

運用報告書 (全体版)

第9期<決算日2023年10月24日>

みずほ日経平均ファンド<DC年金>

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	2015年6月5日から無期限です。	
運用方針	主として「MHAM株式インデックス225マザーファンド」を通じて、わが国の株式で積極的な運用を行い、日経平均株価(日経225)をベンチマークとして、日経平均株価の動きに連動する投資成果を目指します。	
主要投資対象	みずほ日経平均ファンド<DC年金>	MHAM株式インデックス225マザーファンド
	MHAM株式インデックス225マザーファンド	わが国の金融商品取引所に上場されている株式のうち総合的な市場動向を反映する日経平均株価(225種・東証)に採用された銘柄を主要投資対象とします。
運用方法	日経平均株価に採用されている銘柄の中から200~225銘柄に、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を行います。株式の組入比率は、高位を保ちます。	
組入制限	みずほ日経平均ファンド<DC年金>	株式への実質投資割合には、制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。
	MHAM株式インデックス225マザーファンド	株式への投資には、制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	毎期、原則として経費控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を分配対象額の範囲とし、分配金額は、委託会社が基準価額の水準や市況動向等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わないことがあります。	

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、「みずほ日経平均ファンド<DC年金>」は、2023年10月24日に第9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/>

みずほ日経平均ファンド<DC年金>

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			日経平均株価		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
	円	円	%	円	%	%	%	百万円
5期(2019年10月24日)	11,957	0	5.0	22,750.60	3.0	97.3	2.6	522
6期(2020年10月26日)	12,556	0	5.0	23,494.34	3.3	97.1	2.8	683
7期(2021年10月25日)	15,495	0	23.4	28,600.41	21.7	97.6	2.3	987
8期(2022年10月24日)	14,892	0	△3.9	26,974.90	△5.7	98.0	1.9	1,081
9期(2023年10月24日)	17,469	0	17.3	31,062.35	15.2	97.1	2.8	1,309

(注1) 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2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注3) 「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4) △(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		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)	円	%	円	%	%	%
2022年10月24日	14,892	-	26,974.90	-	98.0	1.9
10月末	15,229	2.3	27,587.46	2.3	98.4	1.6
11月末	15,440	3.7	27,968.99	3.7	97.8	2.1
12月末	14,426	△3.1	26,094.50	△3.3	98.4	1.6
2023年1月末	15,104	1.4	27,327.11	1.3	98.1	1.9
2月末	15,175	1.9	27,445.56	1.7	98.3	1.6
3月末	15,645	5.1	28,041.48	4.0	97.8	2.2
4月末	16,097	8.1	28,856.44	7.0	97.9	2.0
5月末	17,233	15.7	30,887.88	14.5	97.2	2.8
6月末	18,534	24.5	33,189.04	23.0	98.4	1.6
7月末	18,522	24.4	33,172.22	23.0	98.3	1.7
8月末	18,221	22.4	32,619.34	20.9	98.0	1.9
9月末	17,918	20.3	31,857.62	18.1	97.6	2.4
(期末)						
2023年10月24日	17,469	17.3	31,062.35	15.2	97.1	2.8

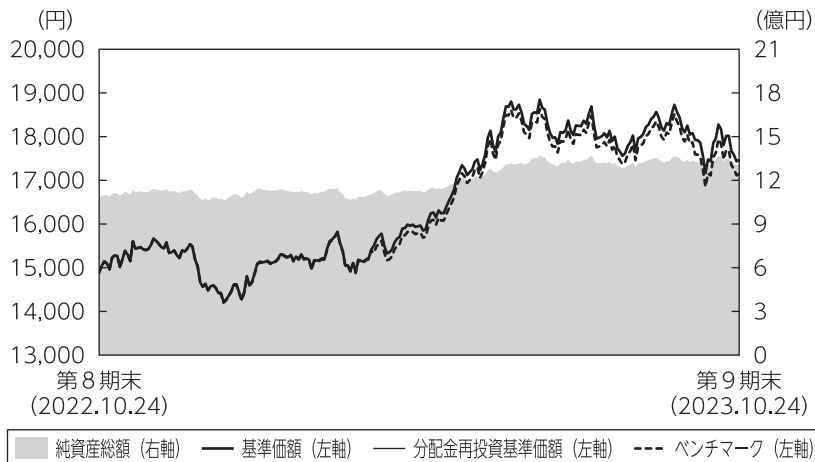
(注1) 騰落率は期首比です。

(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10月25日から2023年10月24日まで)

