することができる株主とみなし、毎年3月31日（事業年度の終了）から3ヶ月以内にこれを招集し、臨時株主総会は必要に応じてこれを招集します。

・取締役会

取締役会は、業務執行の決定を行い、取締役の職務の執行の監督をします。また、取締役会の決議によって重要な業務執行（会社法第399条の13第5項各号に掲げる事項を除く。）の決定の全部又は一部を取締役に委任することができます。

当社の取締役会は10名以内の取締役（監査等委員である取締役を除く。）及び5名以内の監査等委員である取締役で構成され、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。取締役会はその決議をもって、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から、代表取締役若干名を選定します。

・監査等委員会

当社の監査等委員会は、5名以内の監査等委員である取締役で構成され、監査等委員である取締役の任期は選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。監査等委員会は、その決議をもって、監査等委員の中から、常勤の監査等委員を選定します。

(3) 運用の意思決定プロセス（2023年8月末現在）

1. 投資委員会にて、国内外の経済見通し、市況見通しおよび資産配分の基本方針を決定します。
2. 各運用部門は、投資委員会の決定に基づき、個別資産および資産配分戦略に係る具体的な運用方針を策定します。
3. 各運用部門のファンドマネージャーは、上記方針を受け、個別ファンドのガイドラインおよびそれぞれの運用方針に沿って、ポートフォリオを構築・管理します。
4. トレーディング部門は、社会的信用力、情報提供力、執行対応力において最適と判断し得る発注業者、発注方針などを決定します。その上で、トレーダーは、最良執行のプロセスに則り売買を執行します。
5. 運用状況の評価・分析および運用リスク（流動性リスクを含む）の管理ならびに法令など遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立したリスク管理/コンプライアンス業務担当部門が担当し、これを運用部門にフィードバックすることにより、適切な運用体制を維持できるように努めています。

2【事業の内容及び営業の概況】

<更新後>

- ・「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- ・委託会社の運用する、2023年8月末現在の投資信託などは次の通りです。

種 類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	849	269,747
株式投資信託	794	230,883
単位型	314	9,797
追加型	480	221,085
公社債投資信託	55	38,864
単位型	42	1,029
追加型	13	37,835

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

<更新後>

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2023年3月末現在)	事業の内容
auカブコム証券株式会社	7,196百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社SBI証券	48,323百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
楽天証券株式会社	19,495百万円	
株式会社千葉銀行	145,069百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
PayPay銀行株式会社	72,216百万円	

独立監査人の中間監査報告書

2023年9月20日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 辻村 和之
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 榊原 康太
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているTracers グローバル3分法（おとなのバランス）の2023年2月10日から2023年8月9日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）の2023年8月9日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年2月10日から2023年8月9日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、日興アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づ

き、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

日興アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注)1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。