

【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12月28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 MSCIオール・カンントリー・インデックス（全世界株 式）
【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4月10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 海外先進国株式、新興国株式および日本株式を投資対象とする各マザーファンドに投資を行なうことで、実質的に全世界の株式に投資します。

- 以下の各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。

海外株式インデックス
MSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)
マザーファンドへの投資を通じて、
海外先進国の上場株式
に投資を行ないます。

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)
マザーファンドへの投資を通じて、
新興国の上場株式
に投資を行ないます。

日本株式インデックス
MSCIジャパン・マザーファンド
への投資を通じて、
国内の上場株式
に投資を行ないます。

※各マザーファンドは、株価指数先物取引などを活用することがあります。

- 外貨建資産への投資にあたっては、原則として、為替ヘッジは行ないません。

2 「MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス(税引後配当込み、円換算ベース*)」の動きに連動する投資成果をめざします。

*公表指数をもとに日興アセットマネジメントが円換算します。

- 「MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス」は、先進国(含む日本)・新興国市場における大型および中型の上場株式で構成されており、全世界の株式市場の動きをとらえた株価指数です。
※連動をめざす対象指数(ベンチマーク)については、当ファンドの商品性および運用上の効率性などを勘案して、委託会社の判断により変更する場合があります。

3 購入時手数料はかかりません。

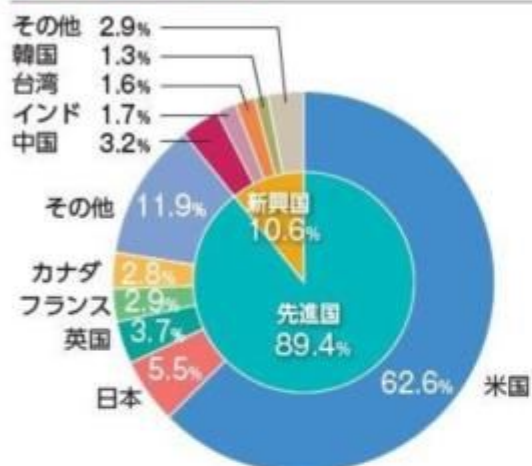
※市況動向および資金動向などにより、上記のような運用が行なえない場合があります。



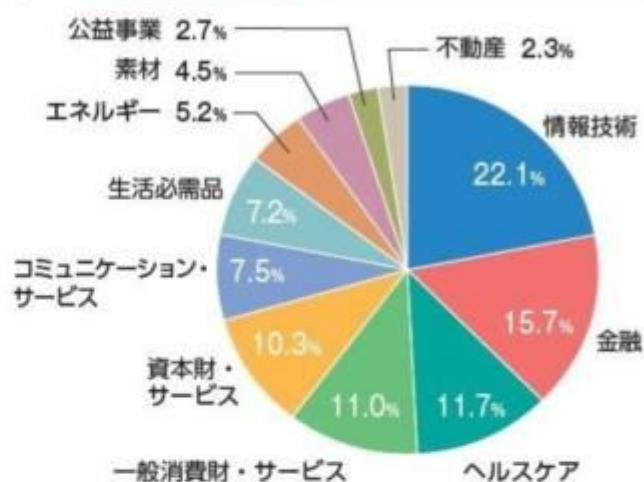
MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックスについて

- 「MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス」とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、先進国（含む日本）23カ国および新興国24カ国の株式市場に上場する大型および中型株で構成されています。
- 構成銘柄数は約2,900銘柄で、世界の投資可能な株式市場の時価総額の約85%をカバーしています。

国・地域別構成比率



業種別構成比率



※業種別構成比率は、世界産業分類基準(GICS)のセクター分類で表示しています。
※四捨五入しているため、合計が100%にならない場合があります。

(2023年10月末現在)

(ご参考)MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックスの推移

(1999年12月末～2023年10月末)



信頼できると判断したデータをもとに日興アセットマネジメントが作成

※当指数は、公表指数をもとに日興アセットマネジメントが円換算したものです。

※ベンチマーク「MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス(税引後配当込み、円換算ベース)」はあくまで参考情報であり、当ファンドの運用実績ではありません。

※上記は過去のものであり、将来の運用成果等を約束するものではありません。

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。
- 配分方針
- ・ 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。

「MSCIオール・カンントリー・ワールド・インデックス」の著作権などについて

本ファンドは、MSCI Inc. (「MSCI」)、その関連会社、情報提供者その他MSCI指数の編集、計算または作成に関与または関係した第三者(以下、総称して「MSCI関係者」という。)によって支持、保証、販売または販売促進されるものではない。MSCI指数は、MSCIの独占的財産とする。MSCIおよびMSCI指数の名称は、MSCIまたはその関連会社のサービスマークであり、日興アセットマネジメント株式会社による特定の目的のために使用が許諾されている。MSCI関係者は、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは組織に対して、ファンド全般もしくは本ファンド自体に対する投資適合性、または対応する株式市場の利回りを追跡するMSCI指数の能力につき、明示的か黙示的かを問わず何ら表明または保証するものではない。MSCIまたはその関連会社は、特定の商標、サービスマークおよび商号、ならびに、本ファンドまたは本ファンドの発行会社、所有者その他の者もしくは組織とは関係なくMSCIが決定、編集し計算したMSCI指数のライセンサーである。いずれのMSCI関係者も、MSCI指数の決定、編集または計算にあたり、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは組織の要望を考慮する義務を負わない。いずれのMSCI関係者も、本ファンドの発行時期、発行価格もしくは発行数量の決定、または、本ファンドを現金に換算する方程式もしくは本ファンドの換算対価の決定もしくは計算について責任を負うものではなく、また、関与していない。また、いずれのMSCI関係者も、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは組織に対して、本ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関するいかなる義務または責任も負わない。

MSCIは、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入または使用するための情報を入手するが、いずれのMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの独創性、正確性および/または完全性について保証するものではない。いずれのMSCI関係者も、明示的か黙示的かを問わず、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは組織が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行なわない。いずれのMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの、またはそれに関連する誤り、欠落または中断について責任を負わない。また、MSCI指数およびそれに含まれるデータの各々に関し、いずれのMSCI関係者も明示的または黙示的な保証を行なうものではなく、かつMSCI関係者は、それらに関する市場性または特定目的適合性に係る一切の保証を明示的に否認する。上記事項を制限することなく、直接的損害、間接的損害、特別損害、懲罰的損害、結果的損害その他あらゆる損害(逸失利益を含む。)につき、仮にその可能性について通知されていた場合であろうと、MSCI関係者は、かかる損害について責任を負わない。

