

ミリオン（従業員積立投資プラン） 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	無期限	
運用方針	信託財産の成長をはかることを目的として、運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	ミリオン・インデックス マザーファンド受益証券
	ミリオン・インデックス マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場 株式
マザー ファンドの 運用方法	①原則として、日経平均株価に採用されている全銘柄に等株数投資を行ない、投資成果を日経平均株価の動きに連動させることをめざします。 ②ただし、投資対象とする企業の財務状況等を考慮したうえで、日経平均株価採用銘柄であっても投資を行なわない場合があります。また、日経平均株価採用銘柄の入替え等に際しては、流動性等を勘案して対応する場合があります。これらの場合、組入銘柄に等株数投資を行なわないことがあります。	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	マザーファンドの株式組入上限比率	無制限
分配方針	分配対象額は、利息等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とし、分配対象額から、原則として、利息等収益を中心に分配します。	

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。ファミリーファンド方式とは、受益者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。

運用報告書（全体版） 第29期 （決算日 2016年 8 月17日）

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「ミリオン（従業員積立投資プラン）インデックスポートフォリオ」は、このたび、第29期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
お問い合わせ先（コールセンター）
TEL 0120-106212
（営業日の9：00～17：00）
<http://www.daiwa-am.co.jp/>

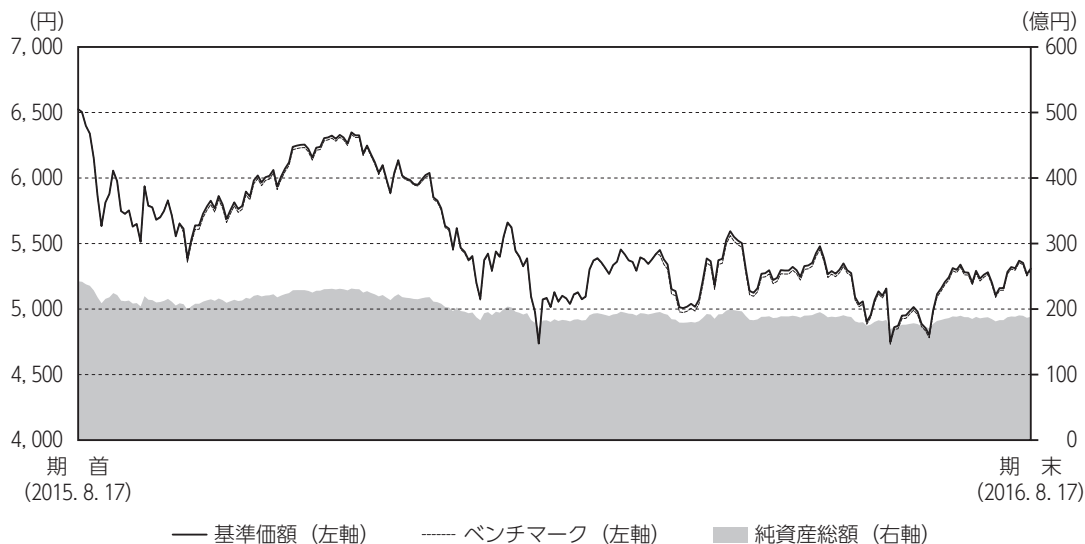
最近5期の運用実績

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 総 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
25期末(2012年 8 月17日)	2,900	5	1.7	9,162.50	1.2	97.8	2.1	16,396
26期末(2013年 8 月19日)	4,364	5	50.7	13,758.13	50.2	96.7	3.3	22,905
27期末(2014年 8 月18日)	4,855	5	11.4	15,322.60	11.4	98.9	1.1	22,785
28期末(2015年 8 月17日)	6,525	5	34.5	20,620.26	34.6	97.6	2.3	24,231
29期末(2016年 8 月17日)	5,308	5	△ 18.6	16,745.64	△ 18.8	98.1	1.8	18,809

(注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
(注 2) 株式および株式先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。
(注 3) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

基準価額等の推移について



(注 1) 期末の基準価額は分配金込みです。

(注 2) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

* ベンチマークは日経平均株価です。

■基準価額・騰落率

期 首：6,525円

期 末：5,308円（分配金 5 円）

騰落率：△18.6%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

日経平均株価への連動をめざした運用を行なったため、日経平均株価の動きを反映して、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ミリオン（従業員積立投資プラン）インデックスポートフォリオ

