

運用報告書 (全体版)

第35期<決算日2022年10月31日>

インデックスミリオン

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	1987年10月30日から無期限です。	
運用方針	「MHAM株式インデックス225マザーファンド」を通じて、主としてわが国の株式に投資を行い、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	インデックス ミリオン	MHAM株式インデックス225マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	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	マザーファンドは、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、株式の組入比率を高位に保ちます。	
組入制限	インデックス ミリオン	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には、制限を設けません。
	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。
分配方針	毎期、原則として利子・配当収益と売買益（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等を勘案して決定します。なお、収益分配金に充てなかった利益については、運用の基本方針に基づき再投資します。	

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、「インデックスミリオン」は、2022年10月31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/>

インデックスミリオ

■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
31期(2018年10月29日)	7,017	55	△3.7	21,149.80	△3.9	86.1	13.3	3,618
32期(2019年10月29日)	7,660	0	9.2	22,974.13	8.6	90.3	9.2	3,858
33期(2020年10月29日)	7,746	50	1.8	23,331.94	1.6	96.4	3.5	3,667
34期(2021年10月29日)	9,522	85	24.0	28,892.69	23.8	97.9	2.1	4,094
35期(2022年10月31日)	9,164	75	△3.0	27,587.46	△4.5	98.4	1.6	3,909

(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		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	%	%	%
2021年10月29日	9,522	—	28,892.69	—	97.9	2.1
11月末	9,166	△3.7	27,821.76	△3.7	97.6	2.3
12月末	9,496	△0.3	28,791.71	△0.3	97.7	2.2
2022年1月末	8,902	△6.5	27,001.98	△6.5	98.0	2.0
2月末	8,747	△8.1	26,526.82	△8.2	98.1	1.9
3月末	9,247	△2.9	27,821.43	△3.7	97.3	2.7
4月末	8,921	△6.3	26,847.90	△7.1	97.7	2.2
5月末	9,065	△4.8	27,279.80	△5.6	97.2	2.7
6月末	8,778	△7.8	26,393.04	△8.7	98.3	1.6
7月末	9,242	△2.9	27,801.64	△3.8	97.7	2.2
8月末	9,339	△1.9	28,091.53	△2.8	98.3	1.6
9月末	8,692	△8.7	25,937.21	△10.2	97.9	2.1
(期末)						
2022年10月31日	9,239	△3.0	27,587.46	△4.5	98.4	1.6

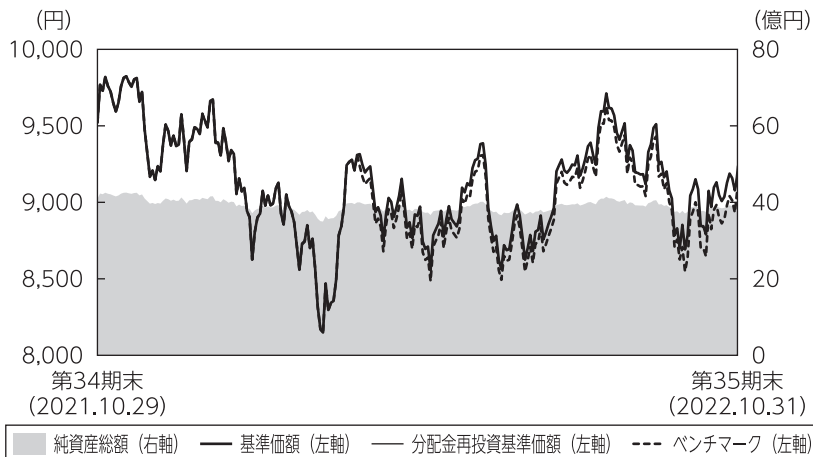
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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10月30日から2022年10月31日まで)

基準価額等の推移



第35期首： 9,522円
第35期末： 9,164円
(既払分配金75円)
騰落率： △3.0%
(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

