

運用報告書 (全体版)

第35期<決算日2022年11月7日>

インデックスポートフォリオ

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／株式／インデックス型	
信託期間	原則、無期限です。	
運用方針	インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド 受益証券に投資し、日経平均株価 (225種) の動きにできるだけ連動する投資成果をめざします。	
主要投資対象	インデックスポートフォリオ	インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド 受益証券。
	インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場株式のうち、日経平均株価 (225種・東証) に採用された銘柄を投資対象とします。
運用方法	インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド 受益証券に投資し、日経平均株価 (225種) の動きにできるだけ連動する投資成果をめざします。 なお、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場におけるわが国の金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引 (有価証券先物取引等) を行うことができます。 また、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価額変動リスクを回避するため、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引 (スワップ取引) を行うことができます。	
組入制限	インデックスポートフォリオのインデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド 組入上限比率	制限を設けません。
	インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンドの株式組入上限比率	制限を設けません。
配分方針	原則として、利息等収益を中心に配分を行います。	

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「インデックスポートフォリオ」は、2022年11月7日に第35期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された

販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

<http://www.am-one.co.jp/>

インデックスポートフォリオ

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税込み 騰落率		日経平均株価(225) (ベンチマーク)		株式組入 比率	株式先物 比率	純資産 総額
		円	%	円	%			
31期(2018年11月7日)	8,752	円	△3.4	円	△3.7	95.8	3.8	百万円 805
32期(2019年11月7日)	9,288	円	6.2	円	5.6	94.0	5.6	782
33期(2020年11月9日)	9,914	円	6.8	円	6.5	95.5	4.0	793
34期(2021年11月8日)	11,799	円	19.1	円	18.8	93.8	5.9	837
35期(2022年11月7日)	11,187	円	△5.1	円	△6.7	92.9	7.0	760

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注4) 「日経平均株価」は、株式会社日本経済新聞社によって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」自体および「日経平均株価」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。当ファンドは、投資信託委託会社等の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用および当ファンドの取引に関して、一切責任を負いません（以下同じ）。

(注5) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		日経平均株価(225) (ベンチマーク)		株式組入 比率	株式先物 比率
	円	%	円	%		
(期首) 2021年11月8日	11,799	—	29,507.05	—	93.8	5.9
11月末	11,116	△5.8	27,821.76	△5.7	94.3	5.5
12月末	11,521	△2.4	28,791.71	△2.4	94.6	5.3
2022年1月末	10,803	△8.4	27,001.98	△8.5	94.8	5.1
2月末	10,615	△10.0	26,526.82	△10.1	95.0	4.9
3月末	11,222	△4.9	27,821.43	△5.7	95.1	4.7
4月末	10,827	△8.2	26,847.90	△9.0	95.8	4.0
5月末	11,001	△6.8	27,279.80	△7.5	96.1	3.8
6月末	10,654	△9.7	26,393.04	△10.6	96.5	3.4
7月末	11,218	△4.9	27,801.64	△5.8	96.9	2.9
8月末	11,336	△3.9	28,091.53	△4.8	97.7	2.1
9月末	10,551	△10.6	25,937.21	△12.1	92.9	6.8
10月末	11,215	△4.9	27,587.46	△6.5	92.9	7.0
(期末) 2022年11月7日	11,192	△5.1	27,527.64	△6.7	92.9	7.0

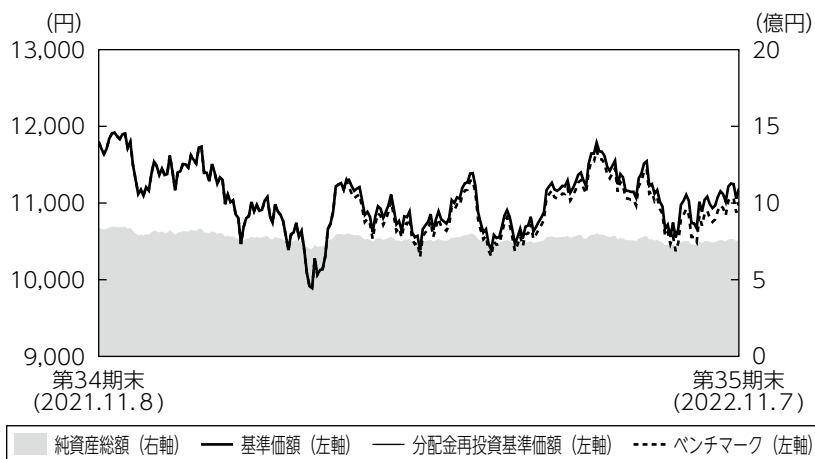
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2021年11月9日から2022年11月7日まで）