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		
	円	%	円	%	%	%
(期首) 2015年 8 月17日	6, 525	—	20, 620. 26	—	97. 6	2. 3
8 月末	5, 977	△ 8. 4	18, 890. 48	△ 8. 4	97. 9	2. 0
9 月末	5, 532	△ 15. 2	17, 388. 15	△ 15. 7	97. 7	2. 2
10月末	6, 062	△ 7. 1	19, 083. 10	△ 7. 5	98. 4	1. 5
11月末	6, 266	△ 4. 0	19, 747. 47	△ 4. 2	99. 2	0. 8
12月末	6, 039	△ 7. 4	19, 033. 71	△ 7. 7	97. 9	2. 0
2016年 1 月末	5, 552	△ 14. 9	17, 518. 30	△ 15. 0	98. 3	1. 6
2 月末	5, 076	△ 22. 2	16, 026. 76	△ 22. 3	98. 5	1. 4
3 月末	5, 340	△ 18. 2	16, 758. 67	△ 18. 7	98. 3	1. 6
4 月末	5, 304	△ 18. 7	16, 666. 05	△ 19. 2	98. 7	1. 2
5 月末	5, 479	△ 16. 0	17, 234. 98	△ 16. 4	99. 1	0. 9
6 月末	4, 952	△ 24. 1	15, 575. 92	△ 24. 5	97. 1	2. 9
7 月末	5, 262	△ 19. 4	16, 569. 27	△ 19. 6	97. 7	2. 2
(期末) 2016年 8 月17日	5, 313	△ 18. 6	16, 745. 64	△ 18. 8	98. 1	1. 8

（注）期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

○国内株式市況

国内株式市況は、期首より、中国をはじめとした世界経済の先行き不透明感の広がりや円高の進行などを受けて下落しました。2015年10月に入ると、世界経済に対する過度な不安感が後退したことやE C B（欧州中央銀行）が追加金融緩和を示唆したこと、中国が追加金融緩和を実施したことなどで株価は上昇しました。12月以降は、E C Bの追加金融緩和策への失望や原油価格の下落、中国・人民元安と中国株安、円高などにより株価は下落しました。2016年1月末には日銀がマイナス金利を導入し一時的に株価は上昇しましたが、その後は米国経済および中国経済への懸念や欧州金融機関の信用不安などで下落しました。2月後半からは、米国の製造業関連指標の回復や中国およびE C Bの金融緩和などにより株価も反発しましたが、3月後半からは、日米金融政策や米国為替政策への思惑から為替相場が不安定になり、株価も乱高下しました。6月には、英国の国民投票でのE U（欧州連合）離脱支持多数を受け株価も下落しましたが、7月に入ると、国内の経済対策や追加金融緩和策への期待から上昇しました。8月以降は、日銀の追加緩和策への失望、欧州金融株安、円高、および政策出尽くし感などから一時的に下落したものの、その後買い戻しが入り日銀の金融政策決定会合前の水準まで回復して期末を迎えました。

前期における「今後の運用方針」

○当ファンド

「ミリオン・インデックスマザーファンド」の受益証券へ投資を行ないます。

○ミリオン・インデックスマザーファンド

日経平均株価に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

ポートフォリオについて

○当ファンド

「ミリオン・インデックスマザーファンド」の受益証券へ投資を行ないました。

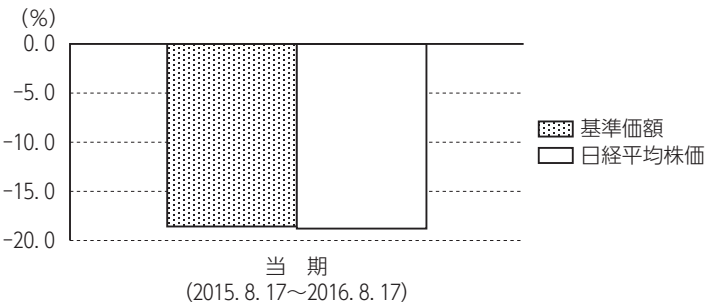
○ミリオン・インデックスマザーファンド

日経平均株価に連動する投資成果をめざして運用を行ないました。

ベンチマークとの差異について

ベンチマーク（日経平均株価）の騰落率は△18.8%となりました。一方、当ファンドの騰落率は△18.6%となりました。マザーファンドで保有している株式の配当金が計上されたのに対して、ベンチマークは配当分が含まれていないため、ベンチマークとかい離しました。その他、マザーファンドで組入れている現物株式ポートフォリオの騰落率と日経平均株価の騰落率との差異、先物取引の影響、信託報酬等のコストがかい離の要因として挙げられます。