基準価額等の推移



第9期首： 14,892円
第9期末： 17,469円
(既払分配金0円)
騰落率： 17.3%
(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はありません。
- (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

MHAM株式インデックス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、期初から2023年6月にかけて、円安ドル高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、上昇基調で推移しました。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。期末にかけては、米国の金融引き締めのもたる長期化懸念や中東情勢の緊迫化が嫌気されたことなどから、下落基調で推移しました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

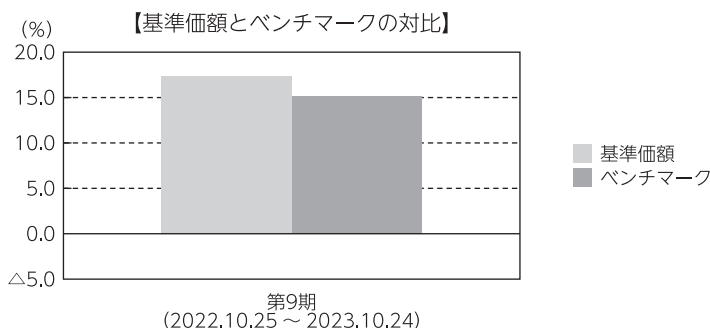
当期の運用につきましては、当ファンドの運用方針に従い、MHAM株式インデックス225マザーファンド受益証券の組入比率を高位に維持しました。

●MHAM株式インデックス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15.2%上昇しました。当ファンドはベンチマークを2.1%程度上回りました。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

当期の収益分配金は、基準価額の水準や市況動向等を勘案した結果、分配を見送らせていただきました。なお、収益分配に充てなかった収益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当期
	2022年10月25日 ～2023年10月24日
当期分配金（税引前）	－円
対基準価額比率	－％
当期の収益	－円
当期の収益以外	－円
翌期繰越分配対象額	7,469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、MHAM株式インデックス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。

●MHAM株式インデックス225マザーファンド

今後の運用につきましても、財務リスク等を考慮しつつ、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9期		項目の概要
	(2022年10月25日 ～2023年10月24日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	45円	0.275%	(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16,531円です。
(投信会社)	(20)	(0.121)	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)	(20)	(0.121)	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)	(5)	(0.033)	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
(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	0.002	(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)	(0)	(0.002)	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	46	0.277	