本有価証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、またはその他のいかなる者もしくは組織も、MSCIの承認が必要か否かの確認を事前にMSCIに求めることなく、本有価証券を支持、保証、販売または販売促進するためにMSCIの商号、商標またはサービスマークを使用したり、それらに言及したりしてはならない。いかなる者または組織も、MSCIの書面による承認を事前に得ることなくMSCIとの関係を主張してはならない。



「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10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

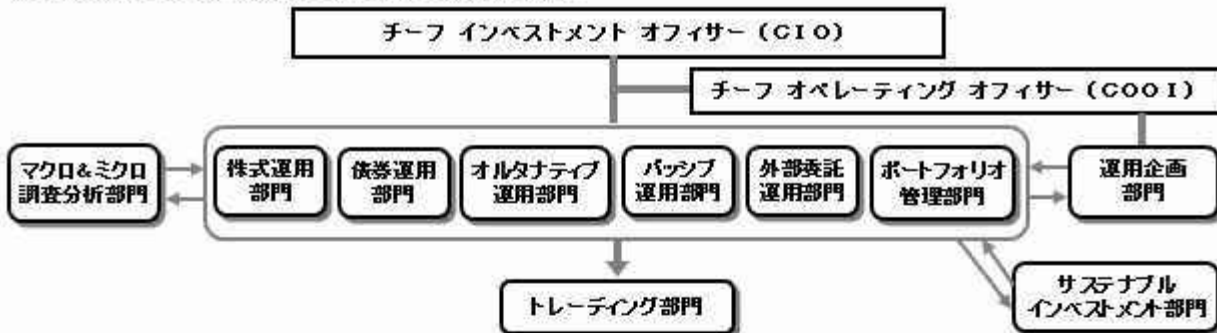
名 称	住 所	所有株数	所有比率
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	192,211,000株	97.562%

