

## 運用報告書 (全体版)

第1期<決算日2024年8月16日>

### みずほ日本オールキャップ株式ファンド

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
信託期間	2023年8月31日から無期限です。
運用方針	信託財産の成長を図ることを目的として、積極的な運用を行います。
主要投資対象	みずほ日本オールキャップ株式ファンド 日本オールキャップ株式ファンド 日本オールキャップ株式マザーファンド
運用方法	主として、マザーファンド受益証券への投資を通じて、わが国の金融商品取引所に上場する株式（上場予定を含みます。）に実質的に投資を行います。銘柄調査と企業との対話に基づき、これからも日本を根幹で支えることができると判断される企業や、今後の成長を担うことが期待される企業を組入候補銘柄として選定します。 ポートフォリオ構築にあたっては、多様な成長機会を取り込むために、成長カテゴリー*を活用し、株価水準も勘案しながら分散投資を行います。 *「成長カテゴリー」とは、製品・サービス等について、成長力や投資機会を見極めるために委託会社が独自に策定した分類です。 マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。
組入制限	マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。 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。
分配方針	決算日（原則として8月16日。休業日の場合は翌営業日。）に、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）および売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額）等の全額を分配対象額とし、委託者が基準価額水準、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は分配を行わない場合があります。

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、「みずほ日本オールキャップ株式ファンド」は、2024年8月16日に第1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/>

# みずほ日本オールキャップ株式ファンド

## ■設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			東 証 株 価 指 数		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 騰 落 中 率	(TOPIX) (配当込み) (参考指数)	期 騰 落 中 率			
(設 定 日) 2023年8月31日	円	円	%	ポイント 3,847.42	%	%	%	百万円
1期(2024年8月16日)	10,000	—	—	4,555.99	—	—	—	16,366
	10,357	0	3.6	4,555.99	18.4	97.2	—	71,718

(注1) 設定日の基準価額は設定当初の金額、純資産総額は設定当初の元本額を表示しております。

(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) 東証株価指数（TOPIX）の指数値およびTOPIXにかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXにかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。JPXは、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません（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		東 証 株 価 指 数 (TOPIX) (配当込み) (参考指数)		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比
	円	騰 落 率 %	ポイント (8月30日)	騰 落 率 %		
(設定日) 2023年 8 月31日	10,000	—	3,847.42	—	—	—
8 月末	10,000	0.0	3,878.51	0.8	78.0	—
9 月末	9,589	△4.1	3,898.26	1.3	95.9	—
10月末	9,059	△9.4	3,781.64	△1.7	96.9	—
11月末	9,963	△0.4	3,986.65	3.6	96.8	—
12月末	10,029	0.3	3,977.63	3.4	97.6	—
2024年 1 月末	10,394	3.9	4,288.36	11.5	97.2	—
2 月末	10,908	9.1	4,499.61	17.0	98.1	—
3 月末	11,101	11.0	4,699.20	22.1	96.9	—
4 月末	10,554	5.5	4,656.27	21.0	96.6	—
5 月末	10,535	5.4	4,710.15	22.4	97.3	—
6 月末	10,882	8.8	4,778.56	24.2	97.5	—
7 月末	10,689	6.9	4,752.72	23.5	97.7	—
(期 末) 2024年 8 月16日	10,357	3.6	4,555.99	18.4	97.2	—

(注1) 設定日の基準価額は、設定当初の金額です。

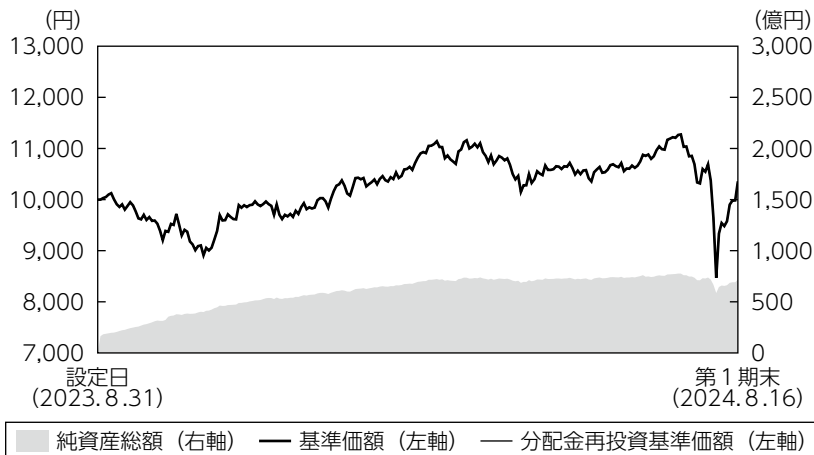
(注2) 騰落率は設定日比です。

(注3) 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4) 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8月31日から2024年8月16日まで）

