

運用報告書 (全体版)

第10期<決算日2024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、2024年10月24日に第10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
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
10期(2024年10月24日)	21,769	0	24.6	38,143.29	22.8	97.0	2.9	1,701

(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	%	%	%
2023年10月24日	17,469	-	31,062.35	-	97.1	2.8
10月末	17,353	△0.7	30,858.85	△0.7	97.7	2.2
11月末	18,828	7.8	33,486.89	7.8	98.2	1.7
12月末	18,840	7.8	33,464.17	7.7	97.6	2.3
2024年1月末	20,427	16.9	36,286.71	16.8	97.6	2.4
2月末	22,060	26.3	39,166.19	26.1	98.2	1.8
3月末	22,883	31.0	40,369.44	30.0	97.6	2.5
4月末	21,766	24.6	38,405.66	23.6	97.8	2.1
5月末	21,814	24.9	38,487.90	23.9	98.1	1.8
6月末	22,450	28.5	39,583.08	27.4	97.6	2.3
7月末	22,176	26.9	39,101.82	25.9	97.5	2.5
8月末	21,928	25.5	38,647.75	24.4	98.0	2.0
9月末	21,647	23.9	37,919.55	22.1	97.8	2.1
(期末)						
2024年10月24日	21,769	24.6	38,143.29	22.8	97.0	2.9

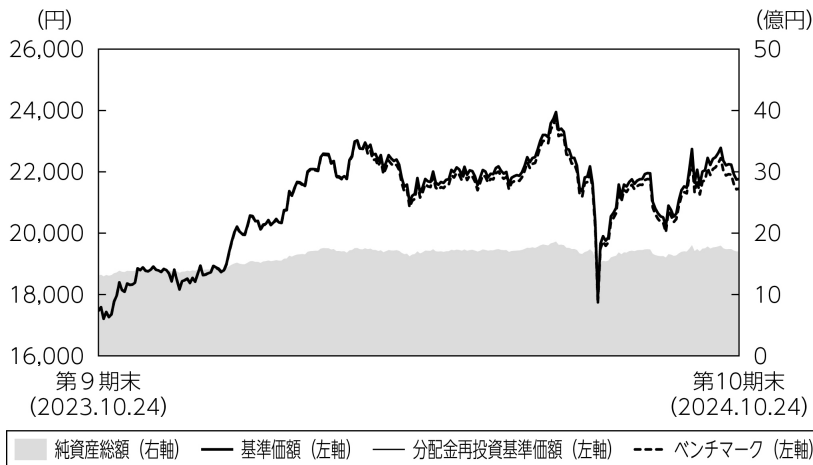
(注1) 騰落率は期首比です。

(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 (2023年10月25日から2024年10月24日まで)

基準価額等の推移



第10期首 : 17,469円
第10期末 : 21,769円
(既払分配金0円)
騰落率 : 24.6%
(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、2024年1月、新NISA開始に伴う個人投資家の資金流入期待などを背景に、大きく上昇しました。その後も上昇基調は続き、2月には、日経平均株価がおよそ34年ぶりに史上最高値を更新しました。8月上旬には、日銀の想定以上の金融引き締め姿勢や米景気の先行き懸念などを背景に円高ドル安が急速に進行したことが嫌気され、日経平均株価は歴史的な下落となりました。しかし、期末にかけては、円高修正が進んだことから、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

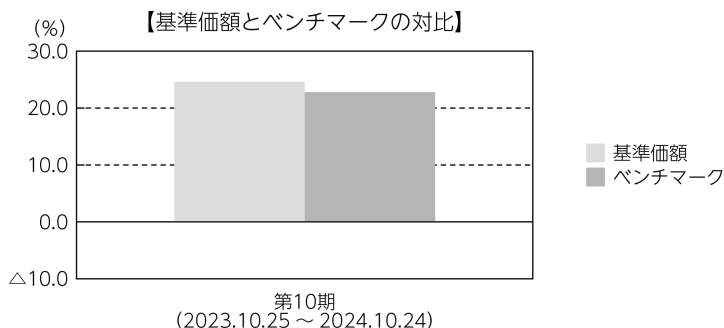
当期の運用につきましては、当ファンドの運用方針に従い、MHAM株式インデックス225マザーファンド受益証券の組入比率を高位に維持しました。