(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。

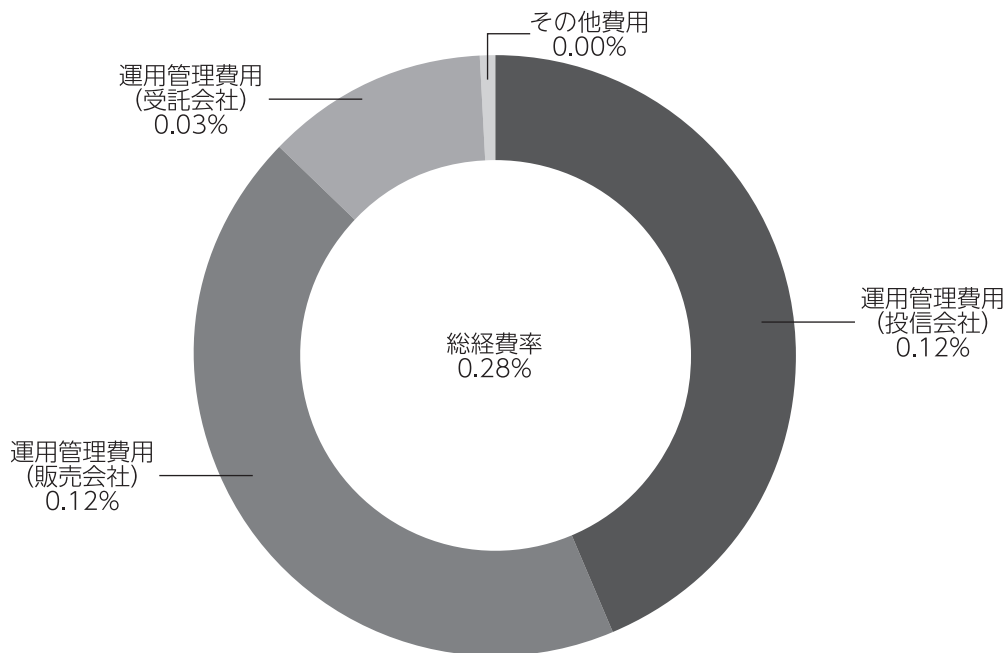
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.28%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。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2022年10月25日から2023年10月24日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
MHAM株式インデックス225マザーファンド	64,600	286,891	56,553	243,912

■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	MHAM株式インデックス225マザーファンド
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	62,544,903千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	167,977,798千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.37

(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10月25日から2023年10月24日まで）

【みずほ日経平均ファンド<DC年金>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)	13千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	3千円
(B) / (A)	26.3%

(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。

【MHAM株式インデックス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	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
区 分	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株 式	21,867	6,129	28.0	40,677	261	0.6
株 式 先 物 取 引	73,745	13,678	18.5	72,809	8,681	11.9

平均保有割合 0.7%

(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 4	百万円 9	百万円 44

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
株 式	百万円 1

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
MHAM株式インデックス225マザーファンド	千円 272,827	千円 280,874	千円 1,309,128

■投資信託財産の構成

2023年10月24日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
MHAM株式インデックス225マザーファンド	千円 1,309,128	% 99.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,117	0.2
投 資 信 託 財 産 総 額	1,311,246	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10月24日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	1,311,246,568円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,896,735
MHAM株式インデックス225 マザーファンド(評価額)	1,309,128,833
未 収 入 金	221,000
(B) 負 債	2,028,658
未 払 解 約 金	242,166
未 払 信 託 報 酬	1,776,490
そ の 他 未 払 費 用	10,002
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	1,309,217,910
元 本	749,446,071
次 期 繰 越 損 益 金	559,771,839
(D) 受 益 権 総 口 数	749,446,071口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	17,469円

(注) 期首における元本額は725,955,733円、当期中における追加設定元本額は270,201,316円、同解約元本額は246,710,978円です。

■損益の状況

当期 自2022年10月25日 至2023年10月24日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△779円
受 取 利 息	113
支 払 利 息	△892
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	150,713,110
売 買 益	184,528,383
売 買 損	△33,815,273
(C) 信 託 報 酬 等	△3,317,497
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	147,394,834
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	65,559,606
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	346,817,399
(配 当 等 相 当 額)	(335,127,272)
(売 買 損 益 相 当 額)	(11,690,127)
(G) 合 計 (D + E + F)	559,771,839
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	559,771,839
追 加 信 託 差 損 益 金	346,817,399
(配 当 等 相 当 額)	(335,798,352)
(売 買 損 益 相 当 額)	(11,019,047)
分 配 準 備 積 立 金	212,954,440

(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	24,180,415円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	89,310,709
(c) 収 益 調 整 金	346,817,399
(d) 分 配 準 備 積 立 金	99,463,316
(e) 当 期 分 配 対 象 額 (a + b + c + d)	559,771,839
(f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	7,469.14
(g) 分 配 金	0
(h) 1 万 口 当 た り 分 配 金	0