### 基準価額等の推移



設定日：10,000円  
第1期末：10,357円  
(既払分配金0円)  
騰落率：3.6%  
(分配金再投資ベース)

(注) 設定日の基準価額は、設定当初の金額です。

- (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) 基準価額は、設定日前日を10,000として計算しています。
- (注4) 分配金再投資基準価額は、設定日前日を10,000として指数化しています。
- (注5) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

### 基準価額の主な変動要因

日本オールキャップ株式マザーファンドへの投資を通じて国内株式に投資しました。企業の堅調な決算内容や円安米ドル高の進行、海外投資家の買いが集まったことなどで国内株式市場が堅調だったことから、基準価額は上昇しました。



## 投資環境

国内株式市場は、設定当初から2024年7月にかけては、企業の堅調な決算内容や円安米ドル高の進行、海外投資家の買いが集まったことなどから堅調な推移となりました。8月月初には米景気後退懸念から調整があったものの、期を通じては上昇しました。

## ポートフォリオについて

### ●当ファンド

日本オールキャップ株式マザーファンドを期を通じて高位に維持するよう運用を行いました。

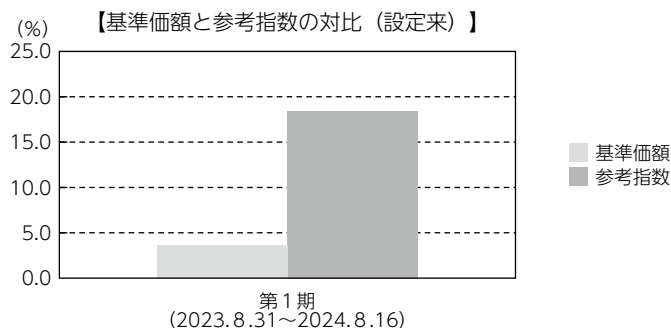
### ●日本オールキャップ株式マザーファンド

銘柄調査と企業との対話に基づき、日本を根幹で支えることができると判断される企業や、今後の成長を担うことが期待される企業を中心に投資を行いました。具体的には、住友ベークライト、ソニーグループなどを購入しました。一方で、成長鈍化が見られる銘柄や、株価が大幅に上昇した銘柄については、売却を行っています。主な売却銘柄は、マネーフォワード、中外製薬などです。

※運用状況については15ページをご参照ください。

## 参考指数との差異

当ファンドはベンチマークを定めておりません。以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数である東証株価指数（TOPIX）（配当込み）の騰落率の対比です。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

## 分配金

当期の収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、無分配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
	2023年8月31日 ～2024年8月16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	455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

引き続き、日本オールキャップ株式マザーファンドを組入れることにより、実質的な運用を当該マザーファンドにて行います。今後もマザーファンドの組入比率を高位に維持します。

### ●日本オールキャップ株式マザーファンド

今後の国内株式市場は、金融政策の動きには留意が必要と考えますが、デフレ脱却への期待感などから緩やかな上昇が続くものと予想します。当ファンドでは、引き続きアセットマネジメントOneの日本株リサーチ体制を活用しながら、徹底したボトムアップで企業の長期的な成長力の見極めを実施し、組入銘柄の見直し、新規銘柄の発掘に努めてまいります。

## ■ 1万口当たりの費用明細

項目	第1期		項目の概要
	(2023年8月31日 ～2024年8月16日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	144円	1.402%	(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10,263円です。
(投信会社)	( 71)	(0.688)	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)	( 71)	(0.688)	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)	( 3)	(0.026)	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	11	0.107	(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
(株式)	( 11)	(0.107)	売買委託手数料は、組入有望証券等の売買の際に発生する手数料
(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	155	1.509	