2 【投資方針】

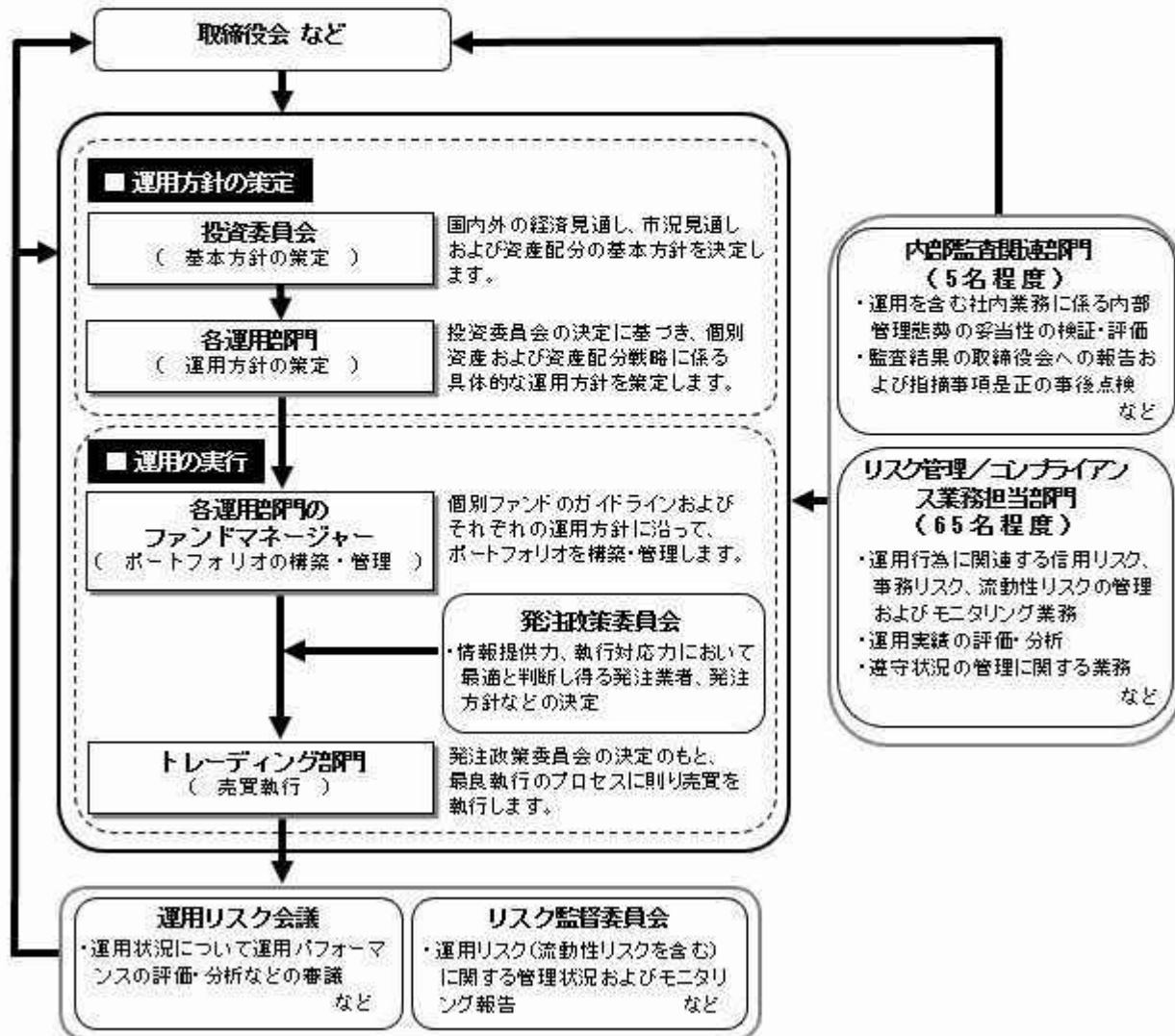
(3) 【運用体制】

<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。



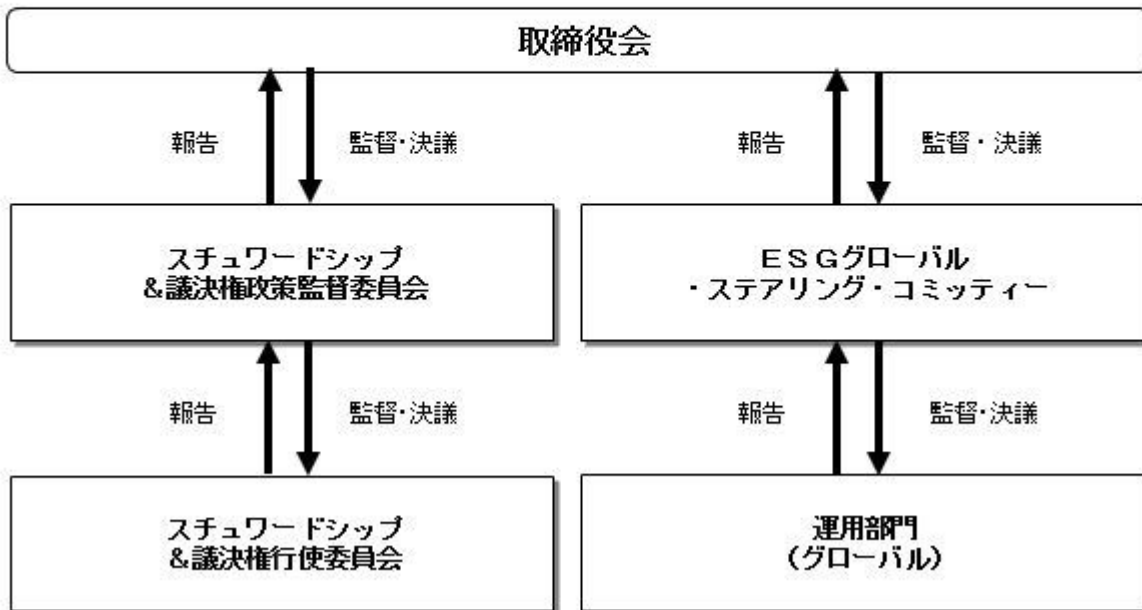
委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

「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）

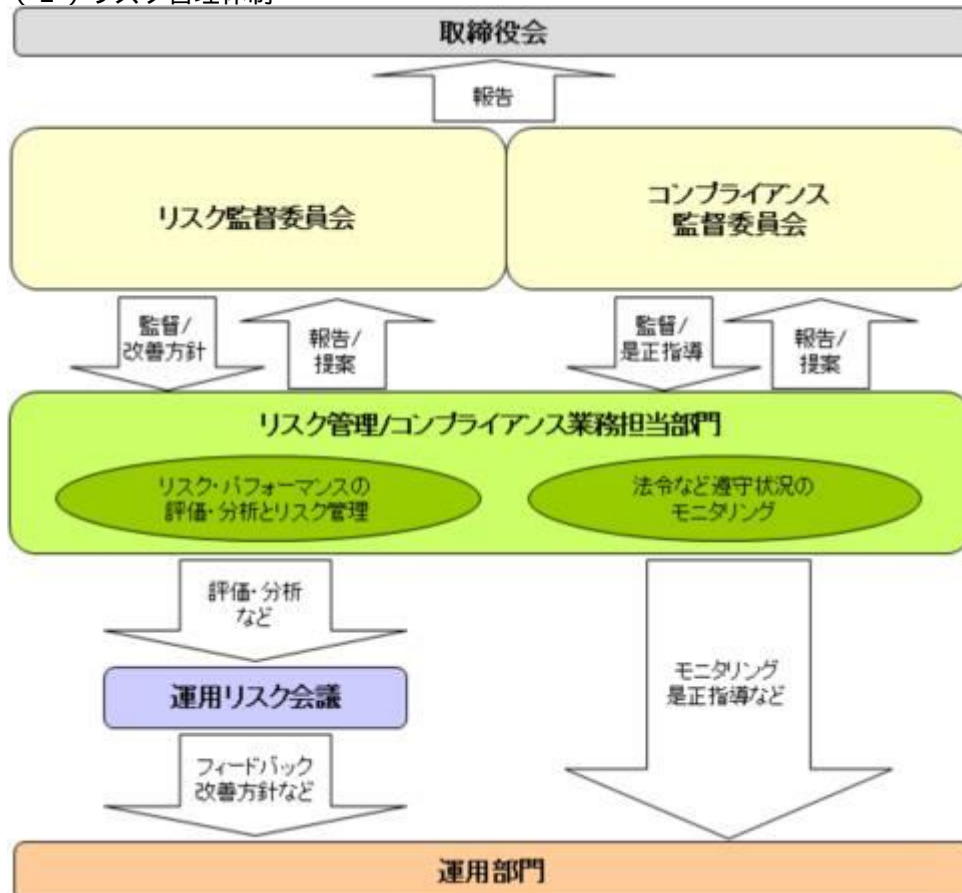


上記体制は2023年10月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

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10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	12.9%	7.2%	15.2%	6.3%	-0.6%	3.1%	3.9%
最大値	56.0%	42.1%	59.8%	62.7%	5.4%	7.9%	21.5%
最小値	-12.2%	-16.0%	-12.4%	-19.4%	-5.5%	-6.1%	-8.6%

※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11月から2023年10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、ベンチマークのデータを使用しています。

<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グローバルディバースファイド(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

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4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)を再投資したものと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。ただし、当ファンドの年間騰落率がないう場合は、ベンチマークのデータを使用しています。

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「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（特定非課税管理助定）」および「つみたて投資枠（特定累積投資助定）」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10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

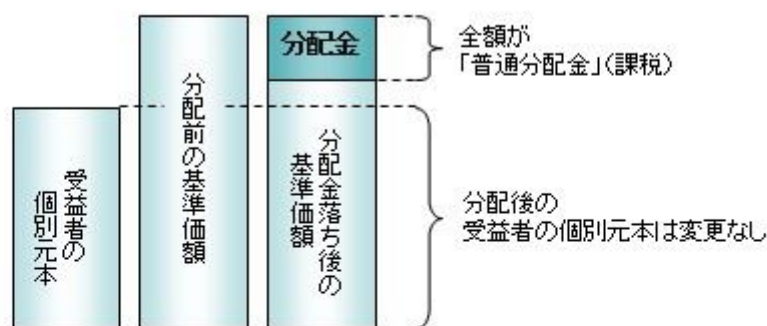
- 1) 各受益者の買付時の基準価額（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が個別元本になります。
- 2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