以下のグラフは当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



分配金について

当期の1万口当り分配金（税込み）は5円といたしました。
収益分配金の決定根拠は下記の「収益分配金の計算過程（1万口当り）」をご参照ください。
なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目		当 期
		2015年 8月18日 ～2016年 8月17日
当期分配金（税込み）	(円)	5
対基準価額比率	(%)	0.09
当期の収益	(円)	—
当期の収益以外	(円)	5
翌期繰越分配対象額	(円)	2,760

（注1）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
（注2）円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。
（注3）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）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。

■収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0.00円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0.00
(c) 収益調整金	1,826.40
(d) 分配準備積立金	938.77
(e) 当期分配対象額（a + b + c + d）	2,765.17
(f) 分配金	5.00
(g) 翌期繰越分配対象額（e - f）	2,760.17

（注）下線を付した該当項目から分配金を計上しています。

《今後の運用方針》

○当ファンド

「ミリオン・インデックスマザーファンド」の受益証券へ投資を行ないます。

○ミリオン・インデックスマザーファンド

日経平均株価に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	(2015. 8. 18～2016. 8. 17)		
	金 額	比 率	
信託報酬	91円	1. 641%	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5, 519円です。
(投信会社)	(20)	(0. 367)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価
(販売会社)	(66)	(1. 188)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託銀行)	(5)	(0. 086)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	0	0. 006	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(0)	(0. 000)	
(先物)	(0)	(0. 006)	
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	0	0. 005	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. 005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	91	1. 652	

(注 1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み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) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注 3) 比率欄は 1 万口当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。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2015年8月18日から2016年8月17日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ミリオン・インデックスマザーファンド	—	—	1,375,100	1,311,000

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2015年8月18日から2016年8月17日まで)

項 目	当 期
	ミリオン・インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	1,055,718千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	20,220,334千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.05

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。
(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

(1) ベビーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

(2015年8月18日から2016年8月17日まで)

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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	120	—	—	935	—	—
株式先物取引	2,436	580	23.8	2,559	1,046	40.9
コール・ローン	60,418	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合97.8%
※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。

(3) 利害関係人の発行する有価証券等

(2015年8月18日から2016年8月17日まで)

種 類	当 期		
	ミリオン・インデックスマザーファンド 買 付 額	売 付 額	期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株式	—	1	25

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

(2015年8月18日から2016年8月17日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	1,218千円
うち利害関係人への支払額 (B)	608千円
(B) / (A)	49.9%

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組み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。

※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係る利害関係人とは、大和証券、大和証券グループ本社です。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ミリオン・インデックスマザーファンド	22,319,663	20,944,562	18,814,500

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年8月17日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ミリオン・インデックスマザーファンド	18,814,500	99.1
コール・ローン等、その他	174,712	0.9
投資信託財産総額	18,989,213	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

ミリオン（従業員積立投資プラン）インデックスポートフォリオ

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2016年 8月17日現在	
項 目	当 期 末
(A)資産	18,989,213,435円
コール・ローン等	174,712,723
ミリオン・インデックス マザーファンド（評価額）	18,814,500,712
(B)負債	179,229,751
未払収益分配金	17,719,187
未払解約金	8,996,647
未払信託報酬	152,013,959
その他未払費用	499,958
(C)純資産総額（A－B）	18,809,983,684
元本	35,438,375,999
次期繰越損益金	△ 16,628,392,315
(D)受益権総口数	35,438,375,999口
1万口当り基準価額（C／D）	5,308円

*期首における元本額は37,134,245,170円、当期中における追加設定元本額は641,382,157円、同解約元本額は2,337,251,328円です。
 *当期末の計算口数当りの純資産額は5,308円です。
 *当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は16,628,392,315円です。

■損益の状況

当期 自2015年 8月18日 至2016年 8月17日	
項 目	当 期
(A)配当等収益	14,821円
受取利息	33,022
支払利息	△ 18,201
(B)有価証券売買損益	△ 3,908,127,951
売買益	178,329,845
売買損	△ 4,086,457,796
(C)信託報酬等	△ 328,943,229
(D)当期損益金（A＋B＋C）	△ 4,237,056,359
(E)前期繰越損益金	3,326,860,595
(F)追加信託差損益金	△ 15,700,477,364
(配当等相当額)	(6,472,478,913)
(売買損益相当額)	(△ 22,172,956,277)
(G)合計（D＋E＋F）	△ 16,610,673,128
(H)収益分配金	△ 17,719,187
次期繰越損益金（G＋H）	△ 16,628,392,315
追加信託差損益金	△ 15,718,196,551
(配当等相当額)	(6,454,759,726)
(売買損益相当額)	(△ 22,172,956,277)
分配準備積立金	3,326,860,595
繰越損益金	△ 4,237,056,359