基準価額等の推移



第35期首： 11,799円

第35期末： 11,187円

(既払分配金5円)

騰落率： △5.1%

(分配金再投資ベース)

(注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

(注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

(注3) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首の基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内株式への投資を行った結果、市況が下落したことなどから、基準価額は下落しました。

投資環境

国内株式市場は、期初から2022年3月中旬にかけ、新型コロナウイルス新規感染者数の拡大、世界的な金融引き締めへの警戒感やロシアのウクライナ侵攻などを受けて下落基調で推移しました。その後、円安ドル高の進行により上昇に転じる場面もありましたが、高インフレを背景とした世界的な金融引き締めの動きが重しとなり、一進一退の展開となりました。期末にかけては、F R B（米連邦準備理事会）の利上げペースが減速に向かうとの思惑から戻りを試す展開となりました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

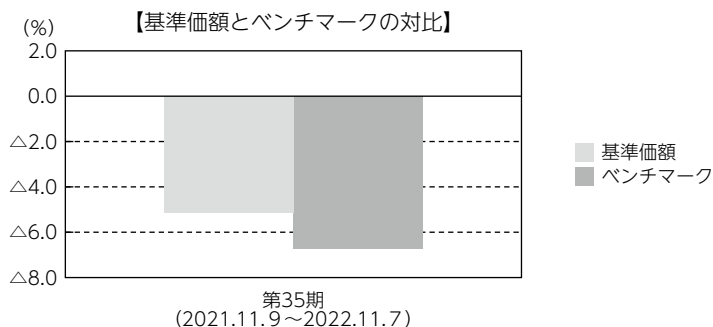
当期の運用につきましては、当ファンドの運用方針に従い、インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド受益証券の組入比率を高位に維持しました。

●インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド

日経平均株価に連動する投資成果を目標に運用を行いました。日経平均株価に採用されている個別銘柄の比率と同程度となるように投資を行いました。また、現物株式と株価指数先物を合わせた実質的な株式の組入比率を高位に維持することにより、日経平均株価との連動性維持に努めました。なお、日経平均株価採用銘柄の入替等にも適宜対応しました。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で6.7%下落しました。当ファンドはベンチマークを1.6%上回りました。この差異は、主に、保有株式の配当金のプラス要因と信託報酬などのマイナス要因との差によるものです。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

分配金

収益分配金につきましては基準価額水準等を勘案し、以下の表の通りとさせていただきます。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当期
	2021年11月9日 ～2022年11月7日
当期分配金（税引前）	5円
対基準価額比率	0.04%
当期の収益	-円
当期の収益以外	5円
翌期繰越分配対象額	6,765円

(注1) 「当期の収益」および「当期の収益以外」は、小数点以下切捨てで算出しているためこれらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

(注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金（税引前）」の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

(注3) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

今後の運用方針

●当ファンド

今後の運用につきましても、インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド受益証券の組入比率を高位に維持します。

●インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド

今後の運用につきましても、日経平均株価に採用されている個別銘柄の比率と同程度となるように投資を行い、また、現物株式と株価指数先物を合わせた実質的な株式の組入比率を高位に維持することにより、日経平均株価に連動する投資成果を目指します。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第35期		項目の概要
	(2021年11月9日 ～2022年11月7日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	61円	0.548%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は11,046円です。 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(投信会社)	(27)	(0.247)	
(販売会社)	(27)	(0.247)	
(受託会社)	(6)	(0.055)	
(b) 売買委託手数料	0	0.001	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(c) その他費用	0	0.001	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
(監査費用)	(0)	(0.001)	
合計	61	0.550	

