

運用報告書 (全体版)

第36期<決算日2023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、2023年11月7日に第36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

<https://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) | 標準価額 | | 日経平均株価(225) | | 株式組入 比率 | 株式先物 比率 | 純資産 総額 |
|-----------------|---------------|------------|----------|----------------|----------|------------|------------|------------|
| | | 税込み 分配金 | 騰落 率 | (ベンチマーク) | 騰落 率 | | | |
| 32期(2019年11月7日) | 円 9,288 | 円 5 | % 6.2 | 円 23,330.32 | % 5.6 | % 94.0 | % 5.6 | 百万円 782 |
| 33期(2020年11月9日) | 9,914 | 5 | 6.8 | 24,839.84 | 6.5 | 95.5 | 4.0 | 793 |
| 34期(2021年11月8日) | 11,799 | 5 | 19.1 | 29,507.05 | 18.8 | 93.8 | 5.9 | 837 |
| 35期(2022年11月7日) | 11,187 | 5 | △5.1 | 27,527.64 | △6.7 | 92.9 | 7.0 | 760 |
| 36期(2023年11月7日) | 13,310 | 5 | 19.0 | 32,271.82 | 17.2 | 93.5 | 6.2 | 863 |

(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) | | 株式組入 比率 | 株式先物 比率 |
|--------------------|-------------|----------|----------------|--------|------------|------------|
| | 騰落率 | (ベンチマーク) | 騰落率 | | | |
| (期首) 2022年11月7日 | 円 11,187 | % - | 円 27,527.64 | % - | % 92.9 | % 7.0 |
| 11月末 | 11,365 | 1.6 | 27,968.99 | 1.6 | 93.7 | 6.2 |
| 12月末 | 10,616 | △5.1 | 26,094.50 | △5.2 | 93.9 | 6.0 |
| 2023年1月末 | 11,111 | △0.7 | 27,327.11 | △0.7 | 93.3 | 6.6 |
| 2月末 | 11,162 | △0.2 | 27,445.56 | △0.3 | 93.6 | 6.2 |
| 3月末 | 11,505 | 2.8 | 28,041.48 | 1.9 | 94.3 | 5.7 |
| 4月末 | 11,835 | 5.8 | 28,856.44 | 4.8 | 95.0 | 4.8 |
| 5月末 | 12,664 | 13.2 | 30,887.88 | 12.2 | 96.7 | 3.3 |
| 6月末 | 13,615 | 21.7 | 33,189.04 | 20.6 | 97.6 | 2.4 |
| 7月末 | 13,603 | 21.6 | 33,172.22 | 20.5 | 98.1 | 1.7 |
| 8月末 | 13,376 | 19.6 | 32,619.34 | 18.5 | 91.6 | 8.1 |
| 9月末 | 13,150 | 17.5 | 31,857.62 | 15.7 | 93.0 | 6.9 |
| 10月末 | 12,734 | 13.8 | 30,858.85 | 12.1 | 93.3 | 6.5 |
| (期末) 2023年11月7日 | 13,315 | 19.0 | 32,271.82 | 17.2 | 93.5 | 6.2 |

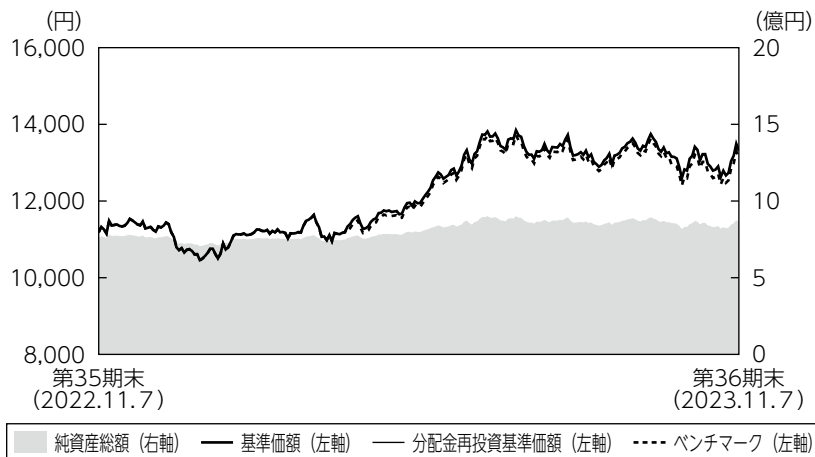
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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（2022年11月8日から2023年11月7日まで）

基準価額等の推移



第36期首： 11,187円
第36期末： 13,310円
（既払分配金5円）
騰落率： 19.0%
（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、市況が上昇したことなどから、基準価額は上昇しました。