●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22.8%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

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
	2023年10月25日 ～2024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	11,769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10期		項目の概要
	(2023年10月25日 ～2024年10月24日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	58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21,064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)	(25)	(0.121)	
(販売会社)	(25)	(0.121)	
(受託会社)	(7)	(0.033)	
(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 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(監査費用)	(0)	(0.002)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	58	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。

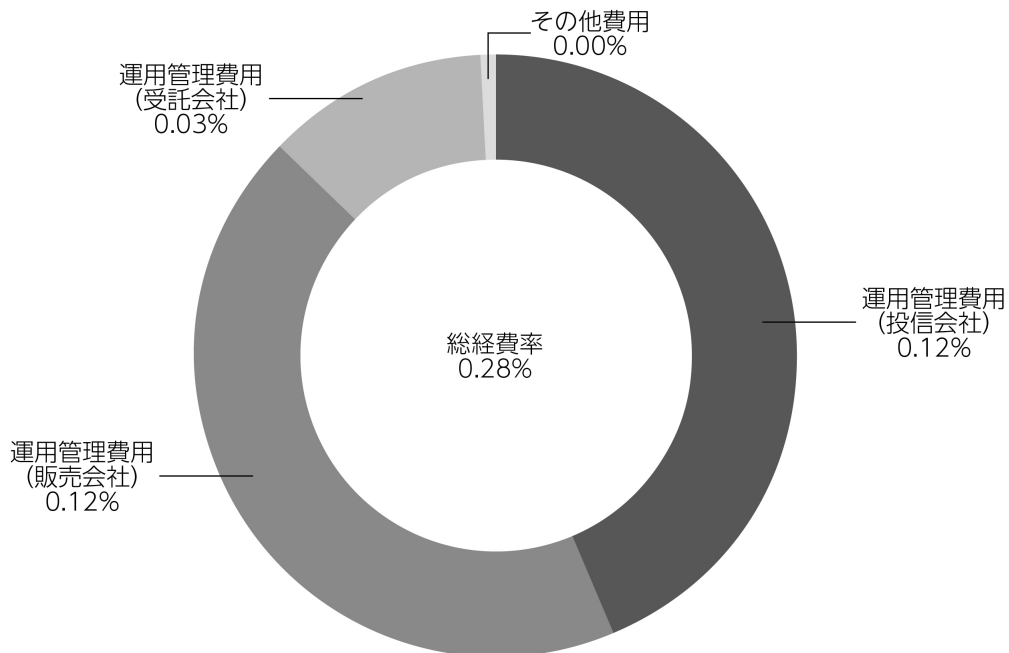
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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（2023年10月25日から2024年10月24日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
MHAM株式インデックス225マザーファンド	千□ 63,422	千円 354,514	千□ 52,207	千円 297,269

■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	72,587,318千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	190,719,311千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.38

(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（2023年10月25日から2024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)	11千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	11千円
(B) / (A)	98.6%

(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	$\frac{D}{C}$
株 式 先 物 取 引	百万円 75,905	百万円 75,905	% 100.0	百万円 75,846	百万円 75,846	% 100.0

平均保有割合 0.8%

(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 6	百万円 10	百万円 50

(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 67

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□ 280,874	千□ 292,090	千円 1,701,220

■投資信託財産の構成

2024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 1,701,220	% 99.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	5,229	0.3
投 資 信 託 財 産 総 額	1,706,449	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

(2024年10月24日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	1,706,449,228円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,516,086
MHAM株式インデックス225 マザーファンド(評価額)	1,701,220,142
未 収 入 金	2,713,000
(B) 負 債	5,087,624
未 払 解 約 金	2,721,077
未 払 信 託 報 酬	2,353,254
そ の 他 未 払 費 用	13,293
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	1,701,361,604
元 本	781,548,797
次 期 繰 越 損 益 金	919,812,807
(D) 受 益 権 総 口 数	781,548,797口
1万口当たり基準価額 (C/D)	21,769円