(注1) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

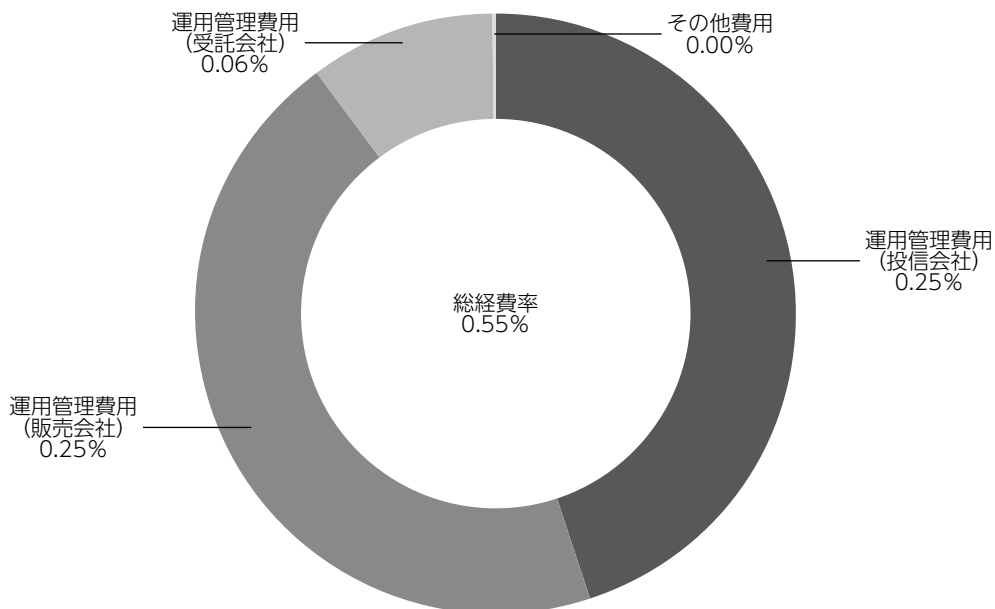
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(参考情報)

◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.55%です。



(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

■**売買及び取引の状況**（2021年11月9日から2022年11月7日まで）

期中の売買及び取引はありません。

■**親投資信託受益証券の設定、解約状況**（2021年11月9日から2022年11月7日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド	千口 1,015	千円 3,706	千口 11,390	千円 41,903

■**株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合**

項 目	インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	1,127,065千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	11,567,123千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)／(b)	0.09

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■**利害関係人との取引状況等**（2021年11月9日から2022年11月7日まで）

【インデックスポートフォリオにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

期中の利害関係人との取引はありません。

(2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	4千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	4千円
(B)／(A)	99.9%

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

【インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株 式	百万円 337	百万円 -	% -	百万円 789	百万円 3	% 0.4
株 式 先 物 取 引	3,118	3,118	100.0	3,038	3,038	100.0

平均保有割合 6.3%

(注) 平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	百万円 -	百万円 0.162137	百万円 2

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券、みずほフィナンシャルグループです。

■組入資産の明細

親投資信託残高

	期 首 (前期末)	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド	千□ 215,838	千□ 205,464	千円 760,321

■投資信託財産の構成

2022年11月7日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド	760,321	99.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,871	0.4
投 資 信 託 財 産 総 額	763,193	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年11月7日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	763,193,111円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,182,714
インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド(評価額)	760,321,397
未 収 入 金	689,000
(B) 負 債	2,778,163
未 払 収 益 分 配 金	339,873
未 払 解 約 金	337,380
未 払 信 託 報 酬	2,095,041
そ の 他 未 払 費 用	5,869
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	760,414,948
元 本	679,746,640
次 期 繰 越 損 益 金	80,668,308
(D) 受 益 権 総 口 数	679,746,640口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	11,187円

(注) 期首における元本額は709,843,358円、当期中における追加設定元本額は5,583,612円、同解約元本額は35,680,330円です。

■損益の状況

当期 自2021年11月9日 至2022年11月7日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△122円
支 払 利 息	△122
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△36,626,351
売 買 損 益	2,101,802
売 買 損 益	△38,728,153
(C) 信 託 報 酬 等	△4,248,738
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△40,875,211
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	359,405,772
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△237,522,380
(配 当 等 相 当 額)	(100,816,816)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△338,339,196)
(G) 合 計(D+E+F)	81,008,181
(H) 収 益 分 配 金	△339,873
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	80,668,308
追 加 信 託 差 損 益 金	△237,522,380
(配 当 等 相 当 額)	(100,816,816)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△338,339,196)
分 配 準 備 積 立 金	359,066,229
繰 越 損 益 金	△40,875,541

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 分配金の計算過程

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収 益 調 整 金	100,816,816
(d) 分 配 準 備 積 立 金	359,406,102
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	460,222,918
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	6,770.51
(g) 分 配 金	339,873
(h) 1 万 口 当 たり 分 配 金	5

■分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金

5円

※分配金は税引後自動的に無手数料で再投資されます。

分配金の課税上の取扱いについて

- ・追加型株式投資信託の分配金には、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）」があります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、分配金から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における受益者毎の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の受益者毎の個別元本となります。

《お知らせ》

約款変更のお知らせ

■当ファンドが投資対象とする「インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド」において、投資対象を「東京証券取引所第一部に上場されている株式」から「わが国の金融商品取引所上場株式のうち、日経平均株価（225種・東証）に採用された銘柄」に変更しました。