(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まず。

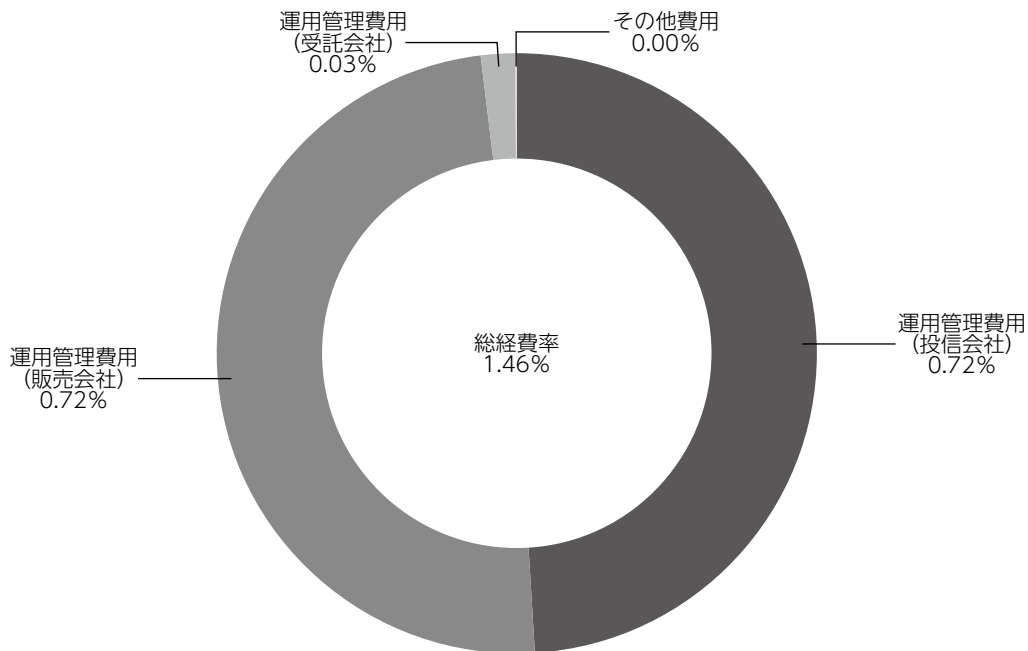
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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1.46%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8月31日から2024年8月16日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
日本オールキャップ株式マザーファンド	69,970,675	69,148,970	1,850,390	2,039,560

■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	日本オールキャップ株式マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	113,480,575千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	56,755,201千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.99

(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8月31日から2024年8月16日まで）

【みずほ日本オールキャップ株式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

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)	61,711千円
うち利害関係人への支払額 (B)	9,401千円
(B) / (A)	15.2%

(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。

## 【日本オールキャップ株式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			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 89,799	百万円 15,208	% 16.9	百万円 23,681	百万円 2,000	% 8.4

平均保有割合 100.0%

(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 29

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、みずほ証券です。

## ■組入資産の明細

### 親投資信託残高

	当 期 末	
	□ 数	評 価 額
日本オールキャップ株式マザーファンド	千□ 68,120,285	千円 71,417,307

## ■投資信託財産の構成

2024年8月16日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
日本オールキャップ株式マザーファンド	71,417,307	98.9
コール・ローン等、その他	800,631	1.1
投資信託財産総額	72,217,938	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8月16日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	72,217,938,856円
コール・ローン等	800,631,377
日本オールキャップ株式マザーファンド(評価額)	71,417,307,479
(B) 負 債	499,655,387
未払解約金	12,238,106
未払信託報酬	487,084,230
その他未払費用	333,051
(C) 純資産総額(A-B)	71,718,283,469
元 本	69,242,902,212
次期繰越損益金	2,475,381,257
(D) 受益権総口数	69,242,902,212口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,357円

(注) 設定当初の投資元本額は16,366,737,095円、当期中における追加設定元本額は57,761,514,983円、同解約元本額は4,885,349,866円です。

## ■損益の状況

当期 自2023年8月31日 至2024年8月16日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	191,196円
受 取 利 息	215,541
支 払 利 息	△24,345
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	3,896,228,016
売 買 損 益	4,320,390,616
売 買 損 益	△424,162,600
(C) 信 託 報 酬 等	△838,309,881
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	3,058,109,331
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	△582,728,074
(配 当 等 相 当 額)	(△12,416)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△582,715,658)
(F) 合 計(D+E)	2,475,381,257
次 期 繰 越 損 益 金(F)	2,475,381,257
追 加 信 託 差 損 益 金	△582,728,074
(配 当 等 相 当 額)	(94,280,301)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△677,008,375)
分 配 準 備 積 立 金	3,058,109,331

(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) (E)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	560,205,617円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	2,497,903,714
(c) 収益調整金	94,280,301
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	3,152,389,632
(f) 1万口当たり当期分配対象額	455.27
(g) 分 配 金	0
(h) 1万口当たり分配金	0

## ■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、無分配とさせていただきます。

# 日本オールキャップ株式マザーファンド

## 運用報告書

第1期 (決算日 2024年8月16日)