■分配金のお知らせ

当期の収益分配金は、基準価額の水準や市況動向等を勘案した結果、分配を見送らせていただきました。

《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「MHAM株式インデックス225マザーファンド」において、新NISA制度の成長投資枠の要件に沿った表記に改めるため、デリバティブの使用目的を明確化しました。

(2023年7月25日)

MHAM株式インデックス225マザーファンド

運用報告書

第21期（決算日 2023年10月24日）

（計算期間 2022年10月25日～2023年10月24日）

MHAM株式インデックス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	2002年9月20日から無期限です。
運用方針	主としてわが国の株式で積極的な運用を行い、日経平均株価（日経225）をベンチマークとして、日経平均株価の動きに連動する投資成果を目指します。日経平均株価に採用されている銘柄の中から200～225銘柄に、原則として上記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を行います。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所に上場されている株式のうち総合的な市場動向を反映する日経平均株価（225種・東証）に採用された銘柄を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資には、制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		日経平均株価 (ベンチマーク)		株式 組入比率	株式 先物比率	純資 産額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
	円	%	円	%	%	%	百万円
17期（2019年10月24日）	31,552	5.3	22,750.60	3.0	97.3	2.6	177,788
18期（2020年10月26日）	33,224	5.3	23,494.34	3.3	97.1	2.8	145,596
19期（2021年10月25日）	41,115	23.8	28,600.41	21.7	97.6	2.3	161,273
20期（2022年10月24日）	39,623	△3.6	26,974.90	△5.7	98.0	1.9	163,938
21期（2023年10月24日）	46,609	17.6	31,062.35	15.2	97.2	2.8	170,902

（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）。

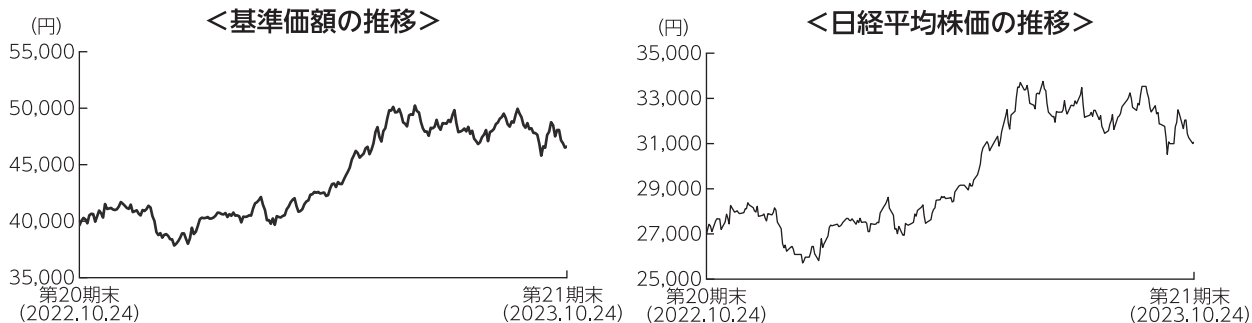
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		日 経 平 均 株 価		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率
	円	騰 落 率 %	(ベンチマーク) 円	騰 落 率 %		
(期 首) 2022年10月24日	39,623	—	26,974.90	—	98.0	1.9
10月末	40,521	2.3	27,587.46	2.3	98.4	1.6
11月末	41,093	3.7	27,968.99	3.7	97.8	2.1
12月末	38,401	△3.1	26,094.50	△3.3	98.4	1.6
2023年 1 月末	40,217	1.5	27,327.11	1.3	98.1	1.9
2 月末	40,416	2.0	27,445.56	1.7	98.4	1.6
3 月末	41,675	5.2	28,041.48	4.0	97.8	2.2
4 月末	42,890	8.2	28,856.44	7.0	97.9	2.0
5 月末	45,928	15.9	30,887.88	14.5	97.2	2.8
6 月末	49,406	24.7	33,189.04	23.0	98.4	1.6
7 月末	49,387	24.6	33,172.22	23.0	98.3	1.7
8 月末	48,594	22.6	32,619.34	20.9	98.0	1.9
9 月末	47,798	20.6	31,857.62	18.1	97.6	2.4
(期 末) 2023年10月24日	46,609	17.6	31,062.35	15.2	97.2	2.8