また、日経225銘柄への投資に当たっては「東京証券取引所第一部に上場されている株式のうち、日経平均株価（225種・東証）に採用された銘柄の中から200銘柄以上に、原則として等株数投資」から「わが国の金融商品取引所上場株式のうち、日経平均株価（225種・東証）に採用された銘柄の中から200銘柄以上に、原則として同指数における個別銘柄の比率と同程度となるように投資」に変更しました。

なお、上記約款変更は東京証券取引所の市場区分の再編と日経平均株価の算出要領の改定に伴うもので商品としての同一性が失われるものではありません。

(2022年2月18日)

インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド

運用報告書

第20期（決算日 2022年1月14日）

（計算期間 2021年1月15日～2022年1月14日）

インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンドの第20期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	原則、無期限です。
運用方針	日経平均株価（225種・東証）に連動する投資成果をめざした運用を行います。
主要投資対象	東京証券取引所第一部に上場されている株式のうち、日経平均株価（225種・東証）に採用された銘柄とします。
主な組入制限	株式の投資割合には制限を設けません。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		日経平均株価(225)		株式組入率 比	株式先物率 比	純資産額
	期騰落率	中率	(ベンチマーク)	期騰落率			
	円	%	円	%	%	%	百万円
16期(2018年1月14日)	28,842	24.9	23,653.82	22.6	93.9	6.0	17,655
17期(2019年1月14日)	25,333	△12.2	20,359.70	△13.9	93.7	6.2	13,491
18期(2020年1月14日)	30,531	20.5	24,025.17	18.0	93.2	6.7	13,595
19期(2021年1月14日)	37,190	21.8	28,698.26	19.5	96.6	3.3	14,019
20期(2022年1月14日)	37,042	△0.4	28,124.28	△2.0	94.8	5.1	12,622

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) 「日経平均株価」は、株式会社日本経済新聞社によって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」自体および「日経平均株価」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。

当ファンドは、投資信託委託会社等の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用および当ファンドの取引に関して、一切責任を負いません（以下同じ）。

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

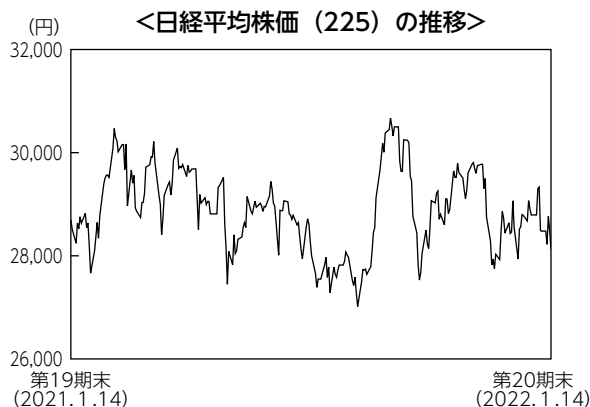
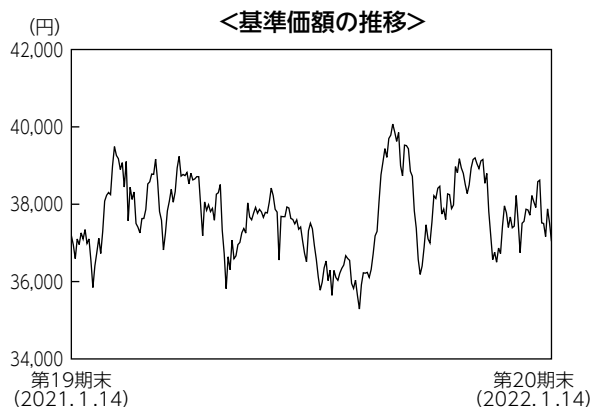
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		日経平均株価(225) (ベンチマーク)		株式組入 率	株式先物 率
	騰 落 率	騰 落 率				
(期 首) 2021年 1月 14日	円 37,190	% -	円 28,698.26	% -	% 96.6	% 3.3
1 月 末	35,846	△3.6	27,663.39	△3.6	97.7	2.1
2 月 末	37,569	1.0	28,966.01	0.9	93.4	6.4
3 月 末	38,052	2.3	29,178.80	1.7	93.3	6.5
4 月 末	37,586	1.1	28,812.63	0.4	94.8	5.1
5 月 末	37,667	1.3	28,860.08	0.6	95.3	4.5
6 月 末	37,607	1.1	28,791.53	0.3	95.7	4.1
7 月 末	35,644	△4.2	27,283.59	△4.9	96.3	3.5
8 月 末	36,712	△1.3	28,089.54	△2.1	96.8	3.1
9 月 末	38,724	4.1	29,452.66	2.6	93.6	6.4
10 月 末	37,980	2.1	28,892.69	0.7	93.6	6.1
11 月 末	36,566	△1.7	27,821.76	△3.1	94.3	5.5
12 月 末	37,915	1.9	28,791.71	0.3	94.6	5.3
(期 末) 2022年 1月 14日	37,042	△0.4	28,124.28	△2.0	94.8	5.1