(注) 期首における元本額は749,446,071円、当期中における追加設定元本額は275,808,076円、同解約元本額は243,705,350円です。

■損益の状況

当期 自2023年10月25日 至2024年10月24日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	2,249円
受 取 利 息	2,302
支 払 利 息	△53
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	257,221,200
売 買 益	330,104,553
売 買 損	△72,883,353
(C) 信 託 報 酬 等	△4,492,362
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	252,731,087
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	155,307,191
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	511,774,529
(配 当 等 相 当 額)	(416,951,612)
(売 買 損 益 相 当 額)	(94,822,917)
(G) 合 計 (D+E+F)	919,812,807
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	919,812,807
追 加 信 託 差 損 益 金	511,774,529
(配 当 等 相 当 額)	(417,519,140)
(売 買 損 益 相 当 額)	(94,255,389)
分 配 準 備 積 立 金	408,038,278

(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	29,668,298円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	223,062,789
(c) 収 益 調 整 金	511,774,529
(d) 分 配 準 備 積 立 金	155,307,191
(e) 当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d)	919,812,807
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	11,769.10
(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。

MHAM株式インデックス225マザーファンド

運用報告書

第22期（決算日 2024年10月24日）

（計算期間 2023年10月25日～2024年10月24日）

MHAM株式インデックス225マザーファンドの第22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
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
22期 (2024年10月24日)	58,243	25.0	38,143.29	22.8	97.1	2.9	196,025

(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）。

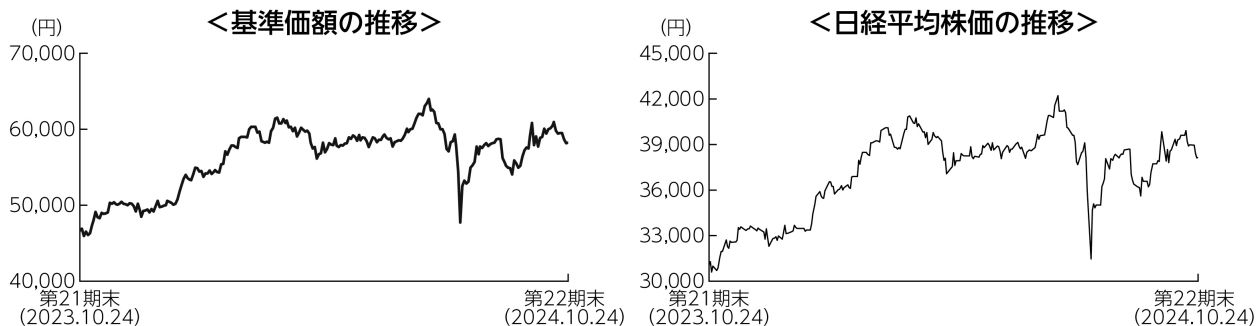
■当期中の基準価額と市況の推移

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) 2023年10月24日	46,609	—	31,062.35	—	97.2	2.8
10月末	46,301	△0.7	30,858.85	△0.7	97.7	2.2
11月末	50,248	7.8	33,486.89	7.8	98.2	1.7
12月末	50,292	7.9	33,464.17	7.7	97.6	2.3
2024年 1 月末	54,543	17.0	36,286.71	16.8	97.6	2.4
2 月末	58,917	26.4	39,166.19	26.1	98.2	1.8
3 月末	61,126	31.1	40,369.44	30.0	97.6	2.5
4 月末	58,157	24.8	38,405.66	23.6	97.8	2.1
5 月末	58,299	25.1	38,487.90	23.9	98.1	1.8
6 月末	60,012	28.8	39,583.08	27.4	97.6	2.3
7 月末	59,295	27.2	39,101.82	25.9	97.5	2.5
8 月末	58,645	25.8	38,647.75	24.4	98.0	2.0
9 月末	57,907	24.2	37,919.55	22.1	97.9	2.1
(期 末) 2024年10月24日	58,243	25.0	38,143.29	22.8	97.1	2.9