(計算期間 2023年8月31日～2024年8月16日)

日本オールキャップ株式マザーファンドの第1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	2023年8月31日から無期限です。
運用方針	信託財産の成長を図ることを目的として、積極的な運用を行います。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所に上場する株式（上場予定を含みます。）を主要投資対象とします。
主な組入制限	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。

### ■設定以来の運用実績

決算期	基準価額		東証株価指数		株式組入率	株式先物率	純資産額
	円	騰落率	(TOPIX) (配当込み) (参考指数)	騰落率			
(設定日) 2023年8月31日	10,000	—	ポイント (8月30日) 3,847.42	—	—	—	16,300
1期(2024年8月16日)	10,484	4.8	4,555.99	18.4	97.6	—	71,415

(注1) 設定日の基準価額は設定当初の金額、純資産総額は設定当初の元本額を表示しております。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注3) 東証株価指数（TOPIX）の指数値およびTOPIXにかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXにかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。JPXは、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません（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

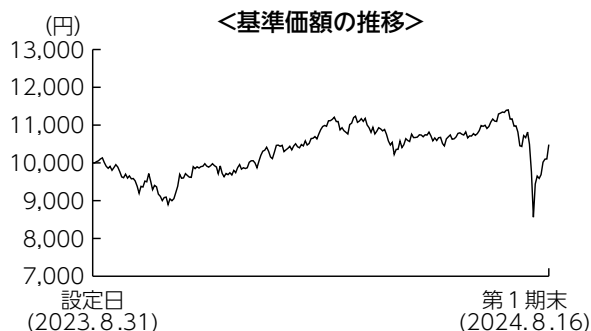
年 月 日	基 準 価 額		東 証 株 価 指 数 (TOPIX) (配当込み) (参考指数)		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比
	円	騰 落 率 %	ポ イ ン ト (8月30日) 3,847.42	騰 落 率 %		
(設定日) 2023年 8 月 31 日	10,000	—	3,847.42	—	—	—
8 月 末	10,000	0.0	3,878.51	0.8	78.3	—
9 月 末	9,585	△4.2	3,898.26	1.3	96.2	—
10 月 末	9,053	△9.5	3,781.64	△1.7	97.2	—
11 月 末	9,978	△0.2	3,986.65	3.6	97.1	—
12 月 末	10,058	0.6	3,977.63	3.4	97.8	—
2024年 1 月 末	10,440	4.4	4,288.36	11.5	97.5	—
2 月 末	10,969	9.7	4,499.61	17.0	98.4	—
3 月 末	11,178	11.8	4,699.20	22.1	97.2	—
4 月 末	10,640	6.4	4,656.27	21.0	96.9	—
5 月 末	10,634	6.3	4,710.15	22.4	97.6	—
6 月 末	10,997	10.0	4,778.56	24.2	97.9	—
7 月 末	10,815	8.2	4,752.72	23.5	98.2	—
(期 末) 2024年 8 月 16 日	10,484	4.8	4,555.99	18.4	97.6	—

(注1) 設定日の基準価額は、設定当初の金額です。

(注2) 騰落率は設定日比です。

(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8月31日から2024年8月16日まで）



### 基準価額等の推移

当期末の基準価額は10,484円となり、設定日比で4.8%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

日本を根幹で支えることができると判断される企業や、今後の成長を担うことが期待される企業を中心に投資を行いました。企業の堅調な決算内容や円安米ドル高の進行、海外投資家の買いが集まったことなどで国内株式市場が堅調だったことから、基準価額は上昇しました。



### 投資環境

国内株式市場は、設定当初から2024年7月にかけては、企業の堅調な決算内容や円安米ドル高の進行、海外投資家の買いが集まったことなどから堅調な推移となりました。8月月初には米景気後退懸念から調整があったものの、期を通じては上昇しました。

### ポートフォリオについて

銘柄調査と企業との対話に基づき、日本を根幹で支えることができると判断される企業や、今後の成長を担うことが期待される企業を中心に投資を行いました。具体的には、住友ベークライト、ソニーグループなどを購入しました。一方で、成長鈍化が見られる銘柄や、株価が大幅に上昇した銘柄については、売却を行っています。主な売却銘柄は、マネーフォワード、中外製薬などです。