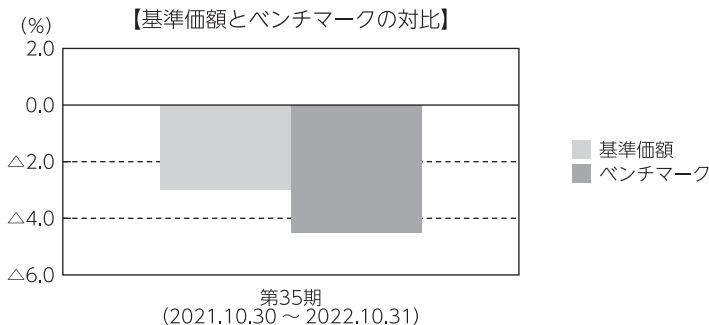
当期の運用につきましては、当ファンドの運用方針に従い、MHAM株式インデックス225マザーファンド受益証券の組入比率を高位に維持しました。

●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4.5%下落しました。当ファンドはベンチマークを1.5%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、利子・配当収益を中心に、基準価額の水準等を勘案して、下記のとおりといたしました。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き再投資します。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当期
	2021年10月30日 ～2022年10月31日
当期分配金（税引前）	75円
対基準価額比率	0.81%
当期の収益	75円
当期の収益以外	-円
翌期繰越分配対象額	6,473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35期		項目の概要
	(2021年10月30日 ～2022年10月31日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	50円	0.553%	(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9,112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)	(23)	(0.249)	
(販売会社)	(23)	(0.249)	
(受託会社)	(5)	(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	0.002	(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	51	0.555	

(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。

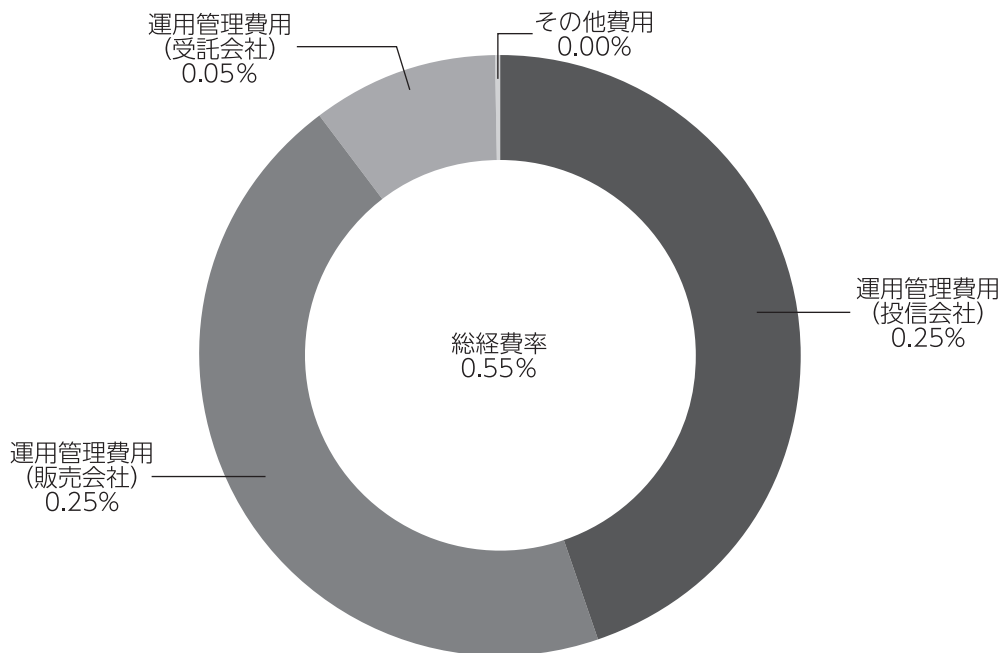
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2021年10月30日から2022年10月31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□ 21,493	千円 86,708	千□ 42,366	千円 169,162

■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	38,212,034千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	159,403,593千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.23

(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10月30日から2022年10月31日まで）

【インデックスミリオン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	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 0.000535	百万円 0.000535	% 100.0	百万円 0.000535	百万円 0.000535	% 100.0

(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)	36千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額(B)	6千円
(B) / (A)	16.6%