(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（2023年10月25日から2024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25.0%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、2024年1月、新NISA開始に伴う個人投資家の資金流入期待などを背景に、大きく上昇しました。その後も上昇基調は続き、2月には、日経平均株価がおよそ34年ぶりに史上最高値を更新しました。8月上旬には、日銀の想定以上の金融引き締め姿勢や米景気の先行き懸念などを背景に円高ドル安が急速に進行したことが嫌気され、日経平均株価は歴史的な下落となりました。しかし、期末にかけては、円高修正が進んだことから、戻りを試す展開となりました。

ポートフォリオについて

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22.8%上昇しました。当ファンドはベンチマークを2.2%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
(b) その他費用 (その他)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	0	0.001	
期中の平均基準価額は56,281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 (2023年10月25日から2024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 6,485.8 (12,801.8)	千円 29,465,538 (-)	千株 9,618.4	千円 43,121,779

(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 75,905	百万円 75,846	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	72,587,318千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	190,719,311千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.38

(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 (2023年10月25日から2024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		
	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 先 物 取 引	百万円 75,905	百万円 75,905	% 100.0	百万円 75,846	百万円 75,846	% 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 6	百万円 10	百万円 50

(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 67

(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)	1,380千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	1,361千円
(B) / (A)	98.6%

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	
ヤマトホールディングス	千株	千株	千円				高島屋	千株	千株	千円				ディー・エヌ・エー	千株	千株	千円				
NIPPON EXPRESS(株)	17.8	16.4	257,808				丸井グループ	89	164	195,160				電通グループ	53.4	49.2	84,943				
海運業 (0.4%)			122,622				イオン	178	164	388,762				オリエンタルランド	178	164	760,304				
日本郵船	53.4	49.2	252,838				ニトリホールディングス	178	164	610,408				サイバーエージェント	178	164	583,020				
商船三井	53.4	49.2	247,279				ファーストリテイリング	53.4	82	1,606,790				楽天グループ	142.4	131.2	130,675				
川崎汽船	53.4	147.6	312,912				銀行業 (0.7%)	534	442.8	22,228,560				リクルートホールディングス	178	164	148,354				
空運業 (0.2%)							しずおかフィナンシャルグループ	178	164	201,310				日本郵政	534	492	4,566,252				
日本航空	178	164	393,108				三井住友フィナンシャルグループ	178	164	122,737				セコム	178	164	225,336				
ANAホールディングス	17.8	16.4	47,773				あおぞら銀行	178	164	41,688				合計	株数・金額	千株	千株	千円			
倉庫・運輸関連業 (0.2%)							三菱UFJフィナンシャル・グループ	178	164	256,660				銘柄数<比率>	41,580.8	51,250	190,244,631				
三菱倉庫	89	82	422,874				りそなホールディングス	17.8	16.4	16,270					225銘柄	225銘柄	<97.1%>				
情報・通信業 (11.3%)							三井住友トラストグループ	17.8	32.8	108,141											
ネクソン	356	328	857,884				三井住友フィナンシャルグループ	17.8	49.2	153,258											
野村総合研究所	-	164	795,892				干葉銀行	178	164	181,302											
メルカリ	178	164	347,680				ぶくおかフィナンシャルグループ	35.6	32.8	113,324											
LINEヤフー	71.2	65.6	27,046				みずほフィナンシャルグループ	17.8	16.4	50,840											
トレンドマイクロ	178	164	1,295,272				証券・商品先物取引業 (0.2%)														
日本電信電話	1,780	1,640	239,276				大和証券グループ本社	178	164	165,148											
KDDI	1,068	984	4,646,448				野村ホールディングス	178	164	126,739											
ソフトバンク	178	1,640	306,680				保険業 (1.2%)														
東宝	17.8	16.4	95,038				SOMPOホールディングス	35.6	98.4	316,060											
NTTデータグループ	890	820	1,950,370				MS&ADインシュアランス	53.4	147.6	503,611											
コナミグループ	178	164	2,315,680				グループホールディングス	17.8	16.4	61,975											
ソフトバンクグループ	1,068	984	8,651,328				第一生命ホールディングス	267	246	1,356,690											
卸売業 (3.1%)							東京海上ホールディングス	35.6	32.8	80,966											
双日	17.8	16.4	53,332				T&Dホールディングス														
伊藤忠商事	178	164	1,238,856				その他金融業 (0.9%)														
丸紅	178	164	383,432				クレディセゾン	178	164	556,124											
豊田通商	178	492	1,304,046				オリックス	178	164	527,588											
三井物産	178	328	1,016,800				日本取引所グループ	178	328	588,104											
住友商事	178	164	530,048				不動産業 (1.1%)														
三菱商事	178	492	1,371,450				東急不動産ホールディングス	178	164	159,850											
小売業 (14.6%)							三井不動産	178	492	648,948											
J.フロント リテイリング	89	82	128,535				三菱地所	178	164	376,052											
ZOZO	-	164	837,056				東京建物	89	82	203,770											
三越伊勢丹ホールディングス	178	164	372,280				住友不動産	178	164	760,960											
セブン&アイホールディングス	178	492	1,114,872				サービス業 (4.7%)														
良品計画	-	164	386,056				エムスリー	427.2	393.6	640,977											