(注1) 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おります。
 (注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。
 (注3) 収益分配金の計算過程は「収益分配金の計算過程（総額）」の表をご参照ください。

■収益分配金の計算過程（総額）

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	0
(c)収益調整金	6,472,478,913
(d)分配準備積立金	3,326,860,595
(e)当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	9,799,339,508
(f)分配金	17,719,187
(g)翌期繰越分配対象額（e－f）	9,781,620,321
(h)受益権総口数	35,438,375,999口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金	5 円

●税引き分配金は、販売会社が、ご加入のみなさまとの契約に基づき、8月18日にそれぞれの口座に繰入れて再投資いたしました。なお、再投資は8月17日現在の基準価額（1万口当り5,308円）に基づいて行ないました。

分配金の課税上の取扱いについて

- ・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）、残りの額が普通分配金です。
- ・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個々の受益者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、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- ・普通分配金については、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用があります。）を選択することもできます。
- ・法人の受益者の場合、税率が異なります。
- ・税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。くわしくは、販売会社にお問い合わせください。
- ・課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

当ファンドは少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA」の適用対象です。非課税口座における取扱いについては販売会社にお問い合わせください。

【注記】

「日経平均株価」に関する著作権、知的所有権、その他一切の権利は日本経済新聞社に帰属します。日本経済新聞社は日経平均株価を継続的に公表する義務を負うものではなく、その誤謬、遅延または中断に関して責任を負いません。また、「ミリオン（従業員積立投資プラン）インデックスポートフォリオ」について、日本経済新聞社は一切の責任を負うものではありません。

ミリオン・インデックスマザーファンド

運用報告書 第29期 (決算日 2016年 8 月17日)

(計算期間 2015年 8 月18日～2016年 8 月17日)

ミリオン・インデックスマザーファンドの第29期にかかる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。

運 用 方 針	わが国の株式市場の動きと長期成長をとらえることを目標に、日経平均株価をモデルとして運用を行ないます。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式
運 用 方 法	①原則として、日経平均株価に採用されている全銘柄に等株数投資を行ない、投資成果を日経平均株価の動きに連動させることをめざします。 ②ただし、投資対象とする企業の財務状況等を考慮したうえで、日経平均株価採用銘柄であっても投資を行わない場合があります。また、日経平均株価採用銘柄の入替え等に際しては、流動性等を勘案して対応する場合があります。これらの場合、組入銘柄に等株数投資を行わないことがあります。
株式組入制限	無制限

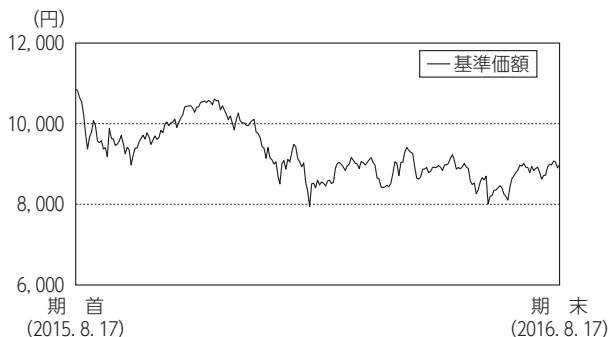
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

<http://www.daiwa-am.co.jp/>

■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 (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) 2015年 8月17日	10,854	—	20,620.26	—	97.6	2.3
8月末	9,948	△ 8.3	18,890.48	△ 8.4	98.0	2.0
9月末	9,218	△15.1	17,388.15	△15.7	97.8	2.2
10月末	10,117	△ 6.8	19,083.10	△ 7.5	98.5	1.5
11月末	10,471	△ 3.5	19,747.47	△ 4.2	99.2	0.8
12月末	10,106	△ 6.9	19,033.71	△ 7.7	97.9	2.0
2016年 1月末	9,304	△14.3	17,518.30	△15.0	98.3	1.6
2月末	8,516	△21.5	16,026.76	△22.3	98.6	1.4
3月末	8,972	△17.3	16,758.67	△18.7	98.3	1.6
4月末	8,923	△17.8	16,666.05	△19.2	98.8	1.2
5月末	9,231	△15.0	17,234.98	△16.4	99.1	0.9
6月末	8,355	△23.0	15,575.92	△24.5	97.1	2.9
7月末	8,889	△18.1	16,569.27	△19.6	97.8	2.2
(期末) 2016年 8月17日	8,983	△17.2	16,745.64	△18.8	98.1	1.8