(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

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	百万円 24,912	百万円 1,590	% 6.4	百万円 13,299	百万円 47	% 0.4
金 銭 信 託	0.245211	0.245211	100.0	0.245211	0.245211	100.0

平均保有割合 2.4%

(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 2	百万円 33

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、みずほ信託銀行です。

■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□ 985,679	千□ 964,805	千円 3,909,488

■投資信託財産の構成

2022年10月31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 3,909,488	% 98.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	43,310	1.1
投 資 信 託 財 産 総 額	3,952,799	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10月31日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	3,952,799,032円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	11,276,990
MHAM株式インデックス225 マザーファンド(評価額)	3,909,488,042
未 収 入 金	32,034,000
(B) 負 債	42,880,365
未 払 収 益 分 配 金	32,000,922
未 払 解 約 金	54,468
未 払 信 託 報 酬	10,794,423
そ の 他 未 払 費 用	30,552
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	3,909,918,667
元 本	4,266,789,662
次 期 繰 越 損 益 金	△356,870,995
(D) 受 益 権 総 口 数	4,266,789,662口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C / D)	9,164円

(注) 期首における元本額は4,299,697,581円、当期中における追加設定元本額は121,609,907円、同解約元本額は154,517,826円です。

■損益の状況

当期 自2021年10月30日 至2022年10月31日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△1,558円
受 取 利 息	38
支 払 利 息	△1,596
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△95,494,047
売 買 益	6,310,107
売 買 損	△101,804,154
(C) 信 託 報 酬 等	△21,687,770
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	△117,183,375
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,781,770,468
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△1,989,457,166
(配 当 等 相 当 額)	(951,474,461)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△2,940,931,627)
計(D + E + F)	△324,870,073
(H) 収 益 分 配 金	△32,000,922
次 期 繰 越 損 益 金(G + H)	△356,870,995
追 加 信 託 差 損 益 金	△1,989,457,166
(配 当 等 相 当 額)	(951,590,893)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△2,941,048,059)
分 配 準 備 積 立 金	1,810,595,294
繰 越 損 益 金	△178,009,123

(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	60,825,748円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収 益 調 整 金	951,590,893
(d) 分 配 準 備 積 立 金	1,781,770,468
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	2,794,187,109
(f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	6,548.69
(g) 分 配 金	32,000,922
(h) 1 万 口 当 た り 分 配 金	75

■分配金のお知らせ

1万口当たり分配金

75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「MHAM株式インデックス225マザーファンド」において、日経平均株価（225種・東証）銘柄への投資を「等株数投資」から「日経平均株価（225種・東証）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1月29日)

MHAM株式インデックス225マザーファンド

運用報告書

第20期（決算日 2022年10月24日）

（計算期間 2021年10月26日～2022年10月24日）

MHAM株式インデックス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	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
16期（2018年10月24日）	29,957	3.3	22,091.18	1.3	97.3	2.6	157,483
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