## 【運用状況】 2024年8月16日現在

(注1) 組入比率は純資産総額に対する割合です。

(注2) 「成長カテゴリー」とは、決算日時点での製品・サービス等について、成長力や投資機会を見極めるために委託会社が独自に策定した分類です。

(注3) 組入上位10業種は東証33業種分類によるものです。

### ○組入上位10成長カテゴリー

No.	成長カテゴリー	組入比率
1	半導体材料	7.4%
2	通信計測器	6.8
3	金融サービス	6.7
4	省力合理化	6.6
5	半導体製造装置	6.6
6	医薬品	6.5
7	医療機器	6.1
8	エネルギー・環境材料	5.9
9	ITサービスインフラ	5.4
10	人材系ビジネス・アウトソース	5.2

### ○組入上位10業種

No.	業種	組入比率
1	電気機器	21.8%
2	情報・通信業	12.3
3	化学	10.9
4	サービス業	9.3
5	機械	7.7
6	精密機器	6.2
7	ガラス・土石製品	3.6
8	医薬品	3.5
9	食料品	3.2
10	銀行業	3.1

## 今後の運用方針

今後の国内株式市場は、金融政策の動きには留意が必要と考えますが、デフレ脱却への期待感などから緩やかな上昇が続くものと予想します。当ファンドでは、引き続きアセットマネジメントOneの日本株リサーチ体制を活用しながら、徹底したボトムアップで企業の長期的な成長力の見極めを実施し、組入銘柄の見直し、新規銘柄の発掘に努めてまいります。



## ■ 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)	11円 (11)	0.107% (0.107)	(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	11	0.107	
期中の平均基準価額は10,319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8月31日から2024年8月16日まで)

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
		33,386.2 (2,804.5)	89,799,117 (-)	8,801	23,681,457

(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。

## ■ 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	113,480,575千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	56,755,201千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)÷(b)	1.99

(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8月31日から2024年8月16日まで）

### (1) 期中の利害関係人との取引状況

決算期		当			期		
区	分	買付額等	うち利害関係人	B/A	売付額等	うち利害関係人	D/C
		A	との取引状況B		C	との取引状況D	
株	式	百万円 89,799	百万円 15,208	% 16.9	百万円 23,681	百万円 2,000	% 8.4

### (2) 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 29

### (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)		61,711千円
う	ち利害関係人への支払額(B)		9,401千円
	(B)/(A)		15.2%

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、みずほ証券です。

## ■組入資産の明細

### 国内株式

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
<b>食料品 (3.3%)</b>		
寿スピリッツ	350	587,650
キッコーマン	412.5	718,575
ニチレイ	250	996,250
<b>繊維製品 (1.3%)</b>		
東レ	1,200	899,280
<b>化学 (11.1%)</b>		
大阪ソーダ	85	736,100
信越化学工業	220	1,403,380
日本酸素ホールディングス	200	942,000
東京応化工業	150	591,900
住友ベークライト	175	696,325
トリケミカル研究所	179.7	639,732
日油	325	702,650
中国塗料	133.6	251,168
富士フィルムホールディングス	309.6	1,111,154
ユニ・チャーム	138.4	692,553
<b>医薬品 (3.6%)</b>		
協和キリン	250	790,000
ネクスラファーマ	300	494,400
第一三共	200	1,192,600
<b>ガラス・土石製品 (3.7%)</b>		
日東紡績	142.5	823,650
東洋炭素	100	608,000
MARUWA	20	834,000
フジミインコーポレーテッド	120	320,640
<b>非鉄金属 (2.8%)</b>		
UACJ	140	691,600
フジクラ	325	1,291,550
<b>機械 (7.8%)</b>		
ディスコ	11	531,190
SMC	15	1,024,500
ユニオンツール	90	532,800
ハーモニック・ドライブ・システムズ	238.1	941,685
荏原製作所	475	989,662
ダイキン工業	27.5	493,487
CKD	300	955,500
<b>電気機器 (22.3%)</b>		
イビデン	50	267,100
日立製作所	500	1,830,000
安川電機	70	335,720
湖北工業	350	1,050,000