(注 1) 騰落率は期首比。

(注 2) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：10,854円 期末：8,983円 騰落率：△17.2%

【基準価額の主な変動要因】

日経平均株価への運動をめざした運用を行なったため、日経平均株価の動きを反映して、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○国内株式市況

国内株式市況は、期首より、中国をはじめとした世界経済の先行き不透明感の広がりや円高の進行などを受けて下落しました。2015年10月に入ると、世界経済に対する過度な不安感が後退したことやECB（欧州中央銀行）が追加金融緩和を示唆したこと、中国が追加金融緩和を実施したことなどで株価は上昇しました。12月以降は、ECBの追加金融緩和策への失望や原油価格の下落、中国・人民元安と中国株安、円高などにより株価は下落しました。2016年1月末には日銀がマイナス金利を導入し一時的に株価は上昇しましたが、その後は米国経済および中国経済への懸念や欧州金融機関の信用不安などで下落しました。2月後半からは、米国の製造業関連指標の回復や中国およびECBの金融緩和などにより株価も反発しましたが、3月後半からは、日米金融政策や米国為替政策への思惑から為替相場が不安定になり、株価も乱高下しました。6月には、英国の国民投票でのEU（欧州連合）離脱支持多数を受け株価も下落しましたが、7月に入ると、国内の経済対策や追加金融緩和策への期待から上昇しました。8月以降は、日銀の追加緩和策への失望、欧州金融株安、円高、および政策出尽くし感などから一時的に下落したものの、その後買い戻しが入り日銀の金融政策決定会合前の水準まで回復して期末を迎えました。

◆前期における「今後の運用方針」

日経平均株価に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

◆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めざして運用を行ないました。

◆ベンチマークとの差異について

ベンチマーク（日経平均株価）の騰落率は△18.8%となりました。一方、当ファンドの騰落率は△17.2%となりました。保有している株式の配当金が計上されたのに対して、ベンチマークは配当分が含まれていないため、ベンチマークと乖離しました。その他、当ファンドで組み入れている現物株式ポートフォリオの騰落率と日経平均株価の騰落率との差異、先物取引の影響等のコストがかい離の要因として挙げられます。

《今後の運用方針》

日経平均株価に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

ミリオン・インデックスマザーファンド

■ 1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (株式) (先物)	1円 (0) (1)
有価証券取引税	—
その他費用	—
合 計	1

(注 1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）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。費用の項目および算出方法については前掲の「1 万口当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。

(注 2) 各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1)株 式

(2015年 8 月18日から2016年 8 月17日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
国内	千株 67 (△ 156.6)	千円 120,389 (—)	千株 520.3	千円 935,328

(注 1) 金額は受渡し代金。

(注 2) () 内は株式分割、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。

(注 3) 金額の単位未満は切捨て。

(2)先物取引の種別取引状況

(2015年 8 月18日から2016年 8 月17日まで)

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 2,436	百万円 2,559	百万円 —	百万円 —

(注 1) 金額は受渡し代金。

(注 2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

株 式

(2015年 8 月18日から2016年 8 月17日まで)

当 期				期 付			
買 付		売 付		買 付		売 付	
銘 柄	株 数	金 額	平均単価	銘 柄	株 数	金 額	平均単価
ヤマハ発動機	千株 44	千円 77,352	円 1,758	ファーストリテイリング	千株 2	千円 72,698	円 36,349
ディー・エヌ・エー	13.8	30,619	2,218	ファナック	2	37,074	18,537
長谷工コーポレーション	9.2	12,418	1,349	ソフトバンクグループ	6	36,422	6,070
				KDDI	12	36,218	3,018
				京セラ	4	21,717	5,429
				ダイキン工業	2	17,357	8,678
				テルモ	4	16,719	4,179
				セコム	2	16,410	8,205
				日東紡績	46	16,406	356
				アステラス製薬	10	15,689	1,568