(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10月25日から2023年10月24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17.6%上昇しました。

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、期初から2023年6月にかけて、円安ドル高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、上昇基調で推移しました。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。期末にかけては、米国の金融引き締めのもる長期化懸念や中東情勢の緊迫化が嫌気されたことなどから、下落基調で推移しました。

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15.2%上昇しました。当ファンドはベンチマークを2.4%程度上回りました。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。

今後の運用方針

今後の運用につきましても、財務リスク等を考慮しつつ、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	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44,048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10月25日から2023年10月24日まで)

(1) 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上 場	千株 5,022 (7,296)	千円 21,867,580 (-)	千株 9,782.8	千円 40,677,322

(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 73,745	百万円 72,809	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	62,544,903千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	167,977,798千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.37

(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10月25日から2023年10月24日まで)

(1) 期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$ %	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$ %
株 式	百万円 21,867	百万円 6,129	28.0	百万円 40,677	百万円 261	0.6
株 式 先 物 取 引	73,745	13,678	18.5	72,809	8,681	11.9

(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 4	百万円 9	百万円 44

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
株 式	百万円 1

(4) 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)	1,893千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	493千円
(B) / (A)	26.0%

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。

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額	
東日本旅客鉄道	千株	千株	千円				セブ&アイ・ホールディングス	千株	千株	千円				住友不動産	千株	千株	千円				
西日本旅客鉄道	20.4	17.8	136,917				高島屋	204	178	939,128				サービス業 (4.4%)	204	178	657,532				
東海旅客鉄道	20.4	89	297,705				丸井グループ	204	178	417,588				エムスリー	489.6	427.2	1,013,959				
ヤマトホールディングス	204	178	428,891				イオン	204	178	542,900				ディー・エヌ・エー	61.2	53.4	77,964				
NIPPON EXPRESSホールディングス	20.4	17.8	135,030				ニトリホールディングス	-	53.4	836,244				電通グループ	204	178	773,588				
海運業 (0.4%)							ファーストリテイリング	204	534	18,097,260				オリエンタルランド	-	178	828,590				
日本郵船	61.2	53.4	198,274				銀行業 (0.7%)							サイバーエージェント	163.2	142.4	112,908				
商船三井	61.2	53.4	212,104				じぶおかフィナンシャルグループ	204	178	217,872				楽天グループ	204	178	101,388				
川崎汽船	61.2	53.4	267,160				コソルティ・フィナンシャルグループ	204	178	120,773				リクルートホールディングス	61.2	53.4	2,321,832				
空運業 (0.3%)							あおぞら銀行	20.4	17.8	51,005				日本郵政	204	178	228,908				
日本航空	-	178	477,752				三菱UFJフィナンシャル・グループ	204	178	216,359				セコム	204	178	1,804,030				
ANAホールディングス	20.4	17.8	51,744				りそなホールディングス	20.4	17.8	13,949				合計	株数・金額	千株	千株	千円			
倉庫・運輸関連業 (0.2%)							三井住友トラスト・ホールディングス	20.4	17.8	97,953				銘柄数<比率>	39,045.6	41,580.8	166,035.069				
三菱倉庫	102	89	343,095				三井住友フィナンシャルグループ	20.4	17.8	126,308					225銘柄	225銘柄	<97.2%>				
情報・通信業 (10.6%)							干葉銀行	204	178	189,570				(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。						
ネクソン	408	356	906,732				ぶくおかフィナンシャルグループ	40.8	35.6	133,500				(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。						
メルカリ	-	178	539,162				みずほフィナンシャルグループ	20.4	17.8	44,544				(注3)	評価額の単位未満は切捨ててあります。						
LINEヤフー	81.6	71.2	27,198				証券・商品先物取引業 (0.2%)														
トレンドマイクロ	204	178	992,350				大和証券グループ本社	204	178	150,392											
日本電信電話	81.6	1,780	308,830				野村ホールディングス	204	178	102,439											
KDDI	1,224	1,068	4,756,872				松井証券	204	-	-											
ソフトバンク	204	178	298,239				保険業 (0.9%)														
東宝	20.4	17.8	87,843				SOMPOホールディングス	40.8	35.6	224,814											
NTTデータグループ	1,020	890	1,554,385				MS&ADインシュアランスグループホールディングス	61.2	53.4	287,665											
コナミグループ	204	178	1,435,214				第一生命ホールディングス	20.4	17.8	54,539											
ソフトバンクグループ	1,224	1,068	6,656,844				東京海上ホールディングス	306	267	879,231											
卸売業 (3.3%)							T&Dホールディングス	40.8	35.6	89,178											
双日	20.4	17.8	54,574				その他金融業 (0.8%)														
伊藤忠商事	204	178	946,604				クレディセゾン	204	178	392,134											
丸紅	204	178	388,218				オリックス	204	178	480,956											
豊田通商	204	178	1,412,786				日本取引所グループ	204	178	526,257											
三井物産	204	178	952,122				不動産業 (1.2%)														
住友商事	204	178	518,336				東急不動産ホールディングス	204	178	156,711											
三菱商事	204	178	1,220,902				三井不動産	204	178	578,678											
小売業 (12.9%)							三菱地所	204	178	346,032											
J.フロント リテイリング	102	89	123,087				東京建物	102	89	179,157											
三越伊勢丹ホールディングス	204	178	288,805																		