（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）。

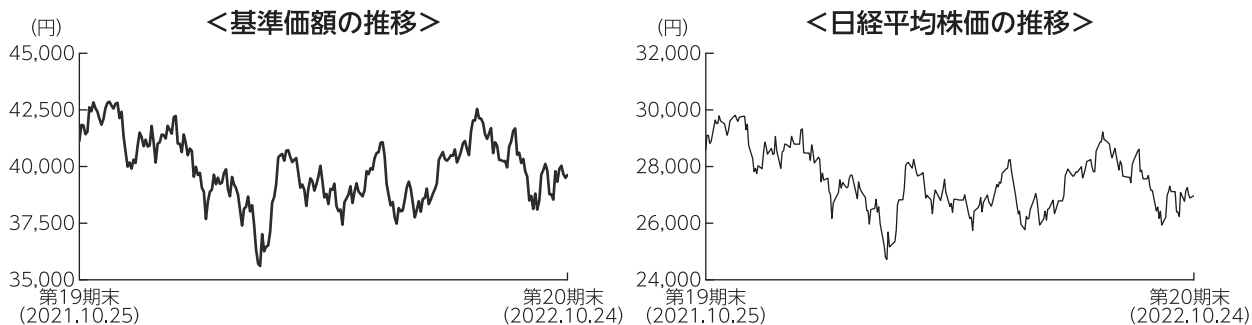
■当期中の基準価額と市況の推移

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) 2021年10月25日	41,115	—	28,600.41	—	97.6	2.3
10月末	41,531	1.0	28,892.69	1.0	97.9	2.1
11月末	39,996	△2.7	27,821.76	△2.7	97.6	2.3
12月末	41,455	0.8	28,791.71	0.7	97.7	2.2
2022年 1 月末	38,879	△5.4	27,001.98	△5.6	98.0	2.0
2 月末	38,218	△7.0	26,526.82	△7.3	98.1	1.9
3 月末	40,422	△1.7	27,821.43	△2.7	97.3	2.7
4 月末	39,013	△5.1	26,847.90	△6.1	97.7	2.2
5 月末	39,666	△3.5	27,279.80	△4.6	97.3	2.7
6 月末	38,425	△6.5	26,393.04	△7.7	98.3	1.6
7 月末	40,476	△1.6	27,801.64	△2.8	97.8	2.2
8 月末	40,921	△0.5	28,091.53	△1.8	98.3	1.6
9 月末	38,101	△7.3	25,937.21	△9.3	97.9	2.1
(期 末) 2022年10月24日	39,623	△3.6	26,974.90	△5.7	98.0	1.9

(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（2021年10月26日から2022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3.6%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月中旬にかけて、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、金利上昇による世界的な景気後退懸念などを背景に米欧株価が調整色を強めたことから下落しました。

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5.7%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。

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39,882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10月26日から2022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 5,594.6 (510.4)	千円 24,965,180 (-)	千株 3,318	千円 13,299,064

(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 53,553	百万円 54,218	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	38,264,244千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	158,857,111千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.24

(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10月26日から2022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	百万円 24,965	百万円 -	% -	百万円 13,299	百万円 47	% 0.4
金 銭 信 託	0.245211	0.245211	100.0	0.245211	0.245211	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 4	百万円 2	百万円 33