(注 1) 金額は受渡し代金。

(注 2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 国内株式

銘柄	期首			銘柄	期首			銘柄	期首		
	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 (0.2%)				三井化学	46	44	19,932	住友電工	46	44	62,150
日本水産	46	44	22,440	三菱ケミカル HLDGS	23	22	12,557	フジクラ	46	44	24,376
マルハニチロ	4.6	4.4	11,246	宇部興産	46	44	7,700	金属製品 (0.5%)			
鉱業 (0.1%)				日本化薬	46	44	47,740	SUMCO	4.6	4.4	3,471
国際石油開発帝石	18.4	17.6	15,692	花王	46	44	235,576	東洋製罐グループHD	46	44	84,040
建設業 (2.8%)				富士フイルム HLDGS	46	44	165,748	機械 (5.1%)			
コムシホールディングス	46	44	81,796	資生堂	46	44	115,236	日本製鋼所	46	44	21,868
大成建設	46	44	34,584	日東電工	46	44	313,192	オクマ	46	44	33,132
大林組	46	44	41,272	医薬品 (7.7%)				アマダホールディングス	46	44	47,168
清水建設	46	44	41,800	協和発酵キリン	46	44	68,508	小松製作所	46	44	101,332
長谷工コーポレーション	—	8.8	8,650	武田薬品	46	44	206,360	住友重機械	46	44	22,616
鹿島建設	46	44	31,416	アステラス製薬	230	220	357,610	日立建機	46	44	84,700
大和ハウス	46	44	116,248	大日本住友製薬	46	44	78,628	クボタ	46	44	65,780
積水ハウス	46	44	71,434	塩野義製薬	46	44	216,260	荏原製作所	46	44	23,760
日揮	46	44	67,100	中外製薬	46	44	152,900	ダイキン工業	46	44	405,944
千代田化工建	46	44	32,516	エーザイ	46	44	266,552	日本精工	46	44	44,000
食料品 (5.3%)				第一三共	46	44	105,534	NTN	46	44	15,840
日清製粉G本社	46	44	69,652	石油・石炭製品 (0.3%)				ジェイテクト	46	44	67,056
明治ホールディングス	4.6	8.8	84,392	昭和シエル石油	46	44	38,720	日立造船	9.2	8.8	4,584
日本ハム	46	44	102,344	JXホールディングス	46	44	17,155	三菱重工業	46	44	19,368
サッポロホールディングス	46	8.8	22,387	ゴム製品 (1.0%)				IHI	46	44	12,980
アサヒグループホールディング	46	44	146,080	横浜ゴム	23	22	34,936	電気機器 (16.7%)			
麒麟HD	46	44	74,426	ブリヂストン	46	44	147,840	日清紡ホールディングス	—	44	44,836
宝ホールディングス	46	44	38,500	ガラス・土製品 (1.5%)				コニカミノルタ	46	44	40,084
キッコーマン	46	44	144,320	日東紡績	46	—	—	ミネベア	46	44	39,204
味の素	46	44	106,128	旭硝子	46	44	27,412	日立	46	44	21,564
ニチレイ	46	44	43,428	日本板硝子	46	44	3,564	東芝	46	44	12,980
日本たばこ産業	46	44	174,636	日本電気硝子	69	66	31,350	三菱電機	46	44	58,036
繊維製品 (0.4%)				住友大阪セメント	46	44	20,856	富士電機	46	44	20,108
東洋紡	46	44	7,392	太平洋セメント	46	44	12,628	安川電機	46	44	63,228
ユニチカ	46	—	2,508	東海カーボン	46	44	11,044	明電舎	46	44	13,816
日清紡ホールディングス	46	—	—	TOYO	46	22	84,590	ジーエス・ユアサコーポ	46	44	17,732
帝人	46	44	16,236	日本碍子	46	44	99,572	日本電気	46	44	11,396
東レ	46	44	43,111	鉄鋼 (0.2%)				富士通	46	44	20,724
パルプ・紙 (0.3%)				新日鐵住金	46	4.4	9,108	沖電気	46	44	6,160
王子ホールディングス	46	44	17,468	神戸製鋼所	46	44	3,916	パナソニック	46	44	45,188
日本製紙	4.6	4.4	7,827	JFEホールディングス	4.6	4.4	6,421	シャープ	46	—	—
北越紀州製紙	46	44	29,084	日新製鋼	4.6	4.4	5,552	ソニー	46	44	143,132
化学 (8.3%)				大太平洋金属	46	44	12,276	TDK	46	44	308,440
クラレ	46	44	61,644	非鉄金属 (1.2%)				ミツミ電機	46	44	24,772
旭化成	46	44	37,166	日本軽金属HD	46	44	9,724	アルプス電気	46	44	99,836
昭和電工	46	4.4	4,756	三井金属	46	44	8,976	パイオニア	46	44	10,296
住友化学	46	44	18,832	東邦亜鉛	46	44	13,552	横河電機	46	44	59,004
日産化学	46	44	134,200	三菱マテリアル	46	44	12,056	アドバンテス	92	88	124,696
日本曹達	46	44	21,296	住友鉱山	46	44	57,354	カシオ	46	44	62,832
東ソー	46	44	26,268	DOWAホールディングス	46	44	28,468	ファナック	46	44	762,300
トクヤマ	46	44	15,620	古河機金	46	44	7,348	京セラ	92	88	435,952
デンカ	46	44	18,172	古河電工	46	44	11,396	太陽誘電	46	44	41,624
信越化学	46	44	315,436								