普通分配金と元本払戻金（特別分配金）

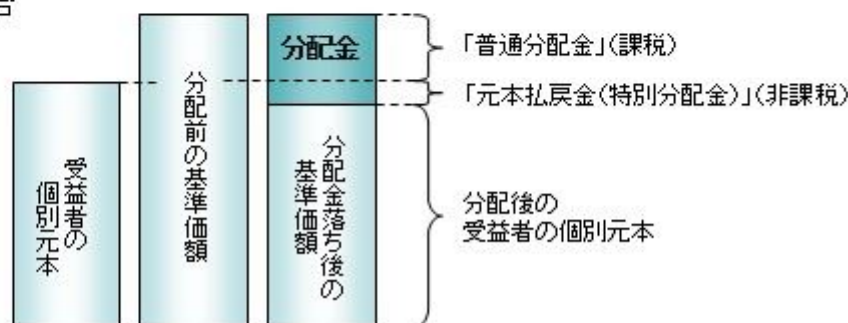
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
 - イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
 - ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、収益分配金から元本払戻金（特別分配金）を控除した金額が普通分配金となります。
 - 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12月28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 MSCIオール・カンントリー・インデックス（全世界株式）】

以下の運用状況は2023年10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	1,773,780,467	99.99
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		196,235	0.01
合計（純資産総額）		1,773,976,702	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	海外株式インデックスMSCI - KOKUSAI (ヘッジなし) マザーファンド	302,108,816	4.8947	1,478,738,155	4.9164	1,485,287,782	83.73
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	80,692,589	2.3782	191,910,645	2.3539	189,942,285	10.71
日本	親投資信託受益証券	日本株式インデックスMSCI ジャパン・マザーファンド	87,779,817	1.1071	97,182,473	1.1227	98,550,400	5.56

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	99.99
合計	99.99

【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 4月末日	60		1.0137	
5月末日	448		1.0607	
6月末日	977		1.1420	
7月末日	1,285		1.1611	
8月末日	1,573		1.1762	
9月末日	1,712		1.1502	
10月末日	1,773		1.1128	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金 (円)
当中間期	2023年 4月26日 ~ 2023年10月25日	

【収益率の推移】

期	期間	収益率 (%)
当中間期	2023年 4月26日 ~ 2023年10月25日	13.23

(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 4月26日～2023年10月25日	2,009,539,015	429,185,849

(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)

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10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	208,164,796,957	69.60
	カナダ	10,026,850,935	3.35
	ドイツ	7,046,274,955	2.36
	イタリア	1,613,014,103	0.54
	フランス	9,317,856,665	3.12
	オランダ	5,357,875,997	1.79
	スペイン	2,154,827,848	0.72
	ベルギー	606,118,725	0.20
	オーストリア	157,237,446	0.05
	ルクセンブルク	145,904,573	0.05
	フィンランド	929,031,981	0.31
	アイルランド	5,520,873,480	1.85
	ポルトガル	156,264,629	0.05
	イギリス	12,189,599,465	4.08
	スイス	9,429,017,168	3.15
	スウェーデン	2,388,414,262	0.80
	ノルウェー	607,175,769	0.20
	デンマーク	2,892,285,140	0.97
	ケイマン	433,493,865	0.14
	オーストラリア	5,634,657,631	1.88
	バミューダ	343,190,043	0.11
	ニュージーランド	224,162,578	0.07
	香港	1,625,364,825	0.54
	シンガポール	973,655,588	0.33
	イスラエル	555,352,181	0.19
	ジャージー	832,322,703	0.28
アラブ首長国連邦	0	0.00	
マン島	41,285,999	0.01	
小計		289,366,905,511	96.75
投資証券	アメリカ	4,946,901,031	1.65
	カナダ	12,378,791	0.00

	フランス	105,425,476	0.04
	ベルギー	28,011,931	0.01
	イギリス	83,962,460	0.03
	オーストラリア	332,866,573	0.11
	香港	72,492,026	0.02
	シンガポール	119,811,138	0.04
	小計	5,701,849,426	1.91
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		4,006,172,524	1.34
合計（純資産総額）		299,074,927,461	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	3,598,416,024	1.20
	買建	ドイツ	695,533,708	0.23

(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		3,685,018,510	1.23
	売建		16,957,256	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。

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	629,794	25,581.16	16,110,861,711	25,460.05	16,034,591,705	5.36
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	282,814	50,933.57	14,404,727,147	50,431.21	14,262,654,516	4.77
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	369,750	18,149.01	6,710,599,738	19,841.47	7,336,384,309	2.45
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	98,880	62,463.78	6,176,418,854	61,539.81	6,085,056,522	2.03
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	238,020	18,779.95	4,470,003,961	18,608.01	4,429,079,635	1.48
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	88,560	44,782.73	3,965,958,595	45,250.69	4,007,401,691	1.34
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	211,550	18,938.43	4,006,425,226	18,800.88	3,977,326,693	1.33
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	114,285	31,758.91	3,629,567,509	29,507.29	3,372,241,049	1.13
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	37,185	79,271.69	2,947,718,056	79,238.80	2,946,494,960	0.99
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	32,269	87,681.63	2,829,398,666	84,579.30	2,729,289,499	0.91
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	51,825	50,369.91	2,610,421,053	50,446.16	2,614,372,714	0.87

アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	161,521	16,235.29	2,622,340,422	15,830.11	2,556,896,619	0.85
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	116,880	20,991.20	2,453,451,924	20,545.66	2,401,377,232	0.80
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	64,762	35,411.44	2,293,315,904	34,847.79	2,256,812,628	0.75
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	96,501	22,661.23	2,186,831,424	21,982.45	2,121,328,919	0.71
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	94,409	22,516.20	2,125,732,492	22,315.86	2,106,818,272	0.70
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	16,530	127,028.18	2,099,775,837	125,775.28	2,079,065,502	0.70
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	131,150	14,720.42	1,930,583,607	14,407.90	1,889,596,347	0.63
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	33,865	57,757.20	1,955,947,852	55,680.51	1,885,620,613	0.63
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	107,170	16,336.63	1,750,797,012	16,195.72	1,735,696,277	0.58
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	42,001.84	1,684,483,966	42,084.07	1,687,781,820	0.56
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	72,391	23,304.12	1,687,008,819	21,841.91	1,581,158,134	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	101,193	15,493.72	1,567,856,139	15,351.68	1,553,483,242	0.52
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	70,306	21,717.82	1,526,893,236	21,213.97	1,491,469,649	0.50
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	17,664	82,229.00	1,452,493,143	82,960.10	1,465,407,362	0.49
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	59,162	24,334.24	1,439,662,756	24,373.12	1,441,962,537	0.48
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	18,194	77,915.64	1,417,597,179	78,782.79	1,433,374,252	0.48
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	16,172	88,960.66	1,438,671,826	87,580.31	1,416,348,935	0.47
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	164,852	8,390.50	1,383,190,904	8,394.98	1,383,930,315	0.46
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	55,211	24,272.94	1,340,133,760	24,262.48	1,339,555,938	0.45