投資環境

国内株式市場は、当期の前半、円安の進行や欧米投資家による積極的な日本株買いなどが好感され、上昇しました。2023年7月には、日銀が長短金利操作の運用を柔軟化したことを受け、国内長期金利上昇懸念が台頭したことから、上値の重い状況に転じました。10月には、中東情勢の緊迫化などが嫌気され急落する場面もありましたが、期末にかけては、米国の経済指標の鈍化傾向を受けた米国追加金融引き締め懸念の後退などが好感され、急反発する展開となりました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

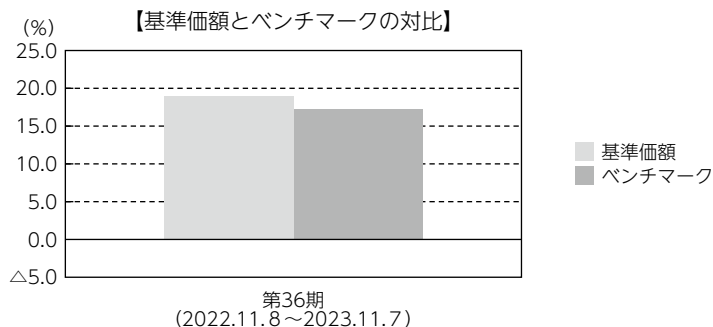
当期の運用につきましては、当ファンドの運用方針に従い、インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド受益証券の組入比率を高位に維持しました。

●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17.2%上昇しました。当ファンドはベンチマークを1.8%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 |
|------------|---------------------------|
| | 2022年11月8日 ～2023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 | 5円 |
| 当期の収益以外 | -円 |
| 翌期繰越分配対象額 | 8,285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36期 | | 項目の概要 |
|---------------------|-----------------------------|------------------|--|
| | (2022年11月8日 ～2023年11月7日) | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 67円 | 0.550% | (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12,216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) | (30) | (0.247) | |
| (販売会社) | (30) | (0.247) | |
| (受託会社) | (7) | (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 |
| (先物・オプション) | (0) | (0.001) | |
| (c) その他費用 (監査費用) | 0 (0) | 0.001 (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 |
| 合計 | 67 | 0.552 | |

(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。

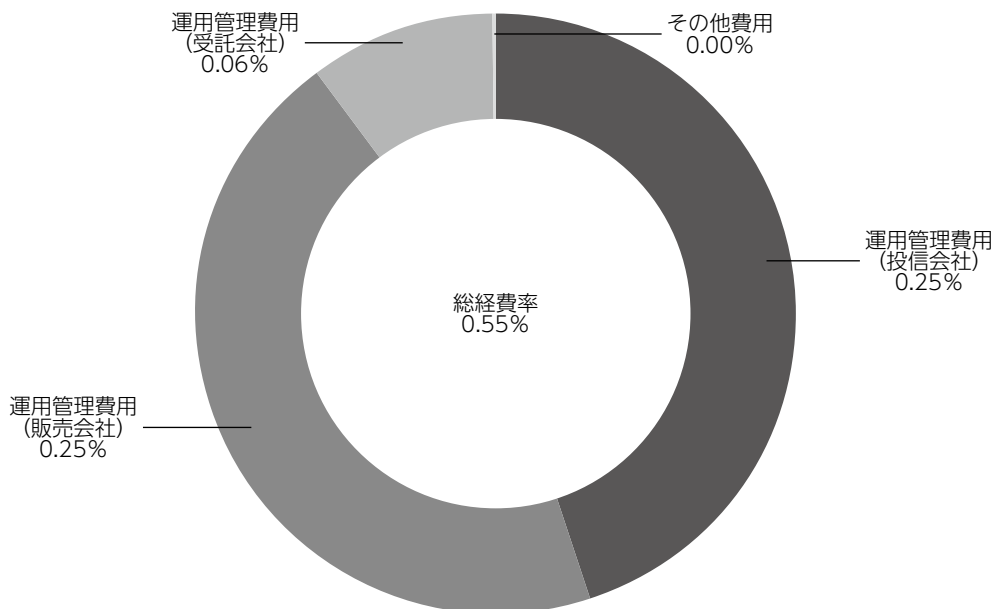
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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**（2022年11月8日から2023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**（2022年11月8日から2023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□ 884 | 千円 3,507 | 千□ 11,375 | 千円 45,964 |

■**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 | 3,202,033千円 |
| (b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 12,097,900千円 |
| (c) 売 買 高 比 率 (a)／(b) | 0.26 |

(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**（2022年11月8日から2023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) | 7千円 |
| う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B) | 7千円 |
| (B)／(A) | 100.0% |