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2021年1月15日から2022年1月14日まで）



基準価額の推移

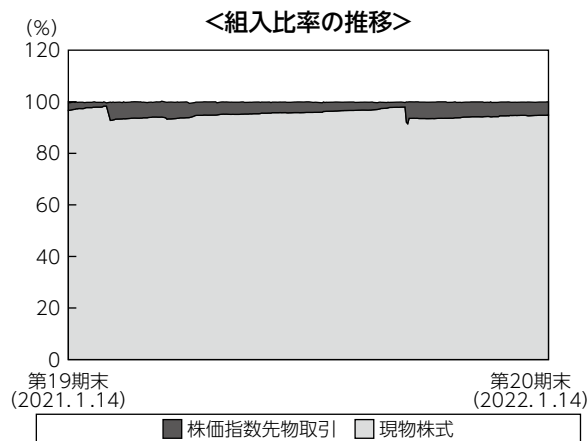
当ファンドの基準価額は、前期末比で0.4%下落しました。

基準価額の主な変動要因

主として国内株式への投資を行った結果、市況が下落したことなどから、基準価額は下落しました。

投資環境

国内株式市場は、米英における新型コロナウイルスのワクチン接種開始などが好感され、2021年1月から2月にかけて上昇しました。しかしその後は、国内での感染再拡大や米インフレ加速懸念などから、下落基調で推移しました。2021年9月には、菅首相の自民党総裁選不出馬表明により、衆院選での与党大敗が回避されるとの期待などから上昇しましたが、期末にかけては、中国不動産大手の信用懸念拡大などを受けて乱高下する展開となりました。



※比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

※計理処理の関係上、一時的に100%を超える場合があります。

今後の運用方針

今後の運用につきましても、日経平均株価に採用されている個別銘柄の比率と同程度となるように投資を行い、また、現物株式と株価指数先物を合わせた実質的な株式の組入比率を高位に維持することにより、日経平均株価に連動する投資成果を目指します。

ポートフォリオについて

日経平均株価に連動する投資成果を目標に運用を行いました。日経平均株価に採用されている個別銘柄の比率と同程度となるように投資を行いました。また、現物株式と株価指数先物を合わせた実質的な株式の組入比率を高位に維持することにより、日経平均株価との連動性維持に努めました。なお、日経平均株価採用銘柄の入替等にも適宜対応しました。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で2.0%下落しました。当ファンドはベンチマークを1.6%上回りました。この差異は、主に、保有株式の配当金のプラス要因によるものです。

■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	0円 (0) (0)	0.001% (0.000) (0.001)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
合 計	0	0.001	
期中の平均基準価額は37,709円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■ 売買及び取引の状況 (2021年1月15日から2022年1月14日まで)

(1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内 上 場		千株	千円	千株	千円
		17.7 (98.4)	314,349 (-)	397.2	1,719,280

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) () 内は株式分割、増資割当および合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
国 内	株 式 先 物 取 引	百万円 4,448	百万円 4,206	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

■ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	2,033,630千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	12,568,948千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)÷(b)	0.16

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2021年1月15日から2022年1月14日まで）

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株 式 先 物 取 引	百万円 4,448	百万円 4,448	% 100.0	百万円 4,206	百万円 4,206	% 100.0

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	百万円 -	百万円 0.321838	百万円 2

(3) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	98千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	98千円
(B)/(A)	99.9%