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	5.38
		素材	4.02
		資本財	6.51
		商業・専門サービス	1.56
		運輸	1.74
		自動車・自動車部品	1.89
		耐久消費財・アパレル	1.53
		消費者サービス	2.06

	メディア・娯楽	5.96
	一般消費財・サービス流通・小売り	4.53
	生活必需品流通・小売り	1.76
	食品・飲料・タバコ	3.77
	家庭用品・パーソナル用品	1.76
	ヘルスケア機器・サービス	4.47
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.26
	銀行	5.16
	金融サービス	6.39
	保険	3.24
	ソフトウェア・サービス	9.85
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.81
	電気通信サービス	1.22
	公益事業	2.75
	半導体・半導体製造装置	5.81
	不動産管理・開発	0.32
投資証券		1.91
合計		98.66

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 EMINI2312	買建	115	米ドル	24,119,687.5	3,606,134,478	24,068,062.5	3,598,416,024	1.20
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 2312	買建	115	ユーロ	4,436,370	703,874,464	4,383,800	695,533,708	0.23

(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	20,800,000.00	3,097,163,510	3,085,553,790	1.03
	ユーロ	買建	3,800,000.00	599,234,121	599,464,720	0.20
	加ドル	売建	157,000.00	16,957,570	16,957,256	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MSCIエマージング(ヘッジなし)マザーファンド

以下の運用状況は2023年10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	345,475,747	0.34
	メキシコ	2,306,293,822	2.29

	ブラジル	5,233,617,874	5.20
	チリ	462,481,492	0.46
	コロンビア	96,360,856	0.10
	ペルー	253,251,543	0.25
	オランダ	50,587,606	0.05
	ルクセンブルク	92,768,358	0.09
	ギリシャ	453,547,722	0.45
	イギリス	123,188,748	0.12
	トルコ	675,592,594	0.67
	チェコ	165,131,972	0.16
	キプロス	296	0.00
	ハンガリー	246,699,132	0.25
	ポーランド	817,839,418	0.81
	ロシア	5,059,177	0.01
	ケイマン	11,952,954,039	11.88
	バミューダ	226,798,687	0.23
	香港	1,767,254,001	1.76
	シンガポール	20,430,676	0.02
	マレーシア	1,400,841,800	1.39
	タイ	1,845,813,840	1.83
	フィリピン	603,479,203	0.60
	インドネシア	1,835,742,981	1.82
	韓国	11,614,486,651	11.54
	台湾	14,450,802,638	14.36
	中国	15,452,652,515	15.35
	インド	15,548,680,056	15.45
	カタール	872,986,105	0.87
	エジプト	42,087,065	0.04
	南アフリカ	2,777,788,321	2.76
	アラブ首長国連邦	1,266,228,795	1.26
	クウェート	784,126,635	0.78
	サウジアラビア	3,995,421,054	3.97
	小計	97,786,471,419	97.17
社債券	インド	0	0.00
投資証券	メキシコ	68,742,328	0.07
	南アフリカ	28,669,335	0.03
	小計	97,411,663	0.10
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		2,754,432,523	2.74
合計（純資産総額）		100,638,315,605	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	2,877,505,342	2.86

(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		164,408,200	0.16
--------	----	--	-------------	------

(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	2,299.09	5,881,905,099	2,453.31	6,276,458,372	6.24
中国	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	693,250	6,491.49	4,500,230,432	5,648.04	3,915,509,276	3.89
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	7,192.87	3,570,975,214	7,470.30	3,708,705,138	3.69
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	1,619.98	2,770,170,367	1,564.97	2,676,102,120	2.66
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	316,462	4,164.59	1,317,936,841	4,185.62	1,324,591,259	1.32
ケイマン	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サービス	526,485	2,584.72	1,360,819,975	2,179.68	1,147,568,825	1.14
ケイマン	株式	PDD HOLDINGS INC-ADR	一般消費財・サービス流通・小売り	61,470	10,630.70	653,469,555	15,587.91	958,188,988	0.95
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	535,787	1,713.57	918,109,226	1,674.06	896,944,407	0.89
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	345,188	2,290.20	790,552,769	2,492.46	860,367,455	0.85
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	9,961,920	102.46	1,020,794,294	85.65	853,314,159	0.85
インド	株式	HDFC BANK LIMITED	銀行	287,193	2,992.51	859,429,477	2,688.03	771,983,687	0.77
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	56,810	9,785.50	555,914,664	13,220.10	751,033,881	0.75
ブラジル	株式	VALE SA	素材	348,106	2,043.65	711,409,630	2,017.61	702,344,462	0.70
ケイマン	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	202,075	2,642.57	533,998,384	3,250.40	656,824,580	0.65
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	158,932	3,089.54	491,027,401	3,952.05	628,108,085	0.62
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	94,436	5,897.88	556,973,136	6,115.17	577,492,714	0.57
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	472.47	611,957,373	435.78	564,436,228	0.56
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	689,000	1,090.60	751,428,357	772.44	532,216,672	0.53
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	203,782	2,976.40	606,538,439	2,598.14	529,454,369	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	6,058.47	518,424,022	5,971.80	511,006,926	0.51
中国	株式	BYD CO LTD-H	自動車・自動車部品	107,000	4,660.06	498,627,246	4,707.34	503,685,808	0.50
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	464,960	759.34	353,064,377	1,038.10	482,677,254	0.48