(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 1,287 | 百万円 327 | % 25.4 | 百万円 1,914 | 百万円 18 | % 1.0 |
| 株 式 先 物 取 引 | 5,430 | 5,430 | 100.0 | 5,546 | 5,546 | 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 0.233994 | 百万円 0.47116 | 百万円 3 |

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□ 205,464 | 千□ 194,973 | 千円 863,539 |

■投資信託財産の構成

2023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 | 863,539 | 99.7 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 2,812 | 0.3 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 866,351 | 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

(2023年11月7日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|--|--------------|
| (A) 資 産 | 866,351,988円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 2,469,616 |
| 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) | 863,539,372 |
| 未 収 入 金 | 343,000 |
| (B) 負 債 | 2,709,162 |
| 未 払 収 益 分 配 金 | 324,436 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 2,378,063 |
| そ の 他 未 払 費 用 | 6,663 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 863,642,826 |
| 元 本 | 648,873,892 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 214,768,934 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 648,873,892口 |
| 1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D) | 13,310円 |

(注) 期首における元本額は679,746,640円、当期中における追加設定元本額は5,040,611円、同解約元本額は35,913,359円です。

■損益の状況

当期 自2022年11月8日 至2023年11月7日

| 項 目 | 当 期 |
|----------------------|----------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | △209円 |
| 支 払 利 息 | △209 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 142,115,143 |
| 売 買 益 | 145,752,870 |
| 売 買 損 | △3,637,727 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △4,451,200 |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C) | 137,663,734 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 301,444,072 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | △224,014,436 |
| (配 当 等 相 当 額) | (98,827,723) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△322,842,159) |
| (G) 合 計(D+E+F) | 215,093,370 |
| (H) 収 益 分 配 金 | △324,436 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(G+H) | 214,768,934 |
| 追 加 信 託 差 損 益 金 | △224,014,436 |
| (配 当 等 相 当 額) | (98,827,723) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△322,842,159) |
| 分 配 準 備 積 立 金 | 438,783,579 |
| 繰 越 損 益 金 | △209 |

(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 | 98,939,711 |
| (c) 収 益 調 整 金 | 98,827,723 |
| (d) 分 配 準 備 積 立 金 | 340,168,304 |
| (e) 当期分配対象額(a+b+c+d) | 537,935,738 |
| (f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額 | 8,290.30 |
| (g) 分 配 金 | 324,436 |
| (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、第17条（先物取引等の運用指図・目的・範囲）の付表「I.外国の証券先物市場等」および第20条（保管業務の委任）の付表「II.外国での保管会社」を削除するため所要の変更を行いました。

(2023年2月8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21期 (決算日 2023年1月14日)

(計算期間 2022年1月15日～2023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21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 | 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。 |
| 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 |
| 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 |
| 21期(2023年1月14日) | 35,176 | △5.0 | 26,119.52 | △7.1 | 94.0 | 6.0 | 11,361 |