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券、みずほフィナンシャルグループです。

■組入資産の明細

(1) 国内株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額
	千株	千株	千円	千円
水産・農林業 (0.1%)				
日本水産	17	15	8,115	
マルハニチロ	1.7	1.5	3,603	
鉱業 (0.1%)				
I N P E X	6.8	6	6,534	
建設業 (1.6%)				
コムシスホールディングス	17	15	39,720	
大成建設	3.4	3	10,725	
大林組	17	15	13,575	
清水建設	17	15	10,845	
長谷工コーポレーション	3.4	3	4,323	
鹿島建設	8.5	7.5	10,132	
大和ハウス工業	17	15	50,595	
積水ハウス	17	15	36,060	
日揮ホールディングス	17	15	15,735	
食料品 (3.6%)				
日清製粉グループ本社	17	15	24,135	
明治ホールディングス	3.4	3	21,150	
日本ハム	8.5	7.5	32,362	
サッポロホールディングス	3.4	3	6,588	
アサヒグループホールディングス	17	15	69,750	
キリンホールディングス	17	15	28,027	
宝ホールディングス	17	15	17,445	
キッコーマン	17	15	128,100	
味の素	17	15	50,415	
ニチレイ	8.5	7.5	19,320	
日本たばこ産業	17	15	35,445	
繊維製品 (0.2%)				
東洋紡	1.7	1.5	2,004	
ユニチカ	1.7	1.5	468	
帝人	3.4	3	4,437	
東レ	17	15	11,101	
パルプ・紙 (0.1%)				
王子ホールディングス	17	15	8,865	
日本製紙	1.7	1.5	1,734	
化学 (7.7%)				
クラレ	17	15	15,735	
旭化成	17	15	17,070	
昭和電工	1.7	1.5	3,910	
住友化学	17	15	8,880	
日産化学	17	15	94,200	
東ソー	8.5	7.5	13,597	
トクヤマ	3.4	3	5,538	
デンカ	3.4	3	11,970	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額
	千株	千株	千円	千円
信越化学工業	17	15	291,000	
三井化学	3.4	3	9,990	
三菱ケミカルホールディングス	8.5	7.5	6,792	
宇部興産	1.7	1.5	3,171	
花王	17	15	85,575	
D I C	1.7	1.5	4,627	
富士フィルムホールディングス	17	15	124,860	
資生堂	17	15	88,320	
日東電工	17	15	134,250	
医薬品 (6.8%)				
協和キリン	17	15	44,070	
武田薬品工業	17	15	50,160	
アステラス製薬	85	75	140,887	
大日本住友製薬	17	15	20,550	
塩野義製薬	17	15	112,335	
中外製薬	51	45	168,750	
エーザイ	17	15	92,970	
第一三共	51	45	119,250	
大塚ホールディングス	17	15	61,290	
石油・石炭製品 (0.2%)				
出光興産	6.8	6	18,840	
E N E O S ホールディングス	17	15	6,892	
ゴム製品 (0.8%)				
横浜ゴム	8.5	7.5	13,837	
ブリヂストン	17	15	76,185	
ガラス・土石製品 (1.0%)				
A G C	3.4	3	15,600	
日本板硝子	1.7	1.5	811	
日本電気硝子	5.1	4.5	13,000	
住友大阪セメント	1.7	1.5	5,287	
太平洋セメント	1.7	1.5	3,477	
東海カーボン	17	15	19,005	
T O T O	8.5	7.5	38,100	
日本碍子	17	15	30,225	
鉄鋼 (0.1%)				
日本製鉄	1.7	1.5	3,285	
神戸製鋼所	1.7	1.5	936	
ジェイ エフ イー ホールディングス	1.7	1.5	2,575	
大平洋金属	1.7	1.5	3,495	
非鉄金属 (0.9%)				
日本軽金属ホールディングス	1.7	1.5	2,778	
三井金属鉱業	1.7	1.5	5,040	
東邦亜鉛	1.7	1.5	3,834	
三菱マテリアル	1.7	1.5	3,139	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価	額
	千株	千株	千円	
住友金属鉱山	8.5	7.5	38,010	
DOWAホールディングス	3.4	3	15,330	
古河電気工業	1.7	1.5	3,630	
住友電気工業	17	15	24,652	
フジクラ	17	15	9,375	
金属製品 (0.0%)				
SUMCO	1.7	1.5	3,675	
東洋製鐵グループホールディングス	17	-	-	
機械 (5.2%)				
日本製鋼所	3.4	3	12,810	
オークマ	3.4	3	15,720	
アマダ	17	15	17,655	
小松製作所	17	15	45,075	
住友重機械工業	3.4	3	8,994	
日立建機	17	15	44,640	
クボタ	17	15	39,097	
荏原製作所	3.4	3	18,810	
ダイキン工業	17	15	379,500	
日本精工	17	15	12,210	
NTN	17	15	3,780	
ジェイテクト	17	15	16,035	
三井E&Sホールディングス	1.7	1.5	610	
日立造船	3.4	3	2,385	
三菱重工業	1.7	1.5	4,755	
IHI	1.7	1.5	3,658	
電気機器 (27.1%)				
日清紡ホールディングス	17	-	-	
コニカミノルタ	17	15	7,995	
ミネベアミツミ	17	15	45,600	
日立製作所	3.4	3	20,583	
三菱電機	17	15	22,875	
富士電機	3.4	3	18,810	
安川電機	17	15	75,750	
オムロン	17	15	152,775	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	3.4	3	7,905	
日本電気	1.7	1.5	7,755	
富士通	1.7	1.5	27,210	
沖電気工業	1.7	1.5	1,357	
セイコーエプソン	34	30	59,820	
パナソニック	17	15	19,657	
シャープ	17	15	19,710	
ソニーグループ	17	15	212,850	
TDK	17	45	202,275	
アルプスアルパイン	17	15	17,235	
横河電機	17	15	30,015	
アドバンテスト	34	30	321,600	