(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、みずほ信託銀行です。

■組入資産の明細

(1) 国内株式

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
		千株	千株			千円			千株	千株		千円			千株	千株		千円		
水産・農林業 (0.1%)							エーザイ	194	204	1,660,968	日本電産	—	163.2	1,299,888						
日本水産	194	204	108,528	第一三共	582	612	2,665,872	オムロン	194	204	1,410,048									
マルハニチロ	19.4	—	—	大塚ホールディングス	194	204	928,812	ジーエス・アール コーポレーション	38.8	40.8	89,474									
鉱業 (0.1%)				石油・石炭製品 (0.2%)			出光興産	77.6	81.6	263,976	日本電気	19.4	20.4	98,532						
INPEX	77.6	81.6	121,094	ENEOSホールディングス	194	204	98,348	富士通	19.4	20.4	331,296									
建設業 (1.6%)				ゴム製品 (0.8%)			セイコーエプソン	388	408	842,112	沖電気工業	19.4	—	—						
コムシスホールディングス	194	204	493,680	横浜ゴム	97	102	236,130	パナソニック ホールディングス	194	204	214,302									
大成建設	38.8	40.8	160,548	ブリヂストン	194	204	1,053,456	シャープ	194	204	180,540									
大林組	194	204	190,944	ガラス・土石製品 (0.9%)			AGC	38.8	40.8	186,048	TDK	582	612	2,818,260						
清水建設	194	204	148,308	日本板硝子	19.4	20.4	10,852	アルプスアルパイン	194	204	227,256									
長谷工コーポレーション	38.8	40.8	62,342	日本電気硝子	58.2	61.2	155,754	横河電機	194	204	481,440									
鹿島建設	97	102	139,230	住友大阪セメント	19.4	20.4	65,382	アドバンテスト	388	408	2,998,800									
大和ハウス工業	194	204	599,760	太平洋セメント	19.4	20.4	40,392	キーエンス	19.4	20.4	996,948									
積水ハウス	194	204	491,844	東海カーボン	194	204	194,208	カシオ計算機	194	204	263,568									
日揮ホールディングス	194	204	348,840	TOTO	97	102	460,020	ファナック	194	204	4,143,240									
食料品 (3.6%)				日本硝子	194	204	376,584	京セラ	388	408	3,003,696									
日清製粉グループ本社	194	204	314,976	鉄鋼 (0.1%)			日本製鉄	19.4	20.4	42,727	太陽誘電	194	204	789,480						
明治ホールディングス	38.8	40.8	247,656	日本製鉄	19.4	20.4	42,727	村田製作所	155.2	163.2	1,147,459									
日本ハム	97	102	363,120	神戸製鋼所	19.4	20.4	12,423	SCREENホールディングス	38.8	40.8	330,072									
サッポロホールディングス	38.8	40.8	131,376	JFEホールディングス	19.4	20.4	28,192	ヤマト	291	306	1,017,756									
アサヒホールディングス	194	204	862,104	大平洋金属	19.4	20.4	41,248	リコー	194	204	226,032									
キリンホールディングス	194	204	438,906	非鉄金属 (0.8%)			日本軽金属ホールディングス	19.4	20.4	29,682	東京エレクトロン	194	204	7,988,640						
宝ホールディングス	194	204	212,568	三井金属鉱業	19.4	20.4	61,302	輸送用機器 (4.6%)												
キッコーマン	194	204	1,629,960	東邦亜鉛	19.4	20.4	43,227	デンソー	194	204	1,455,540									
味の素	194	204	821,508	三菱マテリアル	19.4	20.4	39,841	川崎重工業	19.4	20.4	49,449									
ニチレイ	97	102	229,806	住友金属鉱山	97	102	428,706	日産自動車	194	204	93,472									
日本たばこ産業	194	204	490,416	DOWAホールディングス	38.8	40.8	198,492	いすゞ自動車	97	102	170,136									
繊維製品 (0.1%)				古河電気工業	19.4	20.4	46,022	トヨタ自動車	970	1,020	2,036,430									
東洋紡	19.4	20.4	20,950	住友電気工業	194	204	310,794	日野自動車	194	204	118,932									
ユニチカ	19.4	—	—	フジクラ	194	204	179,316	三菱自動車工業	19.4	20.4	10,118									
帝人	38.8	40.8	55,447	金属製品 (0.0%)			SUMCO	19.4	20.4	37,964	マツダ	38.8	40.8	39,045						
東レ	194	204	145,717	機械 (5.4%)			日本製鋼所	38.8	40.8	124,440	本田技研工業	388	408	1,329,264						
パルプ・紙 (0.1%)				オークマ	38.8	40.8	203,388	スズキ	194	204	944,520									
王子ホールディングス	194	204	106,488	アマダ	194	204	210,324	SUBARU	194	204	470,322									
日本製紙	19.4	20.4	18,094	S/MC	—	20.4	1,202,376	ヤマハ発動機	194	204	610,980									
化学 (6.7%)				小松製作所	194	204	551,514	精密機器 (4.9%)												
クラレ	194	204	207,468	住友重機械工業	38.8	40.8	113,179	テルモ	776	816	3,608,352									
旭化成	194	204	193,371	日立建機	194	204	544,068	ニコン	194	204	283,764									
昭和電工	19.4	20.4	43,819	クボタ	194	204	412,080	オリンパス	776	816	2,431,680									
住友化学	194	204	102,612	荏原製作所	38.8	40.8	195,228	HOYA	—	102	1,469,820									
日産化学	194	204	1,358,640	ダイキン工業	194	204	4,462,500	シチズン時計	194	204	127,704									
東ソー	97	102	166,260	日本精工	194	204	150,348	その他製品 (3.0%)												
トクヤマ	38.8	40.8	70,992	NTN	194	204	52,020	パナソニックホールディングス	194	204	1,976,148									
デンカ	38.8	40.8	131,172	ジェイテクト	194	204	195,840	凸版印刷	97	102	224,706									
信越化学工業	194	204	3,099,780	三井E&Sホールディングス	19.4	20.4	8,262	大日本印刷	97	102	302,022									
三井化学	38.8	40.8	113,383	日立造船	38.8	40.8	34,027	ヤマハ	194	204	1,124,040									
三菱ケミカルグループ	97	102	67,830	三菱重工業	19.4	20.4	100,368	任天堂	19.4	204	1,224,000									
UBE	19.4	20.4	39,208	IHI	19.4	20.4	66,504	電気・ガス業 (0.2%)												
花王	194	204	1,128,120	電気機器 (21.8%)			コニカミノルタ	194	204	90,984										
D I C	19.4	20.4	49,776	コニカミノン	194	204	437,784	東京電力ホールディングス	19.4	20.4	9,710									
富士フイルムホールディングス	194	204	1,395,972	日立製作所	38.8	40.8	261,772	中部電力	19.4	20.4	24,704									
資生堂	194	204	1,023,264	三菱電機	194	204	284,988	関西電力	19.4	20.4	22,848									
日東電工	194	204	1,221,800	富士電機	38.8	40.8	217,872	東京瓦斯	38.8	40.8	102,856									
医薬品 (7.7%)				安川電機	194	204	834,360	大阪瓦斯	38.8	40.8	88,413									
協和キリン	194	204	676,260	陸運業 (1.4%)			東武鉄道	38.8	40.8	139,332										
武田薬品工業	194	204	756,840	東武鉄道	97	102	172,074	小田急電鉄	97	102	184,620									
アステラス製薬	970	1,020	2,019,090	京王電鉄	38.8	40.8	210,528													
住友ファーマ	194	204	209,508																	
塩野義製薬	194	204	1,369,860																	
中外製薬	582	612	2,153,628																	