(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）。

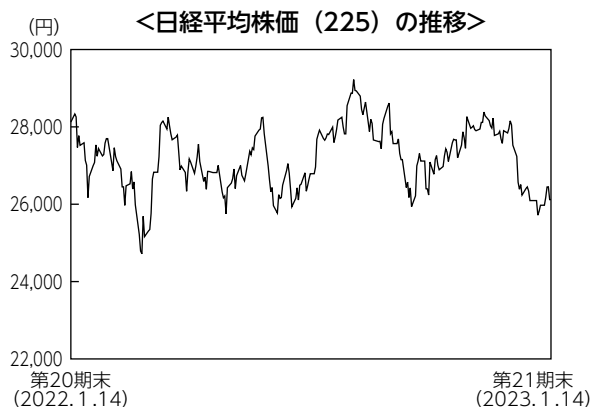
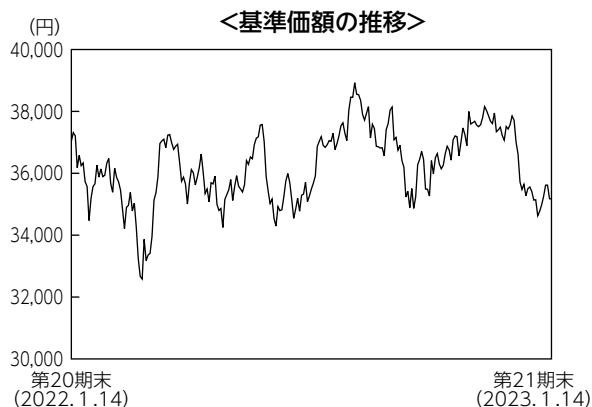
■当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | 日経平均株価(225) (ベンチマーク) | | 株式組入 比 率 | 株式先物 比 率 |
|-------------------------|---------|------------|-------------------------|------------|-------------|-------------|
| | 円 | 騰 落 率 % | 円 | 騰 落 率 % | | |
| (期 首) 2022年 1 月 14 日 | 37,042 | — | 28,124.28 | — | 94.8 | 5.1 |
| 1 月 末 | 35,568 | △4.0 | 27,001.98 | △4.0 | 94.8 | 5.1 |
| 2 月 末 | 34,963 | △5.6 | 26,526.82 | △5.7 | 95.0 | 4.9 |
| 3 月 末 | 36,980 | △0.2 | 27,821.43 | △1.1 | 95.1 | 4.7 |
| 4 月 末 | 35,694 | △3.6 | 26,847.90 | △4.5 | 95.8 | 4.0 |
| 5 月 末 | 36,288 | △2.0 | 27,279.80 | △3.0 | 96.1 | 3.8 |
| 6 月 末 | 35,158 | △5.1 | 26,393.04 | △6.2 | 96.5 | 3.4 |
| 7 月 末 | 37,034 | △0.0 | 27,801.64 | △1.1 | 96.9 | 2.9 |
| 8 月 末 | 37,444 | 1.1 | 28,091.53 | △0.1 | 97.8 | 2.1 |
| 9 月 末 | 34,866 | △5.9 | 25,937.21 | △7.8 | 92.9 | 6.8 |
| 10 月 末 | 37,078 | 0.1 | 27,587.46 | △1.9 | 92.9 | 7.0 |
| 11 月 末 | 37,607 | 1.5 | 27,968.99 | △0.6 | 93.7 | 6.2 |
| 12 月 末 | 35,144 | △5.1 | 26,094.50 | △7.2 | 93.9 | 6.0 |
| (期 末) 2023年 1 月 14 日 | 35,176 | △5.0 | 26,119.52 | △7.1 | 94.0 | 6.0 |

(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（2022年1月15日から2023年1月14日まで）



基準価額の推移

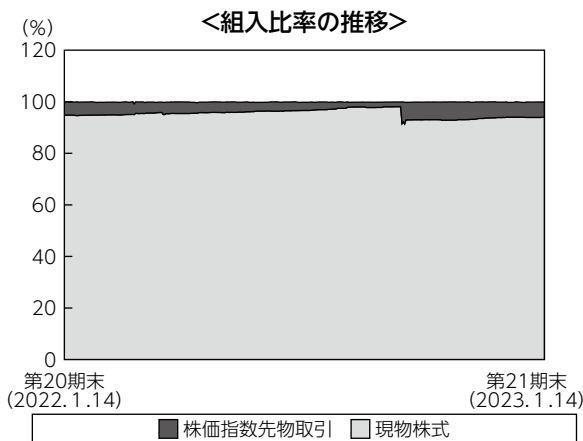
当ファンドの基準価額は、前期末比で5.0%下落しました。

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、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、日銀による金融政策修正とそれに伴う急速な円高ドル安などが嫌気され、大きく下落しました。



※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7.1%下落しました。当ファンドはベンチマークを2.1%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36,212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 (2022年1月15日から2023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 |
| | | 48.6 (35.2) | 326,918 (-) | 207.7 | 779,117 |