(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

国内	銘柄	別	当 期		末
			買 建	額	売 建
				百万円	百万円
	日 経 平 均			5,724	-

■投資信託財産の構成

2024年10月24日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	190,244,631	96.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	7,960,421	4.0
投 資 信 託 財 産 総 額	198,205,053	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

(2024年10月24日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	198,205,053,095円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,826,290,881
株 式(評価額)	190,244,631,360
未 収 入 金	2,320,068,082
未 収 配 当 金	1,481,785,200
差 入 委 託 証 拠 金	332,277,572
(B) 負 債	2,180,021,480
未 払 金	93,791,480
未 払 解 約 金	2,086,230,000
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	196,025,031,615
元 本	33,656,510,570
次 期 繰 越 損 益 金	162,368,521,045
(D) 受 益 権 総 口 数	33,656,510,570口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	58,243円

(注1) 期首元本額 36,667,405,379円
追加設定元本額 3,786,382,896円
一部解約元本額 6,797,277,705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> 292,090,061円
インデックスミリオン 866,015,473円
bondミックスミリオン 72,058,971円
MHAM株式インデックスファンド225 32,340,489,080円
MHAM株式インデックスファンド225VA [適格機関投資家専用] 76,501,719円
MHAM株式インデックスファンド225VA 2 [適格機関投資家専用] 9,355,266円
期末元本合計 33,656,510,570円

■損益の状況

当期 自2023年10月25日 至2024年10月24日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	3,578,000,701円
受 取 配 当 金	3,573,004,684
受 取 利 息	2,847,452
そ の 他 収 益 金	2,325,824
支 払 利 息	△177,259
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	37,865,802,615
売 買 益	43,921,256,016
売 買 損	△6,055,453,401
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	867,821,140
取 引 益	2,227,488,090
取 引 損	△1,359,666,950
(D) そ の 他 費 用	△86,547
(E) 当 期 損 益 金(A + B + C + D)	42,311,537,909
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	134,235,536,327
(G) 解 約 差 損 益 金	△31,031,266,295
(H) 追 加 信 託 差 損 益 金	16,852,713,104
(I) 合 計(E + F + G + H)	162,368,521,045
次 期 繰 越 損 益 金(I)	162,368,521,045

(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) (G)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) (H)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》

■当投資信託において保有していた株式会社東芝の株式について、同社による有価証券報告書等の虚偽記載により当投資信託が被った損失の回復を図るために提訴した損害賠償請求訴訟が和解により終結したため、2023年12月に当該和解金を計上いたしました。

(2023年12月20日)