キーエンス	-	1.5	93,240	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価	額
	千株	千株	千円	
カシオ計算機	17	15	21,045	
ファナック	17	15	340,425	
京セラ	34	30	214,290	
太陽誘電	17	15	93,900	
村田製作所	-	12	108,756	
SCREENホールディングス	3.4	3	38,970	
キヤノン	25.5	22.5	62,437	
リコー	17	15	15,795	
東京エレクトロン	17	15	978,300	
輸送用機器 (5.2%)				
デンソー	17	15	146,250	
川崎重工業	1.7	1.5	3,478	
日産自動車	17	15	9,363	
いすゞ自動車	8.5	7.5	11,317	
トヨタ自動車	17	75	179,250	
日野自動車	17	15	15,345	
三菱自動車工業	1.7	1.5	496	
マツダ	3.4	3	2,937	
本田技研工業	34	30	104,190	
スズキ	17	15	71,940	
SUBARU	17	15	32,452	
ヤマハ発動機	17	15	42,750	
精密機器 (3.5%)				
テルモ	68	60	258,120	
ニコン	17	15	19,320	
オリンパス	68	60	138,450	
シチズン時計	17	15	7,470	
その他製品 (2.7%)				
パンダイナムコホールディングス	17	15	120,645	
凸版印刷	8.5	7.5	16,522	
大日本印刷	8.5	7.5	21,352	
ヤマハ	17	15	80,850	
任天堂	-	1.5	77,880	
電気・ガス業 (0.1%)				
東京電力ホールディングス	1.7	1.5	441	
中部電力	1.7	1.5	1,830	
関西電力	1.7	1.5	1,641	
東京瓦斯	3.4	3	6,591	
大阪瓦斯	3.4	3	5,817	
陸運業 (1.3%)				
東武鉄道	3.4	3	7,875	
東急	8.5	7.5	11,175	
小田急電鉄	8.5	7.5	15,000	
京王電鉄	3.4	3	14,985	
京成電鉄	8.5	7.5	22,215	
東日本旅客鉄道	1.7	1.5	10,050	
西日本旅客鉄道	1.7	1.5	7,033	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価	額
	千株	千株	千円	
東海旅客鉄道	1.7	1.5	21,997	
日本通運	1.7	—	—	
ヤマトホールディングス	17	15	37,590	
NIPPON EXPRESSホールディングス	—	1.5	10,785	
海運業 (0.3%)				
日本郵船	1.7	1.5	14,655	
商船三井	1.7	1.5	14,250	
川崎汽船	1.7	1.5	11,940	
空運業 (0.0%)				
A N Aホールディングス	1.7	1.5	3,576	
倉庫・運輸関連業 (0.2%)				
三菱倉庫	8.5	7.5	20,745	
情報・通信業 (10.6%)				
ネクソン	34	30	61,200	
Zホールディングス	6.8	6	3,696	
トレンドマイクロ	17	15	85,500	
スカパーJ S A Tホールディングス	1.7	—	—	
日本電信電話	6.8	6	19,632	
K D D I	102	90	320,310	
ソフトバンク	17	15	21,705	
東宝	1.7	1.5	6,802	
エヌ・ティ・ティ・データ	85	75	173,625	
コナミホールディングス	17	15	79,350	
ソフトバンクグループ	102	90	494,730	
卸売業 (2.3%)				
双日	1.7	1.5	2,709	
伊藤忠商事	17	15	52,455	
丸紅	17	15	17,640	
豊田通商	17	15	77,250	
三井物産	17	15	42,847	
住友商事	17	15	25,957	
三菱商事	17	15	58,725	
小売業 (9.5%)				
J・フロント リテイリング	8.5	7.5	7,612	
三越伊勢丹ホールディングス	17	15	12,600	
セブン&アイ・ホールディングス	17	15	77,415	
高島屋	8.5	7.5	7,927	
丸井グループ	17	15	32,085	
イオン	17	15	35,917	
ファーストリテイリング	17	15	958,650	
銀行業 (0.6%)				
コンソルディア・フィナンシャルグループ	17	15	7,170	
新生銀行	1.7	1.5	3,189	
あおぞら銀行	1.7	1.5	4,020	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	17	15	10,617	
りそなホールディングス	1.7	1.5	768	
三井住友トラスト・ホールディングス	1.7	1.5	6,403	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価	額
	千株	千株	千円	
三井住友フィナンシャルグループ	1.7	1.5	6,453	
千葉銀行	17	15	11,175	
ふくおかフィナンシャルグループ	3.4	3	6,843	
静岡銀行	17	15	13,290	
みずほフィナンシャルグループ	1.7	1.5	2,397	
証券・商品先物取引業 (0.3%)				
大和証券グループ本社	17	15	10,509	
野村ホールディングス	17	15	7,974	
松井証券	17	15	12,165	
保険業 (0.8%)				
SOMPOホールディングス	4.2	3	16,074	
MS & ADインシュアランスグループホールディングス	5.1	4.5	17,919	
第一生命ホールディングス	1.7	1.5	4,059	
東京海上ホールディングス	8.5	7.5	52,462	
T & Dホールディングス	3.4	3	5,289	
その他金融業 (0.5%)				
クレディセゾン	17	15	19,050	
日本取引所グループ	17	15	37,057	
不動産業 (1.1%)				
東急不動産ホールディングス	17	15	9,465	
三井不動産	17	15	33,967	
三菱地所	17	15	24,225	
東京建物	8.5	7.5	12,472	
住友不動産	17	15	51,000	
サービス業 (5.7%)				
エムスリー	40.8	36	168,264	
ディー・エヌ・エー	5.1	4.5	7,789	
電通グループ	17	15	61,200	
サイバーエージェント	3.4	12	21,588	
楽天グループ	17	15	16,500	
リクルートホールディングス	51	45	272,205	
日本郵政	17	15	14,860	
セコム	17	15	117,465	
合 計	株 数・金 額	3,084.6	2,803.5	11,969,550
	銘柄数<比率>	225銘柄	225銘柄	<94.8%>