(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 3,159 | 百万円 3,106 | 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 | 1,106,035千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 11,402,074千円 |
| (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（2022年1月15日から2023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 | 百万円 326 | 百万円 - | % - | 百万円 779 | 百万円 3 | % 0.4 |
| 株 式 先 物 取 引 | 3,159 | 3,159 | 100.0 | 3,106 | 3,106 | 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 0.162137 | 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) | 76千円 |
| う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B) | 76千円 |
| (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 |
| | 千株 | 千株 | 千円 | |
| 水産・農林業 (0.1%) | | | | |
| ニッスイ | 15 | 14 | 7,280 | |
| マルハニチロ | 1.5 | — | — | |
| 鉱業 (0.1%) | | | | |
| INPEX | 6 | 5.6 | 7,873 | |
| 建設業 (1.7%) | | | | |
| コムシスホールディングス | 15 | 14 | 32,592 | |
| 大成建設 | 3 | 2.8 | 11,396 | |
| 大林組 | 15 | 14 | 13,258 | |
| 清水建設 | 15 | 14 | 9,422 | |
| 長谷工コーポレーション | 3 | 2.8 | 4,037 | |
| 鹿島建設 | 7.5 | 7 | 10,325 | |
| 大和ハウス工業 | 15 | 14 | 41,678 | |
| 積水ハウス | 15 | 14 | 33,558 | |
| 日揮ホールディングス | 15 | 14 | 22,904 | |
| 食料品 (3.5%) | | | | |
| 日清製粉グループ本社 | 15 | 14 | 22,148 | |
| 明治ホールディングス | 3 | 2.8 | 17,976 | |
| 日本ハム | 7.5 | 7 | 24,990 | |
| サッポロホールディングス | 3 | 2.8 | 8,498 | |
| アサヒグループホールディングス | 15 | 14 | 56,882 | |
| キリンホールディングス | 15 | 14 | 26,733 | |
| 宝ホールディングス | 15 | 14 | 14,070 | |
| キッコーマン | 15 | 14 | 92,540 | |
| 味の素 | 15 | 14 | 55,986 | |
| ニチレイ | 7.5 | 7 | 18,788 | |
| 日本たばこ産業 | 15 | 14 | 35,889 | |
| 繊維製品 (0.1%) | | | | |
| 東洋紡 | 1.5 | 1.4 | 1,383 | |
| ユニチカ | 1.5 | — | — | |
| 帝人 | 3 | 2.8 | 3,544 | |
| 東レ | 15 | 14 | 10,148 | |
| パルプ・紙 (0.1%) | | | | |
| 王子ホールディングス | 15 | 14 | 7,266 | |
| 日本製紙 | 1.5 | 1.4 | 1,311 | |
| 化学 (7.1%) | | | | |
| クラレ | 15 | 14 | 14,378 | |
| 旭化成 | 15 | 14 | 13,105 | |
| レゾナック・ホールディングス | 1.5 | 1.4 | 2,961 | |
| 住友化学 | 15 | 14 | 6,580 | |
| 日産化学 | 15 | 14 | 82,180 | |
| 東ソー | 7.5 | 7 | 11,039 | |
| トクヤマ | 3 | 2.8 | 4,961 | |
| デンカ | 3 | 2.8 | 8,442 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|------------------------|---------|-----|---------|---|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 | 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 | |
| 信越化学工業 | 15 | 14 | 232,750 | |
| 三井化学 | 3 | 2.8 | 8,327 | |
| 三菱ケミカルグループ | 7.5 | 7 | 4,790 | |
| UBE | 1.5 | 1.4 | 2,700 | |
| 花王 | 15 | 14 | 70,420 | |
| DIC | 1.5 | 1.4 | 3,253 | |
| 富士フィルムホールディングス | 15 | 14 | 92,414 | |
| 資生堂 | 15 | 14 | 88,816 | |
| 日東電工 | 15 | 14 | 107,520 | |
| 医薬品 (7.6%) | | | | |
| 協和キリン | 15 | 14 | 40,334 | |
| 武田薬品工業 | 15 | 14 | 57,330 | |
| アステラス製薬 | 75 | 70 | 132,090 | |
| 住友ファーマ | 15 | 14 | 12,502 | |
| 塩野義製薬 | 15 | 14 | 86,646 | |
| 中外製薬 | 45 | 42 | 135,282 | |
| エーザイ | 15 | 14 | 113,442 | |
| 第一三共 | 45 | 42 | 173,628 | |
| 大塚ホールディングス | 15 | 14 | 56,798 | |
| 石油・石炭製品 (0.2%) | | | | |
| 出光興産 | 6 | 5.6 | 17,108 | |
| ENEOSホールディングス | 15 | 14 | 6,403 | |
| ゴム製品 (0.7%) | | | | |
| 横浜ゴム | 7.5 | 7 | 14,000 | |
| ブリヂストン | 15 | 14 | 65,940 | |
| ガラス・土石製品 (1.0%) | | | | |
| AGC | 3 | 2.8 | 12,572 | |
| 日本板硝子 | 1.5 | 1.4 | 858 | |
| 日本電気硝子 | 4.5 | 4.2 | 9,954 | |
| 住友大阪セメント | 1.5 | 1.4 | 4,438 | |
| 太平洋セメント | 1.5 | 1.4 | 2,853 | |
| 東海カーボン | 15 | 14 | 14,896 | |
| TOTO | 7.5 | 7 | 35,280 | |
| 日本碍子 | 15 | 14 | 23,940 | |
| 鉄鋼 (0.1%) | | | | |
| 日本製鉄 | 1.5 | 1.4 | 3,556 | |
| 神戸製鋼所 | 1.5 | 1.4 | 936 | |
| JFEホールディングス | 1.5 | 1.4 | 2,269 | |
| 大平洋金属 | 1.5 | 1.4 | 2,721 | |
| 非鉄金属 (0.9%) | | | | |
| 日本軽金属ホールディングス | 1.5 | 1.4 | 2,179 | |
| 三井金属鉱業 | 1.5 | 1.4 | 4,578 | |
| 東邦亜鉛 | 1.5 | 1.4 | 2,956 | |
| 三菱マテリアル | 1.5 | 1.4 | 3,032 | |