ミリオン・インデックスマザーファンド

銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株
SCREENホールディングス	46	44	48,884	48,884
キャノン	69	66	192,588	192,588
リコー	46	44	41,228	41,228
東京エレクトロン	46	44	386,364	386,364
輸送用機器 (6.7%)				
デンソー	46	44	179,300	179,300
三井造船	46	44	6,292	6,292
川崎重工業	46	44	13,156	13,156
日産自動車	46	44	43,401	43,401
いすゞ自動車	23	22	27,170	27,170
トヨタ自動車	46	44	264,264	264,264
日野自動車	46	44	46,860	46,860
三菱自動車工業	4.6	4.4	2,068	2,068
マツダ	9.2	8.8	13,816	13,816
本田技研	92	88	266,464	266,464
スズキ	46	44	143,088	143,088
富士重工業	46	44	168,916	168,916
ヤマハ発動機	—	44	83,688	83,688
精密機器 (3.3%)				
テルモ	92	88	376,640	376,640
ニコン	46	44	65,032	65,032
オリンパス	46	44	149,380	149,380
シチズンホールディングス	46	44	23,540	23,540
その他製品 (1.2%)				
凸版印刷	46	44	39,380	39,380
大日本印刷	46	44	44,880	44,880
ヤマハ	46	44	142,340	142,340
電気・ガス業 (0.3%)				
東京電力HD	4.6	4.4	1,584	1,584
中部電力	4.6	4.4	5,812	5,812
関西電力	4.6	4.4	3,834	3,834
東京瓦斯	46	44	19,184	19,184
大阪瓦斯	46	44	17,890	17,890
陸運業 (2.5%)				
東武鉄道	46	44	22,308	22,308
東京急行	46	44	34,540	34,540
小田急電鉄	46	44	47,388	47,388
京王電鉄	46	44	38,764	38,764
京成電鉄	46	44	54,912	54,912
東日本旅客鉄道	4.6	4.4	38,337	38,337
西日本旅客鉄道	4.6	4.4	25,718	25,718
東海旅客鉄道	4.6	4.4	75,262	75,262
日本通運	46	44	21,340	21,340
ヤマトホールディングス	46	44	105,622	105,622
海運業 (0.2%)				
日本郵船	46	44	7,788	7,788
商船三井	46	44	9,592	9,592
川崎汽船	46	44	11,220	11,220
空運業 (0.1%)				
ANAホールディングス	46	44	11,990	11,990

銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株
倉庫・運輸関連業 (0.4%)				
三菱倉庫	46	44	69,300	69,300
情報・通信業 (12.7%)				
ヤフー	18.4	17.6	7,673	7,673
トレンドマイクロ	46	44	164,340	164,340
スカパーJSATHD	4.6	4.4	2,010	2,010
日本電信電話	9.2	8.8	42,521	42,521
KDDI	276	264	855,624	855,624
NTTドコモ	4.6	4.4	11,895	11,895
東宝	4.6	4.4	12,984	12,984
NTTデータ	46	44	236,720	236,720
コナミホールディングス	46	44	163,460	163,460
ソフトバンクグループ	138	132	893,244	893,244
卸売業 (2.0%)				
双日	4.6	4.4	1,060	1,060
伊藤忠	46	44	53,152	53,152
丸紅	46	44	21,854	21,854
豊田通商	46	44	99,616	99,616
三井物産	46	44	57,156	57,156
住友商事	46	44	47,058	47,058
三菱商事	46	44	91,212	91,212
小売業 (11.1%)				
J.フロントリテイリング	23	22	28,534	28,534
三越伊勢丹HD	46	44	45,144	45,144
セブン&アイ・HLDS	46	44	193,028	193,028
高島屋	46	44	35,156	35,156
丸井グループ	46	44	60,104	60,104
イオン	46	44	62,898	62,898
ユニーグループ・HD	46	44	46,420	46,420
ファーストリテイリング	46	44	1,626,680	1,626,680
銀行業 (1.0%)				
コンソルディア・フィナンシャル	—	44	22,030	22,030
新生銀行	46	44	6,732	6,732
あおぞら銀行	46	44	15,708	15,708
三菱UFJフィナンシャルG	46	44	23,579	23,579
りそなホールディングス	4.6	4.4	1,965	1,965
三井住友トラストHD	46	44	15,554	15,554
三井住友フィナンシャルG	4.6	4.4	15,127	15,127
千葉銀行	46	44	25,168	25,168
横浜銀行	46	—	—	—
ふくおかフィナンシャルG	46	44	18,392	18,392
静岡銀行	46	44	33,704	33,704
みずほフィナンシャルG	46	44	7,396	7,396
証券・商品先物取引業 (0.5%)				
大和証券G本社	46	44	25,863	25,863
野村ホールディングス	46	44	20,292	20,292
松井証券	46	44	41,360	41,360
保険業 (1.0%)				
損保ジャパン興亜HD	11.5	11	35,992	35,992
MS & AD	13.8	13.2	37,976	37,976

銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株
SONY FH	9.2	8.8	13,032	13,032
第一生命	4.6	4.4	6,124	6,124
東京海上HD	23	22	85,470	85,470
T&Dホールディングス	9.2	8.8	9,996	9,996
その他金融業 (0.4%)				
クレディセゾン	46	44	76,164	76,164
不動産業 (1.9%)				
東急不動産HD	46	44	25,344	25,344
三井不動産	46	44	96,888	96,888
三菱地所	46	44	85,866	85,866
平和不動産	9.2	—	—	—
東京建物	23	22	27,192	27,192
住友不動産	46	44	122,188	122,188
サービス業 (3.4%)				
ディー・エヌ・エー	—	13.2	38,161	38,161
電通	46	44	237,600	237,600
東京ドーム	46	22	20,174	20,174
セコム	46	44	340,164	340,164
合計	株数、金額	9,777.3	9,167.4	18,859,344
	銘柄数<比率>	225銘柄	225銘柄	<98.1%>

(注1) 銘柄欄の()内は国内株式の評価総額に対する各業種の比率。
(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。
(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	当期末	
	買建額	売建額
国内	百万円	百万円
日経平均	351	—

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年8月17日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	18,859,344千円	98.1%
コール・ローン等、その他	373,214	1.9
投資信託財産総額	19,232,558	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2016年8月17日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	19,320,696,733円
コール・ローン等	343,110,913
株式（評価額）	18,859,344,240
未収入金	3,593,580
未取配当金	26,510,000
差入委託証拠金	88,138,000
(B) 負債	88,484,000
差入委託証拠金代用有価証券	88,484,000
(C) 純資産総額（A－B）	19,232,212,733
元本	21,410,226,933
次期繰越損益金	△ 2,178,014,200
(D) 受益権総口数	21,410,226,933口
1万口当り基準価額（C／D）	8,983円

* 期首における元本額は22,798,765,231円、当期中における追加設定元本額は24,838,653円、同解約元本額は1,413,376,951円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ミリオン（従業員積立投資プラン）インデックスポートフォリオ20,944,562,744円、ミリオン（従業員積立投資プラン）ボンドミックスポートフォリオ262,833,823円、ミリオン（従業員積立投資プラン）フィナンシャルミックスポートフォリオ202,830,366円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は8,983円です。

* 当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は2,178,014,200円です。

■損益の状況

当期 自2015年8月18日 至2016年8月17日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	378,418,089円
受取配当金	377,787,290
受取利息	92,295
その他収益金	587,461
支払利息	△ 48,957
(B) 有価証券売買損益	△ 4,487,668,018
売買益	404,003,028
売買損	△ 4,891,671,046
(C) 先物取引等損益	△ 82,513,116
取引益	40,520,766
取引損	△ 123,033,882
(D) その他費用	△ 274
(E) 当期損益金（A＋B＋C＋D）	△ 4,191,763,319
(F) 前期繰越損益金	1,946,210,821
(G) 解約差損益金	69,376,951
(H) 追加信託差損益金	△ 1,838,653
(I) 合計（E＋F＋G＋H）	△ 2,178,014,200
次期繰越損益金（I）	△ 2,178,014,200

(注1) 解約差損益金とは、一部解約時の解約価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。