(注1) 銘柄欄の()内は、期末の国内株式評価額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨ててあります。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当 期		末
		買 建 額	売 建 額	額
国内	日 経 平 均	百万円 648		百万円 -

■投資信託財産の構成

2022年1月14日現在

項 目		当 期		末
		評 価 額	比 率	
株 式		千円 11,969,550		% 94.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他		665,742		5.3
投 資 信 託 財 産 総 額		12,635,293		100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年1月14日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	12,635,293,566円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	627,022,666
株 式(評価額)	11,969,550,900
未 収 配 当 金	16,020,000
差 入 委 託 証 拠 金	22,700,000
(B) 負 債	12,397,590
未 払 金	2,007,590
未 払 解 約 金	10,390,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	12,622,895,976
元 本	3,407,767,709
次 期 繰 越 損 益 金	9,215,128,267
(D) 受 益 権 総 口 数	3,407,767,709口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	37,042円

(注1) 期首元本額	3,769,640,045円
追加設定元本額	71,124,653円
一部解約元本額	432,996,989円
(注2) 期末における元本の内訳	
インデックスポートフォリオ	215,579,292円
ボンドミックスポートフォリオ	9,291,495円
財形株投 (一般財形30)	10,428,447円
財形株投 (一般財形50)	39,817,390円
財形株投 (年金・住宅財形30)	10,307,408円
インデックス マネジメント ファンド 225	1,935,480,297円
インデックス マネジメント ファンド 225 (DC年金)	178,312,635円
インデックス マネジメント ファンド 225 (変額年金)	555,494,077円
太陽ミリオン・インデックスポートフォリオ	434,910,265円
太陽ミリオン・ボンドミックスポートフォリオ	18,146,403円
期末元本合計	3,407,767,709円

■損益の状況

当期 自2021年1月15日 至2022年1月14日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	210,328,056円
受 取 配 当 金	210,413,824
そ の 他 収 益 金	5,624
支 払 利 息	△91,392
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△172,977,952
売 買 損 益	1,484,913,823
売 買 損	△1,657,891,775
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△54,118,010
取 引 益	35,492,050
取 引 損	△89,610,060
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△16,767,906
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	10,249,514,837
(F) 解 約 差 損 益 金	△1,212,356,011
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	194,737,347
(H) 合 計(D+E+F+G)	9,215,128,267
次 期 繰 越 損 益 金(H)	9,215,128,267

- (注1) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。
- (注2) (F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。
- (注3) (G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。