| 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 | 7.5 | 7 | 35,952 |
| DOWAホールディングス | 3 | 2.8 | 11,928 |
| 古河電気工業 | 1.5 | 1.4 | 3,347 |
| 住友電気工業 | 15 | 14 | 20,790 |
| フジクラ | 15 | 14 | 13,636 |
| 金属製品 (0.0%) | | | |
| SUMCO | 1.5 | 1.4 | 2,616 |
| 機械 (5.5%) | | | |
| 日本製鋼所 | 3 | 2.8 | 7,249 |
| オークマ | 3 | 2.8 | 13,132 |
| アマダ | 15 | 14 | 14,700 |
| SMC | — | 1.4 | 84,910 |
| 小松製作所 | 15 | 14 | 41,489 |
| 住友重機械工業 | 3 | 2.8 | 7,445 |
| 日立建機 | 15 | 14 | 41,426 |
| クボタ | 15 | 14 | 26,047 |
| 荏原製作所 | 3 | 2.8 | 13,538 |
| ダイキン工業 | 15 | 14 | 297,850 |
| 日本精工 | 15 | 14 | 9,814 |
| NTN | 15 | 14 | 3,640 |
| ジェイテクト | 15 | 14 | 12,656 |
| 三井E&Sホールディングス | 1.5 | 1.4 | 529 |
| 日立造船 | 3 | 2.8 | 2,212 |
| 三菱重工業 | 1.5 | 1.4 | 6,972 |
| IHI | 1.5 | 1.4 | 5,257 |
| 電気機器 (23.6%) | | | |
| コニカミノルタ | 15 | 14 | 7,084 |
| ミネベアミツミ | 15 | 14 | 29,386 |
| 日立製作所 | 3 | 2.8 | 18,144 |
| 三菱電機 | 15 | 14 | 17,997 |
| 富士電機 | 3 | 2.8 | 14,476 |
| 安川電機 | 15 | 14 | 62,440 |
| 日本電産 | — | 11.2 | 81,300 |
| オムロン | 15 | 14 | 93,058 |
| ジーエス・ユアサ コーポレーション | 3 | 2.8 | 5,975 |
| 日本電気 | 1.5 | 1.4 | 6,279 |
| 富士通 | 1.5 | 1.4 | 25,585 |
| 沖電気工業 | 1.5 | — | — |
| セイコーエプソン | 30 | 28 | 54,152 |
| パナソニック ホールディングス | 15 | 14 | 15,442 |
| シャープ | 15 | 14 | 13,818 |
| ソーニーグループ | 15 | 14 | 153,510 |
| TDK | 45 | 42 | 182,490 |
| アルプスアルパイン | 15 | 14 | 16,912 |
| 横河電機 | 15 | 14 | 29,400 |
| アドバンテスト | 30 | 28 | 250,880 |
| キーエンス | 1.5 | 1.4 | 77,112 |