ケイマン	株式	BAIDU INC-CLASS A	メディア・娯楽	234,860	2,334.24	548,219,710	2,047.75	480,935,035	0.48
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	銀行	5,753,500	82.75	476,108,175	83.19	478,633,665	0.48
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA - H	銀行	6,677,575	82.31	549,638,078	71.50	477,505,375	0.47
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	2,671.28	652,523,416	1,936.85	473,121,626	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	25,912.32	526,797,558	23,213.56	471,931,844	0.47
ケイマン	株式	XIAOMI CORP-CLASS B	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,592,800	212.61	338,652,216	273.79	436,106,091	0.43
中国	株式	BANK OF CHINA LTD - H	銀行	8,233,000	62.35	513,346,954	52.19	429,742,841	0.43
インド	株式	AXIS BANK LTD	銀行	236,090	1,659.94	391,896,600	1,790.45	422,707,813	0.42

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	5.14
		素材	7.49
		資本財	4.32
		商業・専門サービス	0.06
		運輸	1.89
		自動車・自動車部品	3.72
		耐久消費財・アパレル	1.32
		消費者サービス	2.71
		メディア・娯楽	6.41
		一般消費財・サービス流通・小売り	5.62
		生活必需品流通・小売り	1.47
		食品・飲料・タバコ	3.73
		家庭用品・パーソナル用品	0.80
		ヘルスケア機器・サービス	1.04
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.82
		銀行	16.14
		金融サービス	2.81
		保険	2.71
		ソフトウェア・サービス	2.47
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.63
電気通信サービス	2.70		
公益事業	2.53		
半導体・半導体製造装置	9.12		
不動産管理・開発	1.51		
社債券			
投資証券			0.10
合計			97.26

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	MINMSCIE2312	買建	416	米ドル	20,252,620	3,027,969,216	19,246,240	2,877,505,342	2.86

(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	1,100,000.00	164,373,000	164,408,200	0.16

(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。

日本株式インデックスMSCIジャパン・マザーファンド

以下の運用状況は2023年10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	390,011,330	97.26
投資証券	日本	3,868,500	0.96
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		7,126,435	1.78
合計(純資産総額)		401,006,265	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	9,016,000	2.25

(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	8,500	2,063.16	17,536,900	2,590.00	22,015,000	5.49
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,000	12,516.50	12,516,500	12,425.00	12,425,000	3.10
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	9,200	967.79	8,903,690	1,257.00	11,564,400	2.88
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	400	17,785.00	7,114,000	19,755.00	7,902,000	1.97
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,000	5,975.30	5,975,300	7,220.00	7,220,000	1.80
日本	株式	S M C	機械	100	70,160.00	7,016,000	68,680.00	6,868,000	1.71
日本	株式	信越化学工業	化学	1,500	4,263.13	6,394,700	4,468.00	6,702,000	1.67
日本	株式	日立製作所	電気機器	700	8,255.14	5,778,600	9,477.00	6,633,900	1.65
日本	株式	三菱商事	卸売業	900	5,684.11	5,115,700	6,955.00	6,259,500	1.56
日本	株式	キーエンス	電気機器	100	62,850.00	6,285,000	58,150.00	5,815,000	1.45
日本	株式	第一三共	医薬品	1,500	4,572.53	6,858,800	3,858.00	5,787,000	1.44
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	3,700	1,307.40	4,837,400	1,506.50	5,574,050	1.39
日本	株式	三井物産	卸売業	1,000	4,607.20	4,607,200	5,417.00	5,417,000	1.35

日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,200	4,238.83	5,086,600	4,487.00	5,384,400	1.34
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,300	4,524.15	5,881,400	4,063.00	5,281,900	1.32
日本	株式	任天堂	その他製品	800	5,879.12	4,703,300	6,221.00	4,976,800	1.24
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	800	5,602.45	4,481,965	6,124.00	4,899,200	1.22
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,900	2,144.36	4,074,300	2,545.50	4,836,450	1.21
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	900	4,849.88	4,364,900	5,373.00	4,835,700	1.21
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,100	4,189.45	4,608,400	4,333.00	4,766,300	1.19
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,400	2,905.42	4,067,600	3,343.00	4,680,200	1.17
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	900	4,938.77	4,444,900	4,857.00	4,371,300	1.09
日本	株式	ダイキン工業	機械	200	26,612.50	5,322,500	21,630.00	4,326,000	1.08
日本	株式	HOYA	精密機器	300	14,873.33	4,462,000	14,335.00	4,300,500	1.07
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	24,000	165.83	3,980,100	176.80	4,243,200	1.06
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,300	1,558.84	3,585,350	1,705.00	3,921,500	0.98
日本	株式	村田製作所	電気機器	1,400	2,660.28	3,724,400	2,477.50	3,468,500	0.86
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	100	31,970.00	3,197,000	33,020.00	3,302,000	0.82
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	600	6,026.66	3,616,000	5,493.00	3,295,800	0.82
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	900	3,005.44	2,704,900	3,521.00	3,168,900	0.79

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	鉱業	0.44
		建設業	1.46
		食料品	3.21
		繊維製品	0.20
		パルプ・紙	0.11
		化学	5.40
		医薬品	5.42
		石油・石炭製品	0.49
		ゴム製品	0.71
		ガラス・土石製品	0.44
		鉄鋼	0.77
		非鉄金属	0.45
		金属製品	0.23
		機械	5.67
		電気機器	17.74
		輸送用機器	10.13
		精密機器	2.38
		その他製品	2.09
		電気・ガス業	1.17
		陸運業	2.72
海運業	0.79		
空運業	0.14		

	情報・通信業	7.22
	卸売業	5.96
	小売業	3.40
	銀行業	7.45
	証券、商品先物取引業	0.75
	保険業	2.95
	その他金融業	1.05
	不動産業	1.96
	サービス業	4.38
投資証券		0.96
合計		98.22

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	東証ミニTOPIX先物 2023年12月	買建	4	日本円	8,994,630	9,016,000	2.25