(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
国内	百万円	百万円
日 経 平 均	4,797	-

■投資信託財産の構成

2023年10月24日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	166,035,069	96.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	6,581,568	3.8
投 資 信 託 財 産 総 額	172,616,638	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10月24日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	172,603,351,526円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,135,397,070
株 式(評価額)	166,035,069,620
未 収 入 金	1,861,828,136
未 収 配 当 金	1,294,436,700
差 入 委 託 証 拠 金	276,620,000
(B) 負 債	1,700,409,820
未 払 金	44,050,820
未 払 解 約 金	1,656,359,000
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	170,902,941,706
元 本	36,667,405,379
次 期 繰 越 損 益 金	134,235,536,327
(D) 受 益 権 総 口 数	36,667,405,379口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	46,609円

(注1) 期首元本額 41,375,064,444円
 追加設定元本額 4,899,570,238円
 一部解約元本額 9,607,229,303円

(注2) 期末における元本の内訳
 みずほ日経平均ファンド<DC年金> 280,874,688円
 インデックスミリオン 936,323,940円
 ボンドミックスミリオン 80,039,314円
 MHAM株式インデックスファンド225 35,258,539,325円
 MHAM株式インデックス225VA [適格機関投資家専用] 102,046,069円
 MHAM株式インデックス225VA2 [適格機関投資家専用] 9,582,043円
 期末元本合計 36,667,405,379円

■損益の状況

当期 自2022年10月25日 至2023年10月24日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	3,533,538,027円
受 取 配 当 金	3,534,914,836
受 取 利 息	29,714
そ の 他 収 益 金	150,535
支 払 利 息	△1,557,058
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	24,143,963,294
売 買 益	29,871,091,169
売 買 損	△5,727,127,875
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	679,850,220
取 引 益	1,379,915,280
取 引 損	△700,065,060
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	28,357,351,541
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	122,563,894,721
(F) 解 約 差 損 益 金	△32,973,526,697
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	16,287,816,762
(H) 合 計(D + E + F + G)	134,235,536,327
次 期 繰 越 損 益 金(H)	134,235,536,327

(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

- 新NISA制度の成長投資枠の要件に沿った表記に改めるため、デリバティブの使用目的を明確化しました。
(2023年7月25日)