| 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 | 15 | 14 | 18,340 |
| ファナック | 15 | 14 | 294,210 |
| 京セラ | 30 | 28 | 181,412 |
| 太陽誘電 | 15 | 14 | 59,150 |
| 村田製作所 | 12 | 11.2 | 80,472 |
| SCREENホールディングス | 3 | 2.8 | 25,984 |
| キャノン | 22.5 | 21 | 59,881 |
| リコー | 15 | 14 | 13,440 |
| 東京エレクトロン | 15 | 14 | 631,260 |
| 輸送用機器 (4.3%) | | | |
| デンソー | 15 | 14 | 91,980 |
| 川崎重工業 | 1.5 | 1.4 | 4,099 |
| 日産自動車 | 15 | 14 | 5,871 |
| いすゞ自動車 | 7.5 | 7 | 10,423 |
| トヨタ自動車 | 75 | 70 | 127,085 |
| 日野自動車 | 15 | 14 | 6,944 |
| 三菱自動車工業 | 1.5 | 1.4 | 653 |
| マツダ | 3 | 2.8 | 2,660 |
| 本田技研工業 | 30 | 28 | 85,876 |
| スズキ | 15 | 14 | 59,220 |
| SUBARU | 15 | 14 | 27,664 |
| ヤマハ発動機 | 15 | 14 | 41,944 |
| 精密機器 (4.2%) | | | |
| テルモ | 60 | 56 | 199,416 |
| ニコン | 15 | 14 | 17,010 |
| オリンパス | 60 | 56 | 131,572 |
| HOYA | — | 7 | 92,470 |
| シチズン時計 | 15 | 14 | 8,078 |
| その他製品 (2.7%) | | | |
| パンダイナムコホールディングス | 15 | 14 | 112,966 |
| 凸版印刷 | 7.5 | 7 | 13,153 |
| 大日本印刷 | 7.5 | 7 | 17,885 |
| ヤマハ | 15 | 14 | 66,920 |
| 任天堂 | 1.5 | 14 | 75,558 |
| 電気・ガス業 (0.2%) | | | |
| 東京電力ホールディングス | 1.5 | 1.4 | 604 |
| 中部電力 | 1.5 | 1.4 | 1,793 |
| 関西電力 | 1.5 | 1.4 | 1,705 |
| 東京瓦斯 | 3 | 2.8 | 6,997 |
| 大阪瓦斯 | 3 | 2.8 | 5,684 |
| 陸運業 (1.4%) | | | |
| 東武鉄道 | 3 | 2.8 | 8,268 |
| 東急 | 7.5 | 7 | 11,144 |
| 小田急電鉄 | 7.5 | 7 | 11,305 |
| 京王電鉄 | 3 | 2.8 | 12,684 |
| 京成電鉄 | 7.5 | 7 | 24,500 |
| 東日本旅客鉄道 | 1.5 | 1.4 | 10,103 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|------------------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 西日本旅客鉄道 | 1.5 | 1.4 | 7,474 |
| 東海旅客鉄道 | 1.5 | 1.4 | 21,700 |
| ヤマトホールディングス | 15 | 14 | 28,434 |
| NIPPON EXPRESSホールディングス | 1.5 | 1.4 | 10,122 |
| 海運業 (0.4%) | | | |
| 日本郵船 | 1.5 | 4.2 | 12,835 |
| 商船三井 | 1.5 | 4.2 | 13,566 |
| 川崎汽船 | 1.5 | 4.2 | 11,482 |
| 空運業 (0.0%) | | | |
| ANAホールディングス | 1.5 | 1.4 | 3,878 |
| 倉庫・運輸関連業 (0.2%) | | | |
| 三菱倉庫 | 7.5 | 7 | 20,174 |
| 情報・通信業 (11.7%) | | | |
| ネクソン | 30 | 28 | 82,152 |
| Zホールディングス | 6 | 5.6 | 1,926 |
| トレンドマイクロ | 15 | 14 | 84,000 |
| 日本電信電話 | 6 | 5.6 | 20,944 |
| KDDI | 90 | 84 | 326,340 |
| ソフトバンク | 15 | 14 | 20,447 |
| 東宝 | 1.5 | 1.4 | 6,426 |
| エヌ・ティ・ティ・データ | 75 | 70 | 133,490 |
| コナミグループ | 15 | 14 | 80,220 |
| ソフトバンクグループ | 90 | 84 | 497,616 |
| 卸売業 (2.8%) | | | |
| 双日 | 1.5 | 1.4 | 3,467 |
| 伊藤忠商事 | 15 | 14 | 56,700 |
| 丸紅 | 15 | 14 | 21,259 |
| 豊田通商 | 15 | 14 | 69,020 |
| 三井物産 | 15 | 14 | 53,396 |
| 住友商事 | 15 | 14 | 30,730 |
| 三菱商事 | 15 | 14 | 60,774 |
| 小売業 (11.4%) | | | |
| J. フロント リテイリング | 7.5 | 7 | 7,791 |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 15 | 14 | 18,592 |
| セブン&アイ・ホールディングス | 15 | 14 | 85,988 |
| 高島屋 | 7.5 | 7 | 12,110 |
| 丸井グループ | 15 | 14 | 29,372 |
| イオン | 15 | 14 | 36,449 |
| ファーストリテイリング | 15 | 14 | 1,028,860 |
| 銀行業 (0.8%) | | | |
| しずおかフィナンシャルグループ | - | 14 | 15,834 |
| コンソルディア・フィナンシャルグループ | 15 | 14 | 8,400 |
| SBI新生銀行 | 1.5 | - | - |
| あおぞら銀行 | 1.5 | 1.4 | 3,840 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 15 | 14 | 13,679 |
| りそなホールディングス | 1.5 | 1.4 | 1,053 |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 1.5 | 1.4 | 6,907 |