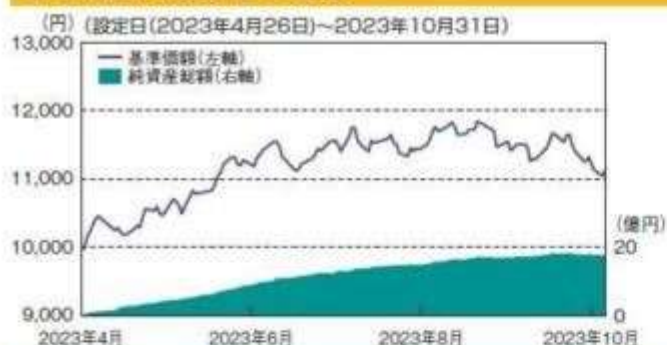
(注)先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

参考情報

運用実績

2023年10月31日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額…………… 11,128円
純資産総額…………… 17.73億円

※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>

資産	組入比率
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし) マザーファンド	83.7%
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	10.7%
日本株式インデックスMSCIジャパン マザーファンド	5.6%
現金その他	0.0%

※各マザーファンドの組入比率は当ファンドの対純資産総額比率です。

<組入上位5か国>

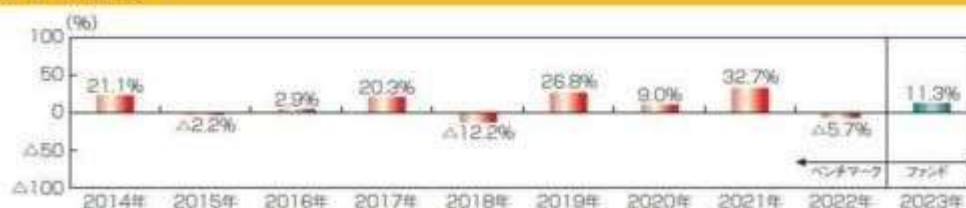
順位	国・地域	比率
1	アメリカ	59.8%
2	日本	5.5%
3	イギリス	3.9%
4	スイス	2.8%
5	フランス	2.8%

※「組入上位5か国」、「組入上位10銘柄」は各マザーファンドの月末構成比率を考慮して合成した内容です。
※比率は対純資産総額比率です。

<組入上位10銘柄>(銘柄数:2,722銘柄)

順位	銘柄	国・地域	業種	比率
1	Apple Inc.	アメリカ	情報技術	4.5%
2	Microsoft Corporation	アメリカ	情報技術	4.0%
3	Amazon.com, Inc.	アメリカ	一般消費財・サービス	2.0%
4	NVIDIA Corporation	アメリカ	情報技術	1.7%
5	Alphabet Inc. Class A	アメリカ	コミュニケーション・サービス	1.2%
6	Meta Platforms Inc. Class A	アメリカ	コミュニケーション・サービス	1.1%
7	Alphabet Inc. Class C	アメリカ	コミュニケーション・サービス	1.1%
8	Tesla, Inc.	アメリカ	一般消費財・サービス	1.0%
9	UnitedHealth Group Incorporated	アメリカ	ヘルスケア	0.8%
10	Eli Lilly and Company	アメリカ	ヘルスケア	0.7%

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。

※2022年以前は、ベンチマーク(MSCIオールカントリー・ワールドインデックス(税引後配当込み、円換算ベース))の収益率を表示しております。

※ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

※2023年は、設定時から2023年10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4月26日から2023年10月25日まで）の中間財務諸表について、PwC Japan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 MSCIオール・カンントリー・インデックス（全世界株式）】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

当中間計算期間末 2023年10月25日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	10,306,579
親投資信託受益証券	1,789,286,774
流動資産合計	1,799,593,353
資産合計	1,799,593,353
負債の部	
流動負債	
未払解約金	9,491,576
未払受託者報酬	106,758
未払委託者報酬	213,644
未払利息	2
その他未払費用	297,439
流動負債合計	10,109,419
負債合計	10,109,419
純資産の部	
元本等	
元本	1,580,353,166
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	209,130,768
元本等合計	1,789,483,934
純資産合計	1,789,483,934
負債純資産合計	1,799,593,353

(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4月26日 至 2023年10月25日	
営業収益	
有価証券売買等損益	41,293,474
営業収益合計	41,293,474
営業費用	
支払利息	2,345
受託者報酬	106,758
委託者報酬	213,644
その他費用	297,439
営業費用合計	620,186
営業利益又は営業損失（ ）	40,673,288

当中間計算期間
自 2023年 4月26日
至 2023年10月25日

経常利益又は経常損失（ ）	40,673,288
中間純利益又は中間純損失（ ）	40,673,288
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（ ）	21,588,668
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	230,790,894
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	230,790,894
剰余金減少額又は欠損金増加額	40,744,746
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	40,744,746
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（ ）	209,130,768

（ 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10月25日現在
1.	期首元本額	10,000,000円
	期中追加設定元本額	1,999,539,015円
	期中一部解約元本額	429,185,849円
2.	受益権の総数	1,580,353,166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 4月26日 至 2023年10月25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10月25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10月25日現在
1口当たり純資産額	1.1323円	
(1万口当たり純資産額)	(11,323円)	

当ファンドは、「海外株式インデックスMSCI-KOKUSA 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」「日本株式インデックスMSCIジャパン・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）

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10月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	527,290,071
コール・ローン	3,606,506,378
株式	295,333,294,690
投資証券	5,794,389,204
派生商品評価勘定	54,913,347
未収入金	109,354,480
未収配当金	222,136,769
差入委託証拠金	413,653,698
流動資産合計	306,061,538,637
資産合計	306,061,538,637
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	49,524,222
未払金	80,941,091
未払解約金	1,875,157,509
未払利息	951
流動負債合計	2,005,623,773
負債合計	2,005,623,773
純資産の部	
元本等	
元本	60,608,192,205
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	243,447,722,659
元本等合計	304,055,914,864
純資産合計	304,055,914,864
負債純資産合計	306,061,538,637

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10月25日現在
1.	期首	2023年 4月26日
	期首元本額	60,852,391,051円
	期首からの追加設定元本額	4,407,774,051円
	期首からの一部解約元本額	4,651,972,897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）	33,026,695,251円
	DCインデックスバランス（株式20）	113,435,960円
	DCインデックスバランス（株式40）	313,637,050円
	DCインデックスバランス（株式60）	674,167,405円
	DCインデックスバランス（株式80）	811,294,314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	1,256,288,290円
	日興五大陸株式ファンド	3,477,499,117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）	13,258,596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）	5,871,665,011円
	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	8,685,455,095円
	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	7,360,005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）	230,944,351円
	Tracers MSCIオール・カンントリー・インデックス（全世界株式）	299,427,253円
	Niつみインデックスラップ世界10指数（均等型）	263,039円
	Niつみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	148,330円
	国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	1,338,394,962円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	15,811,296円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	46,006,775円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	73,292,521円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	73,782,515円
	インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,204,220,619円
	計	60,608,192,205円
2.	受益権の総数	60,608,192,205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10月25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10月25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	3,100,729,899	-	3,052,534,230	48,195,669
	合計	3,100,729,899	-	3,052,534,230	48,195,669