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
芝浦メカトロニクス	80	656,000
I D E C	120	326,040
アドテック プラズマ テクノロジー	205.4	389,438
ルネサスエレクトロニクス	475	1,192,012
アルパック	70	599,830
ソニーグループ	100	1,338,500
T D K	140	1,430,800
日本電波工業	332.3	388,126
メイコー	150	826,500
ヨコオ	275	465,025
キーエンス	16	1,061,440
シスメックス	213.9	575,177
レーザーテック	14	404,320
山一電機	240	690,480
芝浦電子	175	551,250
浜松ホトニクス	125	484,375
村田製作所	220	678,480
<b>輸送用機器 (1.8%)</b>		
スズキ	718.4	1,251,093
<b>精密機器 (6.4%)</b>		
テルモ	470	1,260,775
島津製作所	90	410,760
ナカニシ	250	637,500
HOYA	70	1,386,000
朝日インテック	325	762,937
<b>その他製品 (1.0%)</b>		
フルヤ金属	162.9	677,664
<b>電気・ガス業 (0.5%)</b>		
リニューアブル・ジャパン	555.9	351,328
<b>情報・通信業 (12.6%)</b>		
ソフトクリエイトホールディングス	154.6	241,021
アイスタイル	1,000	510,000
フィックスターズ	282.6	438,030
GMOペイメントゲートウェイ	110	912,780
インターネットイニシアティブ	370	994,745
プラスアルファ・コンサルティング	350	565,950
プレイド	350	330,400
ビジョナル	35	299,250
エクサウィザーズ	800	244,000
コアコンセプト・テクノロジー	165	308,220
ラクスル	650	703,300
スマレジ	210	443,940

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
ギフトィ	165	181,665
メドレー	150	459,000
JMDC	200	737,200
ANYMIND GROUP	400	520,400
AVILEN	170.2	222,111
ソフトバンク	338.3	651,904
<b>卸売業 (2.6%)</b>		
マクニカホールディングス	30	171,420
伊藤忠商事	145.1	1,039,931
ミスミグループ本社	227.8	619,729
<b>小売業 (1.4%)</b>		
コスモス薬品	30	405,750
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	150	558,300
<b>銀行業 (3.1%)</b>		
楽天銀行	275	897,875
三菱UFJフィナンシャル・グループ	500	776,500
三井住友フィナンシャルグループ	50	509,750
<b>証券・商品先物取引業 (1.6%)</b>		
FPG	300	697,800
SBIホールディングス	125	442,500
<b>保険業 (0.5%)</b>		
アニコムホールディングス	600	376,200
<b>その他金融業 (0.3%)</b>		
プレミアグループ	106.5	203,095
<b>不動産業 (2.6%)</b>		
クリアル	90	362,700

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
東急不動産ホールディングス	900	931,500
GA technologies	500	549,000
<b>サービス業 (9.5%)</b>		
エス・エム・エス	300	631,800
エムスリー	200	252,000
エン・ジャパン	300	743,100
ジャパンマテリアル	550	997,150
リクルートホールディングス	70	616,700
鎌倉新書	570.3	236,104
インソース	450	400,500
アンビスホールディングス	200	492,200
カープスホールディングス	550	421,300
LITALICO	250	278,750
リログループ	200	363,000
大栄環境	183.3	528,453
ダイセキ	189.3	680,533
合 計	株 数 ・ 金 額 27,389.7	千株 69,710,217
	銘柄 数 < 比 率 >	105銘柄 <97.6%>

(注1) 銘柄欄の( )内は、期末の国内株式評価総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。

## ■投資信託財産の構成

2024年8月16日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	69,710,217千円	97.5%
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,768,605	2.5
投 資 信 託 財 産 総 額	71,478,822	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8月16日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	71,478,822,065円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,393,227,160
株 式(評価額)	69,710,217,000
未 収 入 金	300,625,155
未 収 配 当 金	74,752,750
(B) 負 債	63,262,662
未 払 金	63,262,662
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	71,415,559,403
元 本	68,120,285,654
次 期 繰 越 損 益 金	3,295,273,749
(D) 受 益 権 総 口 数	68,120,285,654口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,484円

- (注1) 設定当初元本額 16,300,000,000円  
 追加設定元本額 53,670,675,834円  
 一部解約元本額 1,850,390,180円
- (注2) 期末における元本の内訳  
 みずほ日本オールキャップ株式ファンド 68,120,285,654円  
 期末元本合計 68,120,285,654円

## ■損益の状況

当期 自2023年8月31日 至2024年8月16日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	713,592,791円
受 取 配 当 金	713,416,133
受 取 利 息	581,056
そ の 他 収 益 金	1,699
支 払 利 息	△406,097
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	3,592,556,612
売 買 益	11,233,027,510
売 買 損	△7,640,470,898
(C) 当 期 損 益 金(A+B)	4,306,149,403
(D) 解 約 差 損 益 金	△189,169,820
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	△821,705,834
(F) 合 計(C+D+E)	3,295,273,749
次 期 繰 越 損 益 金(F)	3,295,273,749

- (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) (D)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) (E)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。