| 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 | 1.5 | 1.4 | 8,008 |
| 千葉銀行 | 15 | 14 | 14,378 |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 3 | 2.8 | 8,960 |
| 静岡銀行 | 15 | - | - |
| みずほフィナンシャルグループ | 1.5 | 1.4 | 2,860 |
| 証券・商品先物取引業 (0.2%) | | | |
| 大和証券グループ本社 | 15 | 14 | 8,414 |
| 野村ホールディングス | 15 | 14 | 7,030 |
| 松井証券 | 15 | 14 | 10,920 |
| 保険業 (1.0%) | | | |
| SOMPOホールディングス | 3 | 2.8 | 16,080 |
| MS&ADインシュアランスグループホールディングス | 4.5 | 4.2 | 17,593 |
| 第一生命ホールディングス | 1.5 | 1.4 | 4,249 |
| 東京海上ホールディングス | 7.5 | 21 | 57,771 |
| T&Dホールディングス | 3 | 2.8 | 5,829 |
| その他金融業 (0.7%) | | | |
| クレディセゾン | 15 | 14 | 23,226 |
| オリックス | - | 14 | 29,939 |
| 日本取引所グループ | 15 | 14 | 26,040 |
| 不動産業 (1.1%) | | | |
| 東急不動産ホールディングス | 15 | 14 | 8,582 |
| 三井不動産 | 15 | 14 | 31,486 |
| 三菱地所 | 15 | 14 | 22,974 |
| 東京建物 | 7.5 | 7 | 10,605 |
| 住友不動産 | 15 | 14 | 41,741 |
| サービス業 (4.7%) | | | |
| エムスリー | 36 | 33.6 | 119,884 |
| ディー・エヌ・エー | 4.5 | 4.2 | 7,282 |
| 電通グループ | 15 | 14 | 57,400 |
| サイバーエージェント | 12 | 11.2 | 13,193 |
| 楽天グループ | 15 | 14 | 8,708 |
| リクルートホールディングス | 45 | 42 | 171,654 |
| 日本郵政 | 15 | 14 | 15,575 |
| セコム | 15 | 14 | 104,328 |
| 合 計 | 株 数 ・ 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| | 銘柄数 < 比率 > | 225銘柄 | 225銘柄 < 94.0% > |

(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 678 | | 百万円 - |

■投資信託財産の構成

2023年1月14日現在

| 項 目 | | 当 期 | | 末 |
|-------------------------|--|------------------|---|-----------|
| | | 評 価 額 | 比 | 率 |
| 株 式 | | 千円 10,678,775 | | % 93.6 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | | 734,980 | | 6.4 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | | 11,413,755 | | 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

(2023年1月14日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------|-----------------|
| (A) 資 産 | 11,413,676,229円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 650,235,749 |
| 株 式(評価額) | 10,678,775,380 |
| 未 収 配 当 金 | 17,635,100 |
| 差 入 委 託 証 拠 金 | 67,030,000 |
| (B) 負 債 | 52,462,936 |
| 未 払 金 | 42,598,580 |
| 未 払 解 約 金 | 9,864,000 |
| 未 払 利 息 | 356 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 11,361,213,293 |
| 元 本 | 3,229,845,743 |
| 次 期 繰 越 損 益 金 | 8,131,367,550 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 3,229,845,743口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 35,176円 |

| | |
|-------------------------------|----------------|
| (注1) 期首元本額 | 3,407,767,709円 |
| 追加設定元本額 | 89,345,532円 |
| 一部解約元本額 | 267,267,498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 | 203,830,297円 |
| ボンドミックスポートフォリオ | 8,814,194円 |
| 財形株投 (一般財形30) | 12,648,730円 |
| 財形株投 (一般財形50) | 42,831,296円 |
| 財形株投 (年金・住宅財形30) | 12,389,121円 |
| インデックス マネジメント ファンド 225 | 1,860,201,291円 |
| インデックス マネジメント ファンド 225 (DC年金) | 174,387,821円 |
| インデックス マネジメント ファンド 225 (変額年金) | 486,270,832円 |
| 太陽ミリオン・インデックスポートフォリオ | 411,283,941円 |
| 太陽ミリオン・ボンドミックスポートフォリオ | 17,188,220円 |
| 期末元本合計 | 3,229,845,743円 |

■損益の状況

当期 自2022年1月15日 至2023年1月14日

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------|----------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | 250,478,066円 |
| 受 取 配 当 金 | 250,620,340 |
| そ の 他 収 益 金 | 6,652 |
| 支 払 利 息 | △148,926 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | △838,575,859 |
| 売 買 益 | 570,016,229 |
| 売 買 損 | △1,408,592,088 |
| (C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益 | △23,565,890 |
| 取 引 益 | 114,650,420 |
| 取 引 損 | △138,216,310 |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C) | △611,663,683 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 9,215,128,267 |
| (F) 解 約 差 損 益 金 | △702,466,502 |
| (G) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 230,369,468 |
| (H) 合 計(D+E+F+G) | 8,131,367,550 |
| 次 期 繰 越 損 益 金(H) | 8,131,367,550 |

- (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。

《お知らせ》

約款変更のお知らせ

■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)