（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10月25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	2,398,406,226	-	2,452,320,660	53,914,434
	米ドル	2,007,327,400	-	2,057,391,070	50,063,670
	ユーロ	391,078,826	-	394,929,590	3,850,764
	売建	265,777,500	-	266,107,140	329,640
	米ドル	179,652,000	-	179,959,680	307,680
	豪ドル	86,125,500	-	86,147,460	21,960
合計		2,664,183,726	-	2,718,427,800	53,584,794

(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10月25日現在	
1口当たり純資産額	5.0167円
(1万口当たり純資産額)	(50,167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

貸借対照表

(単位：円)

2023年10月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	533,875,154
コール・ローン	142,760,551
株式	97,987,244,310
投資証券	99,906,321

2023年10月25日現在

派生商品評価勘定	330,953
未収配当金	103,783,385
未収利息	13,809
差入委託証拠金	3,629,007,999
流動資産合計	102,496,922,482
資産合計	102,496,922,482
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	129,153,338
未払解約金	1,632,204,601
未払利息	37
流動負債合計	1,761,357,976
負債合計	1,761,357,976
純資産の部	
元本等	
元本	42,698,850,586
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	58,036,713,920
元本等合計	100,735,564,506
純資産合計	100,735,564,506
負債純資産合計	102,496,922,482

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	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。 (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。 (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。 (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。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	(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。 (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。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	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。

(貸借対照表に関する注記)

		2023年10月25日現在
1.	期首	2023年 4月26日
	期首元本額	44,056,328,362円
	期首からの追加設定元本額	4,921,465,490円
	期首からの一部解約元本額	6,278,943,266円
	元本の内訳	
	日興五大陸株式ファンド	1,833,762,041円
	インデックスファンド海外新興国（エマージング）株式	19,120,012,622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）	3,183,338,400円
	グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	18,416,941,877円
	Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	1,970,433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）	61,826,878円
	Tracers MSCIオール・カンントリー・インデックス（全世界株式）	80,136,465円
	Niつみインデックスラップ世界10指数（均等型）	548,268円
	Niつみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	313,602円
	計	42,698,850,586円

2. 受益権の総数	42,698,850,586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10月25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10月25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	2,781,582,549	-	2,655,286,469	126,296,080
	合計	2,781,582,549	-	2,655,286,469	126,296,080

（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10月25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	1,551,169,350	-	1,553,695,655	2,526,305
	米ドル	1,504,585,500	-	1,507,162,320	2,576,820
	メキシコペソ	11,977,000	-	11,903,920	73,080
	香港ドル	14,351,250	-	14,375,475	24,225
	南アフリカランド	11,030,600	-	11,026,960	3,640
	香港・オフショア 人民元	9,225,000	-	9,226,980	1,980
	合計	1,551,169,350	-	1,553,695,655	2,526,305

（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10月25日現在	
1口当たり純資産額	2,3592円
(1万口当たり純資産額)	(23,592円)

日本株式インデックスMSCIジャパン・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2023年10月25日現在	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	10,403,078
株式	380,589,400
投資証券	3,880,800
派生商品評価勘定	18,560
未収入金	31,310
未収配当金	3,497,867
前払金	47,750
流動資産合計	398,468,765
資産合計	398,468,765
負債の部	
流動負債	
未払金	42,820
未払利息	2
流動負債合計	42,822
負債合計	42,822
純資産の部	
元本等	
元本	353,331,395
剰余金	
剰余金又は欠損金()	45,094,548
元本等合計	398,425,943
純資産合計	398,425,943
負債純資産合計	398,468,765

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	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。 (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。 (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。 (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。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	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。

(貸借対照表に関する注記)

		2023年10月25日現在
1.	期首	2023年 4月26日
	期首元本額	199,600,000円
	期首からの追加設定元本額	158,930,177円
	期首からの一部解約元本額	5,198,782円
	元本の内訳	
	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）	67,090,782円
	Tracers MSCIオール・カンントリー・インデックス（全世界株式）	86,991,953円
	インデックスファンドMSCIジャパン（適格機関投資家向け）	199,248,660円
	計	353,331,395円
2.	受益権の総数	353,331,395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	17,049,900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10月25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10月25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	4,488,000	-	4,507,000	19,000
	合計	4,488,000	-	4,507,000	19,000

(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10月25日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1276円 (11,276円)
---------------------------	----------------------

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2023年10月31日現在です。

【Tracers MSCIオール・カンントリー・インデックス(全世界株式)】

【純資産額計算書】

資産総額	1,778,841,857円
負債総額	4,865,155円
純資産総額(-)	1,773,976,702円
発行済口数	1,594,196,130口
1口当たり純資産額(/)	1.1128円

(参考)

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	299,188,246,816円
負債総額	113,319,355円
純資産総額(-)	299,074,927,461円
発行済口数	60,832,381,122口
1口当たり純資産額(/)	4.9164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	100,797,436,223円
負債総額	159,120,618円
純資産総額(-)	100,638,315,605円
発行済口数	42,753,736,284口
1口当たり純資産額(/)	2.3539円

日本株式インデックスMSCIジャパン・マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	401,006,485円
負債総額	220円
純資産総額(-)	401,006,265円
発行済口数	357,174,717口
1口当たり純資産額(/)	1.1227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10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10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10月末現在）

- 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。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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10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	845	259,771
株式投資信託	791	222,110
単位型	308	9,478
追加型	483	212,631
公社債投資信託	54	37,661
単位型	41	972
追加型	13	36,689

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	

独立監査人の中間監査報告書

2023年12月6日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

PwC Japan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 MSCIオール・カンントリー・インデックス（全世界株式）の2023年4月26日から2023年10月25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 MSCIオール・カンントリー・インデックス（全世界株式）の2023年10月25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4月26日から2023年10月25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に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. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。