■投資信託財産の構成

2022年10月24日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 160,700,849	% 97.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	4,604,918	2.8
投 資 信 託 財 産 総 額	165,305,767	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10月24日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	165,305,436,165円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,462,669,405
株 式(評価額)	160,700,849,040
未 収 入 金	1,639,435,220
未 収 配 当 金	1,399,182,800
差 入 委 託 証 拠 金	103,299,700
(B) 負 債	1,366,477,000
未 払 解 約 金	1,366,477,000
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	163,938,959,165
元 本	41,375,064,444
次 期 繰 越 損 益 金	122,563,894,721
(D) 受 益 権 総 口 数	41,375,064,444口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C / D)	39,623円

(注1) 期首元本額 39,224,521,206円
追加設定元本額 6,965,938,652円
一部解約元本額 4,815,395,414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> 272,827,580円
インデックスミリオン 973,042,189円
ボンドミックスミリオン 90,837,342円
MHAM株式インデックスファンド225 39,909,603,774円
MHAM株式インデックス225VA [適格機関投資家専用] 119,049,910円
MHAM株式インデックス225VA2 [適格機関投資家専用] 9,703,649円
期末元本合計 41,375,064,444円

■損益の状況

当期 自2021年10月26日 至2022年10月24日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	3,504,002,290円
受 取 配 当 金	3,504,541,024
受 取 利 息	18,803
そ の 他 収 益 金	222,931
支 払 利 息	△780,468
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△8,392,253,245
売 買 益	10,248,797,290
売 買 損	△18,641,050,535
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	67,884,520
取 引 益	1,168,072,810
取 引 損	△1,100,188,290
(D) そ の 他 費 用	△1
(E) 当 期 損 益 金(A + B + C + D)	△4,820,366,436
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	122,048,489,395
(G) 解 約 差 損 益 金	△14,911,152,586
(H) 追 加 信 託 差 損 益 金	20,246,924,348
(I) 合 計(E + F + G + H)	122,563,894,721
次 期 繰 越 損 益 金(I)	122,563,894,721

(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》

約款変更のお知らせ

■日経平均株価（225種・東証）銘柄への投資を「等株数投資」から「日経平均株価（225種・東証